

永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金

2021 年年度报告

2021 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:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 26 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月24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2021年01月01日起至2021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	11
2.4 信息披露方式	12
2.5 其他相关资料	12
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	12
3.1 主要会计数据和财务指标	12
3.2 基金净值表现	13
3.3 过去三年基金的利润分配情况	15
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
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	22
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	22
§5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	23
§6 审计报告	23
6.1 审计报告基本信息	23
6.2 审计报告的基本内容	23
§7 年度财务报表	25
7.1 资产负债表	25
7.2 利润表	27
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	29
7.4 报表附注	31
§8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
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	78
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	78
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	78
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	79

8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	79
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12	投资组合报告附注	79
§9	基金份额持有人信息	80
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
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	80
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	80
§10	开放式基金份额变动	81
§11	重大事件揭示	81
11.1	基金份额持有人大会决议	81
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	81
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4	基金投资策略的改变	82
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	82
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	82
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.8	其他重大事件	83
§12	影响投资者决策的其他重要信息	86
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	86
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	87
§13	备查文件目录	87
13.1	备查文件目录	87
13.2	存放地点	87
13.3	查阅方式	87

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金
基金简称	永赢竞争力精选混合
基金主代码	009140
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2020年04月22日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	93,628,439.09份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金依托基金管理人的研究体系，精选中国上市的具有全球竞争力的优质企业，分享中国优势产业国际竞争力提升、国产化替代深化、海外市场拓展带来的投资机会，在严格控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳定增值。</p>
投资策略	<p>本基金依托基金管理人的研究体系，通过自上而下的大类资产配置和行业配置以及自下而上的个股选择相结合的方法，充分发挥投研团队的研究能力，从基本面出发，深入分析挖掘中国优质企业。本基金主要投资于具有“竞争力”的上市公司，具体而言，通过投资研究人员分工与合作，运用研究力量，实现投研联动，落实投资过程：首先对于经济、政策、周期等宏观要素进行分析，自上而下预判后续宏观走势，结合投资风险收益的相对比较，给出投资策略和行业配置建议；其次，行业研究员从中微观出发，自下而上选择受益于市场份额、定价权、核心竞争力提升的行业，佐证行业配置，提供行业配置策略及个股投资建议。然后，行业研究员从微观出发，寻找具有资源优势、技术优势、规模优势、品牌优势、管理优势、国际优势和股东优势等竞争力优势的企业，精心选择具</p>

有全球竞争力的个股，力争为投资者创造长期稳健回报。

1、资产配置策略

大类资产配置策略方面，本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

2、股票投资策略

本基金主要投资于具有全球竞争力的国内优秀企业，将结合宏观经济环境、政策形势、行业基本面及上市公司的核心资产的估值水平，综合分析证券市场的走势，主动判断市场时机，通过稳健的资产配置，合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。

我国产业也在经历从量变到质变的阶段，全球竞争力不断提升，在各领域出现了能够参与全球竞争的龙头公司，基金管理人将结合以下投资逻辑发掘相关领域的投资机会：

第一，大国重器，占据技术制高点、竞争力提升的全球扩张型高端产业：在通信、电子、电力设备和高端装备等国家战略领域，国内企业通过多年技术研发，打破了国外产品在某些高端产品领域的垄断，产品升级不断进行，不仅实现了国产化替代，还形成了自有核心技术和品牌影响力，参与国际行业规则制定，引领技术发展方向，具备向海外市场进军、参与全球竞争的实力。

第二，掌握定价权的成熟产业：在食品饮料、家电、汽车等行业中，市场集中度逐步提升，龙头企业到了可以掌握定价权的阶段。部分产品的市场趋于寡头垄断，国内龙头企业享有较高市占率，凭借国内逐步建立的渠道、品牌优势，具有一定的定价权，未来

盈利能力将随着产品价格和市占率双重提升。

第三，自主可控，产业链深度国产化的战略性基础产业：我国的产业不断在升级，产业布局经历了从轻工业到重工业，再向半导体、信息产业逐步进化。同时，垂直产业链的价值分配也在纵向拓展，制造业逐步向产业链微笑曲线的两端推进，掌握具有高附加值的原材料和核心零部件，脱离附加值较低的机加工领域，国产化进程从组装、机加工，深化到核心零部件以及核心原材料。在半导体、计算机、机械设备、新材料、汽车零部件、消费电子等领域，部分优秀企业已经逐步掌握了核心工艺和原材料的生产能力，受制于人的局面逐步缓解，产业的基本功在提升，产业链的积蓄可以达到参与全球竞争的水平。

第四，弯道超车的新兴产业：在全球互联网信息化、能源清洁化等大趋势下，我国吸纳了全球技术突破带来的红利，直接在新兴产业中应用最前沿的技术，在全球竞争中把握了历史机遇。中国在产业全球化转移的过程中，在智能制造、新能源汽车、机器人、消费电子等新兴行业，跃升为最大消费国、最高增速国，并逐步具备完整产业链，是诞生全球巨头的最佳土壤。

第五，穿越周期剩者为王：经过多年的经济周期的洗礼，以及供给侧改革对过剩产能的淘汰，社会实际保有量开始出清，部分行业已经出现底部。在部分周期性行业中，周期底部行业整合加剧，较少行政干预，由市场化竞争淘汰过剩产能，产能出清较为彻底。在这些行业中，基金管理人重点关注在跨越周期的时间长度内，实现了产品系列的拓展、市场份额扩大等有机成长的行业龙头企业，会结合宏观分析判断周期节奏进行配置。

（1）行业精选与配置策略

在行业的选择上，主要选择受益于市场份额、定价权、核心竞争力提升的行业。这些行业包括：通信、电子、计算机、机械设备、家电、汽车、新能源、新材料、电力设备、国防军工、有色金属、建筑建材、金融、轻工制造、医药生物、交通运输、商业贸易、

传媒等。基金管理人将通过对不同行业供需平衡以及市场集中度的情况，参照外部研究机构研究成果，结合宏观经济分析的结果，运用定量与定性相结合的方法来评判不同行业的竞争力提升情况，对核心行业的选择进行评估及调整。

由于全球竞争力覆盖众多子行业，基金管理人将从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度，综合评估各个行业的投资价值。

(a) 行业景气度分析

行业的景气度受到宏观经济形势、国家产业政策、行业自身基本面等多因素的共同影响，本基金将分析经济周期的不同阶段对各行业的影响，并综合考虑国家产业政策、消费者需求变化、行业技术发展趋势等因素，判断各个行业的景气度。本基金将重点关注景气良好或长期增长前景看好的行业。

(b) 行业生命周期分析

本基金将分析各行业所处的生命周期阶段，重点配置处于成长期与成熟期的行业，对处于幼稚期的行业保持积极跟踪，对处于衰退期的行业则予以回避。部分行业从大类行业看处于衰退期，但其中某些细分行业通过创新转型获得新的成长动力，本基金也将对这些细分行业的公司进行投资。

(c) 行业竞争格局

主要分析行业的产品研发能力和行业进入壁垒，重点关注具有较强技术研发能力和较高的行业进入壁垒的行业。

(2) 个股精选策略

在个股的选择上，本基金坚持“自下而上”的个股选择策略，充分发挥投研团队的选股能力，紧密围绕全球竞争力的同时，致力于选择相应行业中具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司，同时结合财务数据定量分析和多种价值评估方法进行多角度投资价值分析。具体分以下三个层次进行投资标的的挑选：

