

永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	6
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	9
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合规守信情况的说明	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	65
7.1 期末基金资产组合情况	65
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	67
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82
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	83
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	83
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	83
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	83
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	83
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	83
7.12 投资组合报告附注	83
§8 基金份额持有人信息	85
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	85

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.....	86
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	86
§9 开放式基金份额变动.....	87
§10 重大事件揭示.....	87
10.1 基金份额持有人大会决议.....	87
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.....	87
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	87
10.4 基金投资策略的改变.....	87
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	87
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.....	87
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	88
10.8 其他重大事件.....	89
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
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.....	90
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
§12 备查文件目录.....	91
12.1 备查文件目录.....	91
12.2 存放地点.....	91
12.3 查阅方式.....	91

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金	
基金简称	永赢沪深300	
基金主代码	007538	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2019年07月09日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	448,823,085.79份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢沪深300A	永赢沪深300C
下属分级基金的交易代码	007538	007539
报告期末下属分级基金的份额总额	358,721,057.19份	90,102,028.60份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。具体主要使用股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、其他金融工具投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略和存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型证券投资基金、货币市场基金和混合型证券投资基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		永赢基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	汪成杰	郭明
	联系电话	021-20430340	(010) 66105799
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-805-8888	95588
传真		021-51690177	(010) 66105798
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		马宇晖	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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)	
	永赢沪深300A	永赢沪深300C
本期已实现收益	-6,634,767.08	-1,427,838.36
本期利润	1,636,376.43	817,669.05
加权平均基金份额本期利润	0.0047	0.0055
本期加权平均净值利润率	0.41%	0.48%
本期基金份额净值增长率	0.86%	0.81%
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	41,425,767.67	9,939,305.47
期末可供分配基金份额利润	0.1155	0.1103
期末基金资产净值	400,146,824.86	100,041,334.07
期末基金份额净值	1.1155	1.1103
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	26.80%	26.27%

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

永赢沪深300A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	2.00%	0.83%	1.10%	0.83%	0.90%	0.00%
过去三个月	-3.53%	0.78%	-4.88%	0.79%	1.35%	-0.01%
过去六个月	0.86%	0.80%	-0.69%	0.80%	1.55%	0.00%
过去一年	-11.07%	0.93%	-13.60%	0.94%	2.53%	-0.01%
过去三年	9.60%	1.13%	-7.07%	1.14%	16.67%	-0.01%
自基金合同生效起至今	26.80%	1.13%	1.40%	1.14%	25.40%	-0.01%

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*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。
永赢沪深300C

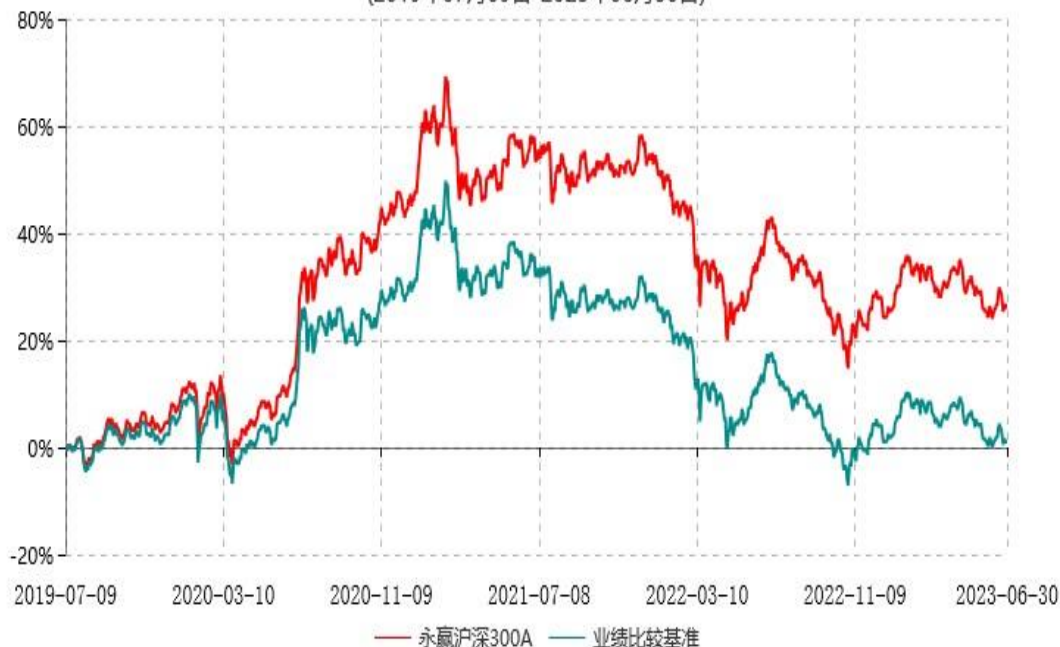
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.99%	0.83%	1.10%	0.83%	0.89%	0.00%
过去三个月	-3.55%	0.78%	-4.88%	0.79%	1.33%	-0.01%
过去六个月	0.81%	0.80%	-0.69%	0.80%	1.50%	0.00%
过去一年	-11.17%	0.93%	-13.60%	0.94%	2.43%	-0.01%
过去三年	9.26%	1.13%	-7.07%	1.14%	16.33%	-0.01%
自基金合同生效起至今	26.27%	1.13%	1.40%	1.14%	24.87%	-0.01%

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*95%+银行活期存款利率（税后）*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

永赢沪深300A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年07月09日-2023年06月30日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

永赢沪深300C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年07月09日-2023年06月30日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

永赢基金管理有限公司（以下简称“公司”）于2013年10月8日取得了中国证监会《关于核准设立永赢基金管理有限公司的批复》（证监许可[2013]1280号），随后，公司于2013年10月11日取得商务部《中华人民共和国外商投资企业批准证书》（商外资资审字[2013]008号），并于2013年11月7日在国家工商行政管理总局注册成立，此后，于2013年11月12日取得中国证监会核发的《基金管理资格证书》（编号A087），并于2017年3月14日获得中国证监会颁发的信用代码为913302007178854322的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014年8月18日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018年1月25日，公司完成增资，注册资本由人民币贰亿元增至人民币玖亿元。目前，公司的股权结构为宁波银行股份有限公司持股71.49%，Oversea-Chinese Banking Corporation Limited持股28.51%。

截止2023年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		
万纯	指数与量化投资部主管兼基金经理	2019-07-17	-	9	万纯先生，北京大学硕士，9年证券相关从业经验。曾任中国证券登记结算有限责任公司技术部基金业务组经理助理，平安基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，永赢基金管理有限公司权益投资部指数与数量投资部副总监。现任永赢基金管理有限公司指数与量化投资部主管。
刘庭宇	基金经理助理	2022-11-07	-	5	刘庭宇先生，上海财经大学金融硕士，5年证券相关从业经验。曾任鹏扬基金管理有限公司量化分析师，永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理。

注：

- 1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。
- 2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢沪深300指数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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资授权管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先、比例分配”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，分别于每季度和每年度对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，每季度对连续四个季度期间内、不同时间窗下不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现显著违反公平交易的行为。本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金坚持既定的指数化投资策略，主要采取完全复制法进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重分配投资于每只股票的具体金额，进而形成股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。报告期内，本基金根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票发生增发或配股、成份股停牌或因法律法规原因被限制投资、市场流动性不足等情况，对股票投资组合进行调整，力争基金净值增长率与标的指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢沪深300A基金份额净值为1.1155元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.86%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%；截至报告期末永赢沪深300C基金份额净值为1.1103元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.81%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年上半年，A股市场在年初快速上涨后震荡回落，整体来看小盘股强于大盘股、价值风格比成长风格占优。2023年初随着疫情防控政策优化、新兴产业规划出台及国内外人工智能应用爆火，TMT和基建板块带领市场快速上行，进入二季度后，地产、消费需求偏弱导致相关板块回调较多、市场整体也震荡回调，上半年整体呈现出以主题轮动为主的结构行情。作为大盘价值风格的代表，沪深300指数兼具规模性和流动性，指数盈利能力相对稳健。报告期内，沪深300指数下跌0.8%，中证500指数上涨2.3%，创业板指下跌5.6%。行业层面，通信、传媒行业领涨，商贸零售、房地产、美容护理行业领跌。

