

# 永赢沪深300指数型发起式证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09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

报告送出日期:2023年10月25日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年07月01日起至2023年09月30日止。

## §2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	526,080,480.48份
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。	
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	
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	416,570,166.47份	109,510,314.01份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023年07月01日 - 2023年09月30日)	
	永赢沪深300A	永赢沪深300C
1.本期已实现收益	4,931,608.68	1,126,293.44
2.本期利润	-10,565,635.16	-2,521,212.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0272	-0.0266
4.期末基金资产净值	454,682,850.63	118,945,972.50
5.期末基金份额净值	1.0915	1.0862

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。

#### 3.2 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净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.15%	0.86%	-3.77%	0.87%	1.62%	-0.01%
过去六个月	-5.60%	0.82%	-8.47%	0.83%	2.87%	-0.01%

过去一年	0.42%	0.93%	-2.81%	0.94%	3.23%	-0.01%
过去三年	-6.80%	1.07%	-18.47%	1.07%	11.67%	0.00%
自基金合同生效起至今	24.07%	1.11%	-2.42%	1.13%	26.49%	-0.02%

## 永赢沪深300C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.17%	0.86%	-3.77%	0.87%	1.60%	-0.01%
过去六个月	-5.65%	0.82%	-8.47%	0.83%	2.82%	-0.01%
过去一年	0.32%	0.93%	-2.81%	0.94%	3.13%	-0.01%
过去三年	-7.08%	1.07%	-18.47%	1.07%	11.39%	0.00%
自基金合同生效起至今	23.53%	1.11%	-2.42%	1.13%	25.95%	-0.02%

## 3.2.2 自基金合同生效以来基金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09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



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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2023-08-29	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，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	2023-08-14	-	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。
刘庭宇	基金经理助理	2022-11-07	2023-07-25	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合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢沪深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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年三季度，A股在7月上涨后在8月9月回落探底，其中沪深300下跌3.98%、中证1000下跌7.92%、创业板指下跌9.53%。随着美元的强势上涨和美债利率持续上行，8月份以来外资持续流出，国内经济逐渐企稳回升、地产政策优化，顺周期板块表现相对更好，价值风格明显比成长风格抗跌。行业层面，活跃资本市场系列举措发布后，非银金融涨幅靠前，供弱需强格局下上游资源板块（煤炭和石油石化）表现较好，由于业绩兑现较弱且缺少持续催化，新能源和TMT板块回调较多。

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。

#### 4.5 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1.0915元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.15%，同期业绩比较基准收益率为-3.77%；截至报告期末永赢沪深300C基金份额净值为1.0862元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.17%，同期业绩比较基准收益率为-3.77%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	539,395,360.34	93.21
	其中：股票	539,395,360.34	93.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,672,853.84	2.19
	其中：债券	12,672,853.84	2.19
	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	19,947,348.44	3.45
8	其他资产	6,671,466.74	1.15
9	合计	578,687,029.36	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29,814,847.00元，占基金资产净值的比例为5.20%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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	5,776,294.84	1.01
B	采矿业	22,717,761.18	3.96
C	制造业	295,593,573.30	51.53
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	16,227,137.35	2.83
E	建筑业	12,255,004.40	2.14
F	批发和零售业	1,694,880.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	16,782,065.35	2.93
H	住宿和餐饮业	511,360.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技 术服务业	23,828,727.12	4.15



J	金融业	117,862,601.29	20.55
K	房地产业	8,070,547.80	1.41
L	租赁和商务服务业	5,199,163.75	0.91
M	科学研究和技术服务业	7,095,064.26	1.24
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	3,070,713.42	0.54
R	文化、体育和娱乐业	624,235.50	0.11
S	综合	-	-
	合计	537,309,129.56	93.67

### 5.2.2 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	1,665,247.39	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,724.27	0.00
F	批发和零售业	63,142.66	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	247,674.78	0.04
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	32,809.24	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	46,446.98	0.01
O	居民服务、修理和其他服	-	-

	务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,185.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,086,230.78	0.36

### 5.2.3 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。

### 5.3 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

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	18,600	33,453,030.00	5.83
2	300750	宁德时代	78,180	15,872,885.40	2.77
3	601318	中国平安	321,194	15,513,670.20	2.70
4	600036	招商银行	367,000	12,099,990.00	2.11
5	000858	五粮液	57,486	8,973,564.60	1.56
6	000333	美的集团	145,700	8,083,436.00	1.41
7	601166	兴业银行	431,100	7,022,619.00	1.22
8	600900	长江电力	290,200	6,454,048.00	1.13
9	002594	比亚迪	26,800	6,343,560.00	1.11
10	600030	中信证券	289,270	6,265,588.20	1.09

#### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	301559	中集环科	6,196	150,067.12	0.03
2	688657	浩辰软件	1,008	104,227.20	0.02
3	688249	晶合集成	3,160	52,361.20	0.01
4	688361	中科飞测	519	39,542.61	0.01
5	688469	中芯集成	6,100	31,476.00	0.01

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	12,672,853.84	2.21
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	12,672,853.84	2.21

**5.5 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债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019694	23国债01	120,000	12,165,152.88	2.12
2	019688	22国债23	5,000	507,700.96	0.09

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

**5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市 值(元)	公允价值变 动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-

公允价值变动总额合计（元）	-
股指期货投资本期收益（元）	-515,240.11
股指期货投资本期公允价值变动（元）	381,420.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	87,077.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,900.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,563,031.65
6	其他应收款	18,457.70
7	其他	-
8	合计	6,671,466.74

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

**5.11.5.1 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。

**5.11.5.2 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	301559	中集环科	150,067.12	0.03	认购新发证券
2	688657	浩辰软件	104,227.20	0.02	认购新发证券
3	688249	晶合集成	52,361.20	0.01	新股限售
4	688361	中科飞测	39,542.61	0.01	新股限售
5	688469	中芯集成	31,476.00	0.01	新股限售

**5.11.6 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。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

	永赢沪深300A	永赢沪深300C
报告期期初基金份额总额	358,721,057.19	90,102,028.60
报告期期间基金总申购份额	101,914,026.39	88,454,123.39
减：报告期期间基金总赎回份额	44,064,917.11	69,045,837.98
报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	416,570,166.47	109,510,314.01

**§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况****7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**§8 报告期末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	1.90%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	382,277.81	0.07%	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	0.07%	10,000,000.00	1.90%	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 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	20230701 - 20230919	101,400,364.32	1,819,992.72	0.00	103,220,357.04	19.62%

#### 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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §10 备查文件目录

### 10.1 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。

## 10.2 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

## 10.3 查阅方式

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

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司

2023年10月25日