

永赢股息优选混合型证券投资基金

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2021 年 03 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自2020年03月25日（基金合同生效日）起至2020年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	14
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	21
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	21
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	22
§6 审计报告	22
6.1 审计报告基本信息	22
6.2 审计报告的基本内容	22
§7 年度财务报表	25
7.1 资产负债表	25
7.2 利润表	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	28
7.4 报表附注	29
§8 投资组合报告	63
8.1 期末基金资产组合情况	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	65
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	73

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
8.12 投资组合报告附注.....	74
§9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	75
§10 开放式基金份额变动.....	76
§11 重大事件揭示.....	76
11.1 基金份额持有人大会决议.....	76
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
11.4 基金投资策略的改变.....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
11.8 其他重大事件.....	78
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	84
§13 备查文件目录.....	84
13.1 备查文件目录.....	84
13.2 存放地点.....	84
13.3 查阅方式.....	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢股息优选混合型证券投资基金	
基金简称	永赢股息优选	
基金主代码	008480	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年03月25日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	369,284,728.59份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢股息优选A	永赢股息优选C
下属分级基金的交易代码	008480	008481
报告期末下属分级基金的份额总额	355,051,699.94份	14,233,028.65份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于股息优选型证券，在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) “股息优选型”证券投资策略</p> <p>本基金在股票投资中侧重于对“股息优选型”证券的投资，“股息优选型”证券是指有稳定股息收益、盈利稳定且确定性较高、具备一定估值优势的优质上市公司发行的证券。基金管理人对股息优选型证券的投</p>

资具体分以下几个层次进行：

首先，基金管理人将满足下述前两个条件之一且满足第三个条件的股票作为符合股息率要求的公司，构建备选股票池：

1) 最近一年有分红，且股息率由高到低排序，排名前50%的股票；

2) 具有潜在股息优势（未来预期有稳定股息收益或具有较强分红意愿、且股票估值合理）；

3) 经营状况良好、无重大违法违规事项、股息分配与经营情况不存在重大异常。

其次，在备选股票池的基础上，本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。

（2）港股通标的投资策略

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。

本基金将重点关注：

1) 相对A股有稀缺性行业与个股，对资本有显著的吸引力，具有较高的配置价值；

2) 具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业具有良好成长性或高额股东回报率；

3) 盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的上市公司；

4) 相对 A 股同类公司具有显著的估值优势的公司。

（3）存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托

凭证进行投资。

3、固定收益投资策略

本基金的债券投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的，具有良好流动性的金融工具。债券投资主要用于提高非股票资产的收益率，严格控制风险，追求合理的回报。本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。

4、可转换债券投资策略

本基金在综合分析可转债的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上，审慎筛选其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，以及基础股票基本面优良的品种，并以合理的价格买入，争取稳健的投资回报。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券、住房抵押贷款支持证券等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

6、股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

7、国债期货投资策略

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金

	<p>管理人通过动态管理国债期货合约数量，以期萃取相应债券组合的超额收益。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）*20%+中债-综合指数（全价）收益率*25%
风险收益特征	<p>本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。</p> <p>本基金将投资港股通投资标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	永赢基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧
	联系电话	021-51690145
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com
客户服务电话	400-805-8888	95566
传真	021-51690177	010-66594942
注册地址	浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	马宇晖	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露	中国证券报
------------	-------

露报纸名称	
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	永赢基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	本期2020年03月25日（基金合同生效日）- 2020年12月31日	
	永赢股息优选A	永赢股息优选C
本期已实现收益	144,378,177.88	3,071,305.50
本期利润	295,188,398.95	5,881,372.25
加权平均基金份额本期利润	0.5243	0.5335
本期加权平均净值利润率	43.72%	40.33%
本期基金份额净值增长率	55.65%	55.42%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	
期末可供分配利润	105,606,293.81	4,204,066.28
期末可供分配基金份额利润	0.2974	0.2954
期末基金资产净值	552,649,917.51	22,121,531.65
期末基金份额净值	1.5565	1.5542

3.1.3 累计期末指标	2020年末	
基金份额累计净值增长率	55.65%	55.42%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同生效日为2020年3月25日，截至本报告期末本基金合同生效未满1年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

永赢股息优选A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.51%	1.60%	9.84%	0.66%	6.67%	0.94%
过去六个月	37.03%	1.70%	13.85%	0.88%	23.18%	0.82%
自基金合同生效起至今	55.65%	1.45%	24.55%	0.84%	31.10%	0.61%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）*20%+中债-综合指数（全价）收益率*25%。

永赢股息优选C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.45%	1.60%	9.84%	0.66%	6.61%	0.94%
过去六个月	36.90%	1.70%	13.85%	0.88%	23.05%	0.82%
自基金合同	55.42%	1.45%	24.55%	0.84%	30.87%	0.61%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）*20%+中债-综合指数（全价）收益率*25%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

永赢股息优选A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2020 年 3 月 25 日，截至本报告期末本基金合同生效未满 1 年；

2、本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同规定。

永赢股息优选C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

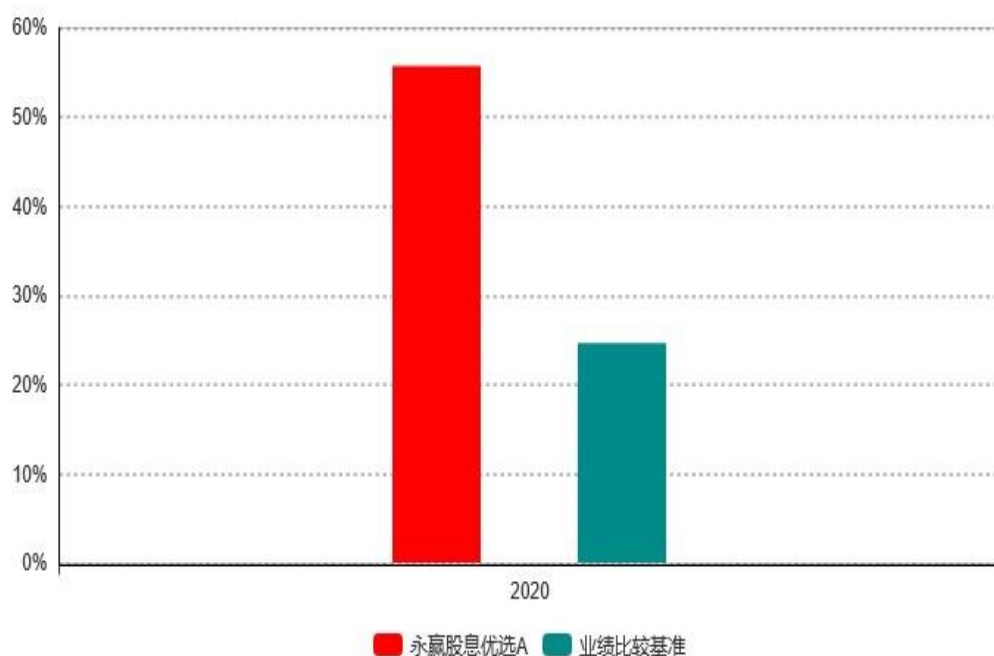
(2020年03月25日-2020年12月31日)