展望2023年下半年，国内经济复苏斜率及结构、美联储货币政策的变化将成为关键变量。随着美联储加息周期进入尾声，美元和美债利率走弱推动资金流入新兴市场；随着国内政策支持的陆续推出和落地，经济复苏节奏加快、企业盈利回升，同时宏观流动性有望维持合理充裕，目前主要宽基指数均处于历史估值中低位水平，因此对权益市场可以保持积极乐观。当前看下半年价值与成长风格或仍以轮动状态为主，行业方面可关注三条主线机会：一是受益于政策超预期和经济复苏的地产链和金融板块，二是盈利和估值有望触底回升的电子行业，三是受益经济复苏的大消费板块。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--永赢基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对永赢基金管理有限公司编制和披露的本基金2023年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢沪深300指数型发起式证券投资基金

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	15,547,599.55	32,176,641.42
结算备付金		1,926,152.32	1,917,214.20
存出保证金		792,895.04	768,524.63
交易性金融资产	6.4.7.2	481,750,446.92	505,761,091.79
其中：股票投资		466,484,156.51	499,719,954.80
基金投资		-	-
债券投资		15,266,290.41	6,041,136.99
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	-	-
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		634,466.94	-
应收股利		26,967.65	-
应收申购款		2,216,549.62	8,818,793.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	9,428.39	505.14
资产总计		502,904,506.43	549,442,770.78
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		-	4,500,000.00
应付清算款		-	7,636,728.23
应付赎回款		2,218,067.85	3,231,164.28
应付管理人报酬		68,653.29	78,342.58
应付托管费		22,884.42	26,114.20
应付销售服务费		10,182.11	16,473.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,431.32	44.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	395,128.51	589,644.67
负债合计		2,716,347.50	16,078,511.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	448,823,085.79	482,948,637.03
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	51,365,073.14	50,415,621.88
净资产合计		500,188,158.93	533,364,258.91
负债和净资产总计		502,904,506.43	549,442,770.78

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值1.1144元，基金份额总额448,823,085.79份。其中A类基金份额净值1.1155元，份额总额358,721,057.19份；C类基金份额净值1.1103元，份额总额90,102,028.60份。

6.2 利润表

会计主体：永赢沪深300指数型发起式证券投资基金

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	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		3,263,687.79	-48,369,517.71
1.利息收入		174,122.46	98,985.17

其中：存款利息收入	6.4.7.9	57,036.76	81,397.33
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		-	-
证券出借利息收入		117,085.70	17,587.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,436,395.46	-21,722,139.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-14,226,328.13	-25,542,592.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	120,940.12	-
资产支持证券投资	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	580,176.78	-1,201,298.14
股利收益	6.4.7.15	6,088,815.77	5,021,750.78
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	10,516,650.92	-26,757,003.33
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	9,309.87	10,640.30
减：二、营业总支出		809,642.31	755,653.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	421,325.16	421,532.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	140,441.69	140,510.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	85,259.08	30,510.88

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,751.66	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,751.66	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		2,511.27	63.35
8. 其他费用	6.4.7.19	158,353.45	163,036.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,454,045.48	-49,125,171.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,454,045.48	-49,125,171.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,454,045.48	-49,125,171.19

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：永赢沪深300指数型发起式证券投资基金

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）	482,948,637.03	-	50,415,621.88	533,364,258.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	482,948,637.03	-	50,415,621.88	533,364,258.91

资产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-34,125,551.24	-	949,451.26	-33,176,099.98
（一）、综合收益总额	-	-	2,454,045.48	2,454,045.48
（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）	-34,125,551.24	-	-1,504,594.22	-35,630,145.46
其中：1.基金申购款	417,300,987.53	-	58,930,702.46	476,231,689.99
2.基金赎回款	-451,426,538.77	-	-60,435,296.68	-511,861,835.45
（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）	448,823,085.79	-	51,365,073.14	500,188,158.93
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	362,263,377.16	-	197,406,127.56	559,669,504.72

资产（基金净值）				
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）	362,263,377.16	-	197,406,127.56	559,669,504.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	19,059,128.33	-	-35,187,086.93	-16,127,958.60
（一）、综合收益总额	-	-	-49,125,171.19	-49,125,171.19
（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）	19,059,128.33	-	13,938,084.26	32,997,212.59
其中：1.基金申购款	347,461,776.87	-	130,502,270.36	477,964,047.23
2.基金赎回款	-328,402,648.54	-	-116,564,186.10	-444,966,834.64
（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）	381,322,505.49	-	162,219,040.63	543,541,546.12

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

永赢沪深300指数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[2019]853号《关于准予永赢沪深300指数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2019年7月9日生效，首次设立募集规模为168,375,498.05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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以沪深300指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。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：本基金投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

6.4.7 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	15,547,599.55
等于：本金	15,545,827.78
加：应计利息	1,771.77
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	15,547,599.55

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	506,328,719.54	-	466,484,156.51	-39,844,563.03	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	14,982,645.00	267,840.41	15,266,290.41	15,805.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,982,645.00	267,840.41	15,266,290.41	15,805.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	521,311,364.54	267,840.41	481,750,446.92	-39,828,758.03	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,139,920.00	-	-	-
--股指期货	6,139,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,139,920.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2309	沪深300股指期货2309合约	5.00	5,758,500.00	-381,420.00
合计				-381,420.00
减：可抵销 期货暂收款				-381,420.00
净额				-

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日

应收利息	-
其他应收款	9,428.39
待摊费用	-
合计	9,428.39

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	239,772.81
其中：交易所市场	239,772.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
应付指数使用费	56,176.75
合计	395,128.51

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 永赢沪深300A

金额单位：人民币元

项目 (永赢沪深300A)	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	314,689,267.55	314,689,267.55
本期申购	171,976,189.33	171,976,189.33
本期赎回（以“-”号填列）	-127,944,399.69	-127,944,399.69
本期末	358,721,057.19	358,721,057.19

6.4.7.7.2 永赢沪深300C

金额单位：人民币元

项目 (永赢沪深300C)	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	168,259,369.48	168,259,369.48
本期申购	245,324,798.20	245,324,798.20
本期赎回（以“-”号填列）	-323,482,139.08	-323,482,139.08
本期末	90,102,028.60	90,102,028.60

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 永赢沪深300A**

单位：人民币元

项目 (永赢沪深300A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	78,077,702.09	-44,729,228.31	33,348,473.78
本期利润	-6,634,767.08	8,271,143.51	1,636,376.43
本期基金份额交易产生的变动数	11,503,237.21	-5,062,319.75	6,440,917.46
其中：基金申购款	42,408,873.11	-18,069,750.67	24,339,122.44
基金赎回款	-30,905,635.90	13,007,430.92	-17,898,204.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82,946,172.22	-41,520,404.55	41,425,767.67

6.4.7.8.2 永赢沪深300C

单位：人民币元

项目 (永赢沪深300C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	40,879,575.36	-23,812,427.26	17,067,148.10
本期利润	-1,427,838.36	2,245,507.41	817,669.05
本期基金份额交易产生的变动数	-19,130,419.23	11,184,907.55	-7,945,511.68

其中：基金申购款	58,792,379.92	-24,200,799.90	34,591,580.02
基金赎回款	-77,922,799.15	35,385,707.45	-42,537,091.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,321,317.77	-10,382,012.30	9,939,305.47

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	39,144.09
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	16,995.19
其他	897.48
合计	57,036.76

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	243,651,129.18
减：卖出股票成本总额	257,275,845.85
减：交易费用	601,611.46
买卖股票差价收入	-14,226,328.13

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	120,940.12
债券投资收益——买卖债券（债转股）	-

及债券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	120,940.12

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--买卖债券差价收入。

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023年01月01日至2023年06月30日
股指期货投资收益	580,176.78
合计	580,176.78

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	6,088,815.77
其中：证券出借权益补偿收入	154,862.57
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,088,815.77

