

# 永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 28 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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30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	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.8 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	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 中期财务会计报告(未经审计)	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	22
6.4 报表附注	23
§7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
7.3 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	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
7.6 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	61
7.7 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
7.8 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
7.9 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	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64

8.3 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
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
10.2 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
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
11.1 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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	永赢稳健增长一年持有混合	
基金主代码	009932	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年08月11日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,496,177,411.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢稳健增长一年持有混合A	永赢稳健增长一年持有混合E
下属分级基金的交易代码	009932	012442
报告期末下属分级基金的份额总额	1,400,214,313.09份	1,095,963,098.16份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格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>本基金将通过宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策及资本市场资金环境的研究，综合运用大类配置策略、股票精选策略、固定收益投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略等多种投资策略，力求控制风险并实现基金资产的增值保值。</p> <p>1、大类资产配置策略</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、固定收益类等大类资产的配置。</p> <p>2、股票投资策略</p>

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。

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

本基金通过综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，实施积极主动的组合以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。

本基金主动投资信用债的评级须在AA（含AA）以上，除短期融资券、超短期融资券以外的信用债采用债项评级，短期融资券、超短期融资券采用主体评级。其中评级为AA的信用债占基金资产净值比例不超过30%，评级为AA+的信用债占基金资产净值比例不超过60%，评级为AAA的信用债不低于基金资产净值的20%，基金持有信用债券期间，如果其评级下降、基金规模变动、变现信用债支付赎回款项等使得投资比例不再符合上述约定，应在评级报告发布之日或不再符合上述约定之日起3个月内调整至符合约定。本基金对信用债券评级的认定参照基金管理人选定的评级机构出具的债券信用评级。所指信用债券包括金融债（不包括政策性金融债）、企业债、公司债、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债券等。

### 4、可转换债券、可交换债券投资策略

本基金在综合分析可转换债券、可交换债券的股性特征、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。

#### 8、证券公司短期公司债券投资策略

本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。

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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*15%+中债-综合指数（全价）收益率*85%
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，但低于股票型基金。

### 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	交通银行股份有限公司
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	95559
传真	021-51690177	021-62701216
注册地址	浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	马宇晖	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	永赢稳健增长一年持有混合 A	永赢稳健增长一年持有混合 E
本期已实现收益	94,455,241.87	741,317.59
本期利润	119,211,827.12	10,693,313.34
加权平均基金份额本期利润	0.0900	0.0460
本期加权平均净值利润率	8.11%	4.05%
本期基金份额净值增长率	8.63%	1.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	137,193,452.97	147,627,525.25
期末可供分配基金份额利润	0.0980	0.1347
期末基金资产净值	1,601,326,305.24	1,253,137,121.41
期末基金份额净值	1.1436	1.1434
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	14.36%	1.83%

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、自2021年5月24日起，永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金增设E类份额类别，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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

永赢稳健增长一年持有混合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
过去一个月	0.73%	0.22%	-0.33%	0.13%	1.06%	0.09%
过去三个月	4.10%	0.28%	0.93%	0.15%	3.17%	0.13%
过去六个月	8.63%	0.43%	0.72%	0.20%	7.91%	0.23%
自基金合同生效起至今	14.36%	0.35%	2.17%	0.19%	12.19%	0.16%

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\*15%+中债-综合指数(全价)收益率\*85%。

永赢稳健增长一年持有混合E

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
过去一个月	0.70%	0.22%	-0.33%	0.13%	1.03%	0.09%
自基金合同生效起至今	1.83%	0.27%	0.22%	0.15%	1.61%	0.12%

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\*15%+中债-综合指数(全价)收益率\*85%；

3、永赢稳健增长一年持有混合 E 类份额合同生效日为 2021 年 5 月 24 日。

### 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

永赢稳健增长一年持有混合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  
(2020年08月11日-2021年06月30日)



- 注：1、本基金合同生效日为 2020 年 8 月 11 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约定。

永赢稳健增长一年持有混合E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年05月24日-2021年06月30日)



注：本基金自 2021 年 5 月 24 日增设 E 类基金份额，截至本报告期末，本类基金份额生效未满 1 年。

## § 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2021年6月30日，本基金管理人共管理78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、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、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、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。

#### 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		
常远	基金经理	2020-08-11	-	10	常远先生，同济大学理学博士，10年证券相关从业经验。曾任易方达基金管理有限公司权益投资部基金经理，现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。
乔嘉麒	基金经理	2020-08-24	-	12	乔嘉麒先生，复旦大学经济学学士、硕士，12年证券相关从业经验。曾任宁波银行金融市场部固定收益交易员，从事债券及固定收益衍生品自营交易、自营投资管理、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。

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行业协会《证券业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、《永赢稳健增长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 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

上半年经济数据受基数效应驱动，同比增速前高后低，但剔除基数效应后，经济表现恰好相反，一季度受就地过年等影响，第三产业产值有明显回落，经济2年复合增速5%左右，二季度经济各产业均全面好转，2年复合增速回弹至5.5%。结构上，出口、生产和投资都比较旺盛，消费、服务业虽有复苏，但速度较慢，经济呈现出结构性失衡。