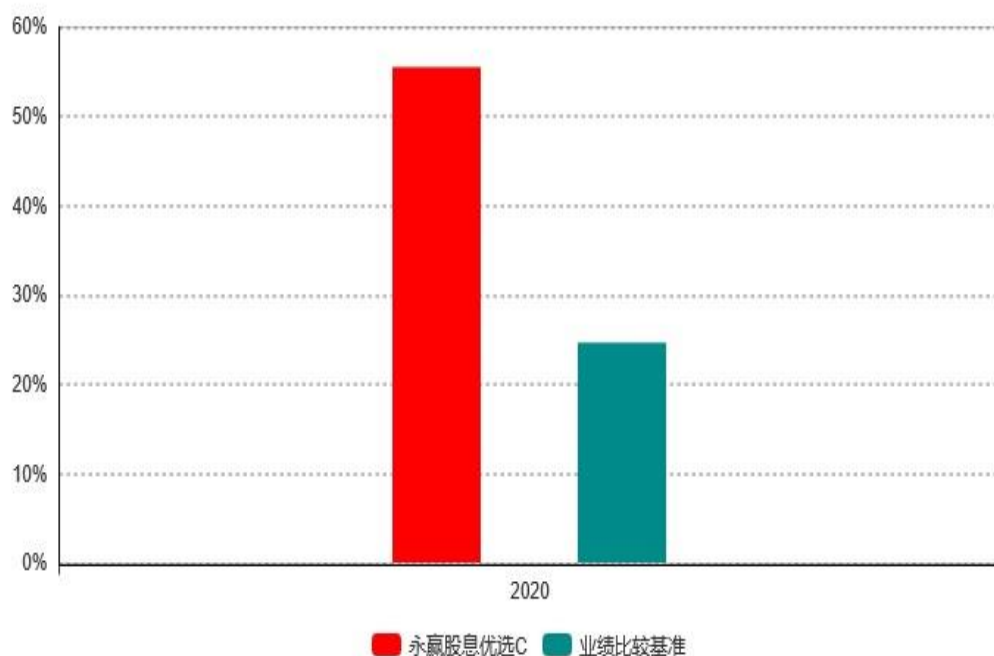
注：1、本基金合同生效日为 2020 年 3 月 25 日，截至本报告期末本基金合同生效未满 1 年；

2、本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：图中所列示的 2020 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 3 月 25 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。



注：图中所列示的 2020 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 3 月 25 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效日为2020年3月25日，截至2020年12月31日，本基金未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

永赢基金管理有限公司（以下简称“公司”）于2013年10月8日取得了中国证监会《关于核准设立永赢基金管理有限公司的批复》（证监许可[2013]1280号），随后，公司于2013年10月11日取得商务部《中华人民共和国外商投资企业批准证书》（商外资资审字[2013]008号），并于2013年11月7日在国家工商行政管理总局注册成立，此后，于2013年11月12日取得中国证监会核发的《基金管理资格证书》（编号A087），并于2017年3月14日获得中国证监会颁发的信用代码为913302007178854322的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014年8月18日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018年1月25日，公司完成增资，注册资本由人民币贰亿元增至人民币玖亿元。目前，公司的股权结构为宁波银行股份有限公司持股71.49%，华侨银行有限公司持股28.51%。

截止2020年12月31日，本基金管理人共管理69只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢稳益债券型证券投资基金、永赢双利债券型证券投资基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢天天利货币市场基金、永赢永益债券型证券投资基金、永赢丰利债券型证券投资基金、永赢增益债券型证券投资基金、永赢恒益债券型证券投资基金、永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢嘉益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢裕益债券型证券投资基金、永赢祥益债券型证券投资基金、永赢通益债券型证券投资基金、永赢诚益债券型证券投资基金、永赢伟益债券型证券投资基金、永赢昌益债券型证券投资基金、永赢宏益债券型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢智益纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢沪深300指数型发起式证券投资基金、永赢众利债券型证券投资基金、永赢同利债券型证券投资基金、永赢昌

利债券型证券投资基金、永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢乾元三年定期开放混合型证券投资基金、永赢科技驱动混合型证券投资基金、永赢元利债券型证券投资基金、永赢易弘债券型证券投资基金、永赢股息优选混合型证券投资基金、永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金、永赢中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金、永赢医药健康股票型证券投资基金、永赢邦利债券型证券投资基金、永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金、永赢瑞宁87个月定期开放债券型证券投资基金、永赢成长领航混合型证券投资基金、永赢鼎利债券型证券投资基金、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金、永赢泰宁63个月定期开放债券型证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢鑫享混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李永 兴	副总经理/基金经理	2020-03-25	-	14	李永兴先生，北京大学金融学硕士，14年证券相关从业经验。曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理；九泰基金管理有限公司投资总监；永赢基金管理有限公司总经理助理。现任永赢基金管理有限公司副总经理。
晏青	权益投资部副总监/基金经理	2020-03-25	-	14	晏青先生，上海交通大学经济学硕士，14年证券相关从业经验。曾任交银施

					罗德基金管理有限公司研究员、基金经理；上海弘尚资产管理中心（有限合伙）投资经理、海外投资总监。现任永赢基金管理有限公司权益投资部副总监。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢股息优选混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限；投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预；基金经理在

授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同基金经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。另外，本基金管理人还建立机制要求公募基金经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各基金经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后分析，确保交易得到公平和公允的执行；对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，基金经理须提出申请并阐明具体原因，交由投资决策委员会进行严格的公平性审核；（4）严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外），确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生同日反向交易的，相关基金经理须向风险控制委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面，风险管理部开展定期分析工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了对非公开发行股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，以及对非连续竞价交易的价格公允性进行审查；事后分析评估上，风险管理部在每个季度的公平交易与异常交易稽核中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资授权管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先、比例分配”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，分别于每季度和每年度对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，每季度对连续四个季度期间内、不同时间窗下不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现显著违反公平交易的行为。本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020年是不平凡的一年，荡气回肠而又令人感动。我们面临百年难遇的新冠疫情，亲历这人类面临生命受到巨大挑战的时刻，也深刻感受到最美逆行者的勇气带给我们的信心和决心。这一年，我们经历了风险资产的至暗时刻，也共同努力走出迷雾而最终收获满满。新冠疫情像一面镜子，照出了中国政府在面临巨大挑战时的制度优势和对人民群众生命安全的担当，让普罗大众充满信心共渡时艰。

新冠疫情导致各个经济体短期出现断崖式的经济衰退，各国央行紧急出台各类刺激政策，这两者的对市场的影响可谓此消彼长，驱动市场在不同阶段呈现不同的特征。1季度，疫情在中国率先爆发，春节前开始扩散，中国政府采取封城的方式解决疫情，2月下旬新增确诊病例出现拐点，也最先走出新冠疫情的阴霾，但这对短期中国经济产生巨大的冲击。3月份疫情在海外进一步升级，造成各经济体经济前景黯淡，石油价格暴跌进而引发全球各类风险资产巨幅下挫。美联储在3月底及时释放了巨量流动性，避免了流动性危机的深化。2季度，充裕的流动性、较低的利率水平叠加深度调整的资产价格，引发股票市场在2季度出现超预期的反弹。3季度，国内经济出现较为清晰的复苏上行态势，地产和基建的动力较强，出口增速超预期，工业企业盈利同比快速增长。美国经济的数据表现较好，贸易逆差大幅上升至600亿美元以上创近10年新高，带动全球经济增长的同时向全球输送流动性，股票市场在3季度普遍上涨。4季度，经济延续了复苏态势，经济增长升至潜在增速以上，出口强劲持续超预期，PMI数据表现出色，PPI环比开始转正。美国经济继续向好，贸易逆差持续维持扩大并创历史最高水平之一。股票和大宗商品在4季度普遍上涨。