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	11,150,070.92
——股票投资	11,133,665.92
——债券投资	16,405.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-633,420.00
——权证投资	-
——股指期货合约	-633,420.00
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	10,516,650.92

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	8,009.34
基金转换费收入	1,300.53
合计	9,309.87

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,997.75
指数使用费	56,176.75
合计	158,353.45

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、基金发起人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（"工商银行"）	基金托管人
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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

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	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	421,325.16	421,532.10
其中：支付销售机构的客户维护费	62,430.75	42,392.08

注：基金管理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：

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

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。

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	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
----	-------------------------------	------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	140,441.69	140,510.67
----------------	------------	------------

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	永赢沪深300A	永赢沪深300C	合计
永赢基金	0.00	42,177.84	42,177.84
宁波银行	0.00	3,303.99	3,303.99
合计	0.00	45,481.83	45,481.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢沪深300A	永赢沪深300C	合计
永赢基金	0.00	1,587.51	1,587.51
宁波银行	0.00	1,143.59	1,143.59
合计	0.00	2,731.10	2,731.10

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0.10%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

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

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。

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。

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。

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**

永赢沪深300A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	10,000,000.00
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	0.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	2.6225%

永赢沪深300C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	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	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

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。

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		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	15,547,599.55	39,144.09	36,042,976.40	65,619.66

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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金管理人股东发行的股票宁波银行（002142.SZ）、基金托管人发行的股票工商银行(601398.SH)。于报告期末，本基金持有的宁波银行（002142.SZ）的数量为97,470，占基金净值比例为0.49%，工商银行（601398.SH）的数量为861,500，占基金净值比例为0.83%。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	105.00	2,932.65	3,468.15	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股限售	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股限售	20.68	25.49	145.00	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	177.00	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股限售	44.48	39.48	55.00	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股限售	28.84	30.78	170.00	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023-06-15	6个月	新股限售	42.45	32.97	226.00	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新股限售	41.20	42.69	262.00	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6个月	新股限售	56.50	52.93	150.00	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股限售	34.00	34.93	250.00	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	306.00	7,900.92	7,900.92	-
3012	朗威	2023	1个月内	认购	25.82	25.82	2,754	71,10	71,10	-

02	股份	-06-28	(含)	新发 证券				8.28	8.28	
3012 03	国泰 环保	2023 -03-28	6个月	新股 限售	46.13	34.40	225.00	10,37 9.25	7,74 0.00	-
3012 10	金杨 股份	2023 -06-21	6个月	新股 限售	57.88	49.17	281.00	16,26 4.28	13,81 6.77	-
3012 25	恒勃 股份	2023 -06-08	6个月	新股 限售	35.66	33.26	333.00	11,87 4.78	11,07 5.58	-
3012 32	飞沃 科技	2023 -06-08	6个月	新股 限售	72.50	58.42	165.00	11,96 2.50	9,63 9.30	-
3012 46	宏源 药业	2023 -03-10	6个月	新股 限售	50.00	30.71	602.00	30,10 0.00	18,48 7.42	-
3012 60	格力 博	2023 -01-20	6个月	新股 限售	30.85	23.63	1,003	30,94 2.55	23,70 0.89	-
3012 61	恒工 精密	2023 -06-29	6个月	新股 限售	36.90	36.90	198.00	7,30 6.20	7,30 6.20	-
3012 61	恒工 精密	2023 -06-29	1个月内 (含)	认购 新发 证券	36.90	36.90	1,775	65,49 7.50	65,49 7.50	-
3012 62	海看 股份	2023 -06-13	6个月	新股 限售	30.22	25.50	692.00	20,91 2.24	17,64 6.00	-
3012 81	科源 制药	2023 -05-26	5个月	新股 限售 -送 股	-	25.10	96.00	-	2,40 9.60	-
3012 81	科源 制药	2023 -03-28	6个月	新股 限售	44.18	25.10	241.00	10,64 7.38	6,04 9.10	-

301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股限售	38.13	31.03	752.00	28,673.76	23,334.56	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	新股限售	19.99	19.99	583.00	11,654.17	11,654.17	-
301292	海科新源	2023-06-29	1个月内(含)	认购新发证券	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股限售	29.60	71.42	333.00	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6个月	新股限售	37.40	36.07	215.00	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6个月	新股限售	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新股限售	26.80	22.32	857.00	22,967.60	19,128.24	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	新股限售	25.25	19.69	753.00	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	新股限售	32.34	31.86	650.00	21,021.00	20,709.00	-
301310	鑫宏业	2023-05-26	6个月	新股限售	67.28	65.43	409.00	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	226.00	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	新股限售	20.67	26.17	694.00	14,344.98	18,161.98	-
3013	豪江	2023	6个月	新股	13.06	20.62	642.00	8,38	13,23	-

20	智能	-06-01		限售				4.52	8.04	
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	228.00	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	新股限售	76.80	107.95	300.00	23,040.00	32,385.00	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股限售	32.60	30.37	232.00	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股限售	73.45	46.64	189.00	13,882.05	8,814.96	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	新股限售	17.55	16.75	563.00	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新股限售	50.00	48.39	190.00	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股限售	23.77	42.89	657.00	15,616.89	28,178.73	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	新股限售	71.88	92.60	134.00	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股限售	33.73	31.85	277.00	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	420.00	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023-05-0	6个月	新股限售	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-

		9								
301383	天键股份	2023-05-31	6个月	新股限售	46.16	35.72	493.00	22,756.88	17,609.96	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股限售	29.99	23.79	378.00	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股限售	58.32	45.36	307.00	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	520.00	13,873.60	13,873.60	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内(含)	认购新发证券	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股限售	53.27	40.20	362.00	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股限售	43.99	51.57	293.00	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股限售	16.24	16.95	879.00	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	新股限售	24.80	43.85	330.00	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	新股限售	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	新股限售	28.75	21.02	499.00	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新股限售	19.99	16.90	725.00	14,492.75	12,225.50	-

301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	57.66	364.00	20,988.24	20,988.24	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内(含)	认购新发证券	57.66	57.66	3,273	188,721.18	188,721.18	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	262.00	10,422.36	10,422.36	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内(含)	认购新发证券	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股限售	6.58	7.58	1,552	10,212.16	11,764.16	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	613.00	6,350.68	7,257.92	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股限售	11.66	12.26	538.00	6,273.08	6,595.88	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	160.00	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股限售	17.80	17.89	475.00	8,455.00	8,497.75	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股限售	15.90	17.09	139.00	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股限售	14.58	16.13	122.00	1,778.76	1,967.86	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	3,160	62,757.60	57,069.60	-

688334	西高院	2023-06-09	6个月	新股限售	14.16	16.21	888.00	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	新股限售	12.10	12.07	1,492	18,053.20	18,008.44	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	519.00	12,248.40	33,563.73	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	新股限售	26.66	31.50	418.00	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	新股限售	75.00	90.76	221.00	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	新股限售	5.69	5.41	6,100	34,709.00	33,001.00	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股限售	11.10	17.04	2,136	23,709.60	36,397.44	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	新股限售	32.52	42.37	402.00	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	332.00	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	新股限售	39.99	36.71	518.00	20,714.82	19,015.78	-
688507	索辰科技	2023-06-20	4个月	新股限售-送股	-	122.11	44.00	-	5,372.84	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6个月	新股限售	245.56	122.11	92.00	22,591.52	11,234.12	-

688512	慧智微	2023-05-08	6个月	新股限售	20.92	19.16	721.00	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	472.00	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股限售	152.38	135.97	191.00	29,104.58	25,970.27	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	新股限售	43.67	53.05	410.00	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	新股限售	21.17	23.50	789.00	16,703.13	18,541.50	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	新股限售	12.68	22.31	726.00	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	新股限售	30.26	25.33	646.00	19,547.96	16,336.18	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	139.00	17,486.20	16,406.17	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	新股限售	26.74	40.68	607.00	16,231.18	24,692.76	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	959.00	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	140.00	7,700.00	7,700.00	-
6886	天承	2023	1个月内	认购	55.00	55.00	1,251	68,80	68,80	-