这种失衡也体现在物价上，工业品价格不断攀升，迭创新高，PPI同比上探9%，显著超过前一轮周期高点且并没呈现出明显的回落迹象；与之相对应，随着猪瘟影响的消退，猪肉为代表的农产品价格受供需两方面影响，显著回落，CPI上行但幅度偏弱，核心CPI则依然位于1%以下，核心消费动能回弹较慢。

政策方面，上半年货币政策保持了常态化的OMO投放和等量MLF续作，政策态度中性偏呵护；财政行为则明显后置，债券供给速度持续慢于市场预期，利率资产供应偏少，供需对比偏向于欠配。

市场方面，以春节为节点，春节前经历前一年末的显著下行后，市场担忧央行投放不足，有一波快速调整；春节后在持续宽松的资金推动下，利率缓慢震荡走低，10年期国债收益率从高点到半年末下行约20BP。

信用债市场方面，因央行维持相对宽松的流动性，上半年信用债总体表现较好。一级发行方面，1-6月发行金额在高基数的情况下，实现了3%左右的同比增长，同期净融

资也达到1.2万亿的较高水平，此前市场担心的到期高峰基本平稳度过。二级市场方面，在利率债总体区间震荡的背景下，信用债因其稳定的票息优势受到机构追捧，中高等级品种收益率下行幅度相对较大，利差压缩至历史较低水平。但是也出现了明显的信用分层情况：一方面，去年底永煤事件导致了市场对于国企信用资质进行重新定价，特别是周期类企业在本轮重定价过程中遭受巨大冲击，利差水平大幅上行，一级市场融资也明显遇阻；另一方面，年初华夏幸福超预期违约对市场产生了巨大影响，各机构普遍收缩风险偏好，进一步给弱资质企业造成较大打击，部分民营企业以及弱地区城投均出现了债券价格大幅下跌。面对一些国企出现的融资困难，山西、天津等地纷纷召开“恳谈会”，对于“逃废债”行为进行了彻底否定，同时试图对国企信用进行重塑，总体而言获得了一定效果，但融资情况距离正常水平仍有差距。

一季度，本基金配置短期限的中高等级城投债、产业债及利率债，较去年年末，一季度末组合久期有所下降，产品杠杆变化不大。二季度，本基金配置3年内的中高等级产业债和城投债，调整短利率债持仓，相较一季度末，二季度末产品杠杆下降，组合久期则有所上升。

2021年上半年A股市场跌宕起伏，从2月初的市场短期高点到3月末沪深300指数回调超过了13%、创业板指数回调约21%；而从3月末的市场底部到6月末，沪深300指数涨幅约6%、创业板指数上涨超过31%。这期间市场的剧烈涨跌和阶段性风格的极致变换让很多投资人措手不及，也让投资者们对于权益投资的风险有了更深的体会，重新确立了对于市场的敬畏。

从周期股的暴涨，到“抱团股”的崩塌；从新能源的狂飙猛进到医药股的剧烈震荡，2021年上半年市场在流动性预期变化、政策预期变化和疫情反复的交织作用下摇摆和闪烁，这其中有人狂喜也自然有人沮丧。如果缺乏完善的投资理念和稳定的投资框架，投资者不仅很难坚守自身的风格，更可能迷失在市场的极端情绪之中。但是在这变幻莫测的市场之中，始终不变的是我们对于中国经济长期发展趋势向好的信心以及我们从价值投资理念出发的投资方法，这使我们能够保持清醒的头脑，理性看待市场的表现。

永赢稳健增长一年持有混合基金在2021年初相对于其发行的时点，已经积累一定的安全垫（即一定的正收益），因此在上半年权益部分总体仓位保持在20%左右运作。得益于我们相对高效的选股策略，重仓股中为基金净值贡献超额收益（即期间涨幅超越基金净值涨幅）的股票比例较高；得益于我们一贯采取的均衡配置思路，在正收益获取和净值回撤控制这两个方面我们都取得了不错的效果。基金权益部分的正收益来源也较为广泛，在白酒、化工、钢铁、新能源、电子以及医药等各行业都有个股正收益贡献。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢稳健增长一年持有混合A基金份额净值为1.1436元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.63%，同期业绩比较基准收益率为0.72%；截至报告期末永

赢稳健增长一年持有混合E基金份额净值为1.1434元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.83%，同期业绩比较基准收益率为0.22%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望来看，6月的经济数据表明经济动能并没有明显的走弱，而且目前来看，工业生产、出口、投资都面临了供给干扰约束，需求动能并没有完全释放，下半年经济总体上可能处于一个平缓磨顶的状态，难以出现明显失速，核心还是消费等板块复苏状态能否持续。物价同比表现预计也将类似，陡峭向上的时期已过，但并不会快速下滑，而是震荡磨顶状态。