首先，本基金采用筛选法，对上市公司的业务构

成进行分析，评估其产品和服务与全球竞争力的而相关度，对在同行业中表现突出的公司予以重点关注。并通过迈克尔·波特竞争优势理论对上市公司进行定性评判，主要选取具备一项或多项企业竞争优势要素的上市公司作为重点的投资对象，企业竞争优势主要包括如下要素：

(a) 资源优势（拥有稀缺、垄断的自然资源或市场资源等）；

(b) 技术优势（自有知识产权、技术壁垒较高、技术领先等）；

(c) 规模优势（国内、外市场份额较大的行业龙头、具有规模生产成本优势等）；

(d) 品牌优势（拥有世界品牌或中国驰名商标、行业知名度高等）；

(e) 市场优势（国内外市场份额较大的行业龙头、能够提供独特细分市场产品，子行业垄断或寡头垄断者、受非关税壁垒政策保护的行业等）；

(f) 管理优势（如真正执行现代企业制度的上市公司）；

(g) 国际优势（具有劳动力成本比较优势并且出口特有资源禀赋的优势行业、对外开放较早并且关税壁垒较低的行业等）；

(h) 股东优势（控股股东或实际控制人实力雄厚，对上市公司的经营发展有较大潜在或现实支持力度等）

其次，对定性筛选出来的股票，进一步进行财务数据的定量分析。采取的指标可包括但不限于：净资产与市值比率（B/P）、每股盈利/每股市价（E/P）、年现金流/市值（C/P）、销售收入/市值（S/P）、过去2年主营业务收入复合增长率、过去2年每股收益复合增长率等。

同时，针对股票所属产业特点的不同，本基金将采取不同的股票估值模型，在综合考虑股票历史的、国内的、国际相对的估值水平的基础上，对企业进行相对价值评估，甄选相对价值低估的个股作为本基金

的投资对象。

（3）港股通标的股票投资策略

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

本基金将重点关注：

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

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

3) 盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的上市公司；

4) 相对A股同类公司具有显著的估值优势的公司。

（4）存托凭证投资策略

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

3、固定收益投资策略

结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

4、可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。

	<p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金将在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+上证国债指数收益率*20%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）*5%
风险收益特征	<p>本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。</p> <p>本基金将投资港股通投资标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	永赢基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰
	联系电话	021-20430340
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com
客户服务电话	400-805-8888	95555
传真	021-51690177	0755-83195201
注册地址	浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦

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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	马宇晖	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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21世纪大厦21、22、27层

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年	2020年04月22日(基金合同生效日)-2020年12月31日
本期已实现收益	13,530,115.18	12,676,828.96
本期利润	14,512,853.71	19,100,334.19
加权平均基金份额本期利润	0.2373	0.4890

本期加权平均净值利润率	13.51%	41.57%
本期基金份额净值增长率	21.35%	49.99%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	60,743,249.50	12,804,617.35
期末可供分配基金份额利润	0.6488	0.3506
期末基金资产净值	170,416,153.08	54,784,498.36
期末基金份额净值	1.8201	1.4999
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	82.01%	49.99%

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。

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	5.13%	1.38%	1.04%	0.62%	4.09%	0.76%
过去六个月	-3.24%	1.58%	-4.58%	0.81%	1.34%	0.77%
过去一年	21.35%	1.60%	-3.69%	0.92%	25.04%	0.68%
自基金合同生效起至今	82.01%	1.54%	22.70%	0.94%	59.31%	0.60%

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；

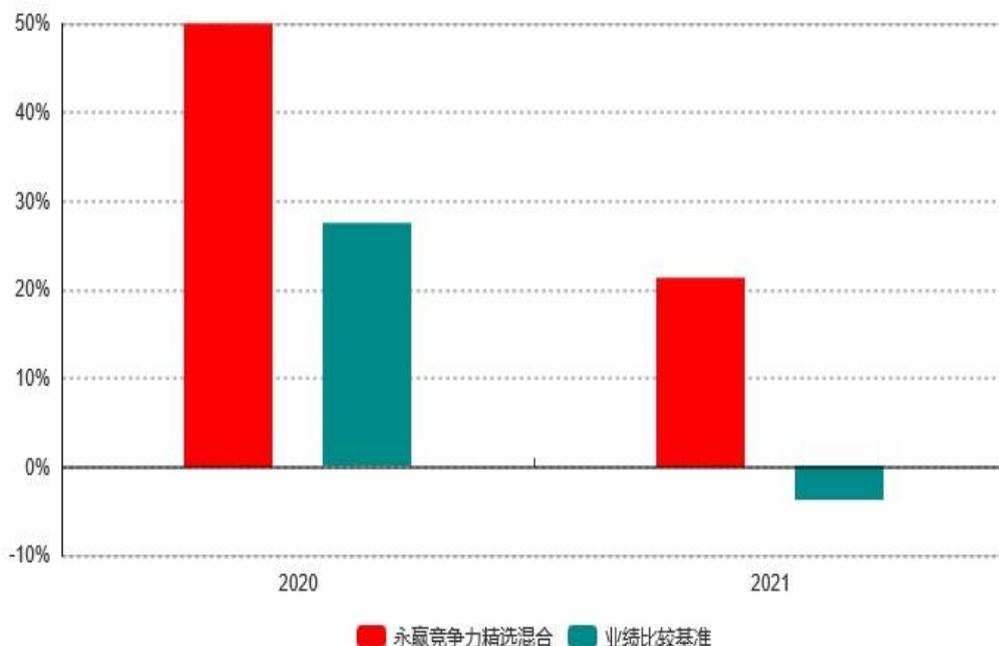
2、本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率*75%+上证国债指数收益率*20%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）*5%。

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



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2020年4月22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2020年4月22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%，华侨银行有限公司持股28.51%。

截止2021年12月31日，本基金管理人共管理92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、永赢通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、永赢智能领先混合型证券投资基金、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、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、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、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以及永赢优质精选混合型发起式证券投资基金。

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		
乔敏	基金经理	2020-04-22	-	11	乔敏女士，清华大学工学学士，长江商学院工商管理硕士，11年证券相关从业经验。曾任平安证券分析师，招商证券分析师，光大保德信基金高级研究员，华宸未来基金投研部研究副总监，永赢基金管理有限公司权益投资部研究总监兼投资经理。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、《永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限；投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预；基金经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同基金经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。另外，本基金管理人还建立机制要求公募基金经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各基金经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后分析，确保交易得到公平和公允的执行；对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，基金经理须提出申请并阐明具体原因，交由投资决策委员会进行严格的公平性审核；（4）严格控制同一投

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2021年，宏观经济的发展与演变，与2020年底所做的年度投资策略中宏观展望大致相符，全球经济逐步从疫情冲击中修复，进入复苏的趋势。随着疫苗覆盖进程的加快，各国经济在快速地联动修复，供需缺口叠加金融属性导致大宗品的价格上行。宽松的货币政策逐步调整，但经济修复的力度重于通胀的顾虑，资产配置的主线，是在经济复苏驱动下的通胀与利率上行。

在这个宏观背景下，权益资产的估值受到压制，波动率加大，但盈利增长可能超出预期。竞争力精选在投资策略上重视公司业绩的增长，谨慎看待估值膨胀，严守估值和业绩的匹配程度，根据各个板块的景气程度，进行估值切换的行情配置。

