

# **永赢瑞益债券型证券投资基金**

## **2019 年年度报告**

2019 年 12 月 31 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2020 年 03 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年12月31日止。

## 1.2 目录

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7  |
| 2.4 信息披露方式                              | 8  |
| 2.5 其他相关资料                              | 8  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况                 | 8  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8  |
| 3.2 基金净值表现                              | 9  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 11 |
| §4 管理人报告                                | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11 |
| 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             | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 17 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 18 |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明        | 18 |
| 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明      | 18 |
| §5 托管人报告                                | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 18 |
| 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 | 18 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 18 |
| §6 审计报告                                 | 19 |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 19 |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 19 |
| §7 年度财务报表                               | 22 |
| 7.1 资产负债表                               | 22 |
| 7.2 利润表                                 | 23 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 25 |
| 7.4 报表附注                                | 27 |
| §8 投资组合报告                               | 54 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 54 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 54 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 55 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 55 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 55 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 55 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 56 |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 56 |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细      | 56 |

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....          | 56 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 56 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                      | 56 |
| §9 基金份额持有人信息.....                       | 57 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 57 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 58 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 58 |
| §10 开放式基金份额变动.....                      | 58 |
| §11 重大事件揭示.....                         | 58 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 58 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....   | 58 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 59 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                     | 59 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 59 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 59 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 59 |
| 11.8 其他重大事件.....                        | 60 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 61 |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 61 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 62 |
| §13 备查文件目录.....                         | 62 |
| 13.1 备查文件目录.....                        | 62 |
| 13.2 存放地点.....                          | 62 |
| 13.3 查阅方式.....                          | 62 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 永赢瑞益债券型证券投资基金     |
| 基金简称       | 永赢瑞益债券            |
| 基金主代码      | 004238            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2017年03月02日       |
| 基金管理人      | 永赢基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 兴业银行股份有限公司        |
| 报告期末基金份额总额 | 2,778,731,529.39份 |
| 基金合同存续期    | 不定期               |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 投资策略 | <p>本基金将通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性等因素，综合运用类属配置策略、久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、国债期货投资策略，力求实现基金资产的增值保值。</p> <p>1、类属配置策略</p> <p>本基金将综合分析各类属相对收益情况、利差变化状况、信用风险评级、流动性风险管理等因素来确定各类属配置比例，发掘具有较好投资价值的投资品种，增持相对低估并能给组合带来相对较高回报的类属，减持相对高估并给组合带来相对较低回报的类属。</p> <p>2、久期策略</p> <p>本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预</p> |

期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。

### 3、收益率曲线策略

本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。

### 4、信用策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响，相应地采用以下两种投资策略：

1) 信用利差曲线变化策略：首先分析经济周期和相关市场变化情况，其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势，最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定本基金信用债分行业投资比例。

2) 信用变化策略：信用债信用等级发生变化后，本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。

本基金将根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

### 5、杠杆策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买相对较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>7、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p>8、国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。</p> |
| 业绩比较基准 | 中国债券总全价指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

## 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             | 兴业银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 毛慧                     | 吴玉婷                 |
|         | 联系电话 | 021-51690145           | 021-52629999-212052 |
|         | 电子邮箱 | maoh@maxwealthfund.com | xywyt@cib.com.cn    |

|        |                            |               |
|--------|----------------------------|---------------|
| 客户服务电话 | 021-51690111               | 95561         |
| 传真     | 021-51690177               | 021-62535823  |
| 注册地址   | 浙江省宁波市鄞州区中山东路466号          | 福州市湖东路154号    |
| 办公地址   | 上海市浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦27楼 | 上海市银城路167号4号楼 |
| 邮政编码   | 200120                     | 200041        |
| 法定代表人  | 马宇晖                        | 高建平           |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                            |
|---------------------|----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报                       |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.maxwealthfund.com      |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦27楼 |

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2019年          | 2018年          | 2017年03月02日（基金合同生效日）-2017年12月31日 |
|---------------|----------------|----------------|----------------------------------|
| 本期已实现收益       | 254,661,864.21 | 516,510,374.69 | 100,767,532.72                   |
| 本期利润          | 188,828,818.76 | 651,990,806.19 | 92,831,863.91                    |



|                      |                  |                  |                   |
|----------------------|------------------|------------------|-------------------|
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0551           | 0.0673           | 0.0380            |
| 本期加权平均净值利润率          | 5.29%            | 6.41%            | 3.73%             |
| 本期基金份额净值增长率          | 4.87%            | 6.59%            | 8.20%             |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2019年末           | 2018年末           | 2017年末            |
| 期末可供分配利润             | 92,247,088.52    | 527,223,969.62   | 268,173,071.66    |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0332           | 0.0678           | 0.0274            |
| 期末基金资产净值             | 2,870,978,617.91 | 8,393,561,883.51 | 10,046,233,564.02 |
| 期末基金份额净值             | 1.0332           | 1.0790           | 1.0274            |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2019年末           | 2018年末           | 2017年末            |
| 基金份额累计净值增长率          | 20.94%           | 15.32%           | 8.20%             |

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.92%    | 0.03%       | 0.85%      | 0.08%         | 0.07%  | -0.05% |
| 过去六个月      | 2.39%    | 0.03%       | 1.47%      | 0.08%         | 0.92%  | -0.05% |
| 过去一年       | 4.87%    | 0.04%       | 1.10%      | 0.09%         | 3.77%  | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.94%   | 0.18%       | 4.32%      | 0.10%         | 16.62% | 0.08%  |