市场的核心纠结点还是政策的反应模式，7月前半期的降准打乱了政策中性预期，情绪上朝着宽松开启的方向演化，但宏观背景实际上依然支持的是一个中性资金面，这种背景下预期过度发散、债券供给后置都是潜在的风险点。但需要注意的是，决策层反复强调“跨周期调节”，强调应对可能的周期下滑风险，且2022年各项常用的周期指示指标面临趋势下滑，要谨防政策框架变迁导致的利率拐点前置，因而以配置思路来看，可以更为积极。

信用债市场方面，资产荒逻辑下中高等级信用债将持续成为机构配置首选，利差水平有望持续保持在低位，但也容易受到无风险收益率波动影响，票息策略有效性较上半年有所下降。降准后相对宽松的流动性环境有利于弱资质主体融资恢复，但利差的实质性修复需要看到一级发行的明显恢复，预计仍将是缓慢的过程。总体看，下半年将重点关注中高等级品种波段交易带来的资本利得，同时在部分行业进行适度短久期信用挖掘，在防范风险的前提下追求一定票息收益。

未来一段时间，在全球后疫情时代逐步到来、经济逐步复苏和流动性尚处于宽松状态的背景下，我们对于权益市场的观点保持一定的乐观。从结构上来说，永赢稳健增长一年持有混合基金将持续关注大消费、医药健康领域；深度挖掘在碳中和政策下可能获得持续和显著发展红利的新能源、节能减排、高碳排放行业的供给侧约束以及其他相关的能源和技术领域的机会；仔细寻找具备战略性提升国内产业供应链自主安全的半导体、新材料等领域的机会；还会继续在相对传统的农业、化工、制造业中寻找格局优化和竞争力显著提升的优质公司。扎实的研究基本功和广阔的投资视角是我们能够坚持多维度选股和均衡配置策略的基础，我们未来还会将最主要的精力放在夯实和有序扩展投资能力圈的工作上。

永赢稳健增长一年持有混合基金成立的时间已满一年，希望首批持有人能够对投资业绩感到满意。未来我们将会一如既往的坚持我们的投资策略和方法，牢固控制风险和争取收益的双指标平衡考察标准，争取为投资者逐步积累收益。应该说资产管理行业是一个前途广阔但是又充满挑战的行业，无论是投资回报还是投资方法都是需要时间的积

累与检验的，我们期待和更多的持有人长期相伴、共同成长。能够服务于更多的人，让更多的人人在权益市场上感受到财富的获得感和幸福感是我们的长期愿景。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，基金托管人在永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，永赢基金管理有限公司在永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由永赢基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,123,132.95	3,150,737.07
结算备付金		8,218,787.62	11,250,747.57
存出保证金		190,611.50	165,818.89
交易性金融资产	6.4.7.2	2,320,569,881.67	1,406,363,144.98
其中：股票投资		484,001,293.17	326,367,144.98
基金投资		-	-
债券投资		1,836,568,588.50	1,079,996,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	393,645,870.47	-
应收证券清算款		720,964.91	-
应收利息	6.4.7.5	22,031,824.63	15,772,555.66
应收股利		-	-
应收申购款		107,409,174.48	52,170.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,855,910,248.23	1,436,755,174.55

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	100,000,000.00
应付证券清算款		-	70,273.98
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		626,317.46	444,670.04
应付托管费		78,289.69	55,583.75
应付销售服务费		110,004.70	-
应付交易费用	6.4.7.7	407,793.19	302,693.34
应交税费		120,278.19	108,851.17
应付利息		-	-31,931.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	104,138.35	170,000.00
负债合计		1,446,821.58	101,120,140.78
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,496,177,411.25	1,268,755,411.70
未分配利润	6.4.7.10	358,286,015.40	66,879,622.07
所有者权益合计		2,854,463,426.65	1,335,635,033.77
负债和所有者权益总计		2,855,910,248.23	1,436,755,174.55

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.1435元，基金份额总额2,496,177,411.25份，其中A类基金份额净值1.1436元，份额总额1,400,214,313.09份；E类基金份额净值1.1434元，份额总额1,095,963,098.16份。

## 6.2 利润表

会计主体：永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年0 6月30日
<b>一、收入</b>		136,219,816.07
1. 利息收入		23,111,120.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	142,250.02
债券利息收入		22,739,021.34
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		229,849.29
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		78,400,114.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	75,433,939.48
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,334,542.74
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	5,300,717.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	34,708,581.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		6,314,675.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,024,181.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	378,022.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	110,009.62
4. 交易费用	6.4.7.19	1,498,592.80
5. 利息支出		1,104,474.03
其中：卖出回购金融资产支出		1,104,474.03

6. 税金及附加		77,076.41
7. 其他费用	6.4.7.20	122,318.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		129,905,140.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		129,905,140.46

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30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）	1,268,755,411.70	66,879,622.07	1,335,635,033.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	129,905,140.46	129,905,140.46
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）	1,227,421,999.55	161,501,252.87	1,388,923,252.42
其中：1. 基金申购款	1,227,421,999.55	161,501,252.87	1,388,923,252.42
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	2,496,177,411.25	358,286,015.40	2,854,463,426.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

