

永赢量化混合型发起式证券投资基金

2018 年半年度报告摘要

2018 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:中信证券股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------|
| 基金简称 | 永赢量化混合发起式 |
| 基金主代码 | 001565 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年08月06日 |
| 基金管理人 | 永赢基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信证券股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 42,271,483.37份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | <p>本基金通过灵活应用多种绝对收益策略，对冲市场系统性风险，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。</p> |
| 投资策略 | <p>本基金采用多因子选股策略为主，辅以事件驱动以及宏观择时等其他绝对收益策略，对冲系统性风险，力争实现稳定的绝对回报。</p> <p>1、多因子选股策略</p> <p>该策略以对中国股票市场较长期的回测研究为基础，运用量化多因子模型框架，结合定性指标和定量指标，综合考虑上市公司基本经营状况和市场对股票的反应两大因素，通过计算市场上所有股票的管理质量、价值、成长变化、市场情绪以及行业特殊因素等量化因子，将计算结果组合成alpha模型，同时结合风险模型构建股票现货组合。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>(1) 基本面因子</p> <p>管理质量：利用计算横截面多种比率来判断上市公司的报表质量以及管理能力，例如衡量报表质量的应收应付因子，衡量管理能力的周转率、偿债能力、R</p> |

OA和ROE等因子；

成长变化：通过计算时间序列上各种比率的变化来衡量公司基本面的成长性；

价值：判断公司的股票价格相对于它的内在价值是否合理。由于内在价值无法直接计算，我们通过计算全市场所有公司的利润、销售量、总资产等多种指标来综合间接反映公司的内在价值。

（2）市场因子

市场情绪：从技术面的动量、反转、枢轴突破等指标来衡量投资者情绪；

分析师预测：通过扫描市场上分析师观点的变化来预测市场反应。

2、事件驱动策略

该策略通过对某些公司事件和市场事件的研究，分析事件对股价造成波动的方向，以赚取超额收益。此外，该策略还利用市场上存在的金融产品定价非有效性，实现套利收益。

3、宏观择时策略

该策略通过计算和跟踪多种宏观经济变量和市场变量，运用计量经济学方法对未来大盘走势进行预测，为对冲窗口的调节提供参考。

4、市场中性投资策略

该策略主要运用股指期货合约与股票构建投资组合，规避市场系统性风险。在行业中性、市场中性的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算估值期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，以求取得与市场波动相关性较低的绝对收益。

5、其他投资策略

（1）债券投资策略

出于对流动性、有效利用基金财产的考虑，本基金适时对债券进行投资。通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势等因素，制定久期控制下的

| | |
|--------|--|
| | <p>投资策略，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。</p> <p>(2) 金融衍生工具投资策略</p> <p>在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。</p> |
| 业绩比较基准 | 一年期银行定期存款税后收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于特殊的混合型证券投资基金，预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金和一般的混合型基金。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。 |

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 | 中信证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 毛慧 |
| | 联系电话 | 021-51690145 |
| | 电子邮箱 | maoh@maxwealthfund.com |
| 客户服务电话 | 021-51690111 | 95548-3 |
| 传真 | 021-51690177 | 010-60834004 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|-----------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.maxwealthfund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人处 |

§ 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（2018年01月01日- 2018年06月30日） |
|---------------|-------------------------------|
| 本期已实现收益 | -302,765.28 |
| 本期利润 | -386,825.81 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0086 |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.08% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2018年06月30日） |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2952 |
| 期末基金资产净值 | 32,866,280.29 |
| 期末基金份额净值 | 0.7775 |

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

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

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

4、为更好地服务于广大投资者，在维护现有基金份额持有人利益的前提下，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的规定及基金合同的约定，基金管理人经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自2018年1月22日起对本基金基金份额净值的小数点保留精度由小数点后3位提高至小数点后4位，并相应修改基金合同和托管协议。具体请见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -0.26% | 0.15% | 0.12% | 0.00% | -0.38% | 0.15% |
| 过去三个月 | -0.68% | 0.12% | 0.37% | 0.00% | -1.05% | 0.12% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|-------|-------|---------|-------|
| 过去六个月 | -1.08% | 0.16% | 0.74% | 0.00% | -1.82% | 0.16% |
| 过去一年 | -5.76% | 0.21% | 1.50% | 0.00% | -7.26% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | -22.25% | 0.38% | 4.42% | 0.00% | -26.67% | 0.38% |