03	科技	-06-30	(含)	新发 证券				5.00	5.00	
688620	安凯微	2023-06-15	6个月	新股 限售	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023-05-31	6个月	新股 限售	125.88	86.79	162.00	20,392.56	14,059.98	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6个月	新股 限售	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股 限售	25.28	29.87	336.00	8,494.08	10,036.32	-

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06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（单 位：股）	期末估值 总额
1	000069	华侨城 A	2023年07月03日-2023年07月03日	4.40	29,400	129,360.00

2	000100	TCL科技	2023年07月10日-2023年07月10日	3.94	110,400	434,976.00
3	000408	藏格矿业	2023年07月03日-2023年07月03日	22.57	5,600	126,392.00
4	000538	云南白药	2023年07月10日-2023年07月10日	52.48	1,000	52,480.00
5	000617	中油资本	2023年07月10日-2023年07月10日	7.23	18,500	133,755.00
6	000723	美锦能源	2023年07月10日-2023年07月10日	7.54	17,000	128,180.00
7	000733	振华科技	2023年07月10日-2023年07月10日	95.85	2,600	249,210.00
8	000876	新希望	2023年07月10日-2023年07月10日	11.68	16,600	193,888.00
9	000877	天山股份	2023年07月03日-2023年07月03日	8.14	12,500	101,750.00
10	000895	双汇发展	2023年07月03日-2023年07月03日	24.49	7,500	183,675.00

			23年07月 03日			
11	000977	浪潮信息	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	48.50	7,400	358,900.00
12	001289	龙源电力	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	22.50	1,100	24,750.00
13	001979	招商蛇口	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	13.03	6,100	79,483.00
14	002001	新和成	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	15.40	12,200	187,880.00
15	002050	三花智控	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	30.26	14,000	423,640.00
16	002074	国轩高科	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	27.62	7,800	215,436.00
17	002120	韵达股份	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	9.56	10,400	99,424.00
18	002180	纳思达	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	34.25	7,200	246,600.00

19	002202	金风科技	2023年07月10日-2023年07月10日	10.62	20,200	214,524.00
20	002230	科大讯飞	2023年07月10日-2023年07月10日	67.96	13,600	924,256.00
21	002236	大华股份	2023年07月10日-2023年07月10日	19.75	10,800	213,300.00
22	002459	晶澳科技	2023年07月03日-2023年07月03日	41.70	11,900	496,230.00
23	002555	三七互娱	2023年07月10日-2023年07月10日	34.88	11,400	397,632.00
24	002601	龙佰集团	2023年07月10日-2023年07月10日	16.50	10,500	173,250.00
25	002756	永兴材料	2023年07月10日-2023年07月10日	62.61	2,300	144,003.00
26	002812	恩捷股份	2023年07月10日-2023年07月10日	96.35	3,900	375,765.00
27	002821	凯莱英	2023年07月10日-2023年07月10日	117.86	1,700	200,362.00

			23年07月 10日			
28	002841	视源股份	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	66.84	3,100	207,204.00
29	002938	鹏鼎控股	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	24.29	4,600	111,734.00
30	300015	爱尔眼科	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	18.55	34,200	634,410.00
31	300033	同花顺	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	175.28	1,500	262,920.00
32	300433	蓝思科技	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	11.76	13,100	154,056.00
33	300661	圣邦股份	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	82.13	2,300	188,899.00
34	300763	锦浪科技	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	104.10	1,400	145,740.00
35	300919	中伟股份	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	60.25	1,900	114,475.00

36	300979	华利集团	2023年07月10日-2023年07月10日	48.74	1,100	53,614.00
37	600010	包钢股份	2023年07月10日-2023年07月10日	1.79	166,800	298,572.00
38	600031	三一重工	2023年07月03日-2023年07月03日	16.63	42,700	710,101.00
39	600061	国投资本	2023年07月03日-2023年07月03日	7.12	18,600	132,432.00
40	600111	北方稀土	2023年07月10日-2023年07月10日	23.98	16,400	393,272.00
41	600115	中国东航	2023年07月10日-2023年07月10日	4.76	50,300	239,428.00
42	600132	重庆啤酒	2023年07月03日-2023年07月03日	92.16	1,700	156,672.00
43	600346	恒力石化	2023年07月03日-2023年07月03日	14.33	5,700	81,681.00
44	600438	通威股份	2023年07月10日-2023年07月10日	34.31	17,400	596,994.00

			23年07月 10日			
45	600600	青岛啤酒	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	103.63	2,600	269,438.00
46	600606	绿地控股	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	2.75	11,800	32,450.00
47	600660	福耀玻璃	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	35.85	11,700	419,445.00
48	600732	爱旭股份	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	30.75	5,700	175,275.00
49	600741	华域汽车	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	18.46	11,300	208,598.00
50	600745	闻泰科技	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	48.90	6,200	303,180.00
51	600803	新奥股份	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	18.98	6,700	127,166.00
52	601006	大秦铁路	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	7.43	42,700	317,261.00

53	601100	恒立液压	2023年07月10日-2023年07月10日	64.33	3,900	250,887.00
54	601111	中国国航	2023年07月10日-2023年07月10日	8.24	25,600	210,944.00
55	601138	工业富联	2023年07月10日-2023年07月10日	25.20	29,100	733,320.00
56	601216	君正集团	2023年07月03日-2023年07月03日	4.10	15,700	64,370.00
57	601236	红塔证券	2023年07月10日-2023年07月10日	7.45	6,900	51,405.00
58	601390	中国中铁	2023年07月03日-2023年07月03日	7.58	10,900	82,622.00
59	601615	明阳智能	2023年07月10日-2023年07月10日	16.88	11,600	195,808.00
60	601628	中国人寿	2023年07月10日-2023年07月10日	34.96	12,200	426,512.00
61	601689	拓普集团	2023年07月10日-2023年07月10日	80.70	3,200	258,240.00

			23年07月 10日			
62	601698	中国卫通	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	19.88	3,100	61,628.00
63	601788	光大证券	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	15.89	14,000	222,460.00
64	601799	星宇股份	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	123.60	1,000	123,600.00
65	601865	福莱特	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	38.51	3,700	142,487.00
66	601868	中国能建	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	2.34	83,700	195,858.00
67	601872	招商轮船	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	5.79	23,800	137,802.00
68	601919	中远海控	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	9.40	14,400	135,360.00
69	601988	中国银行	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	3.91	151,500	592,365.00

70	601995	中金公司	2023年07月03日-2023年07月03日	35.52	6,300	223,776.00
71	601998	中信银行	2023年07月03日-2023年07月03日	5.98	22,000	131,560.00
72	603019	中科曙光	2023年07月10日-2023年07月10日	50.90	8,600	437,740.00
73	603185	弘元绿能	2023年07月10日-2023年07月10日	74.55	1,500	111,825.00
74	603260	合盛硅业	2023年07月10日-2023年07月10日	70.02	2,300	161,046.00
75	603799	华友钴业	2023年07月10日-2023年07月10日	45.91	9,300	426,963.00
76	603806	福斯特	2023年07月10日-2023年07月10日	37.19	4,800	178,512.00
77	603993	洛阳钼业	2023年07月10日-2023年07月10日	5.33	51,900	276,627.00
78	605117	德业股份	2023年07月03日-2023年07月03日	149.55	1,200	179,460.00

			23年07月 03日			
79	688005	容百科技	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	54.02	2,300	124,246.00
80	688008	澜起科技	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	57.42	5,700	327,294.00
81	688036	传音控股	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	147.00	2,100	308,700.00
82	688065	凯赛生物	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	62.26	1,200	74,712.00
83	688111	金山办公	2023年07 月03日-20 23年07月 03日	472.22	1,300	613,886.00
84	688223	晶科能源	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	14.06	12,700	178,562.00
85	688363	华熙生物	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	89.16	1,400	124,824.00
86	688561	奇安信	2023年07 月10日-20 23年07月 10日	51.81	1,700	88,077.00

