永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 30 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月28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2023年01月01日起至2023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 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
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 17
§5 托管人报告 17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 17
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 17
6.1 资产负债表 17
6.2 利润表 19
6.3 净资产（基金净值）变动表 21
6.4 报表附注 22
§7 投资组合报告 51
7.1 期末基金资产组合情况 51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 52
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 52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 55
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 55
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 56
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 56
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 56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 56
7.12 投资组合报告附注 56
§8 基金份额持有人信息 58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 58

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 59
§9 开放式基金份额变动 59
§10 重大事件揭示 60
10.1 基金份额持有人大会决议 60
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 60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 60
10.4 基金投资策略的改变 60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
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 60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 60
10.8 其他重大事件 61
§11 影响投资者决策的其他重要信息 62
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 62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 62
§12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	永赢合嘉一年持有混合	
基金主代码	017220	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年12月29日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	207,448,019.03份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢合嘉一年持有混合A	永赢合嘉一年持有混合C
下属分级基金的交易代码	017220	017221
报告期末下属分级基金的份额总额	73,845,968.17份	133,602,050.86份

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
投资策略	本基金主要投资策略包含大类资产配置策略、股票投资策略、港股通标的股票投资策略、普通债券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、信用衍生品投资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债-综合指数（全价）收益率×85%+沪深300指数收益率×13%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益水平高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临

	汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	0755-25878287
	联系电话	021-20430340	0755-25878287
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-805-8888	95511-3
传真		021-51690177	0755-82080387
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层	深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼
邮政编码		200120	518001
法定代表人		马宇晖	谢永林

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号二十一世纪大厦21、22、23、27层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	永赢基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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(2023年01月01日-2023年06月30日)	
	永赢合嘉一年持有混合A	永赢合嘉一年持有混合C
本期已实现收益	1,730,291.04	2,835,902.34
本期利润	1,457,218.45	2,350,015.83
加权平均基金份额本期利润	0.0198	0.0178
本期加权平均净值利润率	1.96%	1.76%
本期基金份额净值增长率	1.99%	1.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)	
期末可供分配利润	1,469,420.78	2,385,528.68
期末可供分配基金份额利润	0.0199	0.0179
期末基金资产净值	75,315,388.95	135,987,579.54
期末基金份额净值	1.0199	1.0179
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.99%	1.79%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

永赢合嘉一年持有混合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	0.18%	0.15%	0.42%	0.13%	-0.24%	0.02%
过去三个月	0.91%	0.14%	0.09%	0.12%	0.82%	0.02%
过去六个月	1.99%	0.13%	0.98%	0.13%	1.01%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.99%	0.13%	1.08%	0.12%	0.91%	0.01%

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：中债-综合指数（全价）收益率×85%+沪深300指数收益率×13%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×2%。

永赢合嘉一年持有混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.15%	0.15%	0.42%	0.13%	-0.27%	0.02%
过去三个月	0.81%	0.14%	0.09%	0.12%	0.72%	0.02%
过去六个月	1.79%	0.13%	0.98%	0.13%	0.81%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.79%	0.13%	1.08%	0.12%	0.71%	0.01%

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：中债-综合指数（全价）收益率×85%+沪深300指数收益率×13%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×2%。

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：1、本基金合同生效日为2022年12月29日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

2、本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

注：1、本基金合同生效日为2022年12月29日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

2、本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金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91330200717885432 2的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014年8月18日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018年1月25日，公司完成增资，注册资本由人民币贰亿元增至人民币玖亿元。目前，公司的股权结构为宁波银行股份有限公司持股71.49％，Oversea-Chinese Banking Corporation Limited持股28.51％。