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中国债券总全价指数收益率

### 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



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规定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：图中列示的2017年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期3月2日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度    | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计       | 备注 |
|-------|-------------|----------------|-----------|----------------|----|
| 2019年 | 0.954       | 503,027,602.30 | 63,313.65 | 503,090,915.95 | —  |
| 2018年 | 0.153       | 149,604,272.22 | 16.12     | 149,604,288.34 | —  |
| 2017年 | 0.530       | 41,319,485.34  | 26.39     | 41,319,511.73  | —  |
| 合计    | 1.637       | 693,951,359.86 | 63,356.16 | 694,014,716.02 | —  |

## § 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2019年12月31日，本基金管理人共管理49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、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、永赢中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢悦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。

#### 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 | 说明 |
|----|----|-----------------|------|----|
|----|----|-----------------|------|----|

|     |      | 任职日期       | 离任日期       | 年限 |                                                                                                             |
|-----|------|------------|------------|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 乔嘉麒 | 基金经理 | 2018-01-03 | 2019-09-04 | 10 | 乔嘉麒先生，复旦大学经济学学士、硕士，10年证券相关从业经验，曾任宁波银行金融市场部固定收益交易员，从事债券及固定收益衍生品自营交易、自营投资管理、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。 |
| 牟琼屿 | 基金经理 | 2018-04-02 | -          | 10 | 牟琼屿女士，中国人民大学经济学硕士，10年证券相关从业经验，曾任中融国际信托固定收益部交易员，国开证券固定收益部投资经理，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。                       |

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、《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交

易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

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

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

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

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各基金经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后分析，确保交易得到公平和公允的执行；对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，基金经理须提出申请并阐明具体原因，交由投资决策委员会进行严格的公平性审核；（4）严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外），确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生同日反向交易的，相关基金经理须向风险控制委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面，风险管理部开展定期分析工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了对非公开发行股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，以及对非连续竞价交易的价格公允性进行审查；事后分析评估上，风险管理部在每个季度的公平交易与异常交易稽核中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年，实体经济总体下行，增速从年初的6.4%下滑至年末的6%，全年平均增速6.1%；节奏上呈现了首尾强，中间弱的态势。结构上，制造业投资、出口、消费等经济内生动能项目都比较弱，地产投资在下行中保持了较高韧性，基建是主要发力项目。实体数据之外，社融在上半年保持相对强势，下半年则震荡下行，通胀由于猪瘟带来的猪肉价格暴涨，自三季度中后期开始，CPI开始主导物价走势，且在经济下行背景下导致了通胀上涨，使得经济呈现出“类滞胀”走势。

政策方面，全年在“防风险”和“托底”之间不断博弈和平衡，在经济和政策的双重影响下，利率总体形成了震荡形态节奏上。一季度利率维持低位徘徊；4月受经济数据反弹影响，调整显著；5至8月，经济企稳预期逐步证伪，且受外部影响和流动性冲击，利

率震荡下行，10年期国债接近突破3.0%的关键点位；但受政策稳健以及猪通胀幅度超预期影响，利率在9-10月显著调整，随后又在降息和配置力量主导下再度下行，10年期国债收益率年末相对于年初仅下降4个BP左右。

信用基本面方面，在2019年经济增速放缓的背景下，下游行业补贴上游行业的格局有所松动，长期处于高位的上游行业商品价格出现一定松动迹象，企业盈利明显下滑。中游加工行业则经历了较为彻底的行业出清和集中度提升，前几年负债水平持续下降，部分行业盈利与经营获现能力增强。下游行业整体延续了低景气度趋势，同时行业内部或细分子行业之间存在信用资质的分化。此外，城投再融资政策边际放松，2019年城投债收益率在多重因素作用下一路下行，是信用利差压缩行情中最为受益的板块。整体来看，2019年全年信用利差整体呈现全面收窄态势，曲线形态陡峭化。

一季度初，债券收益率处于低位，本基金降低了资产组合久期和杠杆率；3月开始，本基金逐步增加信用债的配置比例，以城投债为主。二至三季度，本基金继续以配置信用债为主，并在收益率高位增加了长期利率债的持仓，大幅提高组合久期和杠杆。四季度，本基金减持长利率债，配置信用债，组合久期和杠杆保持总体平稳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢瑞益债券基金份额净值为1.0332元，本报告期内，基金份额净值增长率为4.87%，同期业绩比较基准收益率为1.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望来看，受新型冠状病毒肺炎疫情冲击，2020年开年经济显著受挫，节后生产复工推延，政策托底力度加大，使得整个2020年上半年的情况大概率呈现为一季度经济增速大幅下跌，二季度经济增速反弹。下半年，实体经济方向尚不明确，政策层面逆周期发力的力度将定最终方向，但通胀方面，经历上半年较高中枢的物价后，下半年面临持续下行压力，总体通胀水平相对上半年大概率走低。

2020年到期和进入回售期的非金融类信用债分别较2018年和2019年增长39%和25%，到期压力相对2019年明显增加，叠加本次疫情带来的阶段性或延展性的冲击，尾部个体信用风险加大。但与此同时，政策层面的逆周期力量也相应会对部分行业带来有利影响，下行压力整体可控，以房地产和基建支撑的投资预计仍有韧性，结构性机会仍在。从利差空间的角度来看，前期大幅受益于供给侧改革和地产需求等行业的超额利差已至历史偏低水平，如煤炭、水泥，后续吸引力已然不大，将积极关注AA+级中游制造行业相关的结构性机会。此外，当前大消费行业超额利差普遍处于高位，在减税降费等积极财政作用及LPR下调等预期之下，后续可能存在一定超预期投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况



2019年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障合规运作和投资者合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，持续开展了合规检查、内部审计、合规培训、制度修订、信息披露、反洗钱等工作。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

1、新规解读及监管要求的落实。2019年，监管机构发布了一系列法律法规，对公募基金投资运作及资管行业整体发展都产生深远影响，主要包括《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法（征求意见稿）》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金投资信用衍生品指引》以及《关于做好公开募集证券投资基金投资顾问业务试点工作的通知》等。法规颁布后，公司第一时间组织相关人员对法规进行解读，并拟定针对性的落实方案，由各相关部门进行具体落实，同时定期对落实情况进行跟踪检查。