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一年期银行定期存款税后收益率。

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

永赢量化混合型发起式证券投资基金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%，利安资金管理公司持股28.51%。

截止2018年6月30日，本基金管理人共管理16只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢量化混合型发起式证券投资基金、永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、永赢天天利货币市场基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、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、永赢泰益债券型证券投资基金。

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 | | |
| 张大木 | 基金经理 | 2015-08-06 | 2018-01-31 | 17 | 张大木先生，硕士，17年金融行业投资研究经验，其中10年证券相关从业经验，曾任美国沃顿商学院高级数据分析师；巴克莱全球投资公司（BGI）投资分析员；博时基金管理有限公司投资经理兼量化分析师。现任永赢基金管理有限公司总经理助理兼量化投资总监。 |
| 周华睿 | 基金经理 | 2018-01-11 | - | 3 | 周华睿先生，CFA，香港城市大学金融工程硕士，6年金融数据分析经验，其中3年证券投资研究经验。曾任深圳证券信息有限公司数据分析师，上海大智慧股份有限公司金融工程师， |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|----------------------|
| | | | | | 现任职于永赢基金管理有限公司量化投资部。 |
|--|--|--|--|--|----------------------|

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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权限管理制度、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”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，于每季度分别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以及不同时间窗口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，未发现任何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

2018年上半年，受中美贸易战升级影响，A股市场整体出现持续下跌行情。尽管以沪深300为代表的大盘蓝筹在前期表现相对抗跌，但在二季度末也出现较为剧烈的杀跌。受此影响，以大盘指数为标的的IH和IF合约基差水平在本季度末处于深度贴水区间，而

IC合约贴基差贴水幅度也逐步加大，绝对收益策略执行的对冲成本明显上升。受限于严格的期现匹配政策监管，本基金目前可供对冲的现货组合选股池仅限于沪深300指数成分股，alpha获取能力受到一定限制，基金单位净值较前一季度出现小幅下跌。

未来，我们将继续密切关注监管机构的相关措施，同时时刻跟踪股指期货市场交易的流动性及基差水平，在严格控制本基金投资风险的前提下审慎决策，力争本基金的稳健运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢量化混合发起式基金份额净值为0.7775元，本报告期内，基金份额净值增长率为-1.08%，同期业绩比较基准收益率为0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年A股以大为美，大盘蓝筹表现远远超越市场平均水平。2018年的A股市场大概率是一个结构性牛市，各风格、行业之间的强弱转换呈现反转效应的可能性较大，但不排除部分强势主题与风格延续2017年趋势的可能性。

A股市场整体波动率自2015年股灾后持续下降，目前处于历史低位，但较去年底已有明显反弹。在此背景下，通过控制投资风险，重点把握阶段性及结构性机会将是较好的选择。本基金一方面通过量化模型分散现货组合个股风险，另一方面采用对冲基准指数规避市场系统性风险降低净值波动率的量化对冲投资策略具有优势。

监管层对于股指期货对冲的限制在过去一年出现一定程度松绑，以大盘指数为标的的IH和IF合约贴水水平有所收敛，偶现升水现象，相比之下IC合约贴水幅度较深，预期未来对冲策略交易环境有望逐步改善。我们将继续密切关注监管机构的相关措施，同时时刻跟踪股指期货市场交易的流动性及基差水平，在严格控制本基金投资风险的前提下审慎决策，力争本基金的稳健运行。

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、固定收益投资的分管领导、权益投资的分管领导、基金运营的分管领导、基金运营部负责人、合规部负责人和风险管理部负责人。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