截止2023年6月30日，本基金管理人共管理117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、永赢中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、永赢医药健康股票型证券投资基金、永赢邦利债券型证券投资基金、永赢瑞宁87个月定期开放债券型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫享混合型证券投资基金、永赢鼎利债券型证券投资基金、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金、永赢成长领航混合型证券投资基金、永赢泰宁63个月定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫欣混合型证券投资基金、永赢稳健增利18个月持有期混合型证券投资基金、永赢鑫盛混合型证券投资基金、永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠添益混合型证券投资基金、永赢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、永赢优质精选混合型发起式证券投资基金、永赢添添欣12个月持有期混合型证券投资基金、永赢养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、永赢卓越臻选股票型发起式证券投资基金、永赢新能源智选混合型发起式证券投资基金、永赢坤益债券型证券投资基金、永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金、永赢宏泰短债债券型证券投资基金、永赢添添悦6个月持有期混合型证券投资基金、永赢优质生活混合型证券投资基金、永赢安悦60天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢湖北国有企业债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、永赢半导体产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢低碳环保智选混合型发起式证券投资基金、永赢安泰中短债债券型证券投资基金、永赢医药创新智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费鑫选6个月持有期混合型证券投资基金、永赢消费龙头智选混合型发起式证券投资基金、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基

金、永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金、永赢季季享90天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢昭利债券型证券投资基金、永赢恒欣稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金、永赢数字经济智选混合型发起式证券投资基金、永赢月月享30天持有期短债债券型证券投资基金、永赢先进制造智选混合型发起式证券投资基金、永赢浩益一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

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		
曾琬云	基金经理	2022-12-29	-	7	曾琬云女士，清华大学金融硕士，7年证券相关从业经验。曾任广发证券股份有限公司交易员，永赢基金管理有限公司固定收益投资部投资经理，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。
杨凡颖	固定收益投资部副总监兼基金经理	2022-12-29	-	13	杨凡颖女士，厦门大学经济学硕士，13年证券相关从业经验。曾任鹏华基金管理有限公司固定收益部高级研究员、基金经理助理、社保投资助理；兴银基金管理有限责任公司固定策略分析部总经理兼基金经理；永赢基金管理有限公司固定收益投资部投资经理。现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部副总监。

斯子文	基金经理助理	2023-01-03	2023-03-17	6	斯子文先生，复旦大学经济学博士，CPA，6年证券相关从业经验。曾任兴证证券资产管理有限公司研究部研究员，永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。现任永赢基金管理有限公司绝对收益投资部投资经理助理。
余国豪	基金经理助理	2023-03-09	-	7	余国豪先生，硕士，7年证券相关从业经验。曾任兴业基金管理有限公司固定收益研究员，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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢合嘉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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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

宏观经济方面，上半年市场交易主线逐步从疫后“强复苏”转向“弱复苏”，板块上消费表现强于投资、服务业表现强于制造业。具体节奏上，年初伴随疫情解封、消费场景快速复苏，工业企业生产回补，地产销售迅速回暖，信贷开门红表现强劲。3月地产销售景气度仍维持高位，但产业端开始出现需求不及预期的迹象，经济修复斜率开始放缓。进入二季度，年初的经济脉冲效应进一步退潮，地产销售转弱、信贷投放回落，经济内生性需求偏弱的症结显现。

政策方面，以3月降准为时间节点，上半年货币环境经历了先紧后松的过程。年初伴随信贷大量投放，资金面延续去年末以来的边际收敛态势，DR007价格上行到政策利率附近。3月降准之后，资金价格和波动率双双回落，资金面进入实质偏松环境。6月央行降息落地，在操作时点上相对靠前，体现了货币政策对于稳经济、稳预期的紧迫性。货币宽松先行后，市场对稳增长政策出台预期升温，政策博弈成为阶段性主线。

利率市场方面，上半年债市收益率整体下行，半年末10年国债收益率相比去年末下降近20BP。节奏上，年初进入疫后修复期，市场对经济复苏预期偏强，叠加资金面边际收敛，债市利率出现小幅调整。3月开始伴随经济修复动能开始转弱，内生性需求不足逐渐成为市场共识，“资产荒”逻辑继续演绎，债市收益率呈现阶梯式下行，整数关口利率往往出现横盘震荡状态，一致预期变化后则迅速突破点位至下一区间。