永赢稳健增长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〔2020〕1506号《关于准予永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由永赢基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于2020年8月11日生效，首次设立募集规模为1,247,349,276.80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和注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据基金管理人于2021年5月22日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金增设E类基金份额并修改基金合同及托管协议部分条款的公告》，自2021年5月24日起，对永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金在现有份额的基础上增设E类基金份额，原基金份额转为A类基金份额。

在投资者申购时收取申购费用、而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、在投资人申购时不收取申购费用的基金份额，称为E类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和E类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。除非基金管理人另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或准予注册上市的股票、存托凭证）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、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、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债券等）、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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-30%，本基金投资同业存单的比例不得超过基金资产的20%。每个交易日日终，在扣除股指期货、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\*15%+中债-综合指数（全价）收益率\*85%。

#### 6.4.2 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（以下合称“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3号《半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。

#### 6.4.3 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2021年6月30日的财务状况以及自2021年1月1日起至2021年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 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。

#### 6.4.6.2 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。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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。

#### 6.4.6.5 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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
----	--------------------

活期存款	3,123,132.95
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	3,123,132.95

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	413,243,760.89	484,001,293.17	70,757,532.28	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	411,392,344.94	408,080,588.50	-3,311,756.44
	银行间市场	1,427,079,445.80	1,428,488,000.00	1,408,554.20
	合计	1,838,471,790.74	1,836,568,588.50	-1,903,202.24
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,251,715,551.63	2,320,569,881.67	68,854,330.04	

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	393,645,870.47	-
合计	393,645,870.47	-

#### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	5,471.65
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	3,698.40
应收债券利息	21,882,051.32
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	140,517.46
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	85.80
合计	22,031,824.63

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	396,988.26
银行间市场应付交易费用	10,804.93
合计	407,793.19

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30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	-
预提费用	104,138.35
合计	104,138.35

## 6.4.7.9 实收基金

## 6.4.7.9.1 永赢稳健增长一年持有混合A

金额单位：人民币元

项目 (永赢稳健增长一年持有混合 A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,268,755,411.70	1,268,755,411.70
本期申购	131,458,901.39	131,458,901.39
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,400,214,313.09	1,400,214,313.09

## 6.4.7.9.2 永赢稳健增长一年持有混合E

金额单位：人民币元

项目 (永赢稳健增长一年持有混合 E)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	-	-
本期申购	1,095,963,098.16	1,095,963,098.16
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,095,963,098.16	1,095,963,098.16

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）根据基金管理人于2021年5月22日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金增设E类基金份额并修改基金合同及托管协议部分条款的公告》，自2021年5月24日起，对本基金在现有份额的基础上增设E类基金份额，原基金份额转为A类基金份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 永赢稳健增长一年持有混合A

单位：人民币元

项目 (永赢稳健增长一年持有混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,412,052.58	34,467,569.49	66,879,622.07
本期利润	94,455,241.87	24,756,585.25	119,211,827.12
本期基金份额交易产生的变动数	10,326,158.52	4,694,384.44	15,020,542.96
其中：基金申购款	10,326,158.52	4,694,384.44	15,020,542.96
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	137,193,452.97	63,918,539.18	201,111,992.15

##### 6.4.7.10.2 永赢稳健增长一年持有混合E

单位：人民币元

项目 (永赢稳健增长一年持有混合E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	741,317.59	9,951,995.75	10,693,313.34

本期基金份额交易产生的变动数	146,886,207.66	-405,497.75	146,480,709.91
其中：基金申购款	146,886,207.66	-405,497.75	146,480,709.91
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	147,627,525.25	9,546,498.00	157,174,023.25

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
活期存款利息收入	51,320.93	
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	89,281.82	
其他	1,647.27	
合计	142,250.02	

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
卖出股票成交总额	546,171,651.37	
减：卖出股票成本总额	470,737,711.89	
买卖股票差价收入	75,433,939.48	

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
债券投资收益——买卖债券（、债转	-2,334,542.74	

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	-2,334,542.74

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	593,139,123.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	582,419,242.74
减：应收利息总额	13,054,423.55
买卖债券差价收入	-2,334,542.74

#### 6.4.7.13.3 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。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 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。

##### 6.4.7.14.2 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。

##### 6.4.7.14.3 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。

##### 6.4.7.14.4 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。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 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。

**6.4.7.15.2 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。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,300,717.68
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	5,300,717.68

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	34,708,581.00
——股票投资	31,093,468.58
——债券投资	3,615,112.42
——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	34,708,581.00
----	---------------

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	1,489,542.80
银行间市场交易费用	9,050.00
合计	1,498,592.80

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	17,580.00
其他	600.00
合计	122,318.35

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内本公司不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构、基金注册登记机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 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。

###### 6.4.10.1.4 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债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,024,181.67
其中：支付销售机构的客户维护费	1,216,059.39