2、深入开展内部审计工作。内部审计是公司合规管理工作的重要组成部分，是公司风险防控机制中的一道重要防线。公司已设置了全面而完善的内部审计体系和流程，2019年公司内部审计体系主要由公司合规管理有效性评估、监管要求的各项例行内审、不定期开展的各类专项审计以及投研人员行为操守的持续监控检查组成，前述内部审计工作作为有效防范操作风险及案件防控风险，为公司各项业务的稳步开展提供了全面、有效的保障。

3、强化合规培训。2019年，监管机构发布了诸多法律法规，为加强员工对法规的理解，强化员工在日常行为以及业务开展中的合规性，合规部组织多次面向不同对象，针对不同内容或法规的合规培训，包括针对新员工的合规培训，面向全员的合规宣导以及邀请外部律师就行业热点问题专项培训等。培训的内容以从业人员执业行为守则、新规要求、监管关注热点、行业风险事件为主，并通过多样化的方式提高了员工在合规培训中的参与度以及积极性。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。本基金管理人估值委员会成员包括公司总经理、督察长、固定收益投资的分管领导、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同规定：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12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。2019年1月22日，本基金进行了收益分配：其中每10份基金份额分红0.510元，共计分配利润345,715,854.77元；2019年2月26日，本基金进行了收益分配：其中每10份基金份额分红0.170元，共计分配利润81,238,292.95元；2019年11月8日，本基金进行了收益分配：其中每10份基金份额分红0.274元，共计分配利润76,136,768.23元

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，未发生会计师事务所出具非标准审计报告的情形。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                            |
|------------|----------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                          |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                    |
| 审计报告编号     | 安永华明（2020）审字第61090672_B06号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|           |                                                                                                                                                                                                       |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题    | 审计报告                                                                                                                                                                                                  |
| 审计报告收件人   | 永赢瑞益债券型证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                |
| 审计意见      | <p>我们审计了永赢瑞益债券型证券投资基金的财务报表，包括2019年12月31日的资产负债表，2019年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的永赢瑞益债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了永赢瑞益债券型证券投资基金2019年12月31日的财务状况以及2019年度的经营成果和净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于永赢瑞益债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>                                     |
| 强调事项      | 无                                                                                                                                                                                                     |
| 其他事项      | 无                                                                                                                                                                                                     |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 其他信息            | <p>永赢瑞益债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估永赢瑞益债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督永赢瑞益债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>                                             |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>                                       |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|           | <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对永赢瑞益债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致永赢瑞益债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |     |
| 注册会计师的姓名  | 蒋燕华                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 费泽旭 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市世纪大道100号环球金融中心50楼                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |     |
| 审计报告日期    | 2020-03-26                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |     |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：永赢瑞益债券型证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2019年12月31日         | 上年度末<br>2018年12月31日         |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                            |                             |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 476,514.24                 | 66,643,680.48               |
| 结算备付金           |            | -                          | -                           |
| 存出保证金           |            | -                          | 3,669.93                    |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 3,355,620,000.00           | 11,210,932,500.00           |
| 其中：股票投资         |            | -                          | -                           |
| 基金投资            |            | -                          | -                           |
| 债券投资            |            | 3,212,108,000.00           | 10,580,149,500.00           |
| 资产支持证券投资        |            | 143,512,000.00             | 630,783,000.00              |
| 贵金属投资           |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 55,822,798.73              | 208,834,650.86              |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 3,411,919,312.97           | 11,486,414,501.27           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2018年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                            |                             |

|               |          |                  |                   |
|---------------|----------|------------------|-------------------|
| 短期借款          |          | -                | -                 |
| 交易性金融负债       |          | -                | -                 |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3  | -                | -                 |
| 卖出回购金融资产款     |          | 539,069,471.38   | 3,082,555,056.16  |
| 应付证券清算款       |          | -                | -                 |
| 应付赎回款         |          | -                | -                 |
| 应付管理人报酬       |          | 729,502.17       | 2,365,234.76      |
| 应付托管费         |          | 243,167.39       | 788,411.60        |
| 应付销售服务费       |          | -                | -                 |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | 46,694.75        | 136,846.97        |
| 应交税费          |          | 375,204.29       | 1,223,767.02      |
| 应付利息          |          | 266,655.08       | 5,463,301.25      |
| 应付利润          |          | -                | -                 |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                 |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 210,000.00       | 320,000.00        |
| 负债合计          |          | 540,940,695.06   | 3,092,852,617.76  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                   |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 2,778,731,529.39 | 7,778,751,064.58  |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 92,247,088.52    | 614,810,818.93    |
| 所有者权益合计       |          | 2,870,978,617.91 | 8,393,561,883.51  |
| 负债和所有者权益总计    |          | 3,411,919,312.97 | 11,486,414,501.27 |