信用债收益率整体下行，信用利差和等级利差均有不同幅度的压缩，期限方面，低等级陡峭化，中高等级则被压平。节奏上， 1-4月的信用债收益率和利差快速下行，5-6月受阶段性止盈、降息等影响，信用债收益率降幅收窄，表现不及利率债。

转债市场方面，上半年市场围绕疫后复苏呈现震荡上行，中证转债指数累计上涨3.37%，同期Wind全A上涨3.06%，跑赢权益指数。上半年流动性整体宽松，对转债高估值起到一定支撑作用，表现出“下有承接资金、上有兑现压力”的波动特征。节奏上，

年初市场在疫情达峰后交易经济V型复苏“强预期”，行业板块呈现从消费到制造业的轮动表现。年后市场情绪在“弱现实”的经济数据下趋于谨慎，叠加海外加息反复与金融风险释放，市场选择了经济弱相关的新兴科技和中特估。4月年报披露后，部分正股面临退市危机、债券面临信用评级下调，转债估值受到一定冲击，但限于局部个券，对常规定价品种影响较小。6月市场开始预期政策刺激，转债跟随权益市场企稳回升，家电、汽车等顺周期板块领涨。

权益市场方面，A股上半年震荡收涨，结构上TMT板块表现占优。疫后经济复苏和政策刺激预期的反复，是上半年市场的核心矛盾。节奏上，年初在疫后复苏“强预期”下演绎普涨行情，国内风险资产具备比价效应，北向资金持续大幅流入。但春节后各项经济数据验证“弱复苏”现实，叠加外围市场压力，市场悲观情绪逐步升温，重新回到资金存量甚至缩量博弈状态，各板块轮动加速，最终主线聚焦在数字经济和中特估并交替轮动。临近年中，市场风险释放较为充分，部分资金开始预期政策发力，指数逐步企稳，悲观情绪有所收敛。

纯债方面，组合较好的把握住了一月至二月初的信用债加仓窗口期，以3年内中票及城投债为主要加仓标的，在一季度获取了较为理想的票息和资本利得收益。二季度开始，结合市场情况适当提升了组合久期及杠杆水平，严控信用风险，主要配置中高等级信用债。同时，积极把握市场的交易型机会，追求组合收益平稳增长。转债操作方面，报告期初产品处于建仓期，年初市场对经济和政策预期都较为积极，权益和转债市场均迅速上行，估值快速修复，但我们的产品由于刚成立尚无安全垫，为了使持有人体验更佳，考虑到市场后续可能的回撤风险，我们并没有在年初市场快速上行过程中完成建仓，而是耐心等待市场回落后，逐步增加含权部分仓位。年后随着经济数据的回落，以及政策刺激的不及预期，权益市场开始调整，转债市场震荡回落，市场风险偏好在这个过程中大幅下行，股票估值亦跟随回落。而我们认为尽管经济修复的过程可能比年初的乐观预期更加曲折，但短期数据的回落尚未影响我们对经济修复方向的判断，市场的短期表现更多是受到库存周期和市场预期的影响，因此在市场震荡回调过程中我们完成了股票和转债仓位的建仓，而后将含权仓位基本稳定在较高水平，并根据转债和股票的风险收益特征动态调整仓位分配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢合嘉一年持有混合A基金份额净值为1.0199元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.99%，同期业绩比较基准收益率为0.98%；截至报告期末永赢合嘉一年持有混合C基金份额净值为1.0179元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.79%，同期业绩比较基准收益率为0.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，在内生性需求偏弱的背景下，经济整体处于磨底状态，以PMI趋势值为代表的经济周期指标上升斜率偏缓，物价、融资数据低位震荡。政策方面，货币政策基调预计维持宽松，进一步宽松动作亦可期待；财政政策边际加码，三季度债券发行节奏明显加快。在高质量发展的核心诉求下，政策基调仍旧维持定力，政策出台大概率呈现节奏密集、幅度克制、侧重中长效的组合拳特征。外围环境方面，下半年经济浅衰退、就业偏韧性、通胀有粘性仍然是基准预期，对应着政策越过最鹰派的加息阶段，但不会就此打开宽松空间，始终保留再紧缩的选择权。