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.40%的年费率计提。计算方法如下：

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

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	378,022.73

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.10.2.3 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		
	2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢稳健增长一年持有混合 A	永赢稳健增长一年持有混合 E	合计
永赢基金	0.00	3.96	3.96
宁波银行	0.00	109,930.20	109,930.20
合计	0.00	109,934.16	109,934.16

注：自2021年5月24日起，本基金增加收取销售服务费的E类份额。本基金A类基金份额不收取销售服务费，E类基金份额的销售服务费年费率为0.40%，销售服务费按前一日E类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{E类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H为E类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为E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。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,123,132.95	51,320.93

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股限售	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688317	之江生物	2021-01-08	2021-07-19	新股限售	43.22	63.82	5,740	248,082.80	366,326.80	-
688161	威高骨科	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
688665	四方光电	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688269	凯立新材	2021-06-01	2021-12-09	新股限售	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-

688456	有研粉材	2021-03-10	2021-09-17	新股限售	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	认购新发证券	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688070	纵横股份	2021-02-02	2021-08-10	新股限售	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	新股限售	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688355	明志科技	2021-04-30	2021-11-12	新股限售	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	认购新发证券	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2022-01-05	新股限售	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	认购新发证券	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-

3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2021 -07- 06	认购 新发 证券	10.6 4	10.6 4	3,789	40,3 14.9 6	40,3 14.9 6	-
6885 97	煜邦 电力	2021 -06- 09	2021 -12- 17	新股 限售	5.88	10.1 6	3,907	22,9 73.1 6	39,6 95.1 2	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2021 -07- 06	认购 新发 证券	9.46	9.46	2,609	24,6 81.1 4	24,6 81.1 4	-
3009 53	震裕 科技	2021 -03- 11	2021 -09- 22	新股 限售	28.7 7	99.8 5	240	6,90 4.80	23,9 64.0 0	-
3010 09	可靠 股份	2021 -06- 08	2021 -12- 17	新股 限售	12.5 4	27.8 9	801	10,0 44.5 4	22,3 39.8 9	-
3009 41	创识 科技	2021 -02- 02	2021 -08- 09	新股 限售	21.3 1	49.9 4	399	8,50 2.69	19,9 26.0 6	-
3010 15	百洋 医药	2021 -06- 22	2021 -12- 30	新股 限售	7.64	38.8 3	462	3,52 9.68	17,9 39.4 6	-
6882 26	威腾 电气	2021 -06- 28	2021 -07- 07	认购 新发 证券	6.42	6.42	2,693	17,2 89.0 6	17,2 89.0 6	-
3009 32	三友 联众	2021 -01- 15	2021 -07- 22	新股 限售	24.6 9	31.7 1	492	12,1 47.4 8	15,6 01.3 2	-
3009 82	苏文 电能	2021 -04- 19	2021 -10- 27	新股 限售	15.8 3	45.2 9	317	5,01 8.11	14,3 56.9 3	-
3009 40	南极 光	2021 -01- 27	2021 -08- 03	新股 限售	12.7 6	43.3 8	307	3,91 7.32	13,3 17.6 6	-

300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股限售	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	认购新发证券	31.56	31.56	349	11,014.4	11,014.4	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	认购新发证券	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股限售	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股限售	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股限售	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-

300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

3010 12	扬电 科技	2021 -06- 15	2021 -12- 22	新股 限售	8.05	24.2 6	170	1,36 8.50	4,12 4.20	-
3009 92	泰福 泵业	2021 -05- 17	2021 -11- 25	新股 限售	9.36	20.3 2	200	1,87 2.00	4,06 4.00	-
3010 10	晶雪 节能	2021 -06- 09	2021 -12- 20	新股 限售	7.83	17.6 1	218	1,70 6.94	3,83 8.98	-
3009 48	冠中 生态	2021 -06- 04	2021 -08- 25	新股 限售 -送 股	-	27.4 2	108	-	2,96 1.36	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	新股 限售	9.46	9.46	290	2,74 3.40	2,74 3.40	-

注：（1）以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准；

（2）本基金持有的限售股冠中生态，于2021年6月4日实施2020年年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每10股转增5股，因转增所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致。

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30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。

#### 6.4.12.4 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

##### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.2.1 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日

A-1	210,524,000.00	109,712,000.00
A-1以下	-	-
未评级	630,806,000.00	350,263,000.00
合计	841,330,000.00	459,975,000.00

注：国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级。

#### 6.4.13.2.2 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。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	49,230,000.00	-
合计	49,230,000.00	-

注：上年度末，本基金未持有短期同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	472,938,588.50	357,799,000.00
AAA以下	252,236,000.00	262,222,000.00
未评级	220,834,000.00	-
合计	946,008,588.50	620,021,000.00

注：国债或政策性金融债列示为未评级。

#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 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。

### 6.4.13.3 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每日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。