报告期内，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务；本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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，本基金托管人在对永赢量化混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的相关约定，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，本基金托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对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进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金的管理人——永赢基金管理有限公司存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对永赢基金管理有限公司编制和披露的永赢量化混合型发起式证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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：永赢量化混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2018年06月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 5,927,170.57 | 11,413,124.70 |
| 结算备付金 | | 4,445,008.63 | 6,003,607.54 |
| 存出保证金 | | 1,413,135.65 | 2,440,872.59 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 10,709,174.10 | 19,148,390.39 |
| 其中：股票投资 | | 10,709,174.10 | 19,148,390.39 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 11,000,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | | 9,174.66 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | -477.79 | 2,444.16 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 33,503,185.82 | 39,008,439.38 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018年06月30日 | 上年度末 2017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 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 40,837.03 | 60,392.27 |
| 应付管理人报酬 | | 32,758.75 | 40,136.38 |

| | | | |
|---------------|--------------|---------------|----------------|
| 应付托管费 | | 6,824.74 | 8,361.72 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 13,500.63 | 41,588.01 |
| 应交税费 | | 14,777.93 | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 528,206.45 | 400,010.65 |
| 负债合计 | | 636,905.53 | 550,489.03 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 42,271,483.37 | 48,907,848.71 |
| 未分配利润 | 6.4.7.1 0 | -9,405,203.08 | -10,449,898.36 |
| 所有者权益合计 | | 32,866,280.29 | 38,457,950.35 |
| 负债和所有者权益总计 | | 33,503,185.82 | 39,008,439.38 |

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.7775元，基金份额总额42,271,483.37份。

6.2 利润表

会计主体：永赢量化混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期2018年01月01日至2018年06月30日 | 上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日 |
|-------------|--------------|---------------------------|--------------------------------|
| 一、收入 | | 102,914.84 | 623,314.80 |
| 1. 利息收入 | | 238,049.12 | 146,560.59 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.1 1 | 34,283.72 | 64,581.15 |
| 债券利息收入 | | 18,904.10 | 15.83 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |

| | | | |
|------------------------|----------------|---------------|---------------|
| 买入返售金融资产收入 | | 184,861.30 | 81,963.61 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -52,522.08 | -2,038,725.94 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.1 2 | -1,481,624.00 | 958,380.91 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.1 3 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.1 4 | 6,278.46 | 5,144.17 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.1 4.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.1 5 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.1 6 | 1,321,572.82 | -3,557,783.75 |
| 股利收益 | 6.4.7.1 7 | 101,250.64 | 555,532.73 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.1 8 | -84,060.53 | 2,503,046.77 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.1 9 | 1,448.33 | 12,433.38 |
| 减：二、费用 | | 489,740.65 | 1,121,963.84 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10. 2.1 | 209,040.74 | 435,519.91 |
| 2. 托管费 | 6.4.10. 2.2 | 43,550.14 | 90,733.29 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10. 2.3 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|--------------|-------------|-------------|
| 4. 交易费用 | 6.4.7.2 0 | 85,592.83 | 363,978.16 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 4,757.66 | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.2 1 | 146,799.28 | 231,732.48 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | -386,825.81 | -498,649.04 |
| 减: 所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | -386,825.81 | -498,649.04 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 永赢量化混合型发起式证券投资基金

本报告期: 2018年01月01日至2018年06月30日

单位: 人民币元

| 项 目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 | | |
|-----------------------------------|-------------------------------|----------------|---------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 48,907,848.71 | -10,449,898.36 | 38,457,950.35 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -386,825.81 | -386,825.81 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -6,636,365.34 | 1,431,521.09 | -5,204,844.25 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 654,884.02 | -141,350.53 | 513,533.49 |
| 2. 基金赎回款 | -7,291,249.36 | 1,572,871.62 | -5,718,377.74 |
| 四、本期向基金份额 | - | - | - |

| | | | |
|--|------------------------------------|----------------|----------------|
| 持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列) | | | |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 42,271,483.37 | -9,405,203.08 | 32,866,280.29 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 100,731,524.69 | -17,118,112.19 | 83,613,412.50 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | - | -498,649.04 | -498,649.04 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | -23,448,018.09 | 4,097,429.91 | -19,350,588.18 |
| 其中：1. 基金申购款 | 102,460.56 | -17,735.12 | 84,725.44 |
| 2. 基金赎回款 | -23,550,478.65 | 4,115,165.03 | -19,435,313.62 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 77,283,506.60 | -13,519,331.32 | 63,764,175.28 |

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

高利民

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

永赢量化混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1273号文《关于准予永赢量化混合型发起式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向社会公开发行募集，基金合同于2015年8月6日正式生效，首次设立募集规模为2,997,837,827.49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及注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等（中小企业私募债除外））、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，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。