信用方面，下半年机构止盈和防风险诉求提高，对弱资质主体投融资或收紧，局部区域信用风险有上升可能。供需角度来看，信用资产荒逻辑仍在，但当前估值和利差优势下降，信用债较难走出独立行情，可关注波段和骑乘机会。方向上，短端票息品种的确定性较强，中长久期关注中高等级、流动性好的资产。

转债市场方面，当前经济动能弱势的预期较为充分，权益市场在估值低位状态下进入政策博弈期，预计下半年指数呈现震荡走势。估值方面，考虑到总量刺激政策工具有限、经济复苏短期内难以一蹴而就，资金面维持宽松将延续对转债估值的支撑；而进一步的向上突破，需要权益市场回暖带动增量资金流入。

权益市场方面，当前经济整体呈现磨底状态，处于主动去库存后期，下半年有望逐步迎来周期拐点。政策上，流动性预计将维持宽松，进一步宽松动作或可期待，财政政策亦边际加码。

策略上，下半年将维持精选个券，适度控制仓位，等待市场预期较弱时的配置时机，重点关注政策发力、结构性复苏、新兴科技等方向。

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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,191,539.49	204,839,439.26
结算备付金		440,495.10	-
存出保证金		38,189.07	-

交易性金融资产	6.4.7.2	251,089,008.04	2,355,845.79
其中：股票投资		10,257,244.00	-
基金投资		-	-
债券投资		240,831,764.04	2,355,845.79
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	9,000,000.00	75,735,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		5,718,084.91	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,506.70	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		267,478,823.31	282,930,285.05
负债和净资产	**附注号**	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
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		51,060,245.00	-
应付清算款		4,761,268.78	78,091,975.54
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		138,893.64	8,978.64
应付托管费		26,042.56	1,683.50
应付销售服务费		44,696.69	2,883.58
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11,830.22	0.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	132,877.93	-
负债合计		56,175,854.82	78,105,521.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	207,448,019.03	204,822,770.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	3,854,949.46	1,992.46
净资产合计		211,302,968.49	204,824,763.18
负债和净资产总计		267,478,823.31	282,930,285.05

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.0186元，基金份额总额207,448,019.03份。其中A类基金份额净值1.0199元，份额总额73,845,968.17份；C类基金份额净值1.0179元，份额总额133,602,050.86份。

6.2 利润表

会计主体：永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
一、营业总收入		5,769,166.99
1.利息收入		144,609.37
其中：存款利息收入	6.4.7.9	88,015.75
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		56,593.62

证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,383,516.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	797,206.12
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	5,454,049.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	132,261.40
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-758,959.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、营业总支出		1,961,932.71
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	823,601.72
2．托管费	6.4.10.2.2	154,425.34
3．销售服务费	6.4.10.2.3	264,418.76
4. 投资顾问费		-
5．利息支出		617,633.94
其中：卖出回购金融资产支出		617,633.94
6．信用减值损失	6.4.7.18	-
7．税金及附加		11,352.20
8．其他费用	6.4.7.19	90,500.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,807,234.28
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,807,234.28

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,807,234.28

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	204,822,770.72	-	1,992.46	204,824,763.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	204,822,770.72	-	1,992.46	204,824,763.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,625,248.31	-	3,852,957.00	6,478,205.31
（一）、综合收益总额	-	-	3,807,234.28	3,807,234.28
（二）、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）	2,625,248.31	-	45,722.72	2,670,971.03
其中：1.基金申	2,625,248.31	-	45,722.72	2,670,971.03