从资产配置角度，1季度疫情导致国内社会各项活动进入冰冻状态，经济衰退期利率下行较快，权益类资产估值抬升，相较于周期性资产短期盈利受损明显，防御性资产占优。企业价值是全生命周期净现金流的折现，虽有疫情影响，消费、医疗等行业中长

期增长几无影响，长期价值因利率下降而上升。下半年经济复苏，利率触底回升，跟上半年利率下行推升成长性行业估值提升出现显著的变化。股票市场的主逻辑从估值推动转为盈利驱动，跟宏观经济相关的顺周期行业和高景气度的成长性行业具有明显的配置价值。

从本产品运行伊始，我们就以谨慎的态度管理投资者资产，通过深度思考和紧密跟踪努力提升认知能力，最大化降低投资中面临的各种风险。在战略上，我们始终坚持聚焦于产生巨大社会价值和出色商业价值回报的公司。本基金3月底开始运作，上半年处于建仓期，有序地增加股票仓位。战略上，我们通过深度研究不断提升认知水平，聚焦于产生长期较高股东回报率的公司。战术上，我们把握了如下几类机会：（1）估值合理的中国核心资产。3月份股票市场泥沙俱下，优质公司股价的大幅下跌为我们提供了良好建仓机会，我们买入了香港市场最优质的中国互联网公司和新能源公司，我们以长期视角审视这类这些成长性企业内在价值的持续增加，并作为我们中期的核心持仓；（2）边际改善的公司。公司治理水平提升、行业变化带来基本面的积极改善，都带来企业内在价值的提升；（3）宏观驱动边际好转的公司。经济复苏阶段，受益于利率上行和价格上行的周期股中的优质公司等具有较好的投资价值。我们的组合配置比较均衡，兼顾了A股和港股，为投资者创造稳健回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢股息优选A基金份额净值为1.5565元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为55.65%，同期业绩比较基准收益率为24.55%；截至报告期末永赢股息优选C基金份额净值为1.5542元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为55.42%，同期业绩比较基准收益率为24.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

不确定性是股票市场的永恒特征。2021年的市场为我们开启全新的一段旅程，这让人充满憧憬，但无疑更具挑战性。从经济面来说，2021年复苏态势将会比曲折动荡的2020年更为明朗，企业盈利前景较为乐观。从流动性来看，相较于2020年为了应对疫情而极度充裕的流动性，2021年整体流动性状况将会弱于2020年，中美利率中枢也会显著上移。市场继续在经济基本面与资金流动性的曲折变化中波动向前。

从国内市场来看，企业盈利增长的态势良好，加上通胀初期有利于企业盈利的上升，上半年基于盈利增长的逻辑具有较高的确定性，当前中性的货币政策对于估值不会产生巨大的压力，资金持续流入股票市场对股票市场估值仍有支撑。在货币政策出现实质性收紧之前，我们认为至少盈利增长性的投资机会仍然存在，特别是过去几年估值持续提升主要集中在一些优质成长性行业上，还有一些行业估值并未显著提升，部分行业的估值甚至处于历史低位。我们将会精选估值合理且盈利增长较好的公司，回避估值显著高

估的企业，同时回避盈利增长具有不确定性的公司。当然，如果通胀风险持续上升最终导致货币政策出现大幅收紧，我们将会谨慎地降低仓位应对出现的市场性风险。

从港股来看，这几年港股市场的资产结构发生了显著变化。2018年香港交易所的制度变革为港股带来了巨大红利，大量生物医药公司、同股不同权公司和赴港二次上市的公司不断登陆港股，这些大量优质新经济公司的加入带来港股资产质量的持续提升。这不仅对内地投资者，对全球投资者都有巨大的吸引力。从企业基本面来看，伴随着国内经济持续复苏，中资企业盈利向好的趋势更加明确，这将引发配置中国资产的海外资金加大对港股的配置。从流动性看，港股市场的资金来自于海外各个经济体，预期2021年海外整体货币环境依然较为宽松，国内货币政策有所收紧，港股市场的流动性相对国内市场具有一定优势。基于本轮港股企业盈利复苏态势清晰、大量周期性行业估值较低等多角度衡量，港股整体具有较强的基本面支持。

资本市场的每一天都充满挑战，我们将凝聚团队智慧，努力做出正确决策。我们通过高质量研究提升认知水平，增加投资的确定性。我们不忘初心，以坚持浇筑理想，日以继夜地与不确定搏斗，不负这沸腾的时代，回报投资者的信任。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障合规运作和投资者合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，持续开展了合规检查、内部审计、合规培训、制度修订、信息披露、反洗钱等工作。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

1、新规解读及监管要求的落实。2020年，监管机构发布了一系列法律法规，对公募基金投资运作及资管行业整体发展都产生深远影响，主要包括《公开募集证券投资基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票指引》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》、《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及配套规则、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等。法规颁布后，公司第一时间组织相关人员对法规进行解读，并拟定针对性的落实方案，由各相关部门进行具体落实，同时定期对落实情况进行跟踪检查。

2、深入开展内部审计工作。公司建立了全面的内部审计体系和流程，并设置审计部作为公司风险防控机制中的一道重要防线独立履行内部审计检查职责。2020年，公司有序开展各类专项审计、离任审查、年度/季度监察稽核项目、即时通讯工具例行检查、风险事件调查等内审工作，并聘请外部机构独立开展合规有效性评估、年度内控评价、信息科技管理评估等项目。针对上述审计检查发现的问题，审计部牵头推进整改，促进制度体系及业务流程不断完善，为公司防范风险、完善内控管理提供有力支持。

3、强化合规培训。2020年，监管机构发布了诸多法律法规，为加强员工对法规的理解，强化员工在日常行为以及业务开展中的合规性，合规部组织多次面向不同对象，针对不同内容或法规的合规培训，包括针对新员工的合规培训，面向全员的合规宣导以及邀请外部律师就行业热点问题进行专项培训等。培训的内容以从业人员执业行为守则、新规要求、监管关注热点、行业风险事件为主，并通过多样化的方式提高了员工在合规培训中的参与度以及积极性。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。本基金管理人估值委员会成员包括公司总经理、督察长、固定收益投资的分管领导、权益投资的分管领导、基金运营的分管领导、基金运营部负责人、合规部负责人和风险管理部负责人。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

报告期内，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务；本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，未发生会计师事务所出具非标准审计报告的情形。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在永赢股息优选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他

有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第61090672_B54号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	永赢股息优选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了永赢股息优选混合型证券投资基金的财务报表，包括2020年12月31日的资产负债表，2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的永赢股息优选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了永赢股息优选混合型证券投资基金2020年12月31日的财务状况以及2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31

	日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于永赢股息优选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	永赢股息优选混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估永赢股息优选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督永赢股息优选混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于

舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对永赢股息优选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致永赢股息优选混合型证券投资基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在