注：报告截止日2019年12月31日，基金份额净值1.0332元，基金份额总额2,778,731,529.39份。

## 7.2 利润表

会计主体：永赢瑞益债券型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期2019年01月01日至2019年12月31日 | 上年度可比期间2018年01月01日至2018年12月31日 |
|-----|-----|---------------------------|--------------------------------|
|-----|-----|---------------------------|--------------------------------|

|                        |                |                |                |
|------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 一、收入                   |                | 228,983,210.95 | 790,770,210.23 |
| 1. 利息收入                |                | 194,737,511.68 | 637,241,959.16 |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11       | 43,249.67      | 45,957,911.51  |
| 债券利息收入                 |                | 181,043,747.27 | 552,157,085.03 |
| 资产支持证券利息收入             |                | 13,462,385.82  | 37,974,854.07  |
| 买入返售金融资产收入             |                | 188,128.92     | 1,152,108.55   |
| 证券出借利息收入               |                | -              | -              |
| 其他利息收入                 |                | -              | -              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |                | 100,078,744.72 | 18,047,819.57  |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12       | -              | -              |
| 基金投资收益                 |                | -              | -              |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13       | 91,552,483.80  | 17,130,944.28  |
| 资产支持证券投资<br>收益         | 7.4.7.13.<br>3 | 8,526,260.92   | 916,875.29     |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14       | -              | -              |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15       | -              | -              |
| 股利收益                   | 7.4.7.16       | -              | -              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17       | -65,833,045.45 | 135,480,431.50 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |                | -              | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18       | -              | -              |
| 减：二、费用                 |                | 40,154,392.19  | 138,779,404.04 |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.<br>1 | 10,816,500.05  | 30,529,685.21  |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.<br>2 | 3,605,500.06   | 10,176,561.69  |
| 3. 销售服务费               |                | -              | -              |



|                     |          |                |                |
|---------------------|----------|----------------|----------------|
| 4. 交易费用             | 7.4.7.19 | 64,912.06      | 49,834.36      |
| 5. 利息支出             |          | 24,777,656.67  | 96,066,750.83  |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 24,777,656.67  | 96,066,750.83  |
| 6. 税金及附加            |          | 627,946.41     | 1,678,388.12   |
| 7. 其他费用             | 7.4.7.20 | 261,876.94     | 278,183.83     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 188,828,818.76 | 651,990,806.19 |
| 减：所得税费用             |          | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 188,828,818.76 | 651,990,806.19 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢瑞益债券型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                               | 本期<br>2019年01月01日至2019年12月31日 |                 |                   |
|-----------------------------------|-------------------------------|-----------------|-------------------|
|                                   | 实收基金                          | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 7,778,751,064.58              | 614,810,818.93  | 8,393,561,883.51  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                             | 188,828,818.76  | 188,828,818.76    |
| 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） | -5,000,019,535.19             | -208,301,633.22 | -5,208,321,168.41 |
| 其中：1. 基金申购款                       | 61,741.20                     | 1,872.17        | 63,613.37         |
| 2. 基金赎回                           | -5,000,081,276.39             | -208,303,505.39 | -5,208,384,781.78 |

|                                        |                                    |                 |                   |
|----------------------------------------|------------------------------------|-----------------|-------------------|
| 回款                                     |                                    |                 |                   |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                  | -503,090,915.95 | -503,090,915.95   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,778,731,529.39                   | 92,247,088.52   | 2,870,978,617.91  |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年12月31日 |                 |                   |
|                                        | 实收基金                               | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 9,778,060,492.36                   | 268,173,071.66  | 10,046,233,564.02 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                  | 651,990,806.19  | 651,990,806.19    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -1,999,309,427.78                  | -155,748,770.58 | -2,155,058,198.36 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 697,367.47                         | 51,471.87       | 748,839.34        |
| 2. 基金赎回款                               | -2,000,006,795.25                  | -155,800,242.45 | -2,155,807,037.70 |
| 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） | -                                  | -149,604,288.34 | -149,604,288.34   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 7,778,751,064.58                   | 614,810,818.93  | 8,393,561,883.51  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

芦特尔

郑凌云

虞俏依

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

永赢瑞益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2016〕1827号《关于准予永赢瑞益债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人永赢基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2017年3月2日生效，首次设立募集规模为200,026,166.65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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的国债、金融债、企业债、央行票据、中期票据、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为：中国债券总全价指数收益率。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2019年12月31日的财务状况以及2019年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括债券投资等；

###### (2) 金融负债分类

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

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，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，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) 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；

#### (2) 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。

#### (3) 国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认；

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

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

（5）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；

（6）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；

（7）国债期货投资收益/（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；

（8）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；

(9) 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12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。

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

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明



本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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。

##### 7.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 7.4.6.3 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[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 476,514.24         | 66,643,680.48       |
| 定期存款         | -                  | -                   |
| 其中：存款期限1个月以内 | -                  | -                   |
| 存款期限1-3个月    | -                  | -                   |
| 存款期限3个月以上    | -                  | -                   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 合计           | 476,514.24         | 66,643,680.48       |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末2019年12月31日 |      |        |
|---------------|----------------|------|--------|
|               | 成本             | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票            | -              | -    | -      |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -              | -    | -      |
| 债券            | -              | -    | -      |
| 交易所市场         | -              | -    | -      |