复盘2021，竞争力精选操作的主线，依据对全年以及每个季度的宏观主要变量进行配置，2021Q1，根据货币条件的变化以及大类资产比价关系，清仓茅指数相关品种，配置重心在全球需求对应的资源品以及防御性金融，部分回避了权益资产的调整。2021Q2，在美债上行减缓后，估值压制阶段性见底，竞争力精选配置切换，增加了较多行业上边际向好的新能源汽车以及光伏行业，赚取了成长行业业绩增长超预期的超额收益；2021Q3，通胀再起，周期中能源品类开始体现价格弹性，权益估值承压，基金配置上倾向于国内外能源相关品种；2021Q4，国内经济加速下行，交易衰退式宽松，参与了部分高成长行业在国内货币宽松中的估值修复。

总体配置上，宏观敏感类的资产中，按照经济周期的走势，增加配置了必选消费品和金融地产。竞争力精选从全仓运行以来，正逢全球经济修复的大周期启动，投资上没有浪费这一轮由疫情引起的周期波动，积极参与了周期品从预期到兑现的全过程，按照供需缺口传导的弹性和顺位，依次参与过早周期的黄金、航运，到中周期有色、采掘、化工，以及中后周期的能源。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢竞争力精选混合基金份额净值为1.8201元，本报告期内，基金份额净值增长率为21.35%，同期业绩比较基准收益率为-3.69%。

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2022年，宏观条件总结起来是“外胀内滞”，海外胀，国内滞；中美共振结束，周期错位演绎。上半年更多演绎滞涨，下半年可能会演绎衰退。疫情对于经济的扰动进入后期，美国经济修复也将逐步见顶回落，房地产和耐用品销售逐步回落，本土的产能供给和库存也将逐步见顶，消费和收入增长的正向循环启动。国内总需求中，外需随着海外总量的边际下行以及本土供应能力的修复而逐步放缓，地产产业链的下行也将逐步兑现到总量经济中，国内稳增长力度也或将增强。

总体流动性将前紧后松，前期美联储加息缩表进程超预期，导致资产价格急剧变化；后期随着经济和商品价格的逐步回落，资金成本可能会阶段性回落。

总体宏观环境对于权益资产并不有利，但其中经济结构的切换和节奏的把握，带来结构性行情。资产配置会权衡仓位、行业景气程度和估值体系三重要素，在必要时降低仓位，在确定性的方向上配置，争取风险调整后收益最大化。

时间走到2022年，周期演绎到了后周期，价格弹性更多体现在能源、必选消费品和交易通胀失控预期的黄金，竞争力精选在年内的周期类配置，也将在这些领域结合行业

具体基本面和估值情况进行配置。万物皆周期，周期品自有其运行的规律，来去有时，行之有度，基金运作也会尊重市场规律，用客观的态度进行理性分析，来攫取周期的收益。

对于宏观不敏感的行业，尤其是高成长的行业，我的看法维持，唯有真成长才能抗衰退。在独立逻辑的高成长板块，用宏观分析往往会弱化或是误判成长的韧性，我更多是关注行业内是否有有效供给的出现，能否为下游客户产生更加广泛的效用，从而启动新的增量市场。尽管年初流动性环境剧变引发高估值板块调整较大，但是成长的驱动要素更多来自于行业技术、成本、机制和模式等的创新，可以用增速对抵利率的上行。对汽车的智能化电动化、光伏、风电等行业，这些行业本身是能源革命的载体，具备长期产业与能源结构升级的趋势，我会保持关注，自下而上研究跟踪公司和行业的动态变化，在估值合理和基本面增强时进行加强配置，不负时代红利。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021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。2021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进行跟踪检查。

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。2021年，公司有序开展各类专项审计、离任审查、年度/季度监察稽核项目、即时通讯工具例行检查、风险事件调查等内审工作，并聘请外部机构独立开展合规有效性评估、年度内控评价等项目。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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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（2022）审字第61090672_B55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	永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的永赢竞争力精选混合型发起式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，公允反映了永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无

其他事项	无
其他信息	<p>永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</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。在编制财务报表时，管理层负责评估永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督永赢竞争力精选混合型发起式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。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误</p>

	<p>导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致永赢竞争力精选混合型发起式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。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蒋燕华 费泽旭
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
审计报告日期	2022-03-24

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	10,669,036.58	5,509,691.86
结算备付金		978,043.06	175,898.32
存出保证金		65,706.56	40,468.37
交易性金融资产	7.4.7.2	160,299,338.15	50,918,889.97
其中：股票投资		160,299,338.15	50,918,889.97
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,626.55	1,638,433.11
应收利息	7.4.7.5	5,678.83	2,160.77
应收股利		-	-
应收申购款		27,487.42	649,619.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		172,047,917.15	58,935,161.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		543,360.76	2,882,117.46
应付赎回款		328,670.39	918,254.74
应付管理人报酬		207,328.99	62,898.84
应付托管费		34,554.84	10,483.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	356,856.39	126,252.13
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	160,992.70	150,656.99
负债合计		1,631,764.07	4,150,663.30
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	93,628,439.09	36,524,986.88
未分配利润	7.4.7.10	76,787,713.99	18,259,511.48
所有者权益合计		170,416,153.08	54,784,498.36
负债和所有者权益总计		172,047,917.15	58,935,161.66

注：（1）报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.8201元，基金份额总额93,628,439.09份。

（2）本基金基金合同于2020年4月22日生效，上年度可比期间为2020年4月22日至2020年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月22日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日
----	-----	-----------------------------------	---

一、收入		18,269,591.47	20,399,478.88
1. 利息收入		137,820.07	84,356.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	137,820.07	65,100.65
债券利息收入		-	19,256.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,743,801.11	13,772,355.96
其中：股票投资收益	7.4.7.12	15,741,907.39	13,459,403.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-8,556.30
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,001,893.72	321,508.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	982,738.53	6,423,505.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	405,231.76	119,260.87
减：二、费用		3,756,737.76	1,299,144.69
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	1,595,222.13	473,654.73
2. 托管费	7.4.10.2. 2	265,870.36	78,942.46
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	1,724,006.95	589,302.87
5. 利息支出		-	1,596.24
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,596.24
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	171,638.32	155,648.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,512,853.71	19,100,334.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,512,853.71	19,100,334.19

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	36,524,986.88	18,259,511.48	54,784,498.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,512,853.71	14,512,853.71
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）	57,103,452.21	44,015,348.80	101,118,801.01
其中：1. 基金申购款	116,491,474.51	90,216,499.57	206,707,974.08
2. 基金赎回	-59,388,022.30	-46,201,150.77	-105,589,173.07

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）	93,628,439.09	76,787,713.99	170,416,153.08
项目	上年度可比期间		
	2020年04月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	50,129,511.77	-	50,129,511.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,100,334.19	19,100,334.19
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）	-13,604,524.89	-840,822.71	-14,445,347.60
其中：1. 基金申购款	17,738,872.08	6,722,480.45	24,461,352.53
2. 基金赎回款	-31,343,396.97	-7,563,303.16	-38,906,700.13
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）	36,524,986.88	18,259,511.48	54,784,498.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

芦特尔

黄庆

虞俏依

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金（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]212号文《关于准予永赢竞争力精选混合型发起式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4月22日生效，首次设立募集规模为50,129,511.77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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围限于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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准注册上市的股票、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（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货等法律法规或中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例为0-50%；每个交易日日终，在扣除股指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×75%+上证国债指数收益率×20%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 股指期货投资