合计					1,405,700	20,697,596.00
----	--	--	--	--	-----------	---------------

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

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，使本基金紧密跟踪标的指数。

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	上年度末
--------	-----	------

	2023年06月30日	2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	15,266,290.41	6,041,136.99
合计	15,266,290.41	6,041,136.99

注：国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均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

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

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	15,547,599.55	-	-	-	-	-	15,547,599.55
结算备付金	1,926,152.32	-	-	-	-	-	1,926,152.32
存出保	792,895.04	-	-	-	-	-	792,895.04

永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金 2023 年中期报告

证金							
交易性金融资产	14,760,694.11	-	505,596.30	-	-	466,484,156.51	481,750,446.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	634,466.94	634,466.94
应收股利	-	-	-	-	-	26,967.65	26,967.65
应收申购款	-	-	-	-	-	2,216,549.62	2,216,549.62
其他资产	-	-	-	-	-	9,428.39	9,428.39
资产总计	33,027,341.02	-	505,596.30	-	-	469,371,569.11	502,904,506.43
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,218,067.85	2,218,067.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	68,653.29	68,653.29
应付托管费	-	-	-	-	-	22,884.42	22,884.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,182.11	10,182.11
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1,431.32	1,431.32
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	395,128.51	395,128.51
负债总计	-	-	-	-	-	2,716,347.50	2,716,347.50
利率敏	33,027,341.02	-	505,596.30	-	-	466,655,221.61	500,188,158.93

感度缺口							
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	32,176,641.42	-	-	-	-	-	32,176,641.42
结算备付金	1,917,214.20	-	-	-	-	-	1,917,214.20
存出保证金	65,768.63	-	-	-	-	702,756.00	768,524.63
交易性金融资产	-	-	6,041,136.99	-	-	499,719,954.80	505,761,091.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	8,818,793.60	8,818,793.60
其他资产	-	-	-	-	-	505.14	505.14
资产总计	34,159,624.25	-	6,041,136.99	-	-	509,242,009.54	549,442,770.78
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	4,500,000.00	-	-	-	-	-	4,500,000.00
应付清算款	-	-	-	-	-	7,636,728.23	7,636,728.23
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,231,164.28	3,231,164.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	78,342.58	78,342.58
应付托管费	-	-	-	-	-	26,114.20	26,114.20
应付销	-	-	-	-	-	16,473.47	16,473.47

售服务费							
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	44.44	44.44
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	589,644.67	589,644.67
负债总计	4,500,000.00	-	-	-	-	11,578,511.87	16,078,511.87
利率敏感度缺口	29,659,624.25	-	6,041,136.99	-	-	497,663,497.67	533,364,258.91

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	-3,771.10	-15,951.62
	市场利率平行下降50个基点	3,771.10	15,951.62

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	上年度末
----	-----	------

	2023年06月30日		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	466,484,156.51	93.26	499,719,954.80	93.69
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	466,484,156.51	93.26	499,719,954.80	93.69

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%	4,975,005.81	5,292,734.10
	业绩比较基准减少1%	-4,975,005.81	-5,292,734.10

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 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	464,450,014.81	497,762,537.70
第二层次	16,095,535.85	6,041,136.99
第三层次	1,204,896.26	1,957,417.10
合计	481,750,446.92	505,761,091.79

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	466,484,156.51	92.76
	其中：股票	466,484,156.51	92.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,266,290.41	3.04
	其中：债券	15,266,290.41	3.04
	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	-	-
	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	17,473,751.87	3.47
8	其他各项资产	3,680,307.64	0.73
9	合计	502,904,506.43	100.00

注：本基金通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为人民币20,697,596.00元，占期末基金资产净值的比例为4.14%。

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（指数投资）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	5,199,134.70	1.04
B	采矿业	18,101,603.24	3.62

C	制造业	262,369,046.97	52.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,852,001.75	2.77
E	建筑业	11,007,713.20	2.20
F	批发和零售业	1,546,344.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	14,464,413.89	2.89
H	住宿和餐饮业	474,208.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,142,078.91	4.63
J	金融业	95,117,870.34	19.02
K	房地产业	6,967,002.40	1.39
L	租赁和商务服务业	4,355,337.75	0.87
M	科学研究和技术服务业	4,538,188.92	0.91
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	2,662,010.30	0.53
R	文化、体育和娱乐业	631,174.50	0.13
S	综合	-	-
	合计	464,428,128.87	92.85

7.2.2 报告期末（积极投资）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	1,840,181.81	0.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,971.39	0.00
F	批发和零售业	36,204.21	0.01

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	109,282.10	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	23,210.79	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,056,027.64	0.41

7.2.3 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股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	15,400	26,041,400.00	5.21
2	300750	宁德时代	64,880	14,843,895.20	2.97
3	601318	中国平安	266,294	12,356,041.60	2.47
4	600036	招商银行	304,100	9,962,316.00	1.99

5	000858	五粮液	47,786	7,816,356.02	1.56
6	000333	美的集团	120,800	7,117,536.00	1.42
7	002594	比亚迪	22,300	5,759,421.00	1.15
8	601166	兴业银行	357,300	5,591,745.00	1.12
9	600900	长江电力	240,600	5,307,636.00	1.06
10	600276	恒瑞医药	109,698	5,254,534.20	1.05
11	600030	中信证券	239,970	4,746,606.60	0.95
12	601899	紫金矿业	404,800	4,602,576.00	0.92
13	300059	东方财富	312,063	4,431,294.60	0.89
14	600887	伊利股份	156,433	4,430,182.56	0.89
15	601012	隆基绿能	149,194	4,277,391.98	0.86
16	601398	工商银行	861,500	4,152,430.00	0.83
17	600309	万华化学	46,300	4,066,992.00	0.81
18	000651	格力电器	110,900	4,048,959.00	0.81
19	002475	立讯精密	122,768	3,983,821.60	0.80
20	601328	交通银行	675,000	3,915,000.00	0.78
21	002415	海康威视	115,300	3,817,583.00	0.76
22	000568	泸州老窖	18,100	3,793,217.00	0.76
23	000725	京东方 A	922,800	3,774,252.00	0.75
24	000063	中兴通讯	78,400	3,570,336.00	0.71
25	300760	迈瑞医疗	11,900	3,567,620.00	0.71
26	601816	京沪高铁	603,500	3,174,410.00	0.63
27	603259	药明康德	50,532	3,148,648.92	0.63
28	002230	科大讯飞	45,535	3,094,558.60	0.62
29	300274	阳光电源	25,600	2,985,728.00	0.60
30	600028	中国石化	467,600	2,973,936.00	0.59
31	601668	中国建筑	515,400	2,958,396.00	0.59
32	300124	汇川技术	45,842	2,943,514.82	0.59
33	002714	牧原股份	67,264	2,835,177.60	0.57
34	601288	农业银行	784,200	2,768,226.00	0.55
35	002352	顺丰控股	60,146	2,711,983.14	0.54

36	000001	平安银行	238,800	2,681,724.00	0.54
37	601888	中国中免	24,075	2,661,009.75	0.53
38	002129	TCL中环	79,575	2,641,890.00	0.53
39	000792	盐湖股份	133,614	2,561,380.38	0.51
40	601088	中国神华	81,100	2,493,825.00	0.50
41	002142	宁波银行	97,470	2,465,991.00	0.49
42	601138	工业富联	97,500	2,457,000.00	0.49
43	600031	三一重工	146,100	2,429,643.00	0.49
44	688981	中芯国际	48,007	2,425,313.64	0.48
45	300498	温氏股份	128,826	2,363,957.10	0.47
46	000002	万科 A	167,700	2,351,154.00	0.47
47	600048	保利发展	176,500	2,299,795.00	0.46
48	600016	民生银行	610,300	2,288,625.00	0.46
49	600406	国电南瑞	98,812	2,282,557.20	0.46
50	600438	通威股份	66,300	2,274,753.00	0.45
51	600050	中国联通	468,800	2,250,240.00	0.45
52	600809	山西汾酒	11,973	2,215,843.11	0.44
53	688111	金山办公	4,665	2,202,906.30	0.44
54	600837	海通证券	237,500	2,189,750.00	0.44
55	601601	中国太保	84,200	2,187,516.00	0.44
56	600690	海尔智家	93,100	2,185,988.00	0.44
57	601728	中国电信	381,100	2,145,593.00	0.43
58	600919	江苏银行	290,530	2,135,395.50	0.43
59	300015	爱尔眼科	114,786	2,129,280.30	0.43
60	600089	特变电工	95,500	2,128,695.00	0.43
61	600436	片仔癀	7,400	2,119,064.00	0.42
62	600000	浦发银行	288,400	2,088,016.00	0.42
63	601857	中国石油	278,700	2,081,889.00	0.42
64	600941	中国移动	22,200	2,071,260.00	0.41
65	002371	北方华创	6,500	2,064,725.00	0.41
66	601988	中国银行	517,000	2,021,470.00	0.40