#### 6.4.13.3.1 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在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6.4.12 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。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 06月30 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	3,123,132.95	-	-	-	-	-	3,123,132.95
结算备付金	8,218,787.62	-	-	-	-	-	8,218,787.62
存出保证金	190,611.50	-	-	-	-	-	190,611.50
交易性金融资产	170,299,000.00	356,558,000.00	848,205,200.00	460,750,000.00	756,388.50	484,001,293.17	2,320,569,881.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	393,645,870.47	-	-	-	-	-	393,645,870.47
应收证券清算款	-	-	-	-	-	720,964.91	720,964.91
应收利息	-	-	-	-	-	22,031,824.63	22,031,824.63
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	107,409,174.48	107,409,174.48
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	575,477,402.54	356,558,000.00	848,205,200.00	460,750,000.00	756,388.50	614,163,257.19	2,855,910,248.23
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	-	-	-	-	-	-	-

永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金 2021 年中期报告

应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	626,317.46	626,317.46
应付托管费	-	-	-	-	-	78,289.69	78,289.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	110,004.70	110,004.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	407,793.19	407,793.19
应付税费	-	-	-	-	-	120,278.19	120,278.19
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	104,138.35	104,138.35
负债总计	-	-	-	-	-	1,446,821.58	1,446,821.58
利率敏感度缺口	575,477,402.54	356,558,000.00	848,205,200.00	460,750,000.00	756,388.50	612,716,435.61	2,854,463,426.65
上年度末 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	3,150,737.07	0.00	0.00	0.00	0.00	-	3,150,737.07
结算备付金	11,250,747.57	-	-	-	-	-	11,250,747.57
存出保证金	165,818.89	-	-	-	-	-	165,818.89
交易性金融资产	0.00	210,400,000.00	642,106,000.00	226,755,000.00	735,000.00	326,367,144.98	1,406,363,144.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利	-	-	-	-	-	15,772,555.6	15,772,555.66

## 永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金 2021 年中期报告

息						6	
应收股利	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	-	-	52,170.38	52,170.38
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	14,567,303.53	210,400,000.00	642,106,000.00	226,755,000.00	735,000.00	342,191,871.02	1,436,755,174.55
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	100,000,000.00	-	-	-	-	-	100,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	70,273.98	70,273.98
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	444,670.04	444,670.04
应付托管费	-	-	-	-	-	55,583.75	55,583.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	302,693.34	302,693.34
应付税费	-	-	-	-	-	108,851.17	108,851.17
应付利息	-	-	-	-	-	-31,931.50	-31,931.50
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	100,000,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,120,140.78	101,120,140.78
利率敏感度缺口	-85,432,696.47	210,400,000.00	642,106,000.00	226,755,000.00	735,000.00	341,071,730.24	1,335,635,033.77

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。

## 6.4.13.4.1.2 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-8,135,038.11	-3,685,089.02
	市场利率平行下降50个基点	8,135,038.11	3,685,089.02

## 6.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 6.4.13.4.3 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。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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	484,001,293.17	16.96	326,367,144.98	24.44
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	484,001,293.17	16.96	326,367,144.98	24.44

#### 6.4.13.4.3.2 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准增加1%	44,861,040.50	14,793,036.47
	业绩比较基准减少1%	-44,861,040.50	-14,793,036.47

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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

##### 6.4.14.1.1 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。

##### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30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476,860,250.84元，属于第二层次的余额为人民币1,836,109,836.29元，属于第三层次的余额为人民币7,599,794.54元。

##### 6.4.14.1.2.2 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。

#### 6.4.14.1.2.3 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变动情况如下：上年度末余额人民币3,119,837.96元，本期变动人民币4,479,956.58元，本期末人民币7,599,794.54元。

#### 6.4.14.2 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。

#### 6.4.14.3 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。

#### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2021年8月27日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	484,001,293.17	16.95
	其中：股票	484,001,293.17	16.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,836,568,588.50	64.31
	其中：债券	1,836,568,588.50	64.31
	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	393,645,870.47	13.78
	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	11,341,920.57	0.40
8	其他各项资产	130,352,575.52	4.56

9	合计	2,855,910,248.23	100.00
---	----	------------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	467,708,568.41	16.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.18
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	279,580.90	0.01
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	50,403.70	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	10,377,996.00	0.36
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	145,471.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	207,853.61	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	484,001,293.17	16.96

### 7.2.2 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。

## 7.3 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	601058	赛轮轮胎	15,831,686	158,158,543.14	5.54
2	688185	康希诺-U	42,123	32,762,005.71	1.15
3	603799	华友钴业	284,800	32,524,160.00	1.14
4	000568	泸州老窖	111,500	26,307,310.00	0.92
5	002318	久立特材	1,992,611	23,951,184.22	0.84
6	300316	晶盛机电	381,500	19,265,750.00	0.67
7	603583	捷昌驱动	324,600	16,431,252.00	0.58
8	000661	长春高新	37,000	14,319,000.00	0.50
9	002601	龙佰集团	388,000	13,417,040.00	0.47
10	600585	海螺水泥	320,500	13,156,525.00	0.46
11	600507	方大特钢	1,940,200	13,154,556.00	0.46
12	000333	美的集团	177,900	12,696,723.00	0.44
13	002311	海大集团	153,637	12,536,779.20	0.44
14	002460	赣锋锂业	96,200	11,648,858.00	0.41
15	002643	万润股份	654,900	11,644,122.00	0.41
16	000656	金科股份	1,792,400	10,377,996.00	0.36
17	002064	华峰化学	672,700	9,552,340.00	0.33
18	000301	东方盛虹	416,700	8,709,030.00	0.31
19	601636	旗滨集团	407,000	7,553,920.00	0.26
20	300636	同和药业	436,800	6,953,856.00	0.24
21	002507	涪陵榨菜	173,000	6,515,180.00	0.23
22	300861	美畅股份	74,600	6,289,526.00	0.22
23	000739	普洛药业	175,600	5,162,640.00	0.18
24	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.18
25	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.04
26	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.01
27	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.01