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

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

(5) 回购协议

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果

该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(12) 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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

(3) 基金收益分配后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。

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

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

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

7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

7.4.6.4 企业所得税

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

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

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

7.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

7.4.6.6 境外投资

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	10,669,036.58	5,509,691.86
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	10,669,036.58	5,509,691.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		152,893,094.39	160,299,338.15	7,406,243.76
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		152,893,094.39	160,299,338.15	7,406,243.76
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		44,495,384.74	50,918,889.97	6,423,505.23
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		44,495,384.74	50,918,889.97	6,423,505.23

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	5,162.16	1,584.19
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	484.11	495.60
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-

其他	32.56	80.98
合计	5,678.83	2,160.77

7.4.7.6 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。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	356,856.39	126,252.13
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	356,856.39	126,252.13

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	992.70	656.99
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	160,000.00	150,000.00
合计	160,992.70	150,656.99

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,524,986.88	36,524,986.88
本期申购	116,491,474.51	116,491,474.51
本期赎回（以“-”号填列）	-59,388,022.30	-59,388,022.30

本期末	93,628,439.09	93,628,439.09
-----	---------------	---------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	12,804,617.35	5,454,894.13	18,259,511.48
本期利润	13,530,115.18	982,738.53	14,512,853.71
本期基金份额交易产生的变动数	34,408,516.97	9,606,831.83	44,015,348.80
其中：基金申购款	71,559,220.42	18,657,279.15	90,216,499.57
基金赎回款	-37,150,703.45	-9,050,447.32	-46,201,150.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,743,249.50	16,044,464.49	76,787,713.99

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年04月22日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	124,630.78	60,164.52
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	11,894.14	4,353.43
其他	1,295.15	582.70
合计	137,820.07	65,100.65

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月22日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
----	-----------------------------------	---

卖出股票成交总额	611,056,091.67	207,680,219.45
减：卖出股票成本总额	595,314,184.28	194,220,815.92
买卖股票差价收入	15,741,907.39	13,459,403.53

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2 021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月22日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券 （、债转股及债券到期兑付） 差价收入	-	-8,556.30
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	-	-8,556.30

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年04月22日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
卖出债券（、债转 股及债券到期兑 付）成交总额	-	8,880,157.42
减：卖出债券（、 债转股及债券到 期兑付）成本总额	-	8,757,874.50
减：应收利息总额	-	130,839.22
买卖债券差价收入	-	-8,556.30

7.4.7.13.3 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月22日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,001,893.72	321,508.73
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	1,001,893.72	321,508.73

7.4.7.17 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20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年04月22日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	982,738.53	6,423,505.23
——股票投资	982,738.53	6,423,505.23
——债券投资	-	-
——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	982,738.53	6,423,505.23

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月22日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
基金赎回费收入	398,876.69	115,915.39
基金转换费收入	6,355.07	3,345.48
合计	405,231.76	119,260.87

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月22日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
----	-----------------------------------	---

交易所市场交易费用	1,724,006.95	589,302.87
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,724,006.95	589,302.87

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年04月22日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	40,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	11,638.32	5,248.39
其他	-	400.00
合计	171,638.32	155,648.39

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、基金发起人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
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
华侨银行有限公司（“华侨银行”）	基金管理人的股东（自2020年8月5日起）

利安资金管理公司（“利安资金”）	基金管理人的原股东（2020年8月5日前）
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司

注：（1）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期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 2021年01月01日 至2021年12月31	上年度可比期间 2020年04月22日（基金合同 生效日）至2020年12月31日

	日	
当期发生的基金应支付的管理费	1,595,222.13	473,654.73
其中：支付销售机构的客户维护费	390,199.53	92,190.42

注：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。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 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年04月22日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	265,870.36	78,942.46

注：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。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

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01 日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年04月22日（基金 合同生效日）至2020年1 2月31日
基金合同生效日（2020年04月22日）持有的基金份额	0.00	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.0 0	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.0 0	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.6805%	27.3785%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
永赢资产	10,000,000.00	10.6805%	10,000,000.00	27.3785%

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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年04月22日（基金合同生效日） 至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	10,669,036.58	124,630.78	5,509,691.86	60,164.52

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

无。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021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**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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2021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2021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、自控和互控的第一道防线，部门内控和部门之间互相监督的第二道防线，合规管理及风险管理部门监控检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险管理进行监督管理的第五道防线。

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均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 2021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	10,669,036.58	-	-	-	-	-	10,669,036.58
结算备付金	978,043.06	-	-	-	-	-	978,043.06
存出保证金	65,706.56	-	-	-	-	-	65,706.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	160,299,338.15	160,299,338.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,626.55	2,626.55
应收利息	-	-	-	-	-	5,678.83	5,678.83
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	27,487.42	27,487.42

永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金 2021 年年度报告

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,712,786.20	-	-	-	-	160,335,130.95	172,047,917.15
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	543,360.76	543,360.76
应付赎回款	-	-	-	-	-	328,670.39	328,670.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	207,328.99	207,328.99
应付托管费	-	-	-	-	-	34,554.84	34,554.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	356,856.39	356,856.39
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	160,992.70	160,992.70
负债总计	-	-	-	-	-	1,631,764.07	1,631,764.07
利率敏感度缺口	11,712,786.20	-	-	-	-	158,703,366.88	170,416,153.08
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	5,509,691.86	-	-	-	-	-	5,509,691.86
结算备	175,898.32	-	-	-	-	-	175,898.32

付金							
存出保证金	40,468.37	-	-	-	-	-	40,468.37
交易性金融资产	-	-	-	-	-	50,918,889.97	50,918,889.97
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,638,433.11	1,638,433.11
应收利息	-	-	-	-	-	2,160.77	2,160.77
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	649,619.26	649,619.26
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,726,058.55	-	-	-	-	53,209,103.11	58,935,161.66
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,882,117.46	2,882,117.46
应付赎回款	-	-	-	-	-	918,254.74	918,254.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	62,898.84	62,898.84
应付托管费	-	-	-	-	-	10,483.14	10,483.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	126,252.13	126,252.13
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	150,656.99	150,656.99
负债总计	-	-	-	-	-	4,150,663.30	4,150,663.30
利率敏感度缺口	5,726,058.55	-	-	-	-	49,058,439.81	54,784,498.36

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

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债券，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 2021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	-	5,713,781.25	-	5,713,781.25
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	5,713,781.25	-	5,713,781.25

		5		5
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	5,713,781.2 5	-	5,713,781.2 5
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	7,038,896.2 2	-	7,038,896.2 2
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	7,038,896.2 2	-	7,038,896.2 2
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,038,896.2	-	7,038,896.2

额		2		2
---	--	---	--	---

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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	所有外币相对于人民币升值5%	285,689.06	351,944.81
	所有外币相对于人民币贬值5%	-285,689.06	-351,944.81

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 2021年12月31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	160,299,338.15	94.06	50,918,889.97	92.94
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	-	-	-	-

一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	160,299,338.15	94.06	50,918,889.97	92.94

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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准增加1%	1,894,335.33	705,096.91
	业绩比较基准减少1%	-1,894,335.33	-705,096.91

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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币160,299,338.15元，属于第二层次的余额为人民币0.00元，属于第三层次的余额为人民币0.00元（于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币50,149,227.75元，属于第二层次的余额为人民币15,363.84元，属于第三层次的余额为人民币754,298.38元）。