购款				
2.基金赎回款	-	-	-	-
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	207,448,019.03	-	3,854,949.46	211,302,968.49

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	汪成杰	虞俏依
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

永赢合嘉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[2022]2713号《关于准予永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人永赢基金管理有限公司自2022年12月7日至2022年12月27日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2022）验字第61090672_B21号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2022年12月29日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币204,789,640.85元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币33,129.87元，以上实收基金（本息）合计为人民币204,822,770.72元，折合204,822,770.72基金份额。其中A类基金份额73,260,583.13份，C类基金份额131,562,187.59份。本基金

的基金管理人及注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、信用衍生品、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:股票资产和可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的比例合计占基金资产的比例为10%-30%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%。每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。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：85%×中债-综合指数（全价）收益率+13%×沪深300指数收益率+2%×恒生指数收益率（按估值汇率折算）。

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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2023年6月30日的财务状况以及自2023年1月1日起至2023年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2023年1月1日起至2023年6月30日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用

风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

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

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

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

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

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本

基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红，通过红利再投资所得基金份额的最短持有期起始日与该认/申购份额最短持有期起始日相同；

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

(4) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 对于收益分配方式为红利再投资的基金份额，每份基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的最短持有期到期日，与该原份额的最短持有期到期日一致；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。?

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

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。

6.4.6.6 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。

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 2023年06月30日
活期存款	1,191,539.49
等于：本金	1,191,054.17
加：应计利息	485.32
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,191,539.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		11,710,719.15	-	10,257,244.00	-1,453,475.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	50,683,398.82	215,520.39	50,945,554.93	46,635.72
	银行间市场	186,215,177.96	3,024,209.11	189,886,209.11	646,822.04
	合计	236,898,576.78	3,239,729.50	240,831,764.04	693,457.76
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		248,609,295.93	3,239,729.50	251,089,008.04	-760,017.39

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 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	9,000,000.00	-

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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-
应付交易费用	48,577.18
其中：交易所市场	38,261.29
银行间市场	10,315.89
应付利息	-
预提费用	84,300.75
合计	132,877.93

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 永赢合嘉一年持有混合A

金额单位：人民币元

项目 (永赢合嘉一年持有混合A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,260,583.13	73,260,583.13
本期申购	585,385.04	585,385.04
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	73,845,968.17	73,845,968.17

6.4.7.7.2 永赢合嘉一年持有混合C

金额单位：人民币元

项目 (永赢合嘉一年持有混合C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	131,562,187.59	131,562,187.59
本期申购	2,039,863.27	2,039,863.27
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	133,602,050.86	133,602,050.86

注: 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 永赢合嘉一年持有混合A

单位：人民币元

项目 (永赢合嘉一年持有混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,122.57	-378.53	1,744.04
本期利润	1,730,291.04	-273,072.59	1,457,218.45
本期基金份额交易产生的变动数	10,379.53	78.76	10,458.29
其中：基金申购款	10,379.53	78.76	10,458.29
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,742,793.14	-273,372.36	1,469,420.78

6.4.7.8.2 永赢合嘉一年持有混合C

单位：人民币元

项目 (永赢合嘉一年持有混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	928.18	-679.76	248.42
本期利润	2,835,902.34	-485,886.51	2,350,015.83
本期基金份额交易产生的变动数	42,777.60	-7,513.17	35,264.43
其中：基金申购款	42,777.60	-7,513.17	35,264.43
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,879,608.12	-494,079.44	2,385,528.68

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	55,562.76
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	32,304.45
其他	148.54
合计	88,015.75

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	48,648,499.19
减：卖出股票成本总额	47,716,183.57
减：交易费用	135,109.50

买卖股票差价收入	797,206.12

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	3,902,843.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,551,205.72
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	5,454,049.20

