

永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金  
2023 年年度报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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 .....	5
2.4	信息披露方式 .....	6
2.5	其他相关资料 .....	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2	基金净值表现 .....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	8
§ 4	管理人报告 .....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	18
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	19
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	19
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 .....	19
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 .....	19
§ 5	托管人报告 .....	19
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	19
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	20
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 .....	20
§ 6	审计报告 .....	20
6.1	审计报告基本信息 .....	20
6.2	审计报告的基本内容 .....	20
§ 7	年度财务报表 .....	22
7.1	资产负债表 .....	22
7.2	利润表 .....	23
7.3	净资产变动表 .....	24
7.4	报表附注 .....	25
§ 8	投资组合报告 .....	55
8.1	期末基金资产组合情况 .....	55
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	56
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 .....	57
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	62
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 .....	62
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 .....	62
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 .....	62
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 .....	63
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	63
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12	投资组合报告附注 .....	63
§ 9	基金份额持有人信息 .....	64
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
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 .....	64
§ 10	开放式基金份额变动 .....	64
§ 11	重大事件揭示 .....	64
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	65
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 .....	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4	基金投资策略的改变 .....	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
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 .....	65
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8	其他重大事件 .....	66
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
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 .....	68
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
§ 13	备查文件目录 .....	68
13.1	备查文件目录 .....	68
13.2	存放地点 .....	68
13.3	查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	永赢惠添盈一年混合
基金主代码	012530
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 09 日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	204,863,513.76 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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	本基金研究以自上而下为主，自下而上为辅，从基本面出发挖掘投资机会。通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策及资本市场资金环境的研究，综合运用资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略以及国债期货投资策略，力求控制风险并实现基金资产的增值保值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债-综合指数（全价）收益率×30%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×10%
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。 本基金将投资港股通标的股票，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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	郭明
	联系电话	021-20430340	(010) 66105799
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-805-8888	95588
传真		021-51690177	(010) 66105798
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 55 号
办公地址		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	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	马宇晖	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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 号二十一世纪大厦 21、22、23、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）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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 号二十一世纪大厦 21、22、23、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	2023 年	2022 年	2021 年 11 月 09 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-19,578,466.44	-27,554,574.38	340,533.30
本期利润	-25,229,925.84	-51,775,886.71	16,771,642.35
加权平均基金份额本期利润	-0.1111	-0.1929	0.0635
本期加权平均净值利润率	-13.09%	-21.08%	6.17%
本期基金份额净值增长率	-13.73%	-18.03%	6.35%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-50,784,001.01	-33,240,637.68	340,514.29
期末可供分配基金份额利润	-0.2479	-0.1282	0.0013
期末基金资产净值	154,079,512.75	225,999,366.51	281,612,870.52
期末基金份额净值	0.7521	0.8718	1.0635
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-24.79%	-12.82%	6.35%

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、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。

### 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

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	-6.96%	0.85%	-4.50%	0.57%	-2.46%	0.28%
过去六个月	-16.72%	0.95%	-7.32%	0.61%	-9.40%	0.34%
过去一年	-13.73%	1.02%	-7.39%	0.60%	-6.34%	0.42%
自基金合同生效起至今	-24.79%	1.47%	-19.42%	0.76%	-5.37%	0.71%

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×60%+中债-综合指数（全价）收益率×30%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×10%。

#### 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

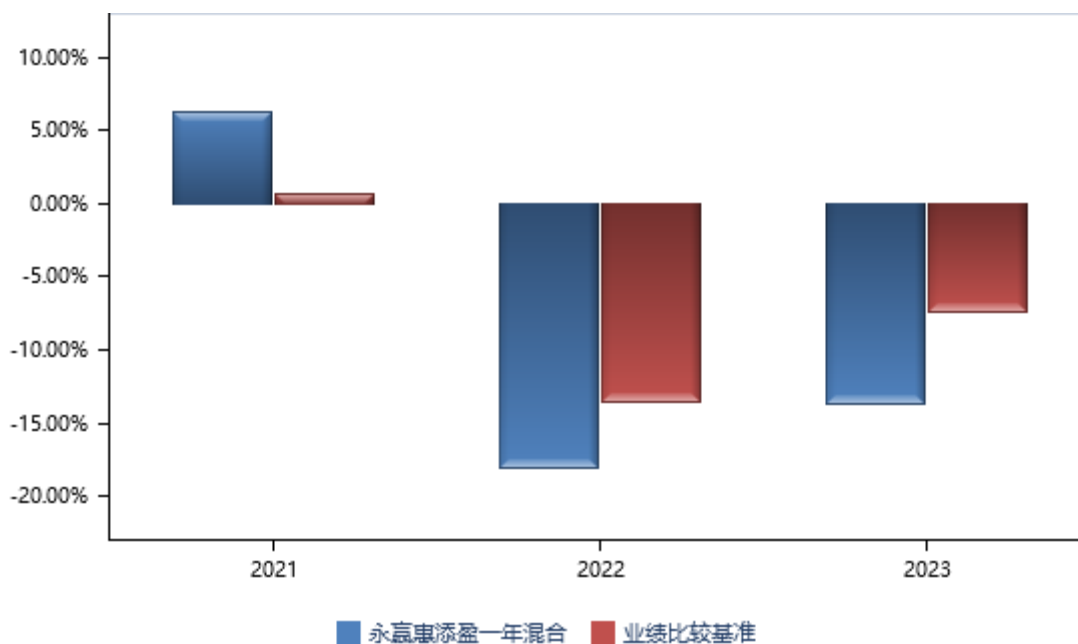
永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年11月09日-2023年12月31日)



注：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。

#### 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：本基金合同于 2021 年 11 月 09 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金的合同生效日为 2021 年 11 月 09 日，截至本报告期末，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%，Oversea-Chinese Banking Corporation Limited 持股 28.51%。

截止 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 121 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、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢嘉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、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢诚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、永赢伟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、永赢合益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、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、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、永赢中债-1-5 年国开行债券指数证券投资基金、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、永赢瑞宁 87 个月定期开放债券型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期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、永赢鑫享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、永赢成长领航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、永赢鑫欣混合型证券投资基金、永赢稳健增利 18 个月持有期混合型证券投资基金、永赢鑫盛混合型证券投资基金、永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠添益混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、永赢港股通优质成长一年持有期混合型证券投资基金、永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、永赢乾益债券型证券投资基金、永赢鑫辰混合型证券投资基金、永赢中债-3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、永赢长远价值混合型证

