

永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金

2023年第2季度报告

2023年06月30日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2023年07月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年07月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年04月01日起至2023年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	永赢高端装备智选混合发起
基金主代码	015789
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年07月15日
报告期末基金份额总额	29,084,097.55份
投资目标	本基金主要投资于高端装备主题相关的资产，在力争控制组合风险的前提下，实现资产净值的中长期稳健增值。
投资策略	本基金将综合运用大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略，在力争控制组合风险的前提下，实现资产净值的中长期稳健增值。
业绩比较基准	中证高端装备制造指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×10%+中债-综合指数（全价）收益率×20%
风险收益特征	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。 本基金可投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风

	险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	永赢高端装备智选混合发起A	永赢高端装备智选混合发起C
下属分级基金的交易代码	015789	015790
报告期末下属分级基金的份额总额	20,602,005.60份	8,482,091.95份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023年04月01日 - 2023年06月30日)	
	永赢高端装备智选混合发起A	永赢高端装备智选混合发起C
1.本期已实现收益	-2,341,329.52	-957,873.31
2.本期利润	-137,120.41	-82,666.35
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0067	-0.0092
4.期末基金资产净值	16,747,631.08	6,869,066.91
5.期末基金份额净值	0.8129	0.8098

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

3.2 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

永赢高端装备智选混合发起A净值表现

阶段	净值增长率①	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	-1.02%	1.18%	-1.53%	0.83%	0.51%	0.35%

过去六个月	-8.23%	1.18%	3.13%	0.81%	-11.36%	0.37%
自基金合同生效起至今	-18.71%	1.18%	-10.71%	0.96%	-8.00%	0.22%

永赢高端装备智选混合发起C净值表现

阶段	净值增长率①	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	-1.12%	1.18%	-1.53%	0.83%	0.41%	0.35%
过去六个月	-8.41%	1.18%	3.13%	0.81%	-11.54%	0.37%
自基金合同生效起至今	-19.02%	1.19%	-10.71%	0.96%	-8.31%	0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

永赢高端装备智选混合发起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 2022 年 7 月 15 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

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约定。

永赢高端装备智选混合发起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



注：1、本基金合同生效日为 2022 年 7 月 15 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

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约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张璐	基金经理	2022-07-15	-	9	张璐先生，上海交通大学硕士研究生，9年证券相关从业经验。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化研究员，华泰证券（上海）资产管理有限公司量化研究员、基金经理，锐方（上海）投资管理有限公司投资经理，永赢基金管理有限公司投资经理，现任永赢基金管理有限公司指数与量化投

					资部基金经理。
--	--	--	--	--	---------

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《永赢高端装备智选混合型发起式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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年二季度，重要A股指数悉数下跌，其中上证指数(-2.16%)、深证成指(-5.97%)、创业板指(-7.69%)、沪深300(-5.15%)。

二季度从4月份开始市场逐步开始调整，重要股票指数跌多涨少，5月份更是出现普跌。一方面原因是一季度市场反弹力度较大，部分透支市场预期；另一方面随着一季报和各种经济数据出炉，弱复苏现实导致市场震荡偏弱。

从成交上看二季度沪深两市月度成交量与一季度相比呈现边际缩小状态。两市日内成交更是长期处于万亿下方，使得市场活跃度不够，市场陷入存量博弈，难以走出持续反弹行情。

军工板块二季度依然分化明显，中证军工指数二季度上涨2.9%而中证国防指数二季度下跌-0.47%。一方面，受到船舶周期向好因素，二季度中证船舶产业指数上涨28.97%，表现亮眼。另一方面，因为中期调整因素，部分军工核心标的二季度表现依然不佳。

党的二十大对国防和军队建设作出战略部署，强调要如期实现建军一百年奋斗目标，军工长期需求确定性较高。展望三季度，各领域“十四五”规划中期调整有可能落地，中上游企业上半年迟滞的需求三季度有望恢复。

军工行业经过了过去近两年时间的较快增长，未来或进入稳定增长期，细分领域业绩差异显著，结构分化加剧或为未来趋势。随着装备技术不断发展，新技术、新产品层出不穷，在新域新质作战领域或将产生较多投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢高端装备智选混合发起A基金份额净值为0.8129元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.02%，同期业绩比较基准收益率为-1.53%；截至报告期末永赢高端装备智选混合发起C基金份额净值为0.8098元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.12%，同期业绩比较基准收益率为-1.53%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	22,247,447.32	93.29
	其中：股票	22,247,447.32	93.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,489,859.73	6.25
8	其他资产	111,126.39	0.47
9	合计	23,848,433.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	21,345,258.82	90.38
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	902,188.50	3.82
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,247,447.32	94.20

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600893	航发动力	35,400	1,496,004.00	6.33
2	002179	中航光电	28,970	1,313,789.50	5.56
3	000768	中航西飞	47,700	1,275,975.00	5.40
4	600760	中航沈飞	26,740	1,203,300.00	5.10
5	600150	中国船舶	34,000	1,118,940.00	4.74
6	002049	紫光国微	11,400	1,063,050.00	4.50
7	000733	振华科技	11,000	1,054,350.00	4.46
8	600482	中国动力	42,200	989,168.00	4.19
9	600862	中航高科	38,700	979,497.00	4.15
10	002149	西部材料	58,300	978,857.00	4.14

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,577.24
2	应收证券清算款	65,701.02
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,848.13
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	111,126.39

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢高端装备智选混合	永赢高端装备智选混合
--	------------	------------

	发起A	发起C
报告期期初基金份额总额	21,000,767.96	8,172,502.86
报告期期间基金总申购份额	1,756,737.43	5,708,595.88
减：报告期期间基金总赎回份额	2,155,499.79	5,399,006.79
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	20,602,005.60	8,482,091.95

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	永赢高端装备智选混 合发起A	永赢高端装备智选混 合发起C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,800.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,800.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	34.39	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,001,800.00	34.39%	10,001,800.00	34.39%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人	61,393.32	0.21%	0.00	0.00%	-

员					
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,063,193.32	34.60%	10,001,800.00	34.39%	不少于3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20230401 - 20230630	10,001,800.00	0.00	0.00	10,001,800.00	34.39%
产品特有风险							
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。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2.《永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4.《永赢高端装备智选混合型发起式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。

10.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层

10.3 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

2023年07月20日