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	216,518,800.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	213,010,700.72
减：应计利息总额	1,942,538.39
减：交易费用	14,355.20
买卖债券差价收入	1,551,205.72

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	132,261.40
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	132,261.40

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-758,959.10
——股票投资	-1,453,475.15
——债券投资	694,516.05
——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	-758,959.10

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	49,588.57
证券出借违约金	-
账户维护费	6,000.00
其他	200.00
合计	90,500.75

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、基金注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司("平安银行")	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 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	823,601.72
其中：支付销售机构的客户维护费	396,541.73

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金管理费年费率/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 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	154,425.34

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：
H=E×基金托管费年费率/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 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢合嘉一年持有混合A	永赢合嘉一年持有混合C	合计
永赢基金	0.00	21.72	21.72
平安银行	0.00	212,291.17	212,291.17
宁波银行	0.00	2,303.76	2,303.76
合计	0.00	214,616.65	214,616.65

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%，销售服务费按前一日C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×C类基金销售服务费年费率/当年天数
H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费
E为C类基金份额前一日的基金资产净值
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

本基金本报告期未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。

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。

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未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 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行	1,191,539.49	55,562.76

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未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——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023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

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。

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2023年6月30日止，本基金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人民币51,060,245.00元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102100654	21青岛地铁MTN001	2023-07-03	101.61	100,000	10,160,699.45
102100702	21杭州交投MTN001	2023-07-03	103.44	100,000	10,344,125.68
102101830	21诚通控股MTN004	2023-07-03	103.38	37,000	3,824,957.62
102103192	21长沙经开MTN002	2023-07-03	102.50	100,000	10,250,419.18
102280012	22溧水城建MTN001	2023-07-03	102.39	100,000	10,239,013.70
102280609	22武侯资本MTN001	2023-07-03	101.80	100,000	10,180,472.13
合计				537,000	54,999,687.76

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023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及业务部门的自控和互控的第一道防线，合规风控部门监督管理的第二道防线，审计部事后检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险控制监督管理的第五道防线。

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

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	12,134,311.23	-

合计	12,134,311.23	-

注：1、国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级；
2、上年度末，本基金未持有短期债券投资。

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

本期末及上年度末，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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	106,558,191.70	-
AAA以下	122,139,261.11	2,355,845.79
未评级	-	-
合计	228,697,452.81	2,355,845.79

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制的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注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 2023 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	1,191,539.49	-	-	-	-	-	1,191,539.49
结算备付金	440,495.10	-	-	-	-	-	440,495.10
存出保证金	38,189.07	-	-	-	-	-	38,189.07
交易性金融资产	-	-	52,866,585.65	140,012,527.35	47,952,651.04	10,257,244.00	251,089,008.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	9,000,000.00	-	-	-	-	-	9,000,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-	5,718,084.91	5,718,084.91
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,506.70	1,506.70
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,670,223.66	-	52,866,585.65	140,012,527.35	47,952,651.04	15,976,835.61	267,478,823.31
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	51,060,245.00	-	-	-	-	-	51,060,245.00
应付清算款	-	-	-	-	-	4,761,268.78	4,761,268.78
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	138,893.64	138,893.64
应付托管费	-	-	-	-	-	26,042.56	26,042.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	44,696.69	44,696.69
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	11,830.22	11,830.22
应付利	-	-	-	-	-	-	-

润							
其他负债	-	-	-	-	-	132,877.93	132,877.93
负债总计	51,060,245.00	-	-	-	-	5,115,609.82	56,175,854.82
利率敏感度缺口	-40,390,021.34	-	52,866,585.65	140,012,527.35	47,952,651.04	10,861,225.79	211,302,968.49
上年度末 2022 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	204,839,439.26	-	-	-	-	-	204,839,439.26
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,333,811.27	1,022,034.52	-	2,355,845.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	75,735,000.00	-	-	-	-	-	75,735,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	280,574,439.26	-	-	1,333,811.27	1,022,034.52	-	282,930,285.05
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	78,091,975.54	78,091,975.54
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,978.64	8,978.64
应付托管费	-	-	-	-	-	1,683.50	1,683.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,883.58	2,883.58
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.61	0.61
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	78,105,521.87	78,105,521.87
利率敏感度缺口	280,574,439.26	-	-	1,333,811.27	1,022,034.52	-78,105,521.87	204,824,763.18