	审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	蒋燕华	费泽旭
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼	
审计报告日期	2021-03-26	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：永赢股息优选混合型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	17,267,021.61
结算备付金		914,623.90
存出保证金		431,013.13
交易性金融资产	7.4.7.2	568,704,017.13
其中：股票投资		539,741,717.13
基金投资		-
债券投资		28,962,300.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		5,576,990.03
应收利息	7.4.7.5	293,852.08
应收股利		73,184.55
应收申购款		1,656,046.60
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-

资产总计		594,916,749.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		18,516,622.88
应付管理人报酬		703,105.21
应付托管费		117,184.21
应付销售服务费		3,818.27
应付交易费用	7.4.7.7	580,624.80
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	223,944.50
负债合计		20,145,299.87
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	369,284,728.59
未分配利润	7.4.7.10	205,486,720.57
所有者权益合计		574,771,449.16
负债和所有者权益总计		594,916,749.03

注：（1）报告截止日2020年12月31日，基金份额净值1.5564元，基金份额总额369,284,728.59份。其中A类基金份额净值1.5565元，份额总额355,051,699.94份；C类基金份额净值1.5542元，份额总额14,233,028.65份。

（2）本基金基金合同于2020年3月25日生效。

7.2 利润表

会计主体：永赢股息优选混合型证券投资基金

本报告期：2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
一、收入		315,450,252.17
1. 利息收入		1,866,522.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	530,437.31
债券利息收入		361,022.60
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		975,062.94
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		156,329,990.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	148,765,294.57
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-417,939.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	7,982,634.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	153,620,287.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,633,451.23
减：二、费用		14,380,480.97
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,936,634.03
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,322,772.26
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	22,396.50
4. 交易费用	7.4.7.19	4,873,415.67
5. 利息支出		7,560.47

其中：卖出回购金融资产支出		7,560.47
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	217,702.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		301,069,771.20
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		301,069,771.20

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢股息优选混合型证券投资基金

本报告期：2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	888,710,770.87	-	888,710,770.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	301,069,771.20	301,069,771.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-519,426,042.28	-95,583,050.63	-615,009,092.91
其中：1. 基金申购款	422,120,493.68	140,062,433.05	562,182,926.73
2. 基金赎回款	-941,546,535.96	-235,645,483.68	-1,177,192,019.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-	-

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	369,284,728.59	205,486,720.57	574,771,449.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

芦特尔

黄庆

虞俏依

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

永赢股息优选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2462号《关于准予永赢股息优选混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人永赢基金管理有限公司自2020年3月16日至2020年3月20日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第61090672_B05号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2020年3月25日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币888,535,849.62元，募集资金在初始销售期间产生的利息为人民币174,921.25元，以上实收基金（本息）合计为人民币888,710,770.87元，折合888,710,770.87份基金份额，其中A类基金份额883,029,750.80份，C类基金份额5,681,020.07份。本基金的基金管理人和注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金基金份额分为A类和C类基金份额。对于A类基金份额，投资者认购/申购时收取认购/申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费；对于C类基金份额，投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法

规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%，其中投资于股息优选型证券的比例不低于非现金基金资产的80%，港股通标的股票投资比例不得超过全部股票资产的50%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×20%+中债-综合指数（全价）收益率×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2020年12月31日的财务状况以及自2020年3月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2020年3月25日（基金合同生效日）起至2020年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；

未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认；

国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(6) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(7) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(13) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况对本基金进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的每类基金份额净值减去该类基金每单位基金份额收益分配金额后均不能低于面值；

(4) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、注册登记机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告，且不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
活期存款	17,267,021.61
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-

存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	17,267,021.61

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	386,140,225.02	539,741,717.13	153,601,492.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	28,943,504.29	28,962,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	28,943,504.29	28,962,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	415,083,729.31	568,704,017.13	153,620,287.82

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020年12月31日
应收活期存款利息	2,326.35
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,193.65
应收债券利息	288,689.04
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	643.04
合计	293,852.08

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	580,624.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	580,624.80

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	33,944.50
应付证券出借违约金	-

预提费用	190,000.00
合计	223,944.50

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 永赢股息优选A

金额单位：人民币元

项目 (永赢股息优选A)	本期2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	883,029,750.80	883,029,750.80
本期申购	389,317,427.57	389,317,427.57
本期赎回（以“-”号填列）	-917,295,478.43	-917,295,478.43
本期末	355,051,699.94	355,051,699.94

7.4.7.9.2 永赢股息优选C

金额单位：人民币元

项目 (永赢股息优选C)	本期2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,681,020.07	5,681,020.07
本期申购	32,803,066.11	32,803,066.11
本期赎回（以“-”号填列）	-24,251,057.53	-24,251,057.53
本期末	14,233,028.65	14,233,028.65

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金基金合同于2020年3月25日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币888,535,849.62元，在募集期间产生的存款利息为人民币174,921.25元，以上实收基金（本息）合计为人民币888,710,770.87元，折合888,710,770.87份基金份额，其中A类基金份额883,029,750.80份，C类基金份额5,681,020.07份。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 永赢股息优选A

单位：人民币元

项目 (永赢股息优选A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	144,378,177.88	150,810,221.07	295,188,398.95
本期基金份额交易产生的变动数	-38,771,884.07	-58,818,297.31	-97,590,181.38
其中：基金申购款	71,593,154.76	57,072,645.96	128,665,800.72
基金赎回款	-110,365,038.83	-115,890,943.27	-226,255,982.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	105,606,293.81	91,991,923.76	197,598,217.57

7.4.7.10.2 永赢股息优选C

单位：人民币元

项目 (永赢股息优选C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,071,305.50	2,810,066.75	5,881,372.25
本期基金份额交易产生的变动数	1,132,760.78	874,369.97	2,007,130.75
其中：基金申购款	6,656,482.22	4,740,150.11	11,396,632.33
基金赎回款	-5,523,721.44	-3,865,780.14	-9,389,501.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,204,066.28	3,684,436.72	7,888,503.00

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	219,242.09
定期存款利息收入	206,666.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	92,532.37

其他	11,996.18
合计	530,437.31

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,742,789,152.66
减：卖出股票成本总额	1,594,023,858.09
买卖股票差价收入	148,765,294.57

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-417,939.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-417,939.00

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑	54,769,162.33

付) 成交总额	
减: 卖出债券 (、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	54,408,139.00
减: 应收利息总额	778,962.33
买卖债券差价收入	-417,939.00

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31

	日
股票投资产生的股利收益	7,982,634.70
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,982,634.70

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	153,620,287.82
——股票投资	153,601,492.11
——债券投资	18,795.71
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	153,620,287.82

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	3,582,168.84
其他	114.79
基金转换费收入	51,167.60

合计	3,633,451.23
----	--------------

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	4,873,415.67
银行间市场交易费用	-
合计	4,873,415.67

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	70,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	19,802.04
账户维护费	7,500.00
其他	400.00
合计	217,702.04

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金管理人的股东、基金代销机构
华侨银行有限公司（“华侨银行”）	基金管理人的股东（自2020年8月5日起）
利安资金管理公司（“利安资金”）	基金管理人的原股东（2020年8月5日前）
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司

注：（1）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）永赢基金管理有限公司原股东利安资金管理公司（Lion Global Investors Limited）将其所持28.51%股权转让给华侨银行有限公司（Oversea-Chinese Banking Corporation Limited）已获中国证券监督管理委员会证监许可〔2020〕467号《关于核准永赢基金管理有限公司变更股权的批复》的核准，并于2020年8月5日完成工商变更登记。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,936,634.03
其中：支付销售机构的客户维护费	2,778,644.08