|               |       |                   |                   |                |
|---------------|-------|-------------------|-------------------|----------------|
|               | 银行间市场 | 3,156,209,868.18  | 3,212,108,000.00  | 55,898,131.82  |
|               | 合计    | 3,156,209,868.18  | 3,212,108,000.00  | 55,898,131.82  |
| 资产支持证券        |       | 137,698,414.58    | 143,512,000.00    | 5,813,585.42   |
| 基金            |       | -                 | -                 | -              |
| 其他            |       | -                 | -                 | -              |
| 合计            |       | 3,293,908,282.76  | 3,355,620,000.00  | 61,711,717.24  |
| 项目            |       | 上年度末2018年12月31日   |                   |                |
|               |       | 成本                | 公允价值              | 公允价值变动         |
| 股票            |       | -                 | -                 | -              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                 | -                 | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 48,620,650.69     | 49,095,000.00     | 474,349.31     |
|               | 银行间市场 | 10,416,525,457.75 | 10,531,054,500.00 | 114,529,042.25 |
|               | 合计    | 10,465,146,108.44 | 10,580,149,500.00 | 115,003,391.56 |
| 资产支持证券        |       | 618,241,628.87    | 630,783,000.00    | 12,541,371.13  |
| 基金            |       | -                 | -                 | -              |
| 其他            |       | -                 | -                 | -              |
| 合计            |       | 11,083,387,737.31 | 11,210,932,500.00 | 127,544,762.69 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 323.66             | 6,828.76            |
| 应收定期存款利息   | -                  | -                   |
| 应收其他存款利息   | -                  | -                   |
| 应收结算备付金利息  | -                  | -                   |
| 应收债券利息     | 55,602,265.11      | 207,181,176.45      |
| 应收资产支持证券利息 | 220,209.96         | 1,646,643.78        |
| 应收买入返售证券利息 | -                  | -                   |
| 应收申购款利息    | -                  | -                   |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  | -                   |
| 应收出借证券利息   | -                  | -                   |
| 其他         | -                  | 1.87                |
| 合计         | 55,822,798.73      | 208,834,650.86      |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                  | -                   |
| 银行间市场应付交易费用 | 46,694.75          | 136,846.97          |
| 合计          | 46,694.75          | 136,846.97          |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31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 | -          | -          |
| 预提费用      | 210,000.00 | 320,000.00 |
| 合计        | 210,000.00 | 320,000.00 |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期2019年01月01日至2019年12月31日 |                   |
|---------------|---------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                   | 账面金额              |
| 上年度末          | 7,778,751,064.58          | 7,778,751,064.58  |
| 本期申购          | 61,741.20                 | 61,741.20         |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,000,081,276.39         | -5,000,081,276.39 |
| 本期末           | 2,778,731,529.39          | 2,778,731,529.39  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末           | 527,223,969.62  | 87,586,849.31  | 614,810,818.93  |
| 本期利润           | 254,661,864.21  | -65,833,045.45 | 188,828,818.76  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -172,125,910.21 | -36,175,723.01 | -208,301,633.22 |
| 其中：基金申购款       | 1,452.28        | 419.89         | 1,872.17        |
| 基金赎回款          | -172,127,362.49 | -36,176,142.90 | -208,303,505.39 |
| 本期已分配利润        | -503,090,915.95 | -              | -503,090,915.95 |
| 本期末            | 106,669,007.67  | -14,421,919.15 | 92,247,088.52   |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期2019年01月01日至2019年12月31日 | 上年度可比期间2018年01月01日至2018年12月31日 |
|----------|---------------------------|--------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 43,204.28                 | 97,415.03                      |

|           |           |               |
|-----------|-----------|---------------|
| 定期存款利息收入  | -         | 45,860,124.95 |
| 其他存款利息收入  | -         | -             |
| 结算备付金利息收入 | -         | 345.40        |
| 其他        | 45.39     | 26.13         |
| 合计        | 43,249.67 | 45,957,911.51 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                                    | 本期<br>2019年01月01日至2019年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年<br>12月31日 |
|---------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券<br>(、债转股及债券到期兑付)<br>差价收入 | 91,552,483.80                     | 17,130,944.28                          |
| 债券投资收益——赎回差价<br>收入                    | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益——申购差价<br>收入                    | -                                 | -                                      |
| 合计                                    | 91,552,483.80                     | 17,130,944.28                          |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2019年01月01日至2019年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年12月<br>31日 |
|-------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出债券(、债转<br>股及债券到期兑<br>付)成交总额 | 10,046,830,996.87                 | 9,839,272,163.34                       |
| 减：卖出债券(、                      | 9,714,802,669.56                  | 9,507,569,011.41                       |

|                      |                |                |
|----------------------|----------------|----------------|
| 债转股及债券到期<br>兑付) 成本总额 |                |                |
| 减: 应收利息总额            | 240,475,843.51 | 314,572,207.65 |
| 买卖债券差价收入             | 91,552,483.80  | 17,130,944.28  |

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位: 人民币元

| 项目                  | 本期<br>2019年01月01日至2019年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年<br>12月31日 |
|---------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额        | 495,504,881.20                    | 1,090,812,813.37                       |
| 减: 卖出资产支持证券成本<br>总额 | 480,543,214.29                    | 1,065,016,251.53                       |
| 减: 应收利息总额           | 6,435,405.99                      | 24,879,686.55                          |
| 资产支持证券投资收益          | 8,526,260.92                      | 916,875.29                             |

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益—其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                           | 本期<br>2019年01月01日至2019年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年12<br>月31日 |
|--------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                     | -65,833,045.45                    | 135,480,431.50                         |
| ——股票投资                         | -                                 | -                                      |
| ——债券投资                         | -59,105,259.74                    | 122,318,087.64                         |
| ——资产支持证券投资                     | -6,727,785.71                     | 13,162,343.86                          |
| ——基金投资                         | -                                 | -                                      |
| ——贵金属投资                        | -                                 | -                                      |
| ——其他                           | -                                 | -                                      |
| 2. 衍生工具                        | -                                 | -                                      |
| ——权证投资                         | -                                 | -                                      |
| 3. 其他                          | -                                 | -                                      |
| 减：应税金融商品公允<br>价值变动产生的预估增<br>值税 | -                                 | -                                      |
| 合计                             | -65,833,045.45                    | 135,480,431.50                         |

#### 7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年01月01日至2019年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年<br>12月31日 |
|----|-----------------------------------|----------------------------------------|
|    |                                   |                                        |



|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| 交易所市场交易费用 | 49.56     | 49.36     |
| 银行间市场交易费用 | 64,862.50 | 49,785.00 |
| 合计        | 64,912.06 | 49,834.36 |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年01月01日至2019年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 审计费用    | 90,000.00                         | 120,000.00                             |
| 信息披露费   | 120,000.00                        | 100,000.00                             |
| 证券出借违约金 | —                                 | —                                      |
| 汇划手续费   | 14,676.94                         | 29,983.83                              |
| 账户维护费   | 36,000.00                         | 27,000.00                              |
| 其他      | 1,200.00                          | 1,200.00                               |
| 合计      | 261,876.94                        | 278,183.83                             |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称              | 与本基金的关系               |
|--------------------|-----------------------|
| 永赢基金管理有限公司（“永赢基金”） | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 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              |
| 利安资金管理公司（“利安资金”）   | 基金管理人的股东              |
| 永赢资产管理有限公司（“永赢资产”） | 基金管理人的子公司             |