券投资基金、永赢信利碳中和主题一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢轩益债券型证券投资基金、永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢合享混合型发起式证券投资基金、永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、永赢安盈 90 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增强债券型证券投资基金、永赢优质精选混合型发起式证券投资基金、永赢添添欣 12 个月持有期混合型证券投资基金、永赢养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、永赢卓越臻选股票型发起式证券投资基金、永赢新能源智选混合型发起式证券投资基金、永赢坤益债券型证券投资基金、永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金、永赢宏泰短债债券型证券投资基金、永赢添添悦 6 个月持有期混合型证券投资基金、永赢优质生活混合型证券投资基金、永赢安悦 60 天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢湖北国有企业债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、永赢半导体产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢低碳环保智选混合型发起式证券投资基金、永赢安泰中短债债券型证券投资基金、永赢医药创新智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费鑫选 6 个月持有期混合型证券投资基金、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费龙头智选混合型发起式证券投资基金、永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金、永赢季季享 90 天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢昭利债券型证券投资基金、永赢恒欣稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、永赢数字经济智选混合型发起式证券投资基金、永赢月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金、永赢先进制造智选混合型发起式证券投资基金、永赢浩益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢匠心增利债券型证券投资基金、永赢启源混合型发起式证券投资基金、永赢中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、永赢睿信混合型证券投资基金。

#### 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	副总经理兼基金经理	2021 年 11 月 09 日	2023 年 10 月 11 日	17 年	李永兴先生，北京大学经济学硕士。17 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，兼永赢国际资产管理有限公司董事。
许拓	基金经理	2023年03月07日	-	10年	许拓先生，硕士，10年证券相关从业经验。曾任中欧基金管理有限公司研究员；中信证券股份有限公司研究员；农银汇理基金管理有限公司权益基金经理。现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。

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、《永赢惠添盈一年持有期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为，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》。

通过组织架构的设置、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资产管理计划投资经理互相隔离，且原则上不能互相授权投资。

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）严格控制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

回顾 2023 年，国内宏观经济复苏进程一波三折。年初，资本市场预期疫情结束后经济将进入强劲复苏阶段，但是春节后部分数据显示复苏力度较为一般；3 月初两会并未释放出强烈的经济刺激信号，Q2 开始市场开始逐步修正过于乐观的经济预期；Q3 开始宏观经济政策逐步增多，继 6 月降息之后，7 月下旬政治局经济工作会议定调中对房地产、资本市场、民营经济的表态较积极，8 月中开始货币政策继续降息降准，房地产领域对认房认贷、首付比例、存量房贷款利率等进行了调整，9 月资本市场降低了印花税、重新规范了股东减持、分红、再融资等政策，并适度控制了 IPO 发行节奏和量化资金交易等，10 月后半月中央出台万亿特别国债，地方政府债务置换逐步推进；但以上努力都没有改变资本市场的悲观预期，Q4 对宏观经济的担忧更加严重。与此同时，美国经济的韧性不断超预期，美国十年期国债收益率一路走高到 Q3；中国外交在中东取得重大成果，但是中美关系未改善。

在此背景下，股票市场先涨后跌，整体表现较弱。2 月之前市场在乐观预期下表现强势，3 月份开始股票市场表现较弱。Q2 开始，经济预期偏悲观叠加美元不断强势，人民币迅速贬值，带动外资持续流出，A 股、H 股经济相关度较高板块出现快速下跌，好在国内金融市场流动性仍然充裕，主题

性投资继续强势。Q3 股票市场缺乏清晰的定价逻辑和主线，围绕经济政策及复苏预期反复博弈，叠加外资流出，市场成交额逐步走低，主要指数表现较差。Q4 缺乏基本面支撑，外资流出时有发生，股票市场整体呈现下跌态势，个别主题有阶段性表现。

本基金 Q1 主要投向地产产业链的相关标的。Q2 保持了较高的权益仓位，但对持仓结构进行了优化，买入部分弹性较大的优质港股房地产企业但降低了房地产整体持仓比例，增配了中特估值背景下的稳定运营的公共事业及低估值行业的建筑、交运等行业。由于国家在 Q3 不断出台政策，所以本基金在 Q3 兑现了部分防御性较强的高股息个股，增配了部分弹性标的，事后证明该决策过早乐观，给组合带来了不小损失。Q4 本基金的持仓结构本身偏向防御，且 10 月份进一步降低了弹性标的的配置比例，但并不能抵挡市场的下跌。

总体来看，2023 年股票市场表现较弱，给基金管理带来不小的挑战。本基金在二季度以后基本保持了稳健投资风格，少部分时间有所积极，但整体收益较差，后续将进一步坚守投资目标和投资框架，优化投资策略和投资方向，以适时改变当前的被动局面。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢惠添盈一年混合基金份额净值为 0.7521 元，本报告期内，基金份额净值增长率为-13.73%，同期业绩比较基准收益率为-7.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们的投资理念是始终坚持尊重时代大势、尊重产业规律、尊重市场特征。在认真分析以上三点后，我们认为股票市场的机会可能已经显现。

一、尊重时代大势：珍惜确定性，重视高质量，迎接新变化

1、百年未有之大变局，确定性成为稀缺品

中央多次强调当前处于百年未有之大变局，二十大报告指出“必须准备经受风高浪急甚至惊涛骇浪的重大考验”。宏观环境复杂度大幅提升，给资产管理行业带来很大挑战。资产管理者如何找到确定性较强的底层资产，如何降低自己管理过程中的不确定性是最大的考验。

2、高质量发展背景下实体企业和资本市场偏好将改变

过往粗放式的提高负债加杠杆扩规模的模式已经走到尽头，政府投资、企业投资都必须注重考虑效益，在此背景下，存量投资和新增投资的潜在回报会逐步提升，经济发展更加坚实，企业盈利能力提升、资产负债表更加稳固，也能更好的通过分红、回购等形式回馈股东。

企业行为的变化也将带来资本市场偏好的转变。过往企业增速较快，资本市场的参与者相应的以追求增长较快的公司为主流审美，可能相对较少关注增长的质量，主要通过交易获取短期的资本

利得，但实际上质量不高的发展最终给市场带来了较大损失。往后看，企业逐步转向追求投资回报优先，追求自由现金流，更加重视增长的连续性、稳定性、持续性，同时企业更加注重投资者回报，通过长期持有并获得分红等形式获得稳定回报成为可能。

### 3、共同富裕要求下资产管理行业迎来利好

国家提出要“着力扩大中等收入群体规模，也鼓励要增加城乡居民住房、农村土地、金融资产等各类财产性收入”，这也给资产管理行业指明了方向。一方面中等收入群体是社会财富创造的主力军，通过辛勤劳动应该获得一份良好回报，另一方面中等收入群体也是资产管理行业的需求主体，资产管理行业理应通过长期投资稳健持续发展的优质企业，让社会大众共享经济发展的成果，更有利于实现共同富裕。

资本市场本身也应该充分认识到，中国经济从高速发展向高质量发展转变的新常态，市场应该更多的转向关注回报的质量和持续性，这给资产管理工作带来了利好。

总结以上三方面，我们应该清晰地看到当前和未来相当一段时间内的不确定性在增加，确定性的稀缺性在上升；高质量发展背景下，会逐步引导企业转向关注投资回报和股东回报，市场偏好将从追求增速向追求稳定性和持续性转变；共同富裕背景下，市场应该对潜在回报率的绝对额和获取速度有合理预期，资产管理行业的从业人员也应该看到这种重大转变背后的利好机会。