28	301009	可靠股份	8,007	265,037.97	0.01
29	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.01
30	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
31	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.01
32	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
33	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.01
34	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.01
35	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.01
36	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.01
37	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.01
38	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
39	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.00
40	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
41	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.00
42	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
43	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.00
44	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.00
45	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
46	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
47	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.00
48	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.00
49	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.00
50	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
51	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.00
52	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
53	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
54	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.00
55	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
56	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
57	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
58	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.00

59	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
60	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
61	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
62	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
63	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
64	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
65	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
66	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
67	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
68	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
69	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
70	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
71	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
72	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
73	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
74	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
75	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
76	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
77	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
78	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
79	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
80	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
81	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
82	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
83	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
84	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
85	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
86	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
87	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
88	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
89	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00

90	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
91	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
92	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
93	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
94	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
95	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
96	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
97	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
98	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
99	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
100	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
101	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
102	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
103	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
104	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
105	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
106	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	601058	赛轮轮胎	102,849,659.74	7.70
2	600507	方大特钢	33,999,332.17	2.55
3	603799	华友钴业	26,592,196.00	1.99
4	000568	泸州老窖	25,868,192.00	1.94
5	600585	海螺水泥	25,129,722.36	1.88
6	002318	久立特材	21,430,728.45	1.60
7	688185	康希诺-U	21,426,315.76	1.60
8	000656	金科股份	18,189,739.00	1.36

9	600031	三一重工	15,931,496.50	1.19
10	002460	赣锋锂业	15,675,750.56	1.17
11	603583	捷昌驱动	15,068,581.32	1.13
12	002466	天齐锂业	15,011,930.00	1.12
13	002984	森麒麟	14,916,970.00	1.12
14	000661	长春高新	14,746,749.00	1.10
15	000333	美的集团	14,454,760.00	1.08
16	002110	三钢闽光	14,429,844.00	1.08
17	002311	海大集团	11,702,273.10	0.88
18	002643	万润股份	10,374,676.00	0.78
19	601318	中国平安	10,163,997.04	0.76
20	600019	宝钢股份	10,146,861.26	0.76

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。

#### 7.4.2 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	600029	南方航空	33,471,113.40	2.51
2	002601	龙佰集团	28,729,036.00	2.15
3	000568	泸州老窖	28,440,818.00	2.13
4	600519	贵州茅台	27,135,429.00	2.03
5	002984	森麒麟	25,363,373.00	1.90
6	002714	牧原股份	23,154,132.76	1.73
7	000651	格力电器	21,694,742.00	1.62
8	002648	卫星石化	21,091,287.21	1.58
9	600507	方大特钢	18,976,366.00	1.42
10	002460	赣锋锂业	18,766,069.16	1.41
11	002110	三钢闽光	16,071,985.00	1.20
12	002318	久立特材	14,956,389.72	1.12
13	002466	天齐锂业	14,429,496.00	1.08

14	600031	三一重工	12,893,084.00	0.97
15	002128	露天煤业	12,056,681.00	0.90
16	002508	老板电器	11,639,188.67	0.87
17	002157	正邦科技	11,560,315.04	0.87
18	600019	宝钢股份	10,746,189.50	0.80
19	000858	五粮液	10,025,265.00	0.75
20	601318	中国平安	9,635,641.00	0.72

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。

#### 7.4.3 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	597,278,391.50
卖出股票收入（成交）总额	546,171,651.37

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。

#### 7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	270,799,000.00	9.49
	其中：政策性金融债	270,799,000.00	9.49
4	企业债券	421,569,200.00	14.77
5	企业短期融资券	791,365,000.00	27.72
6	中期票据	302,849,000.00	10.61
7	可转债(可交换债)	756,388.50	0.03
8	同业存单	49,230,000.00	1.72
9	其他	-	-
10	合计	1,836,568,588.50	64.34

#### 7.6 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	190207	19国开07	1,200,000	120,720,000.00	4.23
2	210202	21国开02	900,000	90,081,000.00	3.16
3	136593	16新华01	800,000	80,040,000.00	2.80
4	042000400	20中盐CP001	500,000	50,340,000.00	1.76
5	102101173	21申迪MTN001	500,000	50,025,000.00	1.75

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 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。