67	603501	韦尔股份	20,407	2,000,702.28	0.40
68	002304	洋河股份	14,800	1,943,980.00	0.39
69	601766	中国中车	299,000	1,943,500.00	0.39
70	603288	海天味业	40,982	1,920,006.70	0.38
71	601390	中国中铁	252,700	1,915,466.00	0.38
72	600905	三峡能源	352,000	1,890,240.00	0.38
73	300014	亿纬锂能	30,100	1,821,050.00	0.36
74	600150	中国船舶	54,900	1,806,759.00	0.36
75	000938	紫光股份	56,339	1,794,397.15	0.36
76	002466	天齐锂业	25,500	1,782,705.00	0.36
77	601688	华泰证券	126,461	1,741,367.97	0.35
78	603986	兆易创新	16,384	1,740,800.00	0.35
79	601225	陕西煤业	95,400	1,735,326.00	0.35
80	002027	分众传媒	248,800	1,694,328.00	0.34
81	002459	晶澳科技	40,628	1,694,187.60	0.34
82	002460	赣锋锂业	27,720	1,689,811.20	0.34
83	601169	北京银行	363,300	1,682,079.00	0.34
84	688012	中微公司	10,656	1,667,131.20	0.33
85	000338	潍柴动力	133,600	1,664,656.00	0.33
86	600570	恒生电子	37,388	1,655,914.52	0.33
87	601985	中国核电	232,000	1,635,600.00	0.33
88	600104	上汽集团	114,900	1,628,133.00	0.33
89	002050	三花智控	52,902	1,600,814.52	0.32
90	000625	长安汽车	122,262	1,580,847.66	0.32
91	002049	紫光国微	16,820	1,568,465.00	0.31
92	601211	国泰君安	110,800	1,550,092.00	0.31
93	600111	北方稀土	62,200	1,491,556.00	0.30
94	601919	中远海控	156,290	1,469,126.00	0.29
95	603019	中科曙光	28,860	1,468,974.00	0.29
96	000100	TCL科技	368,890	1,453,426.60	0.29
97	603799	华友钴业	31,510	1,446,624.10	0.29

98	601628	中国人寿	40,900	1,429,864.00	0.29
99	002179	中航光电	31,248	1,417,096.80	0.28
100	600660	福耀玻璃	39,300	1,408,905.00	0.28
101	601229	上海银行	244,500	1,405,875.00	0.28
102	601818	光大银行	456,100	1,400,227.00	0.28
103	600585	海螺水泥	58,900	1,398,286.00	0.28
104	002812	恩捷股份	14,400	1,387,440.00	0.28
105	600009	上海机场	30,500	1,385,310.00	0.28
106	600893	航发动力	32,600	1,377,676.00	0.28
107	002271	东方雨虹	49,650	1,353,459.00	0.27
108	601989	中国重工	279,900	1,349,118.00	0.27
109	601658	邮储银行	273,178	1,335,840.42	0.27
110	002555	三七互娱	38,200	1,332,416.00	0.27
111	300122	智飞生物	29,500	1,303,900.00	0.26
112	600958	东方证券	128,444	1,245,906.80	0.25
113	600999	招商证券	91,300	1,238,941.00	0.25
114	000977	浪潮信息	25,400	1,231,900.00	0.25
115	600019	宝钢股份	218,600	1,228,532.00	0.25
116	600760	中航沈飞	27,076	1,218,420.00	0.24
117	002709	天赐材料	28,400	1,169,796.00	0.23
118	300896	爱美客	2,600	1,156,870.00	0.23
119	300316	晶盛机电	16,200	1,148,580.00	0.23
120	688036	传音控股	7,787	1,144,689.00	0.23
121	688599	天合光能	26,685	1,137,047.85	0.23
122	688008	澜起科技	19,468	1,117,852.56	0.22
123	600426	华鲁恒升	36,490	1,117,688.70	0.22
124	601186	中国铁建	113,000	1,113,050.00	0.22
125	601360	三六零	87,900	1,102,266.00	0.22
126	600584	长电科技	34,900	1,087,833.00	0.22
127	601006	大秦铁路	145,900	1,084,037.00	0.22
128	000661	长春高新	7,905	1,077,451.50	0.22

129	601600	中国铝业	195,300	1,072,197.00	0.21
130	000776	广发证券	72,700	1,069,417.00	0.21
131	002410	广联达	32,780	1,065,022.20	0.21
132	002920	德赛西威	6,800	1,059,508.00	0.21
133	300142	沃森生物	39,600	1,047,420.00	0.21
134	600745	闻泰科技	21,400	1,046,460.00	0.21
135	002241	歌尔股份	58,876	1,045,049.00	0.21
136	600547	山东黄金	44,388	1,042,230.24	0.21
137	601377	兴业证券	169,920	1,039,910.40	0.21
138	600588	用友网络	50,670	1,038,735.00	0.21
139	601939	建设银行	165,000	1,032,900.00	0.21
140	000166	申万宏源	221,300	1,022,406.00	0.20
141	601009	南京银行	126,940	1,015,520.00	0.20
142	600011	华能国际	108,300	1,002,858.00	0.20
143	600010	包钢股份	557,700	998,283.00	0.20
144	001979	招商蛇口	76,200	992,886.00	0.20
145	000596	古井贡酒	4,000	989,520.00	0.20
146	300450	先导智能	26,900	972,973.00	0.19
147	600085	同仁堂	16,900	972,764.00	0.19
148	601669	中国电建	169,300	971,782.00	0.19
149	300408	三环集团	32,900	965,615.00	0.19
150	002311	海大集团	20,535	961,859.40	0.19
151	600196	复星医药	31,100	960,990.00	0.19
152	601800	中国交建	87,200	951,352.00	0.19
153	603659	璞泰来	24,845	949,575.90	0.19
154	000963	华东医药	21,600	936,792.00	0.19
155	300033	同花顺	5,300	928,984.00	0.19
156	000538	云南白药	17,680	927,846.40	0.19
157	603993	洛阳钼业	173,900	926,887.00	0.19
158	600886	国投电力	73,255	926,675.75	0.19
159	000768	中航西飞	34,300	917,525.00	0.18

160	600845	宝信软件	17,750	901,877.50	0.18
161	600600	青岛啤酒	8,700	901,581.00	0.18
162	300782	卓胜微	9,220	890,928.60	0.18
163	002252	上海莱士	116,100	871,911.00	0.17
164	601689	拓普集团	10,800	871,560.00	0.17
165	002493	荣盛石化	74,508	867,273.12	0.17
166	600926	杭州银行	72,995	857,691.25	0.17
167	000733	振华科技	8,900	853,065.00	0.17
168	601100	恒立液压	13,140	845,296.20	0.17
169	600015	华夏银行	156,200	845,042.00	0.17
170	600795	国电电力	218,800	838,004.00	0.17
171	002180	纳思达	24,405	835,871.25	0.17
172	600176	中国巨石	59,009	835,567.44	0.17
173	300347	泰格医药	12,900	832,566.00	0.17
174	600732	爱旭股份	26,920	827,790.00	0.17
175	000157	中联重科	122,100	824,175.00	0.16
176	600674	川投能源	54,700	823,235.00	0.16
177	603369	今世缘	15,400	813,120.00	0.16
178	002236	大华股份	40,700	803,825.00	0.16
179	600115	中国东航	168,300	801,108.00	0.16
180	600029	南方航空	132,400	798,372.00	0.16
181	000425	徐工机械	115,900	784,643.00	0.16
182	601066	中信建投	31,900	771,980.00	0.15
183	000301	东方盛虹	64,900	767,118.00	0.15
184	601995	中金公司	21,500	763,680.00	0.15
185	601633	长城汽车	30,300	762,651.00	0.15
186	300496	中科创达	7,900	761,165.00	0.15
187	601788	光大证券	47,900	761,131.00	0.15
188	601336	新华保险	20,500	753,785.00	0.15
189	601117	中国化学	90,000	745,200.00	0.15
190	600346	恒力石化	52,000	745,160.00	0.15