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-1,445,578.28	-
	市场利率平行下降50个基点	1,445,578.28	-

注：上年度末，本基金未持有债券，无重大利率风险。

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 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	10,257,244.00	4.85	-	-
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	10,257,244.00	4.85	-	-

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日

	业绩比较基准增加1%	1,463,778.44	-
	业绩比较基准减少1%	-1,463,778.44	-

注：上年度末，本基金尚处于建仓期，暂不进行分析。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 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	49,068,487.70	2,355,845.79
第二层次	202,020,520.34	-
第三层次	-	-
合计	251,089,008.04	2,355,845.79

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2023年8月28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	10,257,244.00	3.83
	其中：股票	10,257,244.00	3.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	240,831,764.04	90.04
	其中：债券	240,831,764.04	90.04
	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	9,000,000.00	3.36
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,632,034.59	0.61
8	其他各项资产	5,757,780.68	2.15
9	合计	267,478,823.31	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,239,201.00	3.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,063,072.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	985,275.00	0.47
J	金融业	969,696.00	0.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,257,244.00	4.85

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	002493	荣盛石化	166,100	1,933,404.00	0.91
2	300054	鼎龙股份	77,600	1,919,048.00	0.91
3	002120	韵达股份	111,200	1,063,072.00	0.50
4	603899	晨光股份	23,400	1,044,576.00	0.49
5	300174	元力股份	65,700	1,036,089.00	0.49
6	300454	深信服	8,700	985,275.00	0.47
7	600036	招商银行	29,600	969,696.00	0.46
8	002415	海康威视	28,400	940,324.00	0.45
9	002460	赣锋锂业	6,000	365,760.00	0.17

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	600011	华能国际	10,376,624.00	5.07
2	002493	荣盛石化	5,875,565.00	2.87
3	002352	顺丰控股	4,108,468.00	2.01
4	688508	芯朋微	3,869,207.55	1.89
5	000776	广发证券	3,689,197.00	1.80
6	300454	深信服	3,499,189.00	1.71
7	002153	石基信息	3,065,098.00	1.50
8	603899	晨光股份	2,878,261.00	1.41
9	688111	金山办公	2,222,689.85	1.09
10	002120	韵达股份	2,081,953.00	1.02
11	300054	鼎龙股份	2,079,680.00	1.02
12	688029	南微医学	2,057,761.31	1.00
13	001215	千味央厨	1,191,370.01	0.58
14	601689	拓普集团	1,049,750.00	0.51
15	002415	海康威视	1,042,280.00	0.51

16	601628	中国人寿	1,041,212.00	0.51
17	600036	招商银行	1,040,736.00	0.51
18	300750	宁德时代	1,040,000.00	0.51
19	600030	中信证券	1,039,922.00	0.51
20	603486	科沃斯	1,038,200.00	0.51

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	600011	华能国际	11,370,042.00	5.55
2	002352	顺丰控股	4,167,267.00	2.03
3	688508	芯朋微	3,997,281.39	1.95
4	002493	荣盛石化	3,730,022.00	1.82
5	000776	广发证券	3,678,746.00	1.80
6	002153	石基信息	3,022,807.00	1.48
7	688029	南微医学	2,275,111.70	1.11
8	688111	金山办公	2,159,422.50	1.05
9	300454	深信服	1,926,495.00	0.94
10	603899	晨光股份	1,527,557.00	0.75
11	001215	千味央厨	1,227,811.00	0.60
12	601991	大唐发电	1,128,913.00	0.55
13	603486	科沃斯	1,122,300.00	0.55
14	601628	中国人寿	1,069,820.00	0.52
15	300750	宁德时代	1,043,640.00	0.51
16	601689	拓普集团	1,037,743.00	0.51
17	603195	公牛集团	1,027,297.60	0.50
18	600030	中信证券	929,773.00	0.45
19	300820	英杰电气	797,454.00	0.39
20	002120	韵达股份	588,336.00	0.29