## 二、尊重产业规律：降速提质促股东回报回升，不同产业发展路径逐步清晰

### 1、宏观经济降速提质，股东回报或迎回升

过往部分行业追求经济快速发展，过度投资带来了总体回报率的降低，虽然需求仍快速增长，但是已经面临产能过剩，企业经营逐步困难；部分行业过度加杠杆，最终带来了一系列的潜在金融风险。

往后看，高质量发展导向下，企业降低做大规模的意愿，投资增速逐步放缓，随着经济的持续稳健增长，反而能逐步消化过剩产能，存量资产的股东回报可能会逐步上行。同时也应该看到，上市公司作为社会优质企业的集中地，很多属于各行业的龙头公司，过往普遍具有融资加杠杆扩规模的冲动，积极回报股东的意愿较弱，这种局面未来可能得到明显转变，尤其是央企、国企在国家政策导向下可能迅速地转向通过各种方式加大对股东的回报。基于此，权益市场将受益于部分行业的存量资产的潜在回报率上升、上市公司更加重视股东回报而更加具有投资价值。

### 2、新老产业发展路径逐步清晰

增长放缓行业中的“卷王”越来越值得重视。过往经济快速发展时代，企业普遍追求规模，各个行业在需求快速增长期几乎都出现了产能过剩，2015年以来国家针对需求增速偏低的传统中上游行业不断推进供给侧改革，新增产能普遍得到遏制，部分行业的产能得到去化，部分行业需求增长

逐步消化了过剩产能；还有部分偏中游的制造业行业，竞争格局已经明晰，基本无新进入者，存量企业也从降价抢份额逐步转向要稳价要利润；与此同时，部分行业正处于产能过剩较为严重的阶段，优胜劣汰刚刚开始，龙头公司正在逐步积累竞争优势，虽然当前盈利能力较弱，但未来值得期待。

拥有雄心壮志的一批“闯王”也值得跟踪。高质量发展要求在很多领域向上突破，如高端设备、生物医药、航空航天、人工智能、半导体制造等诸多领域，这些行业需求仍然强劲，但是需要优质企业坚持不懈的投入研发、相关产业给与适用的机会，一旦实现突破，企业将获得优厚的回报。除此之外，全球市场需求仍大，中国企业出海仍是非常重要的增长路径，优秀的中国企业拥有坚韧的企业家精神、优秀的管理经验、高效的制造能力，如果能够在海外不断打开生产基地、销售渠道，甚至自有品牌，那么良好的竞争力也会获得更好的回报。

除此以外，一些新增需求逐步显现，比如养老、服务消费、新基建等等，这些新增需求中部分行业还未饱和，部分行业竞争有序，都有不少投资机会。改革的红利还在释放，典型者如国企改革快速推进，一批央国企多次进行与市值相关的激励，激活了企业效率，也能让员工共享企业发展的成果。

总体来看，高质量发展背景下，企业降速提质，股东的潜在回报或能提升；增速放缓行业的“卷王”因为竞争减弱而盈利能力提升，坚守本业突破技术或者市场的“闯王”同样值得跟踪，时代的新需求红利、改革红利也孕育一些新机会。

### 三、尊重市场特征：市场参与者重获共识，上行要素已经具备

#### 1、资本市场参与者的转变已经开始

从市场参与者角度看，追求增速向追求稳定性转变。过往经济快速增长背景下，企业发展迅速，市场普遍追求高增速，给高增速公司高估值，从而景气度高的行业和个股容易实现戴维斯双击，可以赚取资本利得，但是后来发现高增速不可持续，业绩甚至大幅下滑，市场又一窝蜂的出逃，出现戴维斯双杀，造成实质亏损，收益并不好。往后看，越来越多的市场参与者转向追求稳定收益，更加注重公司增长的质量、持续性，注重公司是否在意股东回报，追求持有获得稳定收益的市场参与者增多，追逐短期资本利得的市场参与者减少。

从上市公司角度看，优质企业重新得到定义。过往资本市场更加体现股票市场本身的波动，市场较好时奖励的是远期空间大、中期逻辑性强、短期业绩爆发的公司。往后看，持续经营能力较强、稳定性较高、但是增速偏低的优质企业，由于其竞争壁垒扎实，获取自由现金流的能力更强，同时也更重视股东回报，可能被重新定义为优质企业，这些公司的估值可能得到提升。

从资管行业看，让投资者长期获益的可能性提升。以公募基金为例，没有一家基金公司的初心不是以持有人的利益放在第一位，没有一个基金经理的本心不以获取收益为目标，但是过往的高速



发展阶段股票市场本身的波动大，过度追求短期快速收益反而造成了业绩的大幅波动；往后看，如果市场本身的预期回报合理，企业发展降速提效加大股东回报，也有利于基金产品资产负债两端的稳定，反而增大了持有人长期获益的可能。

## 2、资本市场获取收益的新方式逐步明晰

过往资本市场更多的追求短期变化（景气、事件等）带来的股价波动，交易是主要获利手段，并不真正基于企业价值做持有。往后看，在资本市场获利的方式将出现变化，交易不确定性较高标的获得阶段回报仍然是重要投资方式，但是持有确定性较高标的获取稳定收益或是新形成的重要投资方式。

持有确定性较高标的追求稳定收益。确定性较强标的往往增速都比较低，在过往以增长为主要考虑因素的时代，大量的经营稳定但增长较慢的优质资产被忽视，估值被压低到相当低的水平。比如中央企业作为优质的国有资产，天然具备资源、牌照、融资等诸多优势，实力强大、经营风险低、长期业绩稳定性强，且经营的存续期长、加权平均资金成本低，但央企之前的市值很多低于净资产。这一两年随着内外部不确定性的明显增加，这类确定性较强的资产逐步被一部分率先转变理念的投资者关注并买入，估值有一些修复，但是仍处于偏低水平。必须说明，随着确定性资产连续两年走高，有人担心这种风格可能已经见顶，也担心这种转向是短期的避险需要，确实不排除有部分资金是短期避险需求，但以年维度看，未来这种投资方式占比预计仍将提高。

交易不确定性较高标的获得阶段回报。当前由于宏观环境的不确定性仍存，造成了短期这种投资方式想获得回报较困难，但这恰恰压低了市场的整体估值，给未来边际变好后股票上涨提供弹性。展望 2024 年，虽然确实内外部不确定性仍多，但是有利因素也在积累，比如美联储可能步入降息通道，国内经济托底政策增加后经济进一步恢复等等，我们对这种投资方式的阶段性回报同样报以期待。

此外，不能狭隘地把两种投资方式对立起来，二者并行不悖，且相互转化。并行不悖源于资本市场投资者偏好的分化，持有确定性较高标的以获取长期稳定收益的投资者逐步增加，而原有交易不确定性较高标的获取阶段回报的投资者仍在资本市场。相互转化源于变化一直在持续，确定性较强的资产并非完全没有风险，一旦其确定性的假设条件发生变化，也可能沦为不确定性资产；不确定性资产的假设条件逐步走稳，其确定性也会提升，也可能被投资者接受。此外，确定性较高资产定价过高自然就面临风险，不确定性资产定价过低反而会有更好的风险补偿，不能刻舟求剑。