7.4.14.1.2.2 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。

7.4.14.1.2.3 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754,298.38元，2021年度转入第三层次人民币0.00元，转出第三层次人民币545,387.04元，当期计入损益的利得或损失总额人民币-208,911.34元，购买人民币0.00元，出售人民币0.00元，本期末人民币0.00元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动人民币0.00元。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月24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	160,299,338.15	93.17
	其中：股票	160,299,338.15	93.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	11,647,079.64	6.77
8	其他各项资产	101,499.36	0.06
9	合计	172,047,917.15	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5,713,781.25元，占期末净值比例3.35%。

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	4,423,544.00	2.60
B	采矿业	-	-
C	制造业	131,331,223.77	77.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,791,795.13	6.33
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	25,722.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,107,360.00	0.65
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,905,912.00	4.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	154,585,556.90	90.71

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
基础材料	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	1,531,266.69	0.9
公用事业	4,182,514.56	2.45
地产业	-	-
合计	5,713,781.25	3.35

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	002812	恩捷股份	39,800	9,965,920.00	5.85
2	600905	三峡能源	689,263	5,176,365.13	3.04
3	688518	联赢激光	102,474	5,048,893.98	2.96
4	002049	紫光国微	20,800	4,680,000.00	2.75
5	600765	中航重机	92,200	4,655,178.00	2.73
6	300750	宁德时代	7,600	4,468,800.00	2.62
7	600383	金地集团	344,400	4,466,868.00	2.62
8	002714	牧原股份	82,900	4,423,544.00	2.60

9	H00836	华润电力	196,000	4,182,514.56	2.45
10	688033	天宜上佳	121,497	4,015,475.85	2.36
11	603583	捷昌驱动	79,520	3,946,577.60	2.32
12	002074	国轩高科	77,000	3,946,250.00	2.32
13	000539	粤电力A	623,000	3,831,450.00	2.25
14	300394	天孚通信	103,205	3,777,303.00	2.22
15	002371	北方华创	10,800	3,747,816.00	2.20
16	603267	鸿远电子	20,000	3,588,800.00	2.11
17	002920	德赛西威	25,200	3,566,052.00	2.09
18	002918	蒙娜丽莎	123,700	3,541,531.00	2.08
19	603833	欧派家居	23,370	3,447,075.00	2.02
20	300034	钢研高纳	59,200	3,409,920.00	2.00
21	688116	天奈科技	22,741	3,395,003.89	1.99
22	002006	精功科技	123,900	3,330,432.00	1.95
23	600399	抚顺特钢	133,000	3,294,410.00	1.93
24	603027	千禾味业	132,300	3,185,784.00	1.87
25	600529	山东药玻	68,800	3,020,320.00	1.77
26	000420	吉林化纤	560,600	2,954,362.00	1.73
27	603319	湘油泵	114,600	2,947,512.00	1.73
28	603001	奥康国际	303,700	2,863,891.00	1.68
29	000596	古井贡酒	11,500	2,806,000.00	1.65
30	300699	光威复材	32,700	2,762,496.00	1.62
31	000733	振华科技	21,600	2,684,448.00	1.58
32	000568	泸州老窖	9,900	2,513,313.00	1.47
33	000768	中航西飞	67,600	2,467,400.00	1.45
34	688082	盛美上海	19,164	2,449,159.20	1.44
35	601137	博威合金	103,400	2,440,240.00	1.43
36	002244	滨江集团	523,400	2,439,044.00	1.43
37	688696	极米科技	4,361	2,407,272.00	1.41
38	000858	五粮液	10,700	2,382,462.00	1.40
39	300775	三角防务	45,200	2,209,828.00	1.30

40	600460	士兰微	35,700	1,934,940.00	1.14
41	603606	东方电缆	36,800	1,882,688.00	1.10
42	300769	德方纳米	3,700	1,817,292.00	1.07
43	600116	三峡水利	153,000	1,783,980.00	1.05
44	600438	通威股份	37,600	1,690,496.00	0.99
45	002821	凯莱英	3,800	1,653,000.00	0.97
46	603799	华友钴业	14,775	1,629,830.25	0.96
47	H00700	腾讯控股	4,100	1,531,266.69	0.90
48	300496	中科创达	8,000	1,107,360.00	0.65
49	603596	伯特利	15,500	1,078,800.00	0.63
50	002594	比亚迪	4,000	1,072,480.00	0.63
51	600150	中国船舶	43,000	1,065,970.00	0.63
52	002508	老板电器	22,600	814,052.00	0.48
53	300679	电连技术	14,700	771,750.00	0.45
54	001317	三羊马	300	25,722.00	0.02

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	002812	恩捷股份	12,973,024.00	23.68
2	600765	中航重机	10,154,840.00	18.54
3	600426	华鲁恒升	9,812,813.00	17.91
4	300390	天华超净	9,673,900.00	17.66
5	300750	宁德时代	9,129,754.00	16.66
6	603583	捷昌驱动	8,844,729.81	16.14
7	601058	赛轮轮胎	8,423,752.21	15.38
8	688116	天奈科技	8,264,047.08	15.08
9	002006	精功科技	7,609,086.00	13.89
10	002027	分众传媒	7,313,189.00	13.35

11	300059	东方财富	7,204,791.00	13.15
12	002074	国轩高科	7,141,539.00	13.04
13	300118	东方日升	6,842,040.65	12.49
14	600933	爱柯迪	6,668,783.00	12.17
15	600011	华能国际	6,616,550.00	12.08
16	600389	江山股份	6,594,523.00	12.04
17	000301	东方盛虹	6,387,695.00	11.66
18	688518	联赢激光	6,386,449.37	11.66
19	000858	五粮液	6,273,546.00	11.45
20	603786	科博达	6,095,198.75	11.13
21	601919	中远海控	6,052,922.70	11.05
22	688408	中信博	5,960,630.67	10.88
23	002920	德赛西威	5,876,746.00	10.73
24	002371	北方华创	5,850,374.00	10.68
25	300454	深信服	5,847,810.00	10.67
26	603799	华友钴业	5,766,348.00	10.53
27	688169	石头科技	5,656,223.87	10.32
28	600919	江苏银行	5,652,290.56	10.32
29	000933	神火股份	5,617,387.00	10.25
30	600760	中航沈飞	5,575,226.40	10.18
31	002895	川恒股份	5,573,014.00	10.17
32	600438	通威股份	5,554,984.00	10.14
33	000420	吉林化纤	5,475,380.00	9.99
34	300775	三角防务	5,418,100.00	9.89
35	600570	恒生电子	5,383,694.65	9.83
36	300014	亿纬锂能	5,267,742.00	9.62
37	601318	中国平安	5,242,535.00	9.57
38	002532	天山铝业	5,161,102.00	9.42
39	603277	银都股份	5,084,192.00	9.28
40	002459	晶澳科技	4,924,730.00	8.99
41	002080	中材科技	4,879,909.36	8.91