基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%-120%之间。本基金每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。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，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。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。

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款税后收益

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金基金合同生效满3年之日，若本基金的资产净值低于人民币2亿元，本基金基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。本基金基金合同生效日为2015年8月6日，基金合同生效满三年之日为2018年8月6日。截至2018年8月6日日终，本基金的资产净值低于人民币2亿元，故本基金基金合同自动终止，进入基金财产清算程序。本基金最后运作日为2018年8月6日，自2018年8月7日进入清算期。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及财务报表6.4.4所述的重要会计政策和会计估计编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表按照6.4.2所述的编制基础编制，真实、完整地反映了本基金于2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日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。

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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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

(2) 金融负债分类

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

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的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 股指期货投资

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

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

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

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

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。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

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,本基金每年收益分配次数最多为 6 次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%,若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;

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

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4) 每一基金份额享有同等分配权;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在遵守法律法规的前提下,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。

6.4.4.12 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

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

免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

城市维护建设税 - 按实际缴纳的流转税的7%计缴。

教育费附加 - 按实际缴纳的流转税的3%计缴。

地方教育附加 - 按实际缴纳的流转税的2%计缴。

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 关联方关系

6.4.7.1 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

2018年1月，本公司23名原自然人股东将其所持公司股权全部转让给利安资金管理公司（Lion Global Investors Limited）。本次股权变更完成后，本公司股权结构调整为：宁波银行持股71.49%，利安资金持股28.51%。

6.4.7.2 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 |
|--------------------|--------------|
| 中信证券股份有限公司（“中信证券”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 永赢资产管理有限公司（“永赢资产”） | 基金管理人的子公司 |

| | |
|--------------------|-----------------------------|
| 永赢基金管理有限公司（“永赢基金”） | 基金管理人、基金发起人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 中信期货有限公司（“中信期货”） | 基金托管人的子公司、基金代销机构 |
| 利安资金管理公司（“利安资金”） | 基金管理人的股东 |
| 宁波银行股份有限公司（“宁波银行”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

注:1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据中国证券监督管理委员会2017年12月27日证监许可〔2017〕2415号《关于核准永赢基金管理有限公司变更股权的批复》，永赢基金管理有限公司原自然人股东将其所持18.51%转让给利安资金管理公司，并于2018年1月10日完成工商变更登记。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 | | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 | |
|-------|-------------------------------|--------------|------------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 中信证券 | - | - | 184,983,366.52 | 67.89% |

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 | | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 | |
|-------|-------------------------------|-----|------------------------------------|-----|
| | 成交金额 | 占当期 | 成交金额 | 占当期 |

| | | 债券买 卖成交 总额的 比例 | | 债券买 卖成交 总额的 比例 |
|------|---|-------------------------|------------|-------------------------|
| 中信证券 | - | - | 177,160.00 | 0.07% |

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名 称 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 | | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 | |
|-----------|-------------------------------|--------------------------------|------------------------------------|--------------------------------|
| | 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 债券回 购成交 总额的 比例 |
| 中信证券 | - | - | 87,300,000.00 | 32.04% |

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名 称 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 | | | |
|-----------|------------------------------------|------------------------|----------|----------------------|
| | 当期佣金 | 占当期 佣金总 量的比 例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应 付佣金总 额的比例 |
| 中信证券 | - | - | - | - |
| 关联方名 称 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期 佣金总 量的比 例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应 付佣金总 额的比例 |
| 中信证券 | 59,952.77 | 48.86% | 2,394.65 | 14.88% |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至201 8年06月30日 | 上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年06月30日 |
|-----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 209,040.74 | 435,519.91 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 28,396.61 | 64,941.43 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018 年06月30日 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 43,550.14 | 90,733.29 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06 月30日 | 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06 月30日 |
|-----------------------------|-----------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2015年08月06日）持有的基金份额 | 10,001,250.00 | 10,001,250.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,001,250.00 | 10,001,250.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,001,250.00 | 10,001,250.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 23.66% | 12.94% |

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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金报告期末及上年末无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