## 3、资本市场上行的基础要素已经具备

从估值面看，A/H 股票市场的估值水平较低。纵向对比，各个指标衡量 A/H 股票市场的整体估值水平均处于历史偏低，尤其以沪深 300、上证 50 为代表的大盘/价值估值处于历史低位；横向对

比，与海外核心股指进行横向对比，无论是与新兴市场或是发达市场指数，目前的 A 股估值具有较强的吸引力。回到两种投资方式角度看，A/H 股票市场确定性偏高资产的估值水平整体仍低，具备可观的上涨空间；确定性偏低资产的估值水平已经下降，具备修复空间。

从资金面来看，存量资金腾挪或者增量资金入市都有利于股市上涨。外资边际影响已经减弱；机构持仓自 2021 年春节后开始不断打乱，主要是从消费、制造、科技等白马部分分散到了中小市值公司，后续可能不断向优质的经营稳定的重视股东回报的优质公司逐步集中，这就有可能带来蓝筹指数的上涨行情。此外，随着存款利率的不断下行，场外资金仍有入市的可能性，一旦场外低风险偏好的资金接受持有确定性较高资产获取稳定收益的投资方式，或将助推蓝筹指数的上行力度。

综合以上分析来看，从监管者、上市公司到资产管理人、市场参与者的转变都已经出现，企业重视投资回报和股东回报，市场预期合理化，资产管理趋于稳健可控，四方达成一致，更有利于资本市场的恢复。投资方式角度看，持有确定性较高标的获取长期收益有望成为重要投资方式，且未来更加重要，由此引发的资金层面的重新聚拢，是有可能在当前整体估值较低的情形下带动市场走出一波行情。

料峭春寒迎暖意，虽然我们满怀希望，报以期待，但是我们仍然强调未来几年需要牢牢守住底线思维，战略上正视困难，战术上精于筹划，执行上坚决果断，希望能为各位持有人带来长期满意的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 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，持续健全、完善内控建设，提升风险管理水平，确保基金管理业务规范运作。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

1、持续加强制度建设。报告期内，公司根据法律法规、监管政策及业务开展实际情况，对公司制度进行了全面梳理、评估与更新，确保制度的合规性、有效性和可操作性，进一步完善公司制度体系。

2、新规解读及监管要求的落实。2023 年，公司持续密切关注各项最新法律法规、监管政策，及时开展新规新政的传达和解读、并拟定落实方案，由各相关部门进行具体落实，同时定期对落实情况跟踪检查。

3、强化合规培训。为进一步提升员工合规意识，强化员工执业行为的合规性，合规部组织多次面向不同对象，针对不同主题的合规培训，包括针对新员工的合规培训，面向全员的合规宣导以及

邀请外部律师开展专项培训等，并通过多样化的方式提高员工在合规培训中的参与度以及积极性。

4、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。2023 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信息技术专项审计、年度内控评价等项目。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。

#### 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/研究的分管领导、权益投资/研究的分管领导、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，符合基金合同的约定。

#### 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法

律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——永赢基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对永赢基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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（2024）审字第 70077306_B94 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	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的永赢惠添盈一年持有期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，公允反映了永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
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，我们独立于永赢惠添盈一年持有期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	-
其他事项	-

其他信息	<p>永赢惠添盈一年持有期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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估永赢惠添盈一年持有期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。</p> <p>治理层负责监督永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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，就可能导致对永赢惠添盈一年持有期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</p>

	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惠添盈一年持有期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	石静筠	沈熙苑
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层	
审计报告日期	2024年03月25日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	6,634,158.56	18,546,113.31
结算备付金		1,278,962.00	55,217.01
存出保证金		73,485.17	18,859.12
交易性金融资产	7.4.7.2	147,759,866.23	208,255,842.52
其中：股票投资		139,094,719.38	208,255,842.52
基金投资		-	-
债券投资		8,665,146.85	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		42,283.86	35,376.00
应收申购款		980.64	1,284.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		155,789,736.46	226,912,692.39
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>

<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		861,193.98	6.49
应付赎回款		287,085.40	341,748.43
应付管理人报酬		158,771.30	299,465.83
应付托管费		26,461.84	49,910.96
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	376,711.19	222,194.17
负债合计		1,710,223.71	913,325.88
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	204,863,513.76	259,240,004.19
未分配利润	7.4.7.8	-50,784,001.01	-33,240,637.68
净资产合计		154,079,512.75	225,999,366.51
负债和净资产总计		155,789,736.46	226,912,692.39

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7521 元，基金份额总额 204,863,513.76 份。

## 7.2 利润表

会计主体：永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-21,947,522.04	-47,288,731.09
1. 利息收入		61,336.37	66,258.03
其中：存款利息收入	7.4.7.9	52,193.74	66,258.03
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,142.63	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-16,357,399.01	-23,133,676.79
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-19,803,351.78	-30,095,104.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	139,488.49	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-3,510.86	-
股利收益	7.4.7.15	3,309,975.14	6,961,428.13
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-5,651,459.40	-24,221,312.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		3,282,403.80	4,487,155.62
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,674,790.51	3,701,745.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	445,798.35	616,957.51
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	161,814.94	168,453.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-25,229,925.84	-51,775,886.71
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-25,229,925.84	-51,775,886.71
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-25,229,925.84	-51,775,886.71

### 7.3 净资产变动表

会计主体：永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	259,240,004.19	-33,240,637.68	225,999,366.51
二、本期期初净资产	259,240,004.19	-33,240,637.68	225,999,366.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-54,376,490.43	-17,543,363.33	-71,919,853.76
（一）、综合收益总额	-	-25,229,925.84	-25,229,925.84
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-54,376,490.43	7,686,562.51	-46,689,927.92
其中：1. 基金申购款	2,839,250.83	-380,641.29	2,458,609.54
2. 基金赎回款	-57,215,741.26	8,067,203.80	-49,148,537.46
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-



四、本期期末净资产	204,863,513.76	-50,784,001.01	154,079,512.75
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	264,795,974.46	16,816,896.06	281,612,870.52
二、本期期初净资产	264,795,974.46	16,816,896.06	281,612,870.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,555,970.27	-50,057,533.74	-55,613,504.01
（一）、综合收益总额	-	-51,775,886.71	-51,775,886.71
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-5,555,970.27	1,718,352.97	-3,837,617.30
其中：1. 基金申购款	6,362,678.76	-43,646.29	6,319,032.47
2. 基金赎回款	-11,918,649.03	1,761,999.26	-10,156,649.77
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	259,240,004.19	-33,240,637.68	225,999,366.51

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                      汪成杰                      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

永赢惠添盈一年持有期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[2021]1705号《关于准予永赢惠添盈一年持有期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向社会公开募集，基金合同于2021年11月9日生效，首次设立募集规模为263,933,730.40份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“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）、可交换债券、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

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。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产占基金资产的 50%-95%,其中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。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 60%+中债-综合指数(全价)收益率 $\times$ 30%+恒生指数收益率(按估值汇率折算) $\times$ 10%。

#### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 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。

##### 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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和金融负债，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单

项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益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；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 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费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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，通过红利再投资所得基金份额的最短持有期起始日与该认/申购份额最短持有期起始日相同；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一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。

在不违反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、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，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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 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法》、《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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	6,634,158.56	18,546,113.31
等于：本金	6,633,469.27	18,544,241.10

加：应计利息	689.29	1,872.21
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	6,634,158.56	18,546,113.31

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	152,553,042.07	-	139,094,719.38	-13,458,322.69	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,484,189.99	164,296.85	8,665,146.85	16,660.01
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,484,189.99	164,296.85	8,665,146.85	16,660.01
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	161,037,232.06	164,296.85	147,759,866.23	-13,441,662.68	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	216,046,045.80	-	208,255,842.52	-7,790,203.28	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	-	-	-	
	合计	-	-	-	
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	216,046,045.80	-	208,255,842.52	-7,790,203.28	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	221,711.19	57,194.17
其中：交易所市场	221,711.19	57,194.17
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	155,000.00	165,000.00
合计	376,711.19	222,194.17

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	259,240,004.19	259,240,004.19
本期申购	2,839,250.83	2,839,250.83
本期赎回（以“-”号填列）	-57,215,741.26	-57,215,741.26
本期末	204,863,513.76	204,863,513.76

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-26,438,422.38	-6,802,215.30	-33,240,637.68
本期期初	-26,438,422.38	-6,802,215.30	-33,240,637.68
本期利润	-19,578,466.44	-5,651,459.40	-25,229,925.84
本期基金份额交易产生的变动数	6,962,176.83	724,385.68	7,686,562.51
其中：基金申购款	-379,957.66	-683.63	-380,641.29
基金赎回款	7,342,134.49	725,069.31	8,067,203.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-39,054,711.99	-11,729,289.02	-50,784,001.01

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
活期存款利息收入	41,247.15	61,539.25
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	9,985.83	4,017.54
其他	960.76	701.24
合计	52,193.74	66,258.03

## 7.4.7.10 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	688,094,844.64	208,142,488.15
减：卖出股票成本总额	706,145,102.34	237,670,567.47
减：交易费用	1,753,094.08	567,025.60
买卖股票差价收入	-19,803,351.78	-30,095,104.92

## 7.4.7.11 债券投资收益

## 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
债券投资收益—利息收入	139,488.49	-
债券投资收益—买卖债券（债转股及 债券到期兑付）差价收入	-	-

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	139,488.49	-

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-买卖债券差价收入。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
卖出权证成交总额	-3,510.86	-
减：卖出权证成本总额	-	-
减：交易费用	-	-
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	-	-
买卖权证差价收入	-3,510.86	-

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益--其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益--其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
股票投资产生的股利收益	3,309,975.14	6,961,428.13
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	3,309,975.14	6,961,428.13

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-5,651,459.40	-24,221,312.33
-- 股票投资	-5,668,119.41	-24,221,312.33
-- 债券投资	16,660.01	-
-- 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	-5,651,459.40	-24,221,312.33

## 7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

## 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

## 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
审计费用	35,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	4,194.71	1,289.92
证券组合费	2,620.23	2,163.18
合计	161,814.94	168,453.10

## 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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
Oversea-Chinese Banking Corporation Limited（“Oversea-Chinese Banking”）	基金管理人的股东
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司
永赢国际资产管理有限公司（“永赢国际”）	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、根据中国证券监督管理委员会的相关批复，永赢基金管理有限公司已在香港特别行政区政府的公司注册处办理完成香港子公司——永赢国际资产管理有限公司的注册登记手续，并于 2022 年 11 月 14 日获得香港证券及期货事务监察委员会颁发的第四号（就证券提供意见）及第九号（提供资产管理）牌照。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均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 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,674,790.51	3,701,745.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,219,277.07	1,685,673.50
应支付基金管理人的净管理费	1,455,513.44	2,016,071.51

注：2023年07月24日前，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。自2023年07月24日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。

计算方法如下：

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

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 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	445,798.35	616,957.51

注：2023年07月24日前，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。自2023年07月24日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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及上年度可比期间均未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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 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 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	6,634,158.56	41,247.15	18,546,113.31	61,539.25

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均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

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末 2023 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	受限期	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
688627	精智达	2023年07月11日	6个月	新股限售	46.77	87.72	121	5,659.17	10,614.12	-
688548	广钢气体	2023年08月08日	6个月	新股限售	9.87	12.75	680	6,711.60	8,670.00	-
688549	中巨芯	2023年08月30日	6个月	新股限售	5.18	8.09	1,065	5,516.70	8,615.85	-
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	新股限售	26.74	38.67	222	5,936.28	8,584.74	-
688592	司南导航	2023年08月07日	6个月	新股限售	50.50	50.53	167	8,433.50	8,438.51	-
688563	航材股份	2023年07月12日	6个月	新股限售	78.99	60.49	137	10,821.63	8,287.13	-
688573	信宇人	2023年08月09日	6个月	新股限售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688610	埃科光电	2023年07月10日	6个月	新股限售	73.33	51.00	152	11,146.16	7,752.00	-
688591	泰凌微	2023年08月18日	6个月	新股限售	24.98	28.02	269	6,719.62	7,537.38	-
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	新股限售	55.00	74.14	94	5,170.00	6,969.16	-
688671	碧兴物联	2023年08月02日	6个月	新股限售	36.12	34.30	193	6,971.16	6,619.90	-
603296	华勤技术	2023年08月01日	6个月	新股限售	80.80	77.75	83	6,706.40	6,453.25	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股限售	28.03	49.84	129	3,615.87	6,429.36	-
688651	盛邦	2023年	6个月	新股限售	39.90	46.05	139	5,546.10	6,400.95	-

	安全	07月19日		售						
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股限售	31.95	52.25	117	3,738.15	6,113.25	-
301251	威尔高	2023年08月30日	6个月	新股限售	28.88	34.59	164	4,736.32	5,672.76	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股限售	10.50	15.99	345	3,622.50	5,516.55	-
688702	盛科通信	2023年09月06日	6个月	新股限售	42.66	48.18	110	4,692.60	5,299.80	-
688648	中邮科技	2023年11月06日	6个月	新股限售	15.18	21.43	235	3,567.30	5,036.05	-
688693	锆威特	2023年08月10日	6个月	新股限售	40.83	43.41	116	4,736.28	5,035.56	-
688638	誉辰智能	2023年07月04日	6个月	新股限售	83.90	59.68	81	6,795.90	4,834.08	-
301550	斯菱股份	2023年09月06日	6个月	新股限售	37.56	43.57	110	4,131.60	4,792.70	-
688716	中研股份	2023年09月13日	6个月	新股限售	29.66	36.39	131	3,885.46	4,767.09	-
688602	康鹏科技	2023年07月13日	6个月	新股限售	8.66	11.06	424	3,671.84	4,689.44	-
688719	爱科赛博	2023年09月20日	6个月	新股限售	69.98	60.10	75	5,248.50	4,507.50	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股限售	1.70	4.06	1,050	1,785.00	4,263.00	-
688646	逸飞激光	2023年07月21日	6个月	新股限售	46.80	36.07	118	5,522.40	4,256.26	-
301529	福赛科技	2023年08月31日	6个月	新股限售	36.60	37.88	104	3,806.40	3,939.52	-