191	601868	中国能建	317,800	743,652.00	0.15
192	601877	正泰电器	26,500	732,725.00	0.15
193	002074	国轩高科	26,400	729,168.00	0.15
194	002202	金风科技	68,130	723,540.60	0.14
195	600741	华域汽车	38,700	714,402.00	0.14
196	601111	中国国航	85,700	706,168.00	0.14
197	002001	新和成	45,613	702,440.20	0.14
198	601618	中国中冶	175,700	697,529.00	0.14
199	688126	沪硅产业	33,349	696,994.10	0.14
200	688223	晶科能源	49,399	694,549.94	0.14
201	300454	深信服	6,100	690,825.00	0.14
202	002841	视源股份	10,300	688,452.00	0.14
203	002821	凯莱英	5,840	688,302.40	0.14
204	600989	宝丰能源	54,300	684,723.00	0.14
205	603806	福斯特	18,372	683,254.68	0.14
206	688396	华润微	13,011	681,906.51	0.14
207	600188	兖矿能源	22,700	679,184.00	0.14
208	601838	成都银行	55,200	673,992.00	0.13
209	601901	方正证券	101,500	663,810.00	0.13
210	300661	圣邦股份	8,005	657,450.65	0.13
211	601615	明阳智能	38,900	656,632.00	0.13
212	000876	新希望	55,800	651,744.00	0.13
213	600460	士兰微	21,000	635,670.00	0.13
214	688303	大全能源	15,702	635,145.90	0.13
215	300413	芒果超媒	18,450	631,174.50	0.13
216	605117	德业股份	4,220	631,101.00	0.13
217	600039	四川路桥	64,020	628,036.20	0.13
218	000895	双汇发展	25,600	626,944.00	0.13
219	603392	万泰生物	9,275	619,291.75	0.12
220	002648	卫星化学	41,320	618,147.20	0.12
221	002736	国信证券	70,800	618,084.00	0.12

222	600233	圆通速递	42,400	617,344.00	0.12
223	000786	北新建材	25,000	612,750.00	0.12
224	601607	上海医药	27,200	609,552.00	0.12
225	603260	合盛硅业	8,700	609,174.00	0.12
226	300769	德方纳米	5,460	601,855.80	0.12
227	002007	华兰生物	26,850	601,708.50	0.12
228	003816	中国广核	193,400	601,474.00	0.12
229	300207	欣旺达	36,700	598,944.00	0.12
230	300999	金龙鱼	14,600	583,854.00	0.12
231	002601	龙佰集团	35,100	579,150.00	0.12
232	300433	蓝思科技	49,000	576,240.00	0.12
233	300751	迈为股份	3,360	569,116.80	0.11
234	601238	广汽集团	54,400	566,848.00	0.11
235	600383	金地集团	77,540	559,063.40	0.11
236	300759	康龙化成	14,550	556,974.00	0.11
237	600132	重庆啤酒	6,000	552,960.00	0.11
238	601021	春秋航空	9,600	551,712.00	0.11
239	600332	白云山	17,300	551,524.00	0.11
240	600763	通策医疗	5,500	532,730.00	0.11
241	600219	南山铝业	173,300	523,366.00	0.10
242	300223	北京君正	5,900	521,029.00	0.10
243	600875	东方电气	27,400	511,010.00	0.10
244	000983	山西焦煤	55,900	508,690.00	0.10
245	300763	锦浪科技	4,800	499,680.00	0.10
246	002756	永兴材料	7,940	497,123.40	0.10
247	600362	江西铜业	25,600	485,888.00	0.10
248	000723	美锦能源	64,200	484,068.00	0.10
249	601865	福莱特	12,500	481,375.00	0.10
250	601699	潞安环能	29,200	476,544.00	0.10
251	600754	锦江酒店	11,200	474,208.00	0.09
252	600918	中泰证券	68,500	473,335.00	0.09

253	601878	浙商证券	47,800	472,264.00	0.09
254	601872	招商轮船	80,200	464,358.00	0.09
255	601319	中国人保	78,500	458,440.00	0.09
256	603290	斯达半导	2,100	451,920.00	0.09
257	601998	中信银行	75,200	449,696.00	0.09
258	000617	中油资本	62,100	448,983.00	0.09
259	600061	国投资本	62,860	447,563.20	0.09
260	000069	华侨城 A	100,300	441,320.00	0.09
261	000408	藏格矿业	19,400	437,858.00	0.09
262	603486	科沃斯	5,600	435,512.00	0.09
263	300628	亿联网络	12,340	432,763.80	0.09
264	601799	星宇股份	3,500	432,600.00	0.09
265	603833	欧派家居	4,500	431,100.00	0.09
266	600803	新奥股份	22,700	430,846.00	0.09
267	688363	华熙生物	4,786	426,719.76	0.09
268	688005	容百科技	7,841	423,570.82	0.08
269	600884	杉杉股份	27,800	420,892.00	0.08
270	300601	康泰生物	16,500	418,935.00	0.08
271	002938	鹏鼎控股	17,100	415,359.00	0.08
272	600183	生益科技	28,700	407,540.00	0.08
273	603899	晨光股份	9,100	406,224.00	0.08
274	300919	中伟股份	6,600	397,650.00	0.08
275	000708	中信特钢	24,800	392,832.00	0.08
276	601898	中煤能源	45,100	380,644.00	0.08
277	002916	深南电路	5,020	378,357.40	0.08
278	603185	弘元绿能	5,000	372,750.00	0.07
279	601881	中国银河	31,500	365,715.00	0.07
280	600018	上港集团	68,691	360,627.75	0.07
281	000877	天山股份	42,800	348,392.00	0.07
282	688561	奇安信	6,639	343,966.59	0.07
283	601216	君正集团	83,200	341,120.00	0.07

284	002120	韵达股份	35,550	339,858.00	0.07
285	002064	华峰化学	48,900	335,454.00	0.07
286	002414	高德红外	42,048	326,712.96	0.07
287	601155	新城控股	22,400	322,784.00	0.06
288	600025	华能水电	44,100	314,433.00	0.06
289	600606	绿地控股	103,000	283,250.00	0.06
290	300957	贝泰妮	3,100	275,528.00	0.06
291	603195	公牛集团	2,856	274,347.36	0.05
292	688065	凯赛生物	4,322	269,087.72	0.05
293	688187	时代电气	6,318	264,471.48	0.05
294	601698	中国卫通	10,200	202,776.00	0.04
295	601808	中海油服	14,400	199,872.00	0.04
296	000800	一汽解放	23,100	193,347.00	0.04
297	605499	东鹏饮料	1,100	190,190.00	0.04
298	300979	华利集团	3,700	180,338.00	0.04
299	601236	红塔证券	22,980	171,201.00	0.03
300	001289	龙源电力	3,600	81,000.00	0.02

7.3.2 期末积极投资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	301486	致尚科技	3,637	209,709.42	0.04
2	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
3	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
4	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
5	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
6	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
7	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
8	688249	晶合集成	3,160	57,069.60	0.01
9	688472	阿特斯	2,136	36,397.44	0.01