42	002192	融捷股份	4,735,692.00	8.64
43	688185	康希诺-U	4,731,486.70	8.64
44	002353	杰瑞股份	4,686,579.00	8.55
45	000596	古井贡酒	4,619,485.00	8.43
46	688033	天宜上佳	4,550,485.34	8.31
47	002049	紫光国微	4,486,158.76	8.19
48	002791	坚朗五金	4,482,424.00	8.18
49	H02883	中海油田 服务	4,458,794.35	8.14
50	688012	中微公司	4,453,354.02	8.13
51	603369	今世缘	4,422,599.00	8.07
52	600031	三一重工	4,419,973.00	8.07
53	002326	永太科技	4,391,401.00	8.02
54	300432	富临精工	4,281,268.50	7.81
55	600383	金地集团	4,244,912.00	7.75
56	002594	比亚迪	4,206,259.00	7.68
57	002714	牧原股份	4,160,936.50	7.60
58	688696	极米科技	4,094,548.47	7.47
59	600163	中闽能源	3,969,460.00	7.25
60	H01378	中国宏桥	3,959,056.61	7.23
61	002036	联创电子	3,948,379.00	7.21
62	000568	泸州老窖	3,939,464.00	7.19
63	600989	宝丰能源	3,930,248.00	7.17
64	600295	鄂尔多斯	3,900,683.00	7.12
65	600900	长江电力	3,900,016.00	7.12
66	688019	安集科技	3,872,254.03	7.07
67	002460	赣锋锂业	3,763,540.00	6.87
68	603985	恒润股份	3,748,960.00	6.84
69	000951	中国重汽	3,745,538.64	6.84
70	300415	伊之密	3,721,952.80	6.79
71	H00883	中国海洋	3,721,704.38	6.79

		石油		
72	600521	华海药业	3,691,557.00	6.74
73	600660	福耀玻璃	3,668,238.00	6.70
74	000932	华菱钢铁	3,599,912.00	6.57
75	601808	中海油服	3,468,739.00	6.33
76	600745	闻泰科技	3,456,531.00	6.31
77	603596	伯特利	3,450,586.00	6.30
78	300394	天孚通信	3,437,214.45	6.27
79	600905	三峡能源	3,436,527.95	6.27
80	300699	光威复材	3,408,753.00	6.22
81	H00836	华润电力	3,381,867.75	6.17
82	300034	钢研高纳	3,380,483.00	6.17
83	000539	粤电力A	3,272,427.00	5.97
84	002918	蒙娜丽莎	3,264,687.25	5.96
85	603833	欧派家居	3,261,272.00	5.95
86	300737	科顺股份	3,258,475.60	5.95
87	600399	抚顺特钢	3,250,460.00	5.93
88	002959	小熊电器	3,249,896.00	5.93
89	603916	苏博特	3,240,479.00	5.91
90	600703	三安光电	3,239,084.00	5.91
91	603027	千禾味业	3,221,822.00	5.88
92	603288	海天味业	3,221,199.00	5.88
93	002419	天虹股份	3,209,405.00	5.86
94	601137	博威合金	3,180,564.00	5.81
95	603606	东方电缆	3,180,121.05	5.80
96	603267	鸿远电子	3,179,341.00	5.80
97	605117	德业股份	3,176,323.98	5.80
98	600096	云天化	3,160,446.00	5.77
99	603319	湘油泵	3,147,160.00	5.74
100	002056	横店东磁	3,140,820.00	5.73
101	H06606	诺辉健康	3,130,944.77	5.72

		— B		
102	601877	正泰电器	3,067,520.25	5.60
103	600529	山东药玻	3,065,965.00	5.60
104	002466	天齐锂业	2,959,141.00	5.40
105	600188	兖矿能源	2,954,646.00	5.39
106	300702	天宇股份	2,911,864.40	5.32
107	603001	奥康国际	2,893,313.00	5.28
108	603326	我乐家居	2,880,375.72	5.26
109	H00175	吉利汽车	2,850,180.11	5.20
110	601699	潞安环能	2,842,681.00	5.19
111	002241	歌尔股份	2,826,768.00	5.16
112	688599	天合光能	2,806,595.98	5.12
113	688682	霍莱沃	2,733,197.42	4.99
114	000422	湖北宜化	2,685,572.00	4.90
115	H00700	腾讯控股	2,616,081.41	4.78
116	000768	中航西飞	2,594,689.00	4.74
117	601601	中国太保	2,592,720.00	4.73
118	600111	北方稀土	2,571,787.00	4.69
119	300496	中科创达	2,562,004.00	4.68
120	H01898	中煤能源	2,549,618.95	4.65
121	000001	平安银行	2,538,923.00	4.63
122	H02238	广汽集团	2,518,010.96	4.60
123	300470	中密控股	2,515,443.00	4.59
124	601818	光大银行	2,503,420.00	4.57
125	688082	盛美上海	2,489,077.75	4.54
126	688200	华峰测控	2,488,885.60	4.54
127	H03690	美团—W	2,442,961.84	4.46
128	002507	涪陵榨菜	2,433,370.00	4.44
129	603960	克来机电	2,427,833.00	4.43
130	000733	振华科技	2,411,959.00	4.40
131	603105	芯能科技	2,395,812.00	4.37

132	002244	滨江集团	2,372,613.00	4.33
133	688023	安恒信息	2,290,185.01	4.18
134	002508	老板电器	2,289,517.00	4.18
135	000807	云铝股份	2,274,988.00	4.15
136	600110	诺德股份	2,262,239.00	4.13
137	600516	方大炭素	2,261,640.00	4.13
138	600926	杭州银行	2,260,520.00	4.13
139	300657	弘信电子	2,258,255.00	4.12
140	688779	长远锂科	2,258,086.26	4.12
141	601778	晶科科技	2,257,505.30	4.12
142	601225	陕西煤业	2,247,132.00	4.10
143	601166	兴业银行	2,246,916.00	4.10
144	600460	士兰微	2,246,873.00	4.10
145	300073	当升科技	2,229,301.42	4.07
146	H03800	保利协鑫 能源	2,204,156.11	4.02
147	000039	中集集团	2,195,868.00	4.01
148	H00388	香港交易 所	2,173,965.15	3.97
149	300207	欣旺达	2,158,519.00	3.94
150	000848	承德露露	2,140,711.00	3.91
151	600809	山西汾酒	2,138,500.00	3.90
152	002555	三七互娱	2,114,999.00	3.86
153	601888	中国中免	2,106,980.00	3.85
154	002984	森麒麟	2,100,026.75	3.83
155	300568	星源材质	2,093,800.00	3.82
156	300033	同花顺	2,046,481.05	3.74
157	300896	爱美客	2,017,193.00	3.68
158	603337	杰克股份	1,968,324.00	3.59
159	300450	先导智能	1,887,160.07	3.44
160	601658	邮储银行	1,884,854.00	3.44

161	002250	联化科技	1,861,659.00	3.40
162	600782	新钢股份	1,817,166.00	3.32
163	300601	康泰生物	1,804,285.00	3.29
164	002110	三钢闽光	1,776,072.19	3.24
165	300101	振芯科技	1,774,615.00	3.24
166	H01208	五矿资源	1,743,087.00	3.18
167	000983	山西焦煤	1,730,229.00	3.16
168	300769	德方纳米	1,712,646.00	3.13
169	H06049	保利物业	1,707,468.20	3.12
170	688521	芯原股份 -U	1,699,864.42	3.10
171	600596	新安股份	1,697,095.00	3.10
172	600869	远东股份	1,696,188.00	3.10
173	600256	广汇能源	1,690,340.00	3.09
174	600116	三峡水利	1,688,107.00	3.08
175	002821	凯莱英	1,683,000.00	3.07
176	688007	光峰科技	1,675,245.86	3.06
177	603995	甬金股份	1,674,148.00	3.06
178	H00981	中芯国际	1,617,860.48	2.95
179	300679	电连技术	1,616,432.00	2.95
180	002255	海陆重工	1,607,360.00	2.93
181	002304	洋河股份	1,573,200.00	2.87
182	300850	新强联	1,555,926.00	2.84
183	600690	海尔智家	1,520,538.00	2.78
184	H03808	中国重汽	1,504,009.00	2.75
185	002453	华软科技	1,447,159.00	2.64
186	600761	安徽合力	1,446,339.00	2.64
187	601100	恒立液压	1,378,602.00	2.52
188	601717	郑煤机	1,368,776.00	2.50
189	601898	中煤能源	1,348,194.00	2.46
190	002601	龙佰集团	1,154,029.00	2.11