		日								
688612	威迈斯	2023年 07月19 日	6个月	新股限 售	47.29	37.97	100	4,729.00	3,797.00	-
688450	光格科技	2023年 07月17 日	6个月	新股限 售	53.09	36.42	86	4,565.74	3,132.12	-
688657	浩辰软件	2023年 09月25 日	6个月	新股限 售	103.40	78.23	40	4,136.00	3,129.20	-
601083	锦江航运	2023年 11月28 日	6个月	新股限 售	11.25	11.07	270	3,037.50	2,988.90	-
603273	天元智能	2023年 10月16 日	6个月	新股限 售	9.50	18.97	152	1,444.00	2,883.44	-
603270	金帝股份	2023年 08月25 日	6个月	新股限 售	21.77	29.58	96	2,089.92	2,839.68	-
603004	鼎龙科技	2023年 12月20 日	6个月	新股限 售	16.80	31.19	82	1,377.60	2,557.58	-
603373	安邦护卫	2023年 12月13 日	6个月	新股限 售	19.10	34.75	73	1,394.30	2,536.75	-
603119	浙江荣泰	2023年 07月21 日	6个月	新股限 售	15.32	23.87	104	1,593.28	2,482.48	-
603275	众辰科技	2023年 08月16 日	6个月	新股限 售	49.97	39.70	57	2,848.29	2,262.90	-
603107	上海汽配	2023年 10月25 日	6个月	新股限 售	14.23	18.19	108	1,536.84	1,964.52	-
603276	恒兴新材	2023年 09月18 日	6个月	新股限 售	25.73	24.88	77	1,981.21	1,915.76	-
603193	润本股份	2023年 10月09 日	6个月	新股限 售	17.38	16.66	112	1,946.56	1,865.92	-
603062	麦加芯彩	2023年 10月31 日	6个月	新股限 售	58.08	57.81	30	1,742.40	1,734.30	-

603075	热威股份	2023 年 09 月 01 日	6 个月	新股限售	23.10	23.31	70	1,617.00	1,631.70	-
--------	------	------------------------	------	------	-------	-------	----	----------	----------	---

#### 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 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场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 2023 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证券款余额。

#### 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及业务部门的自控和互控的第一道防线，合规风控部门监督管理的第二道防线，审计部事后检查的第三道防线，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控制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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,665,146.85	-
合计	8,665,146.85	-

注：1、国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级；

2、上年度末，本基金未持有短期债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

### 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制的投资品种比例等。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 2023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							
货币资金	6,634,158.56	-	-	-	-	-	6,634,158.56
结算备付金	1,278,962.00	-	-	-	-	-	1,278,962.00
存出保证金	73,485.17	-	-	-	-	-	73,485.17
交易性金融资产	8,665,146.85	-	-	-	-	139,094,719.38	147,759,866.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	42,283.86	42,283.86
应收申购款	-	-	-	-	-	980.64	980.64
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,651,752.58	-	-	-	-	139,137,983.88	155,789,736.46
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	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	861,193.98	861,193.98
应付赎回款	-	-	-	-	-	287,085.40	287,085.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	158,771.30	158,771.30
应付托管费	-	-	-	-	-	26,461.84	26,461.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	376,711.19	376,711.19
负债总计	-	-	-	-	-	1,710,223.71	1,710,223.71
利率敏感度缺口	16,651,752.58	-	-	-	-	137,427,760.17	154,079,512.75
上年度末	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

2022 年 12 月 31 日							
资产							
货币资金	18,546,113.31	-	-	-	-	-	18,546,113.31
结算备付金	55,217.01	-	-	-	-	-	55,217.01
存出保证金	18,859.12	-	-	-	-	-	18,859.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-208,255,842.52	208,255,842.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	35,376.00	35,376.00
应收申购款	-	-	-	-	-	1,284.43	1,284.43
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,620,189.44	-	-	-	-	-208,292,502.95	226,912,692.39
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	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	6.49	6.49
应付赎回款	-	-	-	-	-	341,748.43	341,748.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	299,465.83	299,465.83
应付托管费	-	-	-	-	-	49,910.96	49,910.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	222,194.17	222,194.17
负债总计	-	-	-	-	-	913,325.88	913,325.88
利率敏感度缺口	18,620,189.44	-	-	-	-	-207,379,177.07	225,999,366.51

注：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 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(2023 年 12 月 31 日)	上年度末（2022 年 12 月 31 日）

市场利率平行上升 50 个基点	-1,984.32	-
市场利率平行下降 50 个基点	1,984.32	-

注：上年度末，本基金未持有债券，无重大利率风险。

#### 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 2023 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	-	29,532,846.20	-	29,532,846.20
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	42,283.86	-	42,283.86
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	29,575,130.06	-	29,575,130.06
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
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	-	29,575,130.06	-	29,575,130.06
项目	上年度末 2022 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	-	30,266,889.64	-	30,266,889.64
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	35,376.00	-	35,376.00
应收申购款	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	30,302,265.64	-	30,302,265.64
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
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	-	30,302,265.64	-	30,302,265.64

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	1,478,756.50	1,515,113.28
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,478,756.50	-1,515,113.28

#### 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 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净 值比例（%）	公允价值	占基金资产净 值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	139,094,719.38	90.27	208,255,842.52	92.15
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	139,094,719.38	90.27	208,255,842.52	92.15

##### 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(2023年12月31日)	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准增加 1%	1,477,768.13	3,167,214.29
	业绩比较基准减少 1%	-1,477,768.13	-3,167,214.29

注：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 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	138,878,693.22	208,255,842.52
第二层次	8,673,731.59	-
第三层次	207,441.42	-
合计	147,759,866.23	208,255,842.52

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	376,588.53	376,588.53
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	227,078.59	227,078.59
当期利得或损失总额	-	57,931.48	57,931.48
其中：计入损益的利得或损失	-	57,931.48	57,931.48
期末余额	-	207,441.42	207,441.42
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	21,694.82	21,694.82
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	207,441.42	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预	0.1855-2.1988	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	期年化波动率	不可观察输入值	
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 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。

##### 7.4.15.2 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。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 03 月 25 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	139,094,719.38	89.28
	其中：股票	139,094,719.38	89.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,665,146.85	5.56
	其中：债券	8,665,146.85	5.56
	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	7,913,120.56	5.08

8	其他各项资产	116,749.67	0.07
9	合计	155,789,736.46	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 29,532,846.20 元，占期末净值比例 19.17%。

## 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	27,055,023.64	17.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,693,039.20	23.81
E	建筑业	3,999,832.00	2.60
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,907,931.90	2.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	779,396.69	0.51
J	金融业	3,922,926.00	2.55
K	房地产业	27,026,975.00	17.54
L	租赁和商务服务业	2,536.75	0.00
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	6,174,212.00	4.01
S	综合	-	-
	合计	109,561,873.18	71.11