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年实际天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,322,772.26

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年实际天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢股息优选A	永赢股息优选C	合计
宁波银行	0.00	10,778.74	10,778.74

中国银行	0.00	385.21	385.21
永赢基金	0.00	1,616.33	1,616.33
合计	0.00	12,780.28	12,780.28

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times C$ 类基金销售服务费年费率 / 当年天数

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

永赢股息优选A

关联方名称	本期末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

永赢资产	84,999,000.00	23.0172%
------	---------------	----------

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资永赢股息优选C。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年03月25日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	17,267,021.61	219,242.09

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	认购新发证券	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	认购新发证券	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新股限售	13 8.0 2	12 6.6 7	254	35,05 7.08	32,17 4.18	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	新股限售	43. 76	51. 10	740	32,38 2.40	37,81 4.00	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新股限售	71. 71	90. 85	166	11,90 3.86	15,08 1.10	-
300867	圣元环保	2020-08-12	2021-03-03	新股限售	19. 34	31. 97	1,498	28,97 1.32	47,89 1.06	-
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	新股限售	41. 26	43. 28	593	24,46 7.18	25,66 5.04	-
300869	康泰医学	2020-08-12	2021-02-24	新股限售	10. 16	11 0.8 8	862	8,75 7.92	95,57 8.56	-
300870	欧陆通	2020-08-13	2021-02-24	新股限售	36. 81	65. 67	478	17,59 5.18	31,39 0.26	-
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	新股限售	33. 61	38. 70	618	20,77 0.98	23,91 6.60	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	新股限售	21. 34	37. 84	871	18,58 7.14	32,95 8.64	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	新股限售	30. 72	41. 32	484	14,86 8.48	19,99 8.88	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	新股限售	20. 09	36. 62	350	7,03 1.50	12,81 7.00	-
300877	金春股份	2020-08-17	2021-03-03	新股限售	30. 54	50. 85	569	17,37 7.26	28,93 3.65	-
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	新股限售	41. 34	48. 72	401	16,57 7.34	19,53 6.72	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	新股限售	10. 58	27. 12	466	4,93 0.28	12,63 7.92	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	新股限售	14. 17	32. 31	291	4,12 3.47	9,402. 21	-
300	万胜	2020-	2021-	新股限售	10.	25.	440	4,54	11,34	-

882	智能	08-27	03-10	售	33	79		5.20	7.60	
300 886	华业 香料	2020- 09-08	2021- 03-16	新股限 售	18. 59	45. 67	147	2,73 2.73	6,713. 49	-
300 887	谱尼 测试	2020- 09-09	2021- 03-16	新股限 售	44. 47	74. 52	210	9,33 8.70	15,64 9.20	-
300 889	爱克 股份	2020- 09-09	2021- 03-16	新股限 售	27. 97	30. 12	479	13,39 7.63	14,42 7.48	-
300 890	翔丰 华	2020- 09-10	2021- 03-18	新股限 售	14. 69	48. 85	286	4,20 1.34	13,97 1.10	-
300 891	惠云 钛业	2020- 09-10	2021- 03-17	新股限 售	3.6 4	16. 40	1,143	4,16 0.52	18,74 5.20	-
300 892	品渥 食品	2020- 09-11	2021- 03-24	新股限 售	26. 66	60. 01	272	7,25 1.52	16,32 2.72	-
300 893	松原 股份	2020- 09-17	2021- 03-24	新股限 售	13. 47	35. 08	276	3,71 7.72	9,682. 08	-
300 894	火星 人	2020- 12-24	2021- 07-01	新股限 售	14. 07	36. 97	628	8,83 5.96	23,21 7.16	-
300 895	铜牛 信息	2020- 09-17	2021- 03-24	新股限 售	12. 65	45. 30	283	3,57 9.95	12,81 9.90	-
300 896	爱美 客	2020- 09-21	2021- 03-29	新股限 售	11 8.2 7	60 3.3 6	213	25,19 1.51	128,51 5.68	-
300 898	熊猫 乳品	2020- 10-09	2021- 04-16	新股限 售	10. 78	33. 03	496	5,34 6.88	16,38 2.88	-
300 900	广联 航空	2020- 10-19	2021- 04-29	新股限 售	17. 87	33. 16	879	15,70 7.73	29,14 7.64	-
300 902	国安 达	2020- 10-22	2021- 04-29	新股限 售	15. 38	24. 26	551	8,47 4.38	13,36 7.26	-
300 907	康平 科技	2020- 11-11	2021- 05-18	新股限 售	14. 30	26. 85	473	6,76 3.90	12,70 0.05	-
300 908	仲景 食品	2020- 11-13	2021- 05-24	新股限 售	39. 74	60. 44	285	11,32 5.90	17,22 5.40	-
300	瑞丰	2020-	2021-	新股限	30.	47.	474	14,34	22,69	-

910	新材	11-20	05-27	售	26	87		3.24	0.38	
300 911	亿田 智能	2020- 11-24	2021- 06-03	新股限 售	24. 35	33. 06	309	7,52 4.15	10,21 5.54	-
300 913	兆龙 互连	2020- 11-27	2021- 06-07	新股限 售	13. 21	23. 94	630	8,32 2.30	15,08 2.20	-
300 917	特发 服务	2020- 12-14	2021- 06-21	新股限 售	18. 78	31. 94	281	5,27 7.18	8,975. 14	-
300 918	南山 智尚	2020- 12-15	2021- 06-22	新股限 售	4.9 7	8.9 4	1,063	5,28 3.11	9,503. 22	-
300 919	中伟 股份	2020- 12-15	2021- 06-23	新股限 售	24. 60	61. 51	579	14,24 3.40	35,61 4.29	-
300 922	天秦 装备	2020- 12-18	2021- 06-25	新股限 售	16. 05	31. 58	287	4,60 6.35	9,063. 46	-
300 926	博俊 科技	2020- 12-29	2021- 01-07	认购新 发证券	10. 76	10. 76	3,225	34,70 1.00	34,70 1.00	-
300 926	博俊 科技	2020- 12-29	2021- 07-07	新股限 售	10. 76	10. 76	359	3,86 2.84	3,862. 84	-
300 927	江天 化学	2020- 12-29	2021- 07-07	新股限 售	13. 39	13. 39	217	2,90 5.63	2,905. 63	-
300 927	江天 化学	2020- 12-29	2021- 01-07	认购新 发证券	13. 39	13. 39	1,946	26,05 6.94	26,05 6.94	-
300 999	金龙 鱼	2020- 09-29	2021- 04-15	新股限 售	25. 70	88. 29	2,968	76,27 7.60	262,04 4.72	-
605 277	新亚 电子	2020- 12-25	2021- 01-06	认购新 发证券	16. 95	16. 95	507	8,59 3.65	8,593. 65	-
688 027	国盾 量子	2020- 06-30	2021- 01-11	新股限 售	36. 18	2.1 6	2,830	102,3 89.40	657,01 2.80	-
688 179	阿拉 丁	2020- 10-16	2021- 04-26	新股限 售	19. 43	64. 24	3,944	76,63 1.92	253,36 2.56	-
688 180	君实 生物- U	2020- 07-06	2021- 01-15	新股限 售	55. 50	78. 75	13,16 3	730,5 46.50	1,036, 586.25	-