191	688981	中芯国际	1,153,002.78	2.10
192	600150	中国船舶	1,147,973.00	2.10
193	002756	永兴材料	1,138,320.00	2.08
194	603501	韦尔股份	1,137,816.00	2.08
195	603979	金诚信	1,135,145.20	2.07
196	601015	陕西黑猫	1,129,635.00	2.06
197	002409	雅克科技	1,119,161.00	2.04
198	688188	柏楚电子	1,118,758.59	2.04
199	603185	上机数控	1,116,712.00	2.04

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	600426	华鲁恒升	10,498,979.53	19.16
2	300390	天华超净	10,374,712.00	18.94
3	300059	东方财富	9,518,912.60	17.38
4	002027	分众传媒	9,441,573.64	17.23
5	300750	宁德时代	8,917,249.00	16.28
6	002812	恩捷股份	8,813,234.00	16.09
7	688408	中信博	8,277,537.07	15.11
8	601058	赛轮轮胎	8,055,948.60	14.70
9	600011	华能国际	7,859,740.00	14.35
10	300118	东方日升	7,837,897.00	14.31
11	600765	中航重机	7,570,786.00	13.82
12	002080	中材科技	7,353,309.70	13.42
13	300454	深信服	7,338,213.00	13.39
14	600933	爱柯迪	7,231,951.58	13.20
15	601919	中远海控	6,916,675.00	12.63
16	688116	天奈科技	6,826,413.84	12.46

17	002459	晶澳科技	6,768,828.74	12.36
18	600989	宝丰能源	6,601,480.00	12.05
19	603369	今世缘	6,508,303.35	11.88
20	600570	恒生电子	6,487,543.00	11.84
21	300014	亿纬锂能	6,444,683.00	11.76
22	603786	科博达	6,361,387.64	11.61
23	000301	东方盛虹	6,215,796.80	11.35
24	002353	杰瑞股份	5,800,722.00	10.59
25	600760	中航沈飞	5,775,768.00	10.54
26	002984	森麒麟	5,654,564.64	10.32
27	000933	神火股份	5,525,603.60	10.09
28	600919	江苏银行	5,480,482.00	10.00
29	002192	融捷股份	5,340,684.00	9.75
30	600389	江山股份	5,335,631.00	9.74
31	603583	捷昌驱动	5,313,305.40	9.70
32	601318	中国平安	5,062,661.24	9.24
33	688169	石头科技	5,025,078.27	9.17
34	002895	川恒股份	4,910,052.00	8.96
35	688599	天合光能	4,902,504.73	8.95
36	002532	天山铝业	4,854,355.00	8.86
37	603277	银都股份	4,821,278.00	8.80
38	000858	五粮液	4,771,271.00	8.71
39	603985	恒润股份	4,695,572.00	8.57
40	002460	赣锋锂业	4,301,129.00	7.85
41	002791	坚朗五金	4,271,971.00	7.80
42	600096	云天化	4,237,323.00	7.73
43	H00175	吉利汽车	4,219,824.55	7.70
44	300415	伊之密	4,133,397.00	7.54
45	600031	三一重工	4,120,351.91	7.52
46	002056	横店东磁	4,102,766.00	7.49
47	002594	比亚迪	4,093,709.00	7.47

48	688012	中微公司	4,059,352.69	7.41
49	000039	中集集团	4,013,571.00	7.33
50	300432	富临精工	3,989,532.00	7.28
51	002326	永太科技	3,948,662.88	7.21
52	600438	通威股份	3,844,586.00	7.02
53	688185	康希诺-U	3,791,099.20	6.92
54	H02883	中海油田 服务	3,758,677.89	6.86
55	H00883	中国海洋 石油	3,740,046.02	6.83
56	600900	长江电力	3,689,940.00	6.74
57	300775	三角防务	3,653,551.00	6.67
58	600188	兖矿能源	3,579,111.97	6.53
59	000951	中国重汽	3,500,406.95	6.39
60	605117	德业股份	3,498,614.01	6.39
61	601808	中海油服	3,498,290.00	6.39
62	002036	联创电子	3,477,021.00	6.35
63	H01378	中国宏桥	3,472,116.91	6.34
64	600745	闻泰科技	3,427,361.52	6.26
65	H01898	中煤能源	3,413,891.83	6.23
66	H03690	美团-W	3,365,436.22	6.14
67	600660	福耀玻璃	3,332,207.00	6.08
68	300737	科顺股份	3,326,525.00	6.07
69	603799	华友钴业	3,275,499.00	5.98
70	002959	小熊电器	3,271,287.00	5.97
71	603288	海天味业	3,248,000.00	5.93
72	688019	安集科技	3,228,629.00	5.89
73	601877	正泰电器	3,227,597.81	5.89
74	000420	吉林化纤	3,224,691.00	5.89
75	002006	精工科技	3,224,166.00	5.89
76	000932	华菱钢铁	3,213,103.94	5.86

77	H06606	诺辉健康 - B	3,175,789.40	5.80
78	600163	中闽能源	3,175,453.00	5.80
79	600521	华海药业	3,158,247.00	5.76
80	600905	三峡能源	3,131,073.00	5.72
81	603916	苏博特	3,041,678.80	5.55
82	600703	三安光电	2,997,543.52	5.47
83	601699	潞安环能	2,957,712.00	5.40
84	600295	鄂尔多斯	2,954,546.00	5.39
85	002466	天齐锂业	2,930,079.00	5.35
86	601166	兴业银行	2,861,039.00	5.22
87	600926	杭州银行	2,842,219.00	5.19
88	H00981	中芯国际	2,741,554.50	5.00
89	000422	湖北宜化	2,738,323.00	5.00
90	601601	中国太保	2,713,010.00	4.95
91	300702	天宇股份	2,663,830.00	4.86
92	300073	当升科技	2,625,515.00	4.79
93	600111	北方稀土	2,607,329.00	4.76
94	300850	新强联	2,591,296.00	4.73
95	601778	晶科科技	2,570,678.00	4.69
96	002241	歌尔股份	2,543,209.00	4.64
97	300470	中密控股	2,536,985.00	4.63
98	002419	天虹股份	2,531,472.00	4.62
99	601818	光大银行	2,522,290.00	4.60
100	H03800	保利协鑫 能源	2,491,245.57	4.55
101	603326	我乐家居	2,485,262.62	4.54
102	000001	平安银行	2,452,420.00	4.48
103	300316	晶盛机电	2,420,421.00	4.42
104	H00388	香港交易 所	2,410,430.69	4.40