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。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

**7.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年01月01日至201<br>9年12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至201<br>8年12月31日 |
|-----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 10,816,500.05                     | 30,529,685.21                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,605,269.58                      | 10,177,801.68                          |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年01月01日至2019<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018<br>年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,605,500.06                      | 10,176,561.69                          |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2019年01月01日至2019年12月31日      |        |      |       |      |                  |            |
|------------------------------------|--------|------|-------|------|------------------|------------|
| 银行间市场交<br>易的各关联方<br>名称             | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购            |            |
|                                    | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额             | 利息支出       |
| 兴业银行                               | -      | -    | -     | -    | 300,000.00       | 19,232.88  |
| 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年12月31日 |        |      |       |      |                  |            |
| 银行间市场交<br>易的各关联方名称                 | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购            |            |
|                                    | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额             | 利息支出       |
| 兴业银行                               | -      | -    | -     | -    | 2,860,474,000.00 | 625,591.28 |

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年01月01日至2019年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2018年01月01日至2018年12月31日 |           |
|-------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                          | 当期利息收入    | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 兴业银行  | 476,514.24                    | 43,204.28 | 66,643,680.48                      | 97,415.03 |

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日 | 除息日 | 每10份基<br>金<br>份额分红 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形<br>式发放总<br>额 | 本期利润<br>分配合计 | 备注 |
|----|-----------|-----|--------------------|--------------|-------------------|--------------|----|
|----|-----------|-----|--------------------|--------------|-------------------|--------------|----|

|        |                |                | 数     |                    |           |                    |   |
|--------|----------------|----------------|-------|--------------------|-----------|--------------------|---|
| 1      | 2019-01<br>-22 | 2019-01<br>-22 | 0.510 | 345,681,71<br>8.48 | 34,136.29 | 345,715,85<br>4.77 | - |
| 2      | 2019-02<br>-26 | 2019-02<br>-26 | 0.170 | 81,227,20<br>0.63  | 11,092.32 | 81,238,29<br>2.95  | - |
| 3      | 2019-11<br>-08 | 2019-11<br>-08 | 0.274 | 76,118,68<br>3.19  | 18,085.04 | 76,136,76<br>8.23  | - |
| 合<br>计 |                |                | 0.954 | 503,027,60<br>2.30 | 63,313.65 | 503,090,91<br>5.95 | - |

#### 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币539,069,471.38元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|-----------|---------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 170205    | 17国开05        | 2020-01-06 | 100.46 | 398,000   | 39,983,080.00  |
| 101561024 | 15中电投MTN004   | 2020-01-02 | 102.73 | 1,900,000 | 195,187,000.00 |
| 101800227 | 18川交投MTN003   | 2020-01-03 | 106.91 | 600,000   | 64,146,000.00  |
| 101800340 | 18华润置地MTN002B | 2020-01-03 | 105.61 | 500,000   | 52,805,000.00  |
| 101800453 | 18豫投资MTN003   | 2020-01-03 | 104.67 | 500,000   | 52,335,000.00  |

|           |              |            |        |           |                |
|-----------|--------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 101800798 | 18广州地铁MTN003 | 2020-01-03 | 101.67 | 1,000,000 | 101,670,000.00 |
| 101800882 | 18深圳高速MTN002 | 2020-01-03 | 103.32 | 221,000   | 22,833,720.00  |
| 101800913 | 18陕高速MTN003  | 2020-01-02 | 102.07 | 323,000   | 32,968,610.00  |
| 101901600 | 19陕煤化MTN006  | 2020-01-03 | 100.24 | 334,000   | 33,480,160.00  |
| 合计        |              |            |        | 5,776,000 | 595,408,570.00 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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交易的国债、金融债、企业债、央行票据、中期票据、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会制订公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部由督察长分管。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，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并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | 101,120,000.00      |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | 683,443,000.00      |
| 合计     | -                  | 784,563,000.00      |

注：1、本期末，本基金未持有短期债券投资；

2、上年度末，未评级的短期债券均是政策性金融债和超短期融资券。

## 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

## 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | 772,670,000.00      |
| 合计     | -                  | 772,670,000.00      |

注：本期末，本基金未持有短期同业存单投资。

## 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 2,721,992,000.00   | 7,675,992,500.00    |
| AAA以下  | 329,380,000.00     | 1,084,394,000.00    |
| 未评级    | 160,736,000.00     | 262,530,000.00      |
| 合计     | 3,212,108,000.00   | 9,022,916,500.00    |

注：本期末及上年度末，未评级的长期债券均是政策性金融债。

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 143,512,000.00     | 630,783,000.00      |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | 143,512,000.00     | 630,783,000.00      |