6.4.8.6 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未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期存放于中信期货的结算备付金金额为人民币3,297,209.81元。当期发生的基金应支付给中信期货的交易费用为人民币3,456.21元,本报告期末无应付中信期货的交易费用余额。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 000415 | 渤海金控 | 2018-01-17 | 重大资产重组 | 5.84 | 2018-07-17 | 5.26 | 2,900 | 18,836.58 | 16,936.00 | - |
| 002426 | 胜利精密 | 2018-06-19 | 重大事项 | 3.60 | 2018-07-03 | 3.26 | 2,400 | 10,390.83 | 8,640.00 | - |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018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金融资产款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 公允价值

6.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币10,683,598.10元，属于第二层次的余额为人民币25,576.00元，属于第三层次余额为人民币0.00元。

6.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2018年8月27日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|----|----|---------------|
| | | | |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 1 | 权益投资 | 10,709,174.10 | 31.96 |
| | 其中：股票 | 10,709,174.10 | 31.96 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 11,000,000.00 | 32.83 |
| | 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 | 10,372,179.20 | 30.96 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,421,832.52 | 4.24 |
| 9 | 合计 | 33,503,185.82 | 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 | 492,771.00 | 1.50 |
| C | 制造业 | 4,010,888.60 | 12.20 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 455,390.00 | 1.39 |
| E | 建筑业 | 193,088.00 | 0.59 |
| F | 批发和零售业 | 191,839.50 | 0.58 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 623,196.00 | 1.90 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 516,389.00 | 1.57 |
| J | 金融业 | 2,310,361.00 | 7.03 |
| K | 房地产业 | 1,091,080.00 | 3.32 |
| L | 租赁和商务服务业 | 49,141.00 | 0.15 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 13,984.00 | 0.04 |
| 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 | 761,046.00 | 2.32 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 10,709,174.10 | 32.58 |

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沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 600606 | 绿地控股 | 83,200 | 544,128.00 | 1.66 |
| 2 | 601006 | 大秦铁路 | 65,100 | 534,471.00 | 1.63 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 99,000 | 526,680.00 | 1.60 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 8,800 | 515,504.00 | 1.57 |
| 5 | 601939 | 建设银行 | 71,500 | 468,325.00 | 1.42 |
| 6 | 300251 | 光线传媒 | 45,300 | 461,154.00 | 1.40 |
| 7 | 601985 | 中国核电 | 80,600 | 455,390.00 | 1.39 |
| 8 | 600031 | 三一重工 | 41,000 | 367,770.00 | 1.12 |
| 9 | 601898 | 中煤能源 | 73,900 | 356,937.00 | 1.09 |
| 10 | 000069 | 华侨城 A | 47,500 | 343,425.00 | 1.04 |

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 | 000338 | 潍柴动力 | 1,245,175.00 | 3.24 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 1,087,670.00 | 2.83 |
| 3 | 601006 | 大秦铁路 | 1,043,099.00 | 2.71 |
| 4 | 601607 | 上海医药 | 1,002,292.59 | 2.61 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 966,022.00 | 2.51 |
| 6 | 601991 | 大唐发电 | 890,584.00 | 2.32 |
| 7 | 601398 | 工商银行 | 776,467.00 | 2.02 |
| 8 | 600837 | 海通证券 | 768,428.00 | 2.00 |
| 9 | 600606 | 绿地控股 | 758,063.00 | 1.97 |
| 10 | 600688 | 上海石化 | 706,794.00 | 1.84 |
| 11 | 600000 | 浦发银行 | 638,468.00 | 1.66 |
| 12 | 600170 | 上海建工 | 627,672.00 | 1.63 |
| 13 | 600519 | 贵州茅台 | 600,794.00 | 1.56 |
| 14 | 300251 | 光线传媒 | 596,286.00 | 1.55 |
| 15 | 601988 | 中国银行 | 560,778.00 | 1.46 |
| 16 | 000069 | 华侨城 A | 557,581.00 | 1.45 |
| 17 | 000425 | 徐工机械 | 554,349.00 | 1.44 |
| 18 | 000898 | 鞍钢股份 | 543,928.00 | 1.41 |
| 19 | 002558 | 巨人网络 | 540,881.00 | 1.41 |
| 20 | 000725 | 京东方 A | 520,485.00 | 1.35 |