10	688361	中科飞测	519	33,563.73	0.01
11	688469	中芯集成	6,100	33,001.00	0.01
12	301301	川宁生物	3,640	32,614.40	0.01
13	301325	曼恩斯特	300	32,385.00	0.01
14	301358	湖南裕能	664	28,486.80	0.01
15	688531	日联科技	203	27,752.39	0.01
16	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.01
17	688582	芯动联科	607	24,692.76	0.00
18	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
19	301260	格力博	1,003	23,700.89	0.00
20	301291	明阳电气	752	23,334.56	0.00
21	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
22	688484	南芯科技	573	21,281.78	0.00
23	301307	美利信	650	20,709.00	0.00
24	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
25	301303	真兰仪表	865	19,311.12	0.00
26	688552	航天南湖	789	18,541.50	0.00
27	301246	宏源药业	602	18,487.42	0.00
28	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
29	688352	颀中科技	1,492	18,008.44	0.00
30	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
31	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
32	301419	阿莱德	392	17,324.36	0.00
33	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
34	688507	索辰科技	136	16,606.96	0.00
35	688581	安杰思	139	16,406.17	0.00
36	688570	天玛智控	646	16,363.18	0.00
37	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
38	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
39	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
40	301408	华人健康	884	14,985.85	0.00

41	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
42	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
43	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
44	688623	双元科技	162	14,059.98	0.00
45	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
46	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
47	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
48	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
49	301141	中科磁业	317	13,720.28	0.00
50	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
51	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
52	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
53	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
54	301439	泓淋电力	741	12,537.94	0.00
55	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
56	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
57	601061	中信金属	1,552	11,764.16	0.00
58	301373	凌玮科技	364	11,640.38	0.00
59	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
60	301386	未来电器	476	11,460.26	0.00
61	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
62	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
63	301281	科源制药	427	10,832.90	0.00
64	301157	华塑科技	198	10,629.42	0.00
65	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
66	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
67	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
68	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
69	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
70	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
71	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00

72	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
73	301345	涛涛车业	189	8,814.96	0.00
74	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
75	603135	中重科技	475	8,497.75	0.00
76	301203	国泰环保	243	8,384.22	0.00
77	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
78	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
79	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
80	601065	江盐集团	613	7,257.92	0.00
81	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
82	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
83	601133	柏诚股份	538	6,595.88	0.00
84	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
85	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
86	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
87	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
88	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
89	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
90	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
91	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
92	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	9,397,735.88	1.76
2	300750	宁德时代	5,636,571.00	1.06
3	601318	中国平安	5,424,799.00	1.02
4	600036	招商银行	4,475,439.00	0.84

5	000858	五粮液	3,318,936.00	0.62
6	000333	美的集团	2,650,362.00	0.50
7	601166	兴业银行	2,578,570.00	0.48
8	601899	紫金矿业	2,454,507.00	0.46
9	600900	长江电力	2,393,765.00	0.45
10	601012	隆基绿能	2,181,712.48	0.41
11	600276	恒瑞医药	2,129,822.64	0.40
12	600030	中信证券	2,119,345.00	0.40
13	300059	东方财富	2,111,806.00	0.40
14	002594	比亚迪	2,038,708.00	0.38
15	600887	伊利股份	1,929,089.00	0.36
16	600028	中国石化	1,880,060.00	0.35
17	002415	海康威视	1,783,969.00	0.33
18	600309	万华化学	1,735,061.00	0.33
19	601398	工商银行	1,729,502.00	0.32
20	000651	格力电器	1,629,631.00	0.31

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	600519	贵州茅台	11,557,405.00	2.17
2	300750	宁德时代	6,651,561.00	1.25
3	601318	中国平安	6,554,116.00	1.23
4	600036	招商银行	5,355,459.82	1.00
5	000858	五粮液	3,935,905.00	0.74
6	600900	长江电力	3,816,899.00	0.72
7	000333	美的集团	3,248,092.00	0.61
8	601166	兴业银行	3,073,813.00	0.58
9	002594	比亚迪	2,571,394.00	0.48

10	600276	恒瑞医药	2,511,119.77	0.47
11	600030	中信证券	2,484,137.97	0.47
12	300059	东方财富	2,387,411.44	0.45
13	600887	伊利股份	2,367,413.00	0.44
14	601012	隆基绿能	2,356,957.00	0.44
15	601899	紫金矿业	2,210,038.00	0.41
16	601398	工商银行	2,127,924.00	0.40
17	002415	海康威视	2,080,482.00	0.39
18	600309	万华化学	2,057,362.00	0.39
19	601328	交通银行	1,952,094.00	0.37
20	000651	格力电器	1,930,833.00	0.36

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	212,906,381.64
卖出股票收入（成交）总额	243,651,129.18

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	15,266,290.41	3.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	15,266,290.41	3.05

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	019679	22国债14	145,000	14,760,694.11	2.95
2	019688	22国债23	5,000	505,596.30	0.10

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

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。根据基金合同规定，本基金可投资于以标的指数为基础资产的股指期货，并在相关法律法规的限制下，起到配合基金日常投资管理需要，降低交易成本和跟踪误差的作用。报告期内，本基金严格遵守既定投资政策和投资目的，进行股指期货投资。

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、招商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、3883万元**。

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	792,895.04
2	应收清算款	634,466.94
3	应收股利	26,967.65
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,216,549.62
6	其他应收款	9,428.39
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,680,307.64

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	--------------	----------

1	301486	致尚科技	209,709.42	0.04	认购新发证券
2	301395	仁信新材	138,629.28	0.03	认购新发证券
3	301292	海科新源	116,421.76	0.02	认购新发证券
4	301488	豪恩汽电	104,144.04	0.02	认购新发证券
5	301202	朗威股份	79,009.20	0.02	认购新发证券

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。

58 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
永赢沪深300A	12,519	28,654.13	250,164,600.29	69.73 79%	108,556,456.90	30.262 1%
永赢沪深300C	15,882	5,673.22	10,913,457.81	12.11 23%	79,188,570.79	87.887 7%
合计	28,401	15,803.07	261,078,058.10	58.16 95%	187,745,027.69	41.830 5%

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	永赢沪深300 A	324,547.12	0.09%
	永赢沪深300 C	390,151.25	0.43%
	合计	714,698.37	0.16%

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	永赢沪深300A	0~10
	永赢沪深300C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢沪深300A	0
	永赢沪深300C	0
	合计	0

8.4 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	0.00	0.00%	10,000,000.00	2.23%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	382,277.81	0.09%	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	382,277.81	0.09%	10,000,000.00	2.23%	不少于3年

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满3年，发起份额已全部赎回。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢沪深300A	永赢沪深300C
基金合同生效日(2019年07月09日)基金份额总额	167,410,623.76	964,874.29
本报告期期初基金份额总额	314,689,267.55	168,259,369.48
本报告期基金总申购份额	171,976,189.33	245,324,798.20
减：本报告期基金总赎回份额	127,944,399.69	323,482,139.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	358,721,057.19	90,102,028.60

§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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	30,888,657.37	6.98%	22,469.46	7.02%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	202,706,004.52	45.79%	146,209.37	45.69%	-
华创证券	2	128,794,862.82	29.09%	92,899.52	29.03%	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	80,341,460.94	18.15%	58,455.81	18.27%	-

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
野村东方国际 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	499,390.0 0	5.55%	8,300,00 0.00	45.86%	-	-	-	-
华创证券	7,994,54 0.00	88.89%	7,100,00 0.00	39.23%	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	499,515.0 0	5.55%	2,700,00 0.00	14.92%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢基金管理有限公司关于新增兴业证券股份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	2023-01-05
2	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
3	永赢基金管理有限公司关于新增江苏江南农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-02-17
4	永赢基金管理有限公司关于新增杭州银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-29
5	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-30

6	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
7	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公告	中国证监会规定媒介	2023-04-08
8	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
9	永赢基金管理有限公司关于新增中国邮政储蓄银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-17
10	永赢基金管理有限公司关于新增上海基煜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	2023-05-26

§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

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	20230607 - 20230608, 20230616 - 20230630	59,927,916.73	46,902,640.11	5,430,192.52	101,400,364.32	22.59%
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。							

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沪深300指数型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2.《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4.《永赢沪深300指数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。

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