#### 7.11 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。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，基金投资的前十名证券的发行主体国家开发银行在报告编制日前一年受到行政处罚，处罚金额合计为4940万元。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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	190,611.50
2	应收证券清算款	720,964.91
3	应收股利	-
4	应收利息	22,031,824.63
5	应收申购款	107,409,174.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	130,352,575.52

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113044	大秦转债	756,388.50	0.03

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 稳健 增长 一年 持有 混合A	22,556	62,077.24	17,969,889.80	1.283 4%	1,382,244,423. 29	98.716 6%
永赢 稳健 增长 一年 持有 混合E	8,724	125,626.21	0.00	0.000 0%	1,095,963,098. 16	100.00 00%
合计	31,280	79,801.07	17,969,889.80	0.719 9%	2,478,207,521. 45	99.280 1%

## 8.2 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	永赢稳健增长一年 持有混合A	173,056.11	0.01%
	永赢稳健增长一年 持有混合E	9,775.99	0.00%
	合计	182,832.10	0.01%

## 8.3 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	永赢稳健增长一年持有混合A	0
	永赢稳健增长一年持有混合E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢稳健增长一年持有混合A	0
	永赢稳健增长一年持有混合E	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢稳健增长一年持有混合A	永赢稳健增长一年持有混合E
基金合同生效日(2020年08月11日)基金份额总额	1,247,349,276.80	-
本报告期期初基金份额总额	1,268,755,411.70	-
本报告期基金总申购份额	131,458,901.39	1,095,963,098.16
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,400,214,313.09	1,095,963,098.16

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 10.3 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。

#### 10.4 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。

#### 10.5 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。

#### 10.6 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，未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	61,138,744.78	5.41%	44,711.87	5.49%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	2,913,830.62	0.26%	2,130.39	0.26%	-

东北 证券	2	21,768,490.10	1.93%	15,483.92	1.90%	-
东方 财富	2	-	-	-	-	-
东方 证券	2	32,583,225.03	2.88%	23,372.53	2.87%	-
东吴 证券	2	55,915,752.49	4.95%	39,772.99	4.89%	-
东兴 证券	2	-	-	-	-	-
方正 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	218,372,643.83	19.33%	157,651.08	19.37%	-
国泰 君安 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	15,613,359.94	1.38%	11,231.13	1.38%	-
国元 证券	2	-	-	-	-	-
宏信 证券	2	218,189,426.88	19.31%	157,707.29	19.38%	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
华创 证券	2	-	-	-	-	-

华西证券	2	-	-	-	-	-
华菁证券	2	113,793,023.36	10.07%	81,896.22	10.06%	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	270,602,623.29	23.95%	194,132.57	23.86%	-
信达证券	2	3,146,844.84	0.28%	2,299.30	0.28%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	77,016,711.65	6.82%	55,570.80	6.83%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	38,890,615.05	3.44%	27,757.86	3.41%	-
中信证券	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。

### 10.7.2 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

				比例				
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	572,000,00 0.00	5.63%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	20,187,47 6.71	100.0 0%	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	2,516,000, 000.00	24.7 8%	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	49,000,00 0.00	0.48%	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	2,582,600, 000.00	25.4 3%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	1,025,000, 000.00	10.0 9%	-	-	-	-

申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	2,618,000, 000.00	25.7 8%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	55,500,00 0.00	0.55%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	737,171,00 0.00	7.26%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 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旗下部分基金开展网上直销平台认购、申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-06
2	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销平台认购、申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-07
3	永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-22
4	永赢基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-26
5	永赢基金管理有限公司关于新增甬兴证券有限公司为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	2021-01-29
6	永赢基金管理有限公司关于新增平安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	中国证监会规定媒介	2021-02-01

	的公告		
7	永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金恢复办理大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-02-27
8	永赢基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-06
9	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	2021-03-08
10	永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-27
11	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的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-31
12	永赢基金管理有限公司关于永赢稳健增长一年持有期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	2021-04-02
13	永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金2021年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
14	永赢基金管理有限公司关于永赢稳健增长一年持有期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	2021-04-22
15	永赢基金管理有限公司关于新增交通银行股份有限公司为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	2021-04-27
16	永赢基金管理有限公司关于新增腾安基金销售（深圳）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	2021-05-14
17	永赢基金管理有限公司关于永赢稳健增长一年持有期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	2021-05-21
18	永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金（A份额）基金产品资料	中国证监会规定媒介	2021-05-22

	概要更新(2021年1号)		
19	永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金(E份额)基金产品资料概要更新(2021年1号)	中国证监会规定媒介	2021-05-22
20	永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书(2021年第1号)	中国证监会规定媒介	2021-05-22
21	永赢稳健增长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	2021-05-22
22	永赢稳健增长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	2021-05-22
23	永赢基金管理有限公司关于永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金增设E类基金份额并修改基金合同及托管协议部分条款的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-22
24	永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金E类份额开放日常申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2021-05-22
25	永赢基金管理有限公司关于新增国信证券股份有限公司为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	2021-06-18

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢稳健增长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。

## 12.2 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

## 12.3 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  
二〇二一年八月二十八日