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	59,426,902.72
卖出股票收入（成交）总额	48,648,499.19

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。

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	12,134,311.23	5.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,007,115.61	19.88
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,238,889.32	2.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	143,640,204.18	67.98
7	可转债(可交换债)	38,811,243.70	18.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	240,831,764.04	113.97

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	019688	22国债23	120,000	12,134,311.23	5.74
2	2028025	20浦发银行二级01	100,000	10,568,608.77	5.00
3	101901018	19嘉兴现代M	100,000	10,566,950.14	5.00

		TN001			
4	1928022	19兴业银行二级01	100,000	10,521,153.42	4.98
5	2128030	21交通银行二级	100,000	10,472,600.00	4.96

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

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兴业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年受到行政处罚，处罚金额分别合计为600万元、20351万元、500万元、933万元。

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	38,189.07
2	应收清算款	5,718,084.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,506.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,757,780.68

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	113627	太平转债	6,270,658.68	2.97
2	110081	闻泰转债	6,102,592.34	2.89
3	123101	拓斯转债	5,970,848.45	2.83
4	113061	拓普转债	3,814,436.51	1.81
5	123092	天壕转债	3,512,358.13	1.66
6	113056	重银转债	2,898,740.28	1.37
7	127053	豪美转债	2,300,447.54	1.09
8	128138	侨银转债	2,090,542.08	0.99
9	113636	甬金转债	1,276,360.03	0.60
10	113633	科沃转债	1,162,642.62	0.55
11	123156	博汇转债	1,070,657.37	0.51
12	123142	申昊转债	1,060,694.04	0.50
13	123161	强联转债	1,060,441.55	0.50

14	123128	首华转债	219,824.08	0.10

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
永赢合嘉一年持有混合A	505	146,229.64	10,006,200.00	13.5501%	63,839,768.17	86.4499%
永赢合嘉一年持有混合C	1,065	125,447.94	4,487,892.46	3.3591%	129,114,158.40	96.6409%
合计	1,570	132,132.50	14,494,092.46	6.9869%	192,953,926.57	93.0131%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	永赢合嘉一年持有混合A	14,670.01	0.02%
	永赢合嘉一年持有混合C	301,093.39	0.23%
	合计	315,763.40	0.15%

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	永赢合嘉一年持有混合A	0
	永赢合嘉一年持有混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢合嘉一年持有混合A	0
	永赢合嘉一年持有混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢合嘉一年持有混合A	永赢合嘉一年持有混合C
基金合同生效日(2022年12月29日)基金份额总额	73,260,583.13	131,562,187.59
本报告期期初基金份额总额	73,260,583.13	131,562,187.59
本报告期基金总申购份额	585,385.04	2,039,863.27
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	73,845,968.17	133,602,050.86

§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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

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	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	佣金	占当期佣金总	

	元数量		交总额的比例		量的比例	
中信证券	2	108,075,401.91	100.00%	77,954.27	100.00%	-

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
中信证券	152,045,984.73	100.00%	481,100,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2023-02-17
2	永赢基金管理有限公司关于新增招商银行股份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	2023-03-29
3	永赢基金管理有限公司关于广州分公司办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
4	永赢基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-08
5	永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金2023年第1季	中国证监会规定媒介	2023-04-21

	度报告		

§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.中国证监会准予永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金注册的文件；

2.《永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；

3.《永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；

4.《永赢合嘉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号二十一世纪大厦21、22、23、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.

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

二〇二三年八月三十日