#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

本期末，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年<br>12月31<br>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                       | 476,514.24 | -     | -              | -                | -              | -             | 476,514.24       |
| 结算备付金                      | -          | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 存出保证金                      | -          | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 交易性金融资产                    | -          | -     | 239,940,000.00 | 3,010,260,000.00 | 105,420,000.00 | -             | 3,355,620,000.00 |
| 衍生金融资产                     | -          | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 买入返售金融资产                   | -          | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应收证券清算款                    | -          | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应收利息                       | -          | -     | -              | -                | -              | 55,822,798.73 | 55,822,798.73    |
| 应收股利                       | -          | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应收申购款                      | -          | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 其他资产                       | -          | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 资产总计                       | 476,514.24 | -     | 239,940,000.00 | 3,010,260,000.00 | 105,420,000.00 | 55,822,798.73 | 3,411,919,310.00 |

|                 |                 |       |                |                  |                |               |                  |
|-----------------|-----------------|-------|----------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 计               |                 |       | 00             | 0.00             | 0.00           | 73            | 2.97             |
| 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       | 539,069,471.38  | -     | -              | -                | -              | -             | 539,069,471.38   |
| 应付证券清算款         | -               | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应付赎回款           | -               | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应付管理人报酬         | -               | -     | -              | -                | -              | 729,502.17    | 729,502.17       |
| 应付托管费           | -               | -     | -              | -                | -              | 243,167.39    | 243,167.39       |
| 应付销售服务费         | -               | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 应付交易费用          | -               | -     | -              | -                | -              | 46,694.75     | 46,694.75        |
| 应付税费            | -               | -     | -              | -                | -              | 375,204.29    | 375,204.29       |
| 应付利息            | -               | -     | -              | -                | -              | 266,655.08    | 266,655.08       |
| 应付利润            | -               | -     | -              | -                | -              | -             | -                |
| 其他负债            | -               | -     | -              | -                | -              | 210,000.00    | 210,000.00       |
| 负债总计            | 539,069,471.38  | -     | -              | -                | -              | 1,871,223.68  | 540,940,695.06   |
| 利率敏感度缺口         | -538,592,957.14 | -     | 239,940,000.00 | 3,010,260,000.00 | 105,420,000.00 | 53,951,575.05 | 2,870,978,617.91 |
| 上年度末2018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      | 66,643,680.48     | -              | -                | -                | -              | -              | 66,643,680.48     |
| 存出保证金     | 3,669.93          | -              | -                | -                | -              | -              | 3,669.93          |
| 交易性金融资产   | 140,798,000.00    | 575,337,000.00 | 4,555,913,000.00 | 5,305,388,500.00 | 633,496,000.00 | -              | 11,210,932,500.00 |
| 应收利息      | -                 | -              | -                | -                | -              | 208,834,650.86 | 208,834,650.86    |
| 资产总计      | 207,445,350.41    | 575,337,000.00 | 4,555,913,000.00 | 5,305,388,500.00 | 633,496,000.00 | 208,834,650.86 | 11,486,414,501.27 |
| 负债        |                   |                |                  |                  |                |                |                   |
| 卖出回购金融资产款 | 3,082,555,056.16  | -              | -                | -                | -              | -              | 3,082,555,056.16  |
| 应付管理人报酬   | -                 | -              | -                | -                | -              | 2,365,234.76   | 2,365,234.76      |
| 应付托管费     | -                 | -              | -                | -                | -              | 788,411.60     | 788,411.60        |
| 应付交易费用    | -                 | -              | -                | -                | -              | 136,846.97     | 136,846.97        |
| 应交税费      | -                 | -              | -                | -                | -              | 1,223,767.02   | 1,223,767.02      |
| 应付利息      | -                 | -              | -                | -                | -              | 5,463,301.25   | 5,463,301.25      |
| 其他负债      | -                 | -              | -                | -                | -              | 320,000.00     | 320,000.00        |
| 负债总计      | 3,082,555,056.16  | -              | -                | -                | -              | 10,297,561.60  | 3,092,852,617.76  |
| 利率敏感度缺口   | -2,875,109,705.75 | 575,337,000.00 | 4,555,913,000.00 | 5,305,388,500.00 | 633,496,000.00 | 198,537,089.26 | 8,393,561,883.51  |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                         |                   |
|----|-------------------------|-------------------|
| 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<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|  | 市场利率平行上升50个基点 | -39,298,967.86     | -71,871,967.96      |
|  | 市场利率平行下降50个基点 | 39,298,967.86      | 71,871,967.96       |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2019年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币0.00元，属于第二层次的余额为人民币3,355,620,000.00元，属于第三层次的余额为人民币0.00元（于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币0.00元，属于第二层次的余额为人民币11,210,932,500.00元，属于第三层次的余额为人民币0.00元）。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次均未发生重大变动。

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

##### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2020年3月26日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | —                | —             |
|    | 其中：股票             | —                | —             |
| 2  | 基金投资              | —                | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 3,355,620,000.00 | 98.35         |
|    | 其中：债券             | 3,212,108,000.00 | 94.14         |
|    | 资产支持证券            | 143,512,000.00   | 4.21          |
| 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      | 476,514.24       | 0.01          |
| 8  | 其他各项资产            | 55,822,798.73    | 1.64          |
| 9  | 合计                | 3,411,919,312.97 | 100.00        |

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动****8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细**

本基金本报告期内未投资股票。

**8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细**

本基金本报告期内未投资股票。

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本基金本报告期内未投资股票。

**8.5 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      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 160,736,000.00   | 5.60         |
|    | 其中：政策性金融债 | 160,736,000.00   | 5.60         |
| 4  | 企业债券      | 30,738,000.00    | 1.07         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 3,020,634,000.00 | 105.21       |
| 7  | 可转债(可交换债) | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 3,212,108,000.00 | 111.88       |

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

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 | 101561024 | 15中电投MTN004  | 1,900,000 | 195,187,000.00 | 6.80    |
| 2 | 170205    | 17国开05       | 1,600,000 | 160,736,000.00 | 5.60    |
| 3 | 101901600 | 19陕煤化MTN006  | 1,100,000 | 110,264,000.00 | 3.84    |
| 4 | 101800913 | 18陕高速MTN003  | 1,000,000 | 102,070,000.00 | 3.56    |
| 5 | 101800798 | 18广州地铁MTN003 | 1,000,000 | 101,670,000.00 | 3.54    |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码    | 证券名称       | 数量（份）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 1889087 | 18建元8A2_bc | 1,000,000 | 105,420,000.00 | 3.67         |
| 2  | 1889109 | 18飞驰建融2A   | 1,300,000 | 19,084,000.00  | 0.66         |
| 3  | 1889119 | 18工元4A1    | 900,000   | 19,008,000.00  | 0.66         |