105	H02238	广汽集团	2,368,134.87	4.32
106	002410	广联达	2,350,886.00	4.29
107	688518	联赢激光	2,347,582.42	4.29
108	002507	涪陵榨菜	2,343,636.00	4.28
109	688200	华峰测控	2,300,607.39	4.20
110	688779	长远锂科	2,289,785.91	4.18
111	002920	德赛西威	2,275,214.00	4.15
112	300207	欣旺达	2,268,706.00	4.14
113	002371	北方华创	2,254,623.00	4.12
114	603596	伯特利	2,233,772.00	4.08
115	002074	国轩高科	2,232,026.80	4.07
116	603105	芯能科技	2,204,889.00	4.02
117	600516	方大炭素	2,134,106.06	3.90
118	603960	克来机电	2,113,562.00	3.86
119	601225	陕西煤业	2,107,085.00	3.85
120	600110	诺德股份	2,087,364.00	3.81
121	300450	先导智能	2,074,253.00	3.79
122	000807	云铝股份	2,048,434.00	3.74
123	002555	三七互娱	2,030,941.00	3.71
124	688023	安恒信息	2,002,701.60	3.66
125	300601	康泰生物	1,983,538.00	3.62
126	000596	古井贡酒	1,960,800.00	3.58
127	688682	霍莱沃	1,897,041.00	3.46
128	601888	中国中免	1,882,500.00	3.44
129	002250	联化科技	1,877,877.00	3.43
130	601898	中煤能源	1,866,773.00	3.41
131	300033	同花顺	1,835,800.00	3.35
132	300568	星源材质	1,835,166.00	3.35
133	601658	邮储银行	1,816,310.00	3.32
134	600809	山西汾酒	1,774,500.00	3.24
135	603337	杰克股份	1,751,871.00	3.20

136	688521	芯原股份-U	1,738,083.54	3.17
137	000983	山西焦煤	1,715,360.00	3.13
138	603995	甬金股份	1,688,069.00	3.08
139	603606	东方电缆	1,677,503.00	3.06
140	002453	华软科技	1,658,290.00	3.03
141	002508	老板电器	1,654,352.00	3.02
142	600256	广汇能源	1,645,722.21	3.00
143	H00700	腾讯控股	1,640,963.18	3.00
144	002110	三钢闽光	1,625,650.00	2.97
145	H01772	赣锋锂业	1,613,173.72	2.94
146	600782	新钢股份	1,582,604.00	2.89
147	002255	海陆重工	1,564,622.00	2.86
148	000848	承德露露	1,533,708.96	2.80
149	300101	振芯科技	1,512,182.00	2.76
150	688567	孚能科技	1,497,317.74	2.73
151	000651	格力电器	1,489,923.00	2.72
152	600761	安徽合力	1,485,214.00	2.71
153	600869	远东股份	1,469,950.00	2.68
154	300896	爱美客	1,456,581.00	2.66
155	600690	海尔智家	1,433,820.00	2.62
156	300657	弘信电子	1,420,275.00	2.59
157	H06049	保利物业	1,395,100.91	2.55
158	300451	创业慧康	1,391,498.00	2.54
159	002182	云海金属	1,380,240.00	2.52
160	600596	新安股份	1,379,072.00	2.52
161	688696	极米科技	1,371,499.52	2.50
162	300496	中科创达	1,370,246.00	2.50
163	000568	泸州老窖	1,366,498.00	2.49
164	688007	光峰科技	1,334,109.94	2.44
165	002409	雅克科技	1,279,716.00	2.34

166	002304	洋河股份	1,279,428.00	2.34
167	H03808	中国重汽	1,261,034.83	2.30
168	601100	恒立液压	1,247,543.00	2.28
169	300274	阳光电源	1,243,910.00	2.27
170	603501	韦尔股份	1,242,780.00	2.27
171	H01299	友邦保险	1,233,198.23	2.25
172	000547	航天发展	1,228,505.00	2.24
173	300699	光威复材	1,184,492.00	2.16
174	603308	应流股份	1,172,387.00	2.14
175	601717	郑煤机	1,152,898.00	2.10
176	002601	龙佰集团	1,151,692.00	2.10
177	002756	永兴材料	1,143,528.00	2.09
178	688981	中芯国际	1,101,484.80	2.01

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	703,711,893.93
卖出股票收入（成交）总额	611,056,091.67

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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	65,706.56
2	应收证券清算款	2,626.55
3	应收股利	-
4	应收利息	5,678.83
5	应收申购款	27,487.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,499.36

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
7,843	11,937.83	57,539,865.46	61.455 5%	36,088,573.63	38.544 5%

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	658,348.53	0.70%

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	10.68%	10,000,000.00	10.68%	自合同生效之日起不少于三年

基金管理人高级管理人员	325,800.29	0.35%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,325,800.29	11.03%	10,000,000.00	10.68%	自合同生效之日起不少于三年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年04月22日)基金份额总额	50,129,511.77
本报告期期初基金份额总额	36,524,986.88
本报告期基金总申购份额	116,491,474.51
减：本报告期基金总赎回份额	59,388,022.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	93,628,439.09

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经永赢基金管理有限公司董事会审议通过，毛慧女士不再担任公司督察长职务，聘任汪成杰先生担任公司督察长职务。本基金管理人已分别于2021年9月18日、2021年9月29日在规定信息披露媒介登载了高级管理人员变更公告。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

自2021年10月27日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

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40,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

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	
中信建投	1	-	-	-	-	新增
长江证券	2	-	-	-	-	新增
方正证券	2	146,351,887.44	11.17%	105,514.81	11.19%	-
开源证券	2	380,523,390.64	29.05%	274,308.57	29.08%	-
民生证券	2	108,636,247.71	8.29%	77,172.09	8.18%	-

兴业证券	2	348,273,157.04	26.59%	250,857.98	26.60%	新增
招商证券	2	272,775,792.24	20.82%	196,931.18	20.88%	-
甬兴证券	2	53,435,349.89	4.08%	38,420.89	4.07%	新增

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
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金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	永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金2020年第4季度报告内容更正公告	中国证监会规定媒介	2021-01-28
6	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
7	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的公告	中国证监会规定媒介	2021-02-01
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	永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金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	永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金2021年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
13	永赢基金管理有限公司关于调整部	中国证监会规定媒介	2021-06-17

	分基金最低赎回（含转换转出）份额和最低持有份额数额限制的公告		
14	永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金2021年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2021-07-20
15	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	2021-07-21
16	永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金2021年中期报告	中国证监会规定媒介	2021-08-28
17	永赢基金管理有限公司关于新增上海万得基金销售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	2021-08-31
18	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021-09-18
19	永赢基金管理有限公司关于新增华侨永亨银行（中国）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	2021-09-29
20	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021-09-29
21	永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金2021年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2021-10-27
22	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	2021-11-03
23	永赢基金管理有限公司关于新增长江证券股份有限公司为永赢竞争力精选混合型发起式证券投资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	2021-11-12
24	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-12-09

25	永赢基金管理有限公司关于新增国金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	2021-12-13
26	永赢基金管理有限公司关于新增国联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	2021-12-24
27	永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新(2021年第1号)	中国证监会规定媒介	2021-12-28
28	永赢竞争力精选混合型发起式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	2021-12-28
29	永赢基金管理有限公司广州分公司成立公告	中国证监会规定媒介	2021-12-30

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101 - 20210127, 20210204 - 20210222	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	10.68%
	2	20210101 - 20210127, 20210204 - 20210222	10,000,000.00	1,868,249.36	0.00	11,868,249.36	12.68%
产品特有风险							
本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，存在可能因单一投资者持有基							

金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司
二〇二二年三月二十六日