688 256	寒武 纪-U	2020- 07-10	2021- 01-20	新股限 售	64. 39	14 3.5 4	5,377	346,2 25.03	771,81 4.58	-
688 356	键凯 科技	2020- 08-17	2021- 02-26	新股限 售	41. 18	10 5.0 6	2,433	100,1 90.94	255,61 0.98	-
688 561	奇安 信-U	2020- 07-16	2021- 01-22	新股限 售	56. 10	12 2.8 3	6,448	361,7 32.80	792,00 7.84	-
688 617	惠泰 医疗	2020- 12-30	2021- 07-07	新股限 售	74. 46	74. 46	1,673	124,5 71.58	124,57 1.58	-
688 699	明微 电子	2020- 12-10	2021- 06-18	新股限 售	38. 43	45. 27	1,869	71,82 5.67	84,60 9.63	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年12月31日止，本基金无因从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体系。五道防线分别为员工自律、自控和互控的第一道防线，部门内控和部门之间互相监督的第二道防线，合规管理及风险管理部门监控检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险管理进行监督管理的第五道防线。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	28,962,300.00
合计	28,962,300.00

注：1、本期末，未评级的短期债券均是国债；
2、本基金于2020年3月25日成立，无上年度末数据。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

1、本期末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券；
2、本基金于2020年3月25日成立，无上年度末数据。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

1、本期末，本基金未持有短期同业存单投资；
2、本基金于2020年3月25日成立，无上年度末数据。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

1、本期末，本基金未持有长期债券投资；
2、本基金于2020年3月25日成立，无上年度末数据。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

1、本期末，本基金未持有长期资产支持证券投资；
2、本基金于2020年3月25日成立，无上年度末数据。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

1、本期末，本基金未持有长期同业存单投资；
2、本基金于2020年3月25日成立，无上年度末数据。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金可以投资于固定收益品种，且持有银行存款等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	17,267,021.61	-	-	-	-	-	17,267,021.61

结算备付金	914,623.90	-	-	-	-	-	914,623.90
存出保证金	431,013.13	-	-	-	-	-	431,013.13
交易性金融资产	-	-	28,962,300.00	-	-	539,741,717.13	568,704,017.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,576,990.03	5,576,990.03
应收利息	-	-	-	-	-	293,852.08	293,852.08
应收股利	-	-	-	-	-	73,184.55	73,184.55
应收申购款	-	-	-	-	-	1,656,046.60	1,656,046.60
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,612,658.64	-	28,962,300.00	-	-	547,341,790.39	594,916,749.03
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	18,516,622.88	18,516,622.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	703,105.21	703,105.21
应付托管费	-	-	-	-	-	117,184.21	117,184.21
应付销售服务	-	-	-	-	-	3,818.27	3,818.27

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	580,624.80	580,624.80
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	223,944.50	223,944.50
负债总计	-	-	-	-	-	20,145,299.87	20,145,299.87
利率敏感度缺口	18,612,658.64	-	28,962,300.00	-	-	527,196,490.52	574,771,449.16

注：本基金于2020年3月25日成立，无上年度末数据；

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率曲线向上、向下平行移动50个基点	
假设	2. 其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2020年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-76,359.10
	市场利率平行下降50个基点	76,359.10

注：本基金于2020年3月25日成立，无上年度末数据。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	265,210,022. 04	-	265,210,022. 04
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	73,184.55	-	73,184.55
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	265,283,206. 59	-	265,283,206. 59
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口 净额	-	265,283,206. 59	-	265,283,206. 59

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)
		本期末 2020年12月31日
	所有外币相对于人民币升值	13,264,160.33

	5%	
	所有外币相对于人民币贬值	-13,264,160.33
	5%	

注：本基金于2020年3月25日成立，无上年度末数据。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	539,741,717.13	93.91
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	539,741,717.13	93.91

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险	
	2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末 2020年12月31日
业绩比较基准增加1%	7,998,937.35
业绩比较基准减少1%	-7,998,937.35

注：本基金于2020年3月25日成立，无上年度末数据。本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.13.1 公允价值

7.4.13.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.13.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.13.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币534,497,605.35元，属于第二层次的余额为人民币29,044,847.48元，属于第三层次的余额为人民币5,161,564.30元。

7.4.13.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.13.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期末未发生变动。

7.4.13.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.13.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.13.4 财务报表的批准

本财务报表已于2021年3月26日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	539,741,717.13	90.73
	其中：股票	539,741,717.13	90.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,962,300.00	4.87
	其中：债券	28,962,300.00	4.87
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,181,645.51	3.06
8	其他各项资产	8,031,086.39	1.35
9	合计	594,916,749.03	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币265,210,022.04元，占期末净值比例46.14%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	152,999,638.77	26.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	18,994,998.88	3.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,324,482.73	5.62
J	金融业	46,247,600.00	8.05
K	房地产业	10,457,975.14	1.82
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,395,530.51	2.33
N	水利、环境和公共设施管理业	62,972.16	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	32,174.18	0.01
S	综合	-	-
	合计	274,531,695.09	47.76

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	46,761,518.40	8.14
非日常生活消费品	81,102,113.68	14.11
日常消费品	21,498,852.16	3.74
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	12,978,088.80	2.26
工业	-	-
信息技术	45,381,228.80	7.9

电信服务	37,974,796.80	6.61
公用事业	-	-
地产业	19,513,423.40	3.39
合计	265,210,022.04	46.14

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	H01772	赣锋锂业	600,000	46,761,518.40	8.14
2	H03690	美团-W	170,000	42,151,014.48	7.33
3	000858	五粮液	140,000	40,859,000.00	7.11
4	H00700	腾讯控股	80,000	37,974,796.80	6.61
5	H00268	金蝶国际	1,300,000	34,574,571.20	6.02
6	000568	泸州老窖	140,000	31,662,400.00	5.51
7	601166	兴业银行	1,480,000	30,887,600.00	5.37
8	002410	广联达	370,035	29,136,555.90	5.07
9	002756	永兴材料	500,017	27,110,921.74	4.72
10	H01211	比亚迪股份	150,000	25,653,187.20	4.46
11	603369	今世缘	420,000	24,099,600.00	4.19
12	H01458	周黑鸭	3,100,000	21,498,852.16	3.74
13	002928	华夏航空	1,500,000	18,975,000.00	3.30
14	601601	中国太保	400,000	15,360,000.00	2.67
15	H03998	波司登	4,000,000	13,297,912.00	2.31
16	002949	华阳国际	700,081	13,126,518.75	2.28
17	H02269	药明生物	150,000	12,978,088.80	2.26
18	601636	旗滨集团	1,000,000	12,800,000.00	2.23