### 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（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-



日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	1,104,220.01	0.72
通讯业务	-	-
公用事业	11,796,990.71	7.66
房地产	16,631,635.48	10.79
合计	29,532,846.20	19.17

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	600011	华能国际	1,318,894	10,155,483.80	6.59
1	00902	华能国际电力股份	1,288,000	4,832,255.03	3.14
2	600027	华电国际	1,807,600	9,291,064.00	6.03
2	01071	华电国际电力股份	1,692,000	5,320,635.11	3.45
3	000543	皖能电力	1,754,200	10,981,292.00	7.13
4	06049	保利物业	289,000	7,542,650.30	4.90
5	00119	保利置业集团	4,108,000	5,919,175.30	3.84
6	000002	万科 A	446,600	4,671,436.00	3.03
6	02202	万科企业	58,500	382,760.14	0.25
7	000777	中核科技	345,800	5,027,932.00	3.26
8	600150	中国船舶	165,400	4,869,376.00	3.16
9	600582	天地科技	894,800	4,867,712.00	3.16
10	600642	申能股份	744,900	4,782,258.00	3.10
11	600383	金地集团	1,055,800	4,603,288.00	2.99
12	601155	新城控股	389,900	4,448,759.00	2.89
13	300803	指南针	65,100	3,922,926.00	2.55
14	601333	广深铁路	1,507,700	3,904,943.00	2.53
15	600048	保利发展	308,500	3,054,150.00	1.98
16	000069	华侨城 A	955,400	2,971,294.00	1.93
17	002208	合肥城建	453,000	2,903,730.00	1.88
18	00123	越秀地产	483,564	2,787,049.74	1.81
19	600970	中材国际	286,800	2,678,712.00	1.74
20	601921	浙版传媒	301,600	2,304,224.00	1.50
21	001979	招商蛇口	241,300	2,299,589.00	1.49
22	601098	中南传媒	225,900	2,297,403.00	1.49
23	600519	贵州茅台	1,200	2,071,200.00	1.34

24	000333	美的集团	30,400	1,660,752.00	1.08
25	00836	华润电力	116,000	1,644,100.57	1.07
26	601928	凤凰传媒	178,500	1,572,585.00	1.02
27	300037	新宙邦	32,900	1,556,170.00	1.01
28	000921	海信家电	75,300	1,536,120.00	1.00
29	000539	粤电力 A	303,260	1,482,941.40	0.96
30	688382	益方生物	92,509	1,400,586.26	0.91
31	600657	信达地产	380,200	1,364,918.00	0.89
32	000090	天健集团	287,200	1,321,120.00	0.86
33	688498	源杰科技	8,704	1,296,721.92	0.84
34	09669	北森控股	236,600	1,104,220.01	0.72
35	688653	康希通信	47,571	950,981.07	0.62
36	688083	中望软件	7,681	764,566.74	0.50
37	688234	天岳先进	11,514	760,729.98	0.49
38	301272	英华特	13,500	733,320.00	0.48
39	603506	南都物业	65,300	709,811.00	0.46
40	002149	西部材料	8,100	127,332.00	0.08
41	688563	航材股份	234	14,223.53	0.01
42	688627	精智达	121	10,614.12	0.01
43	688548	广钢气体	680	8,670.00	0.01
44	688549	中巨芯	1,065	8,615.85	0.01
45	688582	芯动联科	222	8,584.74	0.01
46	688592	司南导航	167	8,438.51	0.01
47	688573	信宇人	285	8,208.00	0.01
48	688610	埃科光电	152	7,752.00	0.01
49	688591	泰凌微	269	7,537.38	0.00
50	688603	天承科技	94	6,969.16	0.00
51	688671	碧兴物联	193	6,619.90	0.00
52	603296	华勤技术	83	6,453.25	0.00
53	688720	艾森股份	129	6,429.36	0.00
54	688651	盛邦安全	139	6,400.95	0.00
55	688652	京仪装备	117	6,113.25	0.00
56	301251	威尔高	164	5,672.76	0.00
57	688702	盛科通信	110	5,299.80	0.00
58	688648	中邮科技	235	5,036.05	0.00
59	688693	锆威特	116	5,035.56	0.00
60	688638	誉辰智能	81	4,834.08	0.00
61	301550	斯菱股份	110	4,792.70	0.00
62	688716	中研股份	131	4,767.09	0.00
63	688602	康鹏科技	424	4,689.44	0.00
64	688719	爱科赛博	75	4,507.50	0.00

65	601096	宏盛华源	1,050	4,263.00	0.00
66	688646	逸飞激光	118	4,256.26	0.00
67	301529	福赛科技	104	3,939.52	0.00
68	688612	威迈斯	100	3,797.00	0.00
69	688450	光格科技	86	3,132.12	0.00
70	688657	浩辰软件	40	3,129.20	0.00
71	601083	锦江航运	270	2,988.90	0.00
72	603273	天元智能	152	2,883.44	0.00
73	603270	金帝股份	96	2,839.68	0.00
74	603004	鼎龙科技	82	2,557.58	0.00
75	603373	安邦护卫	73	2,536.75	0.00
76	603119	浙江荣泰	104	2,482.48	0.00
77	603275	众辰科技	57	2,262.90	0.00
78	603107	上海汽配	108	1,964.52	0.00
79	603276	恒兴新材	77	1,915.76	0.00
80	603193	润本股份	112	1,865.92	0.00
81	603062	麦加芯彩	30	1,734.30	0.00
82	603075	热威股份	70	1,631.70	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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000539	粤电力 A	19,625,131.65	8.68
2	601333	广深铁路	17,992,579.00	7.96
3	000543	皖能电力	17,587,125.34	7.78
4	600011	华能国际	16,720,343.00	7.40
5	000928	中钢国际	15,110,270.35	6.69
6	600027	华电国际	13,410,540.03	5.93
7	300308	中际旭创	12,421,634.00	5.50
8	000690	宝新能源	12,220,357.00	5.41
9	600642	申能股份	11,388,577.00	5.04
10	601598	中国外运	10,757,035.00	4.76
11	601668	中国建筑	10,729,234.00	4.75
12	600970	中材国际	10,597,483.74	4.69
13	601991	大唐发电	10,418,202.00	4.61
14	002025	航天电器	9,975,662.00	4.41
15	301339	通行宝	9,926,934.00	4.39
16	300502	新易盛	9,724,300.00	4.30
17	601186	中国铁建	9,552,193.00	4.23