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

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



8.12.2 基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | —             |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 55,822,798.73 |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 55,822,798.73 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(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 |

|     |               |                      |              |            |         |
|-----|---------------|----------------------|--------------|------------|---------|
| 274 | 10,141,355.95 | 2,778,037,54<br>7.67 | 99.975<br>0% | 693,981.72 | 0.0250% |
|-----|---------------|----------------------|--------------|------------|---------|

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 2,845.68  | 0.00%    |

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10              |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2017年03月02日)基金份额总额 | 200,026,166.65   |
| 本报告期期初基金份额总额               | 7,778,751,064.58 |
| 本报告期基金总申购份额                | 61,741.20        |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 5,000,081,276.39 |
| 本报告期基金拆分变动份额               | —                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 2,778,731,529.39 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经永赢基金管理有限公司董事会审议通过，聘任黄庆先生担任公司首席信息官职务。本基金管理人已于2019年11月30日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站以及中国证监会基金电子披露网站登载了《永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

本报告期内，自2019年1月22日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

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

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为90,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 信达证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由本基金管理人董事会授权管理层批准。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 | 基金交易 |
|-----|------|--------|------|------|
|-----|------|--------|------|------|

| 称        | 成交金额          | 占当期<br>债券成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期<br>债券回<br>购成交<br>总额的<br>比例 | 成交<br>金额 | 占当期权<br>证成交总<br>额的比例 | 成交<br>金额 | 占当期基<br>金成交总<br>额的比例 |
|----------|---------------|--------------------------|------|--------------------------------|----------|----------------------|----------|----------------------|
| 信达证<br>券 | 49,512,890.40 | 100.00%                  | -    | -                              | -        | -                    | -        | -                    |

## 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                             | 法定披露方式                  | 法定披露日期     |
|----|----------------------------------|-------------------------|------------|
| 1  | 永赢瑞益债券型证券投资基金2018年第4季度报告         | 证券时报、公司网站               | 2019-01-22 |
| 2  | 永赢瑞益债券型证券投资基金分红公告（2019年第1次）      | 证券时报、公司网站               | 2019-01-22 |
| 3  | 永赢瑞益债券型证券投资基金分红公告（2019年第2次）      | 证券时报、公司网站               | 2019-02-26 |
| 4  | 永赢瑞益债券型证券投资基金2018年年度报告           | 证券时报、公司网站               | 2019-03-28 |
| 5  | 永赢瑞益债券型证券投资基金2018年年度报告摘要         | 证券时报、公司网站               | 2019-03-28 |
| 6  | 永赢瑞益债券型证券投资基金更新招募说明书（2019年第1号）   | 证券时报、公司网站               | 2019-04-15 |
| 7  | 永赢瑞益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019年第1号） | 证券时报、公司网站               | 2019-04-15 |
| 8  | 永赢瑞益债券型证券投资基金2019年第1季度报告         | 证券时报、公司网站               | 2019-04-18 |
| 9  | 永赢瑞益债券型证券投资基金2019年第2季度报告         | 证券时报、公司网站               | 2019-07-19 |
| 10 | 永赢瑞益债券型证券投资基金2019年半年度报告          | 证券时报、公司网站               | 2019-08-26 |
| 11 | 永赢瑞益债券型证券投资基金2019年半年度报告摘要        | 证券时报、公司网站               | 2019-08-26 |
| 12 | 永赢瑞益债券型证券投资基金的基金经理变更公告           | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2019-09-05 |

|    |                                                               |                         |            |
|----|---------------------------------------------------------------|-------------------------|------------|
| 13 | 永赢瑞益债券型证券投资基金更新招募说明书（2019年第2号）                                | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2019-09-09 |
| 14 | 永赢瑞益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019年第2号）                              | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2019-09-09 |
| 15 | 永赢瑞益债券型证券投资基金2019年第3季度报告                                      | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2019-10-24 |
| 16 | 永赢基金管理有限公司关于永赢瑞益债券型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同及托管协议的公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2019-10-25 |
| 17 | 永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同-2019信披新规版本                                  | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2019-10-25 |
| 18 | 永赢瑞益债券型证券投资基金托管协议-2019信披新规版本                                  | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2019-10-25 |
| 19 | 永赢瑞益债券型证券投资基金更新招募说明书（2019年第3号）                                | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2019-10-30 |
| 20 | 永赢瑞益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019年第3号）                              | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2019-10-30 |
| 21 | 永赢瑞益债券型证券投资基金分红公告（2019年第3次）                                   | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站 | 2019-11-08 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|---|----------------|------------|
|---|----------------|------------|

| 资<br>者<br>类<br>别                                                                                                                        | 序<br>号 | 持有基<br>金份额<br>比例达<br>到或者<br>超过2<br>0%的时<br>间区间 | 期初份额                 | 申购份额 | 赎回份额                 | 持有份额                 | 份额占比   |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------------------------|----------------------|------|----------------------|----------------------|--------|
| 机<br>构                                                                                                                                  | 1      | 201901<br>01 - 20<br>191231                    | 7,778,037,54<br>7.67 | 0.00 | 5,000,000,00<br>0.00 | 2,778,037,54<br>7.67 | 99.98% |
| 产品特有风险                                                                                                                                  |        |                                                |                      |      |                      |                      |        |
| 本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。 |        |                                                |                      |      |                      |                      |        |

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准永赢瑞益债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢瑞益债券型证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢瑞益债券型证券投资基金招募说明书》及其更新（如有）；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦27楼

### 13.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：[www.maxwealthfund.com](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：021-51690111

永赢基金管理有限公司  
二〇二〇年三月二十六日