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 | 601318 | 中国平安 | 1,378,890.00 | 3.59 |
| 2 | 601607 | 上海医药 | 1,322,937.00 | 3.44 |
| 3 | 000338 | 潍柴动力 | 1,222,488.00 | 3.18 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 983,258.60 | 2.56 |
| 5 | 600688 | 上海石化 | 889,928.00 | 2.31 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 6 | 601991 | 大唐发电 | 859,747.00 | 2.24 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 847,686.40 | 2.20 |
| 8 | 600036 | 招商银行 | 726,637.55 | 1.89 |
| 9 | 601988 | 中国银行 | 663,742.00 | 1.73 |
| 10 | 600837 | 海通证券 | 655,937.00 | 1.71 |
| 11 | 601006 | 大秦铁路 | 650,888.00 | 1.69 |
| 12 | 600170 | 上海建工 | 595,155.00 | 1.55 |
| 13 | 601939 | 建设银行 | 576,078.00 | 1.50 |
| 14 | 600674 | 川投能源 | 557,977.00 | 1.45 |
| 15 | 000651 | 格力电器 | 556,392.00 | 1.45 |
| 16 | 000333 | 美的集团 | 544,946.00 | 1.42 |
| 17 | 600104 | 上汽集团 | 540,076.98 | 1.40 |
| 18 | 601328 | 交通银行 | 529,038.00 | 1.38 |
| 19 | 000898 | 鞍钢股份 | 526,734.00 | 1.37 |
| 20 | 002304 | 洋河股份 | 482,759.17 | 1.26 |

注：卖出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。

7.4.3 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 | 39,934,314.32 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 45,909,946.08 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 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 | 公允价值变动 | 风险说明 |
|-------------------|-----------------|----------|---------------|------------|--------------|
| IF1809 | 沪深300股指期货1809合约 | -9 | -9,295,560.00 | 829,320.00 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | 829,320.00 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | 1,321,572.82 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | 897,900.00 |

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用市场中性策略，利用股指期货对冲市场系统性风险，对冲敞口控制在合同范围内。针对股灾后股指期货市场流动性明显下降，期货、现货之间长期保持贴水状态，本基金管理人密切关注市场动态，时刻跟踪流动性及基差水平，在严格控制本基金投资风险前提下对期货对冲合约进行合理选择。本基金投资于股指期货，剥离系统性风险，大幅降低净值波动率，符合既定的投资政策和投资目标。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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。

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 | 1,413,135.65 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,174.66 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | -477.79 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,421,832.52 |

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

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

| 持有人户 | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | |
|------|-----------|-------|-------|
| | | 机构投资者 | 个人投资者 |
| | | | |

| 数 (户) | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
|----------|-----------|---------------|------------|---------------|------------|
| 1,334 | 31,687.77 | 13,089,304.06 | 30.96% | 29,182,179.31 | 69.04% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 293.13 | - |

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 | 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 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 | 10,001,250. 00 | 23.66% | 10,001,250. 00 | 23.66% | 自合同生效 之日起不少 于三年 |
| 基金管 理人高 级管理 人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经 理等人 员 | - | - | - | - | - |
| 基金管 理人股 东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,001,250. | 23.66% | 10,001,250. | 23.66% | - |

| | | | | | |
|--|----|--|----|--|--|
| | 00 | | 00 | | |
|--|----|--|----|--|--|

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2015年08月06日)基金份额总额 | 2,997,837,827.49 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 48,907,848.71 |
| 本报告期基金总申购份额 | 654,884.02 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 7,291,249.36 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 42,271,483.37 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金管理人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，本基金管理人没有发生重大人事变动。本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《基金合同》及《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

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 | |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 2 | 85,830,490.40 | 100.00% | 28,436.31 | 100.00% | - |
| 信达证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | 已退租 |

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 |

| | | | | | | | | |
|------|--------------|---------|--------------|---------|---|---|---|---|
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 9,993,721.54 | 100.00% | 1,067,700.00 | 100.00% | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

§ 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 | 2018年1月1日-2018年6月30日 | 10,001,250.00 | 0.00 | 0.00 | 10,001,250.00 | 23.66% |
| 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，存在可能因投资者的大额申购或赎回造成基金份额波动的风险。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

永赢基金管理有限公司
二〇一八年八月二十八日