18	002149	西部材料	9,472,072.00	4.19
19	601390	中国中铁	9,429,666.00	4.17
20	06049	保利物业	9,011,627.97	3.99
21	600383	金地集团	8,732,026.00	3.86
22	00123	越秀地产	7,650,558.98	3.39
23	00836	华润电力	7,631,952.55	3.38
24	000777	中核科技	7,442,882.36	3.29
25	688382	益方生物	7,431,775.49	3.29
26	600325	华发股份	7,260,414.00	3.21
27	601155	新城控股	7,167,727.00	3.17
28	00119	保利置业集团	7,165,493.72	3.17
29	02669	中海物业	6,737,348.74	2.98
30	000977	浪潮信息	6,514,843.00	2.88
31	600820	隧道股份	6,193,988.00	2.74
32	00902	华能国际电力 股份	6,121,591.55	2.71
33	01071	华电国际电力 股份	5,918,709.74	2.62
34	601995	中金公司	5,588,030.00	2.47
35	000733	振华科技	5,372,070.00	2.38
36	000002	万科 A	5,228,465.00	2.31
37	600023	浙能电力	5,210,326.00	2.31
38	002517	恺英网络	4,957,454.00	2.19
39	688369	致远互联	4,815,859.37	2.13
40	002555	三七互娱	4,783,590.62	2.12
41	688498	源杰科技	4,767,165.31	2.11
42	600582	天地科技	4,734,308.00	2.09
43	02380	中国电力	4,708,848.98	2.08
44	003031	中瓷电子	4,640,021.00	2.05

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	001979	招商蛇口	19,815,636.61	8.77
2	600383	金地集团	18,991,707.00	8.40
3	000539	粤电力 A	18,290,534.50	8.09
4	600048	保利发展	17,969,480.00	7.95
5	603833	欧派家居	15,047,206.00	6.66
6	603816	顾家家居	12,911,916.90	5.71
7	000928	中钢国际	12,908,296.68	5.71

8	000690	宝新能源	12,503,491.00	5.53
9	601598	中国外运	12,305,121.00	5.44
10	300308	中际旭创	12,280,868.00	5.43
11	601333	广深铁路	11,518,607.00	5.10
12	600309	万华化学	11,132,920.00	4.93
13	000002	万科 A	10,829,907.00	4.79
14	000001	平安银行	10,350,382.00	4.58
15	002025	航天电器	10,253,870.00	4.54
16	002572	索菲亚	10,070,709.00	4.46
17	600036	招商银行	9,853,416.32	4.36
18	601668	中国建筑	9,756,625.00	4.32
19	002149	西部材料	9,654,875.00	4.27
20	301339	通行宝	9,637,725.00	4.26
21	601318	中国平安	8,263,345.00	3.66
22	000543	皖能电力	8,185,496.00	3.62
23	601186	中国铁建	8,170,294.00	3.62
24	601390	中国中铁	8,045,710.00	3.56
25	300502	新易盛	7,967,460.60	3.53
26	02669	中海物业	7,880,657.04	3.49
27	00123	越秀地产	7,855,113.37	3.48
28	601991	大唐发电	7,800,115.00	3.45
29	00688	中国海外发展	7,599,473.58	3.36
30	600325	华发股份	7,164,269.00	3.17
31	600376	首开股份	7,101,143.58	3.14
32	688382	益方生物	6,761,319.29	2.99
33	00836	华润电力	6,728,105.51	2.98
34	000069	华侨城 A	6,652,444.00	2.94
35	000977	浪潮信息	6,447,294.54	2.85
36	03900	绿城中国	6,327,725.93	2.80
37	000063	中兴通讯	6,092,114.70	2.70
38	600820	隧道股份	6,071,690.00	2.69
39	600023	浙能电力	6,025,340.00	2.67
40	600642	申能股份	6,015,761.00	2.66
41	600970	中材国际	5,987,692.00	2.65
42	601995	中金公司	5,621,107.00	2.49
43	02202	万科企业	5,591,351.86	2.47
44	600011	华能国际	5,524,841.36	2.44
45	000733	振华科技	5,332,175.00	2.36
46	601166	兴业银行	5,187,950.00	2.30
47	688668	鼎通科技	5,045,237.30	2.23
48	003031	中瓷电子	4,953,163.00	2.19

49	000938	紫光股份	4,896,335.00	2.17
50	688369	致远互联	4,806,627.83	2.13
51	688239	航宇科技	4,656,608.57	2.06
52	688111	金山办公	4,606,740.29	2.04
53	02380	中国电力	4,545,037.06	2.01
54	002517	恺英网络	4,530,029.00	2.00

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	642,652,098.61
卖出股票收入（成交）总额	688,094,844.64

注：买入股票成本总额、卖出股票收入总额均按买卖成交金额（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	8,665,146.85	5.62
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	8,665,146.85	5.62

#### 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	019694	23 国债 01	85,000	8,665,146.85	5.62

#### 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 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

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 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	73,485.17
2	应收清算款	-
3	应收股利	42,283.86
4	应收利息	-
5	应收申购款	980.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	116,749.67

### 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

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
6,312	32,456.20	0.00	0.0000%	204,863,513.76	100.0000%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,331,741.58	1.14%

### 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年11月09日）基金份额总额	263,933,730.40
本报告期期初基金份额总额	259,240,004.19
本报告期基金总申购份额	2,839,250.83
减：本报告期基金总赎回份额	57,215,741.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	204,863,513.76

## § 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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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，未发生显著的改变。

### 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 35,000.00 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 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，未发生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	
国投证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	84,607,758.85	6.38%	61,200.34	6.39%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	298,240,572.99	22.50%	215,941.48	22.53%	-

华创证券	2	446,804,741.75	33.71%	320,593.20	33.45%	-
上海证券	2	194,889,214.41	14.70%	141,572.76	14.77%	-
野村东方 国际证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	109,396,695.27	8.25%	78,718.22	8.21%	-
中信证券	2	191,582,283.66	14.45%	140,348.93	14.64%	-

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
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	53,159,000.00	85.96%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	8,679,000.00	14.04%	-	-	-	-
华创证券	8,484,189.99	100.00%	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	永赢基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的声明	中国证监会规定媒介	2023年01月12日
2	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年01月20日
3	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(2023年第1号)	中国证监会规定媒介	2023年03月08日

4	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新(2023年第1号)	中国证监会规定媒介	2023年03月08日
5	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2023年03月08日
6	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023年03月30日
7	永赢基金管理有限公司关于广州分公司办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
8	永赢基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息信息的公告	中国证监会规定媒介	2023年04月08日
9	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年04月21日
10	永赢基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为永赢基金旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023年05月22日
11	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(2023年第2号)	中国证监会规定媒介	2023年05月31日
12	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新(2023年第2号)	中国证监会规定媒介	2023年05月31日
13	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年07月20日
14	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新(2023年第3号)	中国证监会规定媒介	2023年07月22日
15	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(2023年第3号)	中国证监会规定媒介	2023年07月22日
16	永赢基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2023年07月22日
17	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2023年07月22日
18	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2023年07月22日
19	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会规定媒介	2023年08月30日
20	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2023年10月12日
21	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书(2023年第4号)	中国证监会规定媒介	2023年10月12日
22	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资	中国证监会规定媒介	2023年10月12日

	基金基金产品资料概要更新(2023 年第 4 号)		日
23	永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 10 月 25 日

## § 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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. 中国证监会准予永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢惠添盈一年持有期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 号二十一世纪大厦 21、22、23、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](http://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  
2024 年 03 月 27 日