19	600346	恒力石化	400,000	11,188,000.00	1.95
20	601155	新城控股	300,000	10,449,000.00	1.82
21	H06049	保利物业	200,000	10,284,840.80	1.79
22	H01030	新城发展	1,700,000	9,228,582.60	1.61
23	H01347	华虹半导体	180,000	6,665,788.80	1.16
24	H03800	保利协鑫能源	4,000,000	4,140,868.80	0.72
25	601058	赛轮轮胎	300,000	1,812,000.00	0.32
26	002624	完美世界	50,000	1,475,000.00	0.26
27	688180	君实生物-U	13,163	1,036,586.25	0.18
28	688561	奇安信-U	6,448	792,007.84	0.14
29	688256	寒武纪-U	5,377	771,814.58	0.13
30	688027	国盾量子	2,830	657,012.80	0.11
31	300894	火星人	6,279	300,116.16	0.05
32	300999	金龙鱼	2,968	262,044.72	0.05
33	688356	键凯科技	2,433	255,610.98	0.04
34	688179	阿拉丁	3,944	253,362.56	0.04
35	300896	爱美客	213	128,515.68	0.02
36	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
37	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.02
38	688699	明微电子	1,869	84,609.63	0.01
39	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.01
40	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
41	300861	美畅股份	740	37,814.00	0.01
42	300919	中伟股份	579	35,614.29	0.01
43	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.01
44	300860	锋尚文化	254	32,174.18	0.01
45	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.01
46	300900	广联航空	879	29,147.64	0.01

47	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
48	300877	金春股份	569	28,933.65	0.01
49	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
50	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00
51	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
52	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
53	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
54	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
55	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
56	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
57	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
58	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
59	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
60	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
61	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
62	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.00
63	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
64	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
65	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
66	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
67	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
68	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
69	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
70	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
71	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
72	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
73	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
74	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
75	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
76	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
77	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00

78	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
79	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
80	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
81	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
82	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002928	华夏航空	55,442,294.92	9.65
2	603369	今世缘	44,246,000.42	7.70
3	000002	万科A	43,739,131.08	7.61
4	600297	广汇汽车	43,367,066.84	7.55
5	600346	恒力石化	40,646,637.00	7.07
6	601888	中国中免	39,500,349.52	6.87
7	600305	恒顺醋业	38,954,361.29	6.78
8	000858	五粮液	37,922,567.00	6.60
9	600055	万东医疗	36,574,199.96	6.36
10	H01918	融创中国	36,286,236.59	6.31
11	H03690	美团-W	35,699,777.45	6.21
12	002714	牧原股份	35,201,122.57	6.12
13	300059	东方财富	33,135,716.01	5.77
14	000710	贝瑞基因	32,512,295.14	5.66
15	H00175	吉利汽车	32,089,040.90	5.58
16	000860	顺鑫农业	31,733,557.00	5.52
17	601336	新华保险	31,585,811.25	5.50
18	601318	中国平安	31,583,893.33	5.50
19	002949	华阳国际	31,467,435.50	5.47
20	H00700	腾讯控股	31,211,647.01	5.43

21	600048	保利地产	30,827,458.97	5.36
22	H00268	金蝶国际	29,494,147.57	5.13
23	600309	万华化学	29,053,270.19	5.05
24	H02318	中国平安	28,547,476.02	4.97
25	H00291	华润啤酒	28,486,310.70	4.96
26	600030	中信证券	28,447,713.88	4.95
27	600690	海尔智家	28,137,670.00	4.90
28	H01772	赣锋锂业	27,695,202.73	4.82
29	H01211	比亚迪股份	27,297,529.60	4.75
30	601166	兴业银行	27,132,837.67	4.72
31	000568	泸州老窖	26,449,666.00	4.60
32	002410	广联达	26,295,336.50	4.57
33	000333	美的集团	25,236,192.25	4.39
34	H01398	工商银行	25,113,892.82	4.37
35	600026	中远海能	24,627,332.00	4.28
36	600449	宁夏建材	23,984,911.60	4.17
37	300144	宋城演艺	23,922,537.29	4.16
38	H01458	周黑鸭	23,582,605.58	4.10
39	600720	祁连山	22,618,930.54	3.94
40	601601	中国太保	22,138,432.00	3.85
41	601628	中国人寿	22,087,774.00	3.84
42	688030	山石网科	21,750,445.43	3.78
43	H00631	三一国际	20,966,038.67	3.65
44	H01138	中远海能	20,702,909.21	3.60
45	002007	华兰生物	20,269,139.34	3.53
46	600859	王府井	20,019,667.00	3.48
47	H02269	药明生物	19,685,618.81	3.42
48	600036	招商银行	18,646,980.00	3.24
49	002594	比亚迪	18,638,362.16	3.24
50	600486	扬农化工	18,467,793.00	3.21

51	002756	永兴材料	18,150,039.99	3.16
52	000625	长安汽车	18,006,594.08	3.13
53	000401	冀东水泥	17,753,942.03	3.09
54	H02238	广汽集团	17,721,456.44	3.08
55	688116	天奈科技	17,687,549.16	3.08
56	600754	锦江酒店	17,363,082.20	3.02
57	600519	贵州茅台	16,898,926.00	2.94
58	000932	华菱钢铁	16,294,571.80	2.83
59	H01717	澳优	15,487,038.98	2.69
60	H06049	保利物业	15,266,544.70	2.66
61	000789	万年青	14,483,988.49	2.52
62	H01171	兖州煤业 股份	13,865,176.76	2.41
63	H01448	福寿园	13,535,120.69	2.35
64	H00763	中兴通讯	13,047,826.70	2.27

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002928	华夏航空	55,065,992.81	9.58
2	300059	东方财富	49,830,546.75	8.67
3	H01211	比亚迪股份	49,012,921.12	8.53
4	600305	恒顺醋业	45,130,146.62	7.85
5	000002	万科A	43,626,927.29	7.59
6	601888	中国中免	42,948,748.45	7.47
7	002714	牧原股份	39,757,018.85	6.92
8	600297	广汇汽车	36,358,051.19	6.33
9	600055	万东医疗	36,273,419.29	6.31

10	H03690	美团-W	35,275,479.11	6.14
11	603369	今世缘	34,981,069.00	6.09
12	600346	恒力石化	33,992,489.44	5.91
13	H01918	融创中国	33,909,669.60	5.90
14	H00175	吉利汽车	33,642,344.39	5.85
15	601336	新华保险	32,901,048.62	5.72
16	H00291	华润啤酒	32,789,781.83	5.70
17	600690	海尔智家	32,597,052.16	5.67
18	000860	顺鑫农业	32,433,869.40	5.64
19	601318	中国平安	31,604,668.40	5.50
20	600048	保利地产	29,109,368.50	5.06
21	600309	万华化学	29,079,330.88	5.06
22	000333	美的集团	28,649,703.70	4.98
23	H02318	中国平安	28,189,003.36	4.90
24	300144	宋城演艺	27,600,074.20	4.80
25	600720	祁连山	27,464,813.21	4.78
26	600030	中信证券	26,788,847.72	4.66
27	600026	中远海能	25,829,678.95	4.49
28	601628	中国人寿	25,338,377.56	4.41
29	002007	华兰生物	25,088,509.70	4.36
30	600449	宁夏建材	24,659,149.22	4.29
31	H01398	工商银行	24,203,873.76	4.21
32	002594	比亚迪	22,959,030.00	3.99
33	H00631	三一国际	22,683,634.87	3.95
34	600486	扬农化工	22,284,667.00	3.88
35	000710	贝瑞基因	22,030,650.40	3.83
36	688030	山石网科	21,949,602.62	3.82
37	000625	长安汽车	19,497,438.00	3.39
38	H01138	中远海能	18,370,082.44	3.20
39	600036	招商银行	18,109,222.11	3.15
40	000401	冀东水泥	18,072,606.00	3.14

41	600754	锦江酒店	17,698,414.70	3.08
42	600519	贵州茅台	17,333,253.00	3.02
43	600859	王府井	16,897,802.00	2.94
44	H01772	赣锋锂业	16,891,790.73	2.94
45	H02238	广汽集团	15,704,266.62	2.73
46	688116	天奈科技	15,638,032.30	2.72
47	000932	华菱钢铁	15,513,052.00	2.70
48	002949	华阳国际	14,650,593.83	2.55
49	H01448	福寿园	13,969,946.83	2.43
50	H01171	兖州煤业 股份	13,647,385.25	2.37
51	000789	万年青	13,503,421.96	2.35
52	H02269	药明生物	12,902,130.68	2.24
53	688981	中芯国际 -U	12,339,495.20	2.15
54	H01238	宝龙地产	12,244,066.00	2.13
55	H01717	澳优	12,179,900.69	2.12
56	600362	江西铜业	11,975,394.42	2.08

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,980,164,083.11
卖出股票收入（成交）总额	1,742,789,152.66

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	28,962,300.00	5.04
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,962,300.00	5.04

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019640	20国债10	290,000	28,962,300.00	5.04

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内,基金投资的前十名证券的发行主体兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年受到行政处罚,处罚金额合计为2979万元。本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

8.12.2 基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	431,013.13
2	应收证券清算款	5,576,990.03
3	应收股利	73,184.55
4	应收利息	293,852.08
5	应收申购款	1,656,046.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,031,086.39

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
永赢股息优选A	7,650	46,411.99	88,537,113.10	24.9364%	266,514,586.84	75.0636%
永赢股息优选C	2,588	5,499.62	0.00	0.0000%	14,233,028.65	100.0000%
合计	10,238	36,070.01	88,537,113.10	23.9753%	280,747,615.49	76.0247%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	永赢股息优选A	3,099,734.89	0.87%
	永赢股息优选C	851,203.13	5.98%
	合计	3,950,938.02	1.07%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	永赢股息优选A	10~50
	永赢股息优选C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢股息优选A	>100
	永赢股息优选C	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢股息优选A	永赢股息优选C
基金合同生效日(2020年03月25日)基金份额总额	883,029,750.80	5,681,020.07
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	389,317,427.57	32,803,066.11
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	917,295,478.43	24,251,057.53
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	355,051,699.94	14,233,028.65

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经永赢基金管理有限公司董事会审议通过，聘任郑凌云先生担任公司总经理助理职务、聘任厉大业先生担任公司首席产品官职务。本基金管理人已分别于2020年5月29日、2020年9月12日在规定信息披露媒介登载了高级管理人员变更公告。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金将存托凭证纳入本基金的投资范围，新增了存托凭证投资策略，并修改了基金合同和托管协议，对招募说明书和基金产品资料概要进行了更新。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响。本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金基金合同及招募说明书中披露的基本投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为70,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，上海证监局对公司出具责令改正的行政监管措施。公司已及时根据上海证监局的相关要求完成全部整改工作，并提交了整改报告。

除上述情况外，本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	599,857,909.85	16.24%	427,073.48	20.70%	-
海通证券	2	1,445,606,829.54	39.14%	1,046,713.45	50.74%	-
华泰证券	2	1,485,956,950.51	40.23%	471,816.26	22.87%	-
瑞银证券	2	162,446,235.50	4.40%	117,408.33	5.69%	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由本基金管理人董事会授权管理层批准。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	20,975,900.01	15.27%	10,000,000.00	0.28%	-	-	-	-
海通证券	64,694,969.00	47.11%	1,938,000,000.00	54.47%	-	-	-	-
华泰证券	15,218,519.99	11.08%	1,565,000,000.00	43.99%	-	-	-	-
瑞银证券	36,452,454.29	26.54%	44,600,000.00	1.25%	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢股息优选混合型证券投资基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2020-02-26
2	永赢股息优选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2020-02-26
3	永赢股息优选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2020-02-26
4	永赢股息优选混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2020-02-26
5	永赢基金管理有限公司关于永赢股息优选混合型证券投资基金增加代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-06
6	永赢基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2020-03-13

	新增上海浦东发展银行股份有限公司为永赢股息优选混合型证券投资基金代销机构的公告		
7	永赢基金管理有限公司关于永赢股息优选混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-20
8	永赢股息优选混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2020-03-26
9	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金开展网上直销平台申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2020-04-08
10	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易、网站以及呼叫中心服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-04-30
11	永赢基金管理有限公司关于新增中信证券华南股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2020-05-06
12	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2020-05-29
13	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易、网站以及呼叫中心服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-06-06
14	永赢股息优选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2020-06-15
15	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微	中国证监会规定媒介	2020-06-23

	信交易、网站以及呼叫中心服务的公告		
16	永赢基金管理有限公司关于变更客户服务热线的公告	中国证监会规定媒介	2020-06-30
17	永赢基金管理有限公司关于新增恒泰证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2020-07-02
18	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易、网站以及呼叫中心服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-07-16
19	永赢股息优选混合型证券投资基金2020年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2020-07-21
20	永赢基金管理有限公司关于新增湘财证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2020-07-22
21	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易、网站以及呼叫中心服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-07-23
22	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-08-01
23	永赢基金管理有限公司关于提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证监会规定媒介	2020-08-05
24	永赢基金管理有限公司关于股权变更的公告	中国证监会规定媒介	2020-08-07
25	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京度小	中国证监会规定媒介	2020-08-11

	满基金销售有限公司为代销机构并开通转换业务的公告		
26	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-08-15
27	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-08-27
28	永赢股息优选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（2020年1号）	中国证监会规定媒介	2020-08-28
29	永赢股息优选混合型证券投资基金2020年中期报告	中国证监会规定媒介	2020-08-31
30	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-08-31
31	永赢基金管理有限公司关于新增银河证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-04
32	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2020-09-12
33	永赢基金管理有限公司关于新增江苏银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-14
34	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-16
35	永赢基金管理有限公司关于新增东北证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-18

36	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-22
37	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-10-22
38	永赢股息优选混合型证券投资基金2020年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2020-10-28
39	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-10-29
40	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金关联交易的公告	中国证监会规定媒介	2020-11-03
41	永赢基金管理有限公司关于调整部分基金最低赎回（含转换转出）份额和最低持有份额数额限制的公告	中国证监会规定媒介	2020-11-11
42	永赢基金管理有限公司关于新增平安银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2020-11-16
43	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-11-19
44	永赢股息优选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（2020年2号）	中国证监会规定媒介	2020-11-30
45	永赢股息优选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2020-11-30
46	永赢股息优选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2020-11-30
47	永赢基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2020-11-30

	旗下部分基金投资范围新增存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告（二）		
48	永赢股息优选混合型证券投资基金更新招募说明书（2020年第1号）	中国证监会规定媒介	2020-12-03
49	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-03
50	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-12
51	永赢基金管理有限公司关于系统维护暂停网上交易、微信交易以及网站服务的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-24
52	永赢股息优选混合型证券投资基金2020年“香港圣诞节”假期暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-25

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200703 - 20200920, 20200922 - 20201008, 20201012 - 20201231	99,999,000.00	0.00	15,000,000.00	84,999,000.00	23.02%
产品特有风险							
<p>本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准永赢股息优选混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《永赢股息优选混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢股息优选混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢股息优选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新（如有）；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.maxwealthfund.com。

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司
二〇二一年三月二十七日