

# 永赢中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 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:中国银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 23 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年03月21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2022年01月01日起至2022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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	15
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	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
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	78
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	79
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	79
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	79

8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	79
8.12 投资组合报告附注 .....	79
§9 基金份额持有人信息 .....	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	80
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	80
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	81
9.4 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 .....	81
§10 开放式基金份额变动 .....	81
§11 重大事件揭示 .....	81
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	81
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 .....	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	82
11.4 基金投资策略的改变 .....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	82
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 .....	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	82
11.8 其他重大事件 .....	84
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	85
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 .....	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	85
§13 备查文件目录 .....	85
13.1 备查文件目录 .....	85
13.2 存放地点 .....	86
13.3 查阅方式 .....	86

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	永赢中证500ETF
场内简称	永赢500
基金主代码	159999
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年07月14日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	44,344,275.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020年08月12日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内。主要投资策略有：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略和存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		永赢基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	汪成杰	许俊
	联系电话	021-20430340	010-66596688
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-805-8888	95566
传真		021-51690177	010-66594942
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		马宇晖	刘连舸

## 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号二十一世纪大厦21、22、23、27层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §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	2022年	2021年	2020年07月14日（基金合同生效日）-2020年12月31日
本期已实现收益	-818,689.50	5,426,805.40	9,269,950.33
本期利润	-10,353,803.05	8,981,870.46	9,253,338.35
加权平均基金份额本期利润	-0.2243	0.1895	0.0455
本期加权平均净值利润率	-21.98%	17.21%	4.51%
本期基金份额净值增长率	-18.60%	15.68%	2.75%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	-1,440,457.96	6,460,035.53	1,591,312.97
期末可供分配基金份额利润	-0.0325	0.1336	0.0220
期末基金资产净值	42,903,817.04	57,462,298.25	74,333,012.77
期末基金份额净值	0.9675	1.1886	1.0275
3.1.3 累计期末指标	2022年末	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	-3.25%	18.86%	2.75%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.94%	1.01%	2.63%	1.03%	0.31%	-0.02%
过去六个月	-8.21%	1.08%	-9.14%	1.10%	0.93%	-0.02%
过去一年	-18.60%	1.35%	-20.31%	1.38%	1.71%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-3.25%	1.19%	-15.00%	1.23%	11.75%	-0.04%

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：中证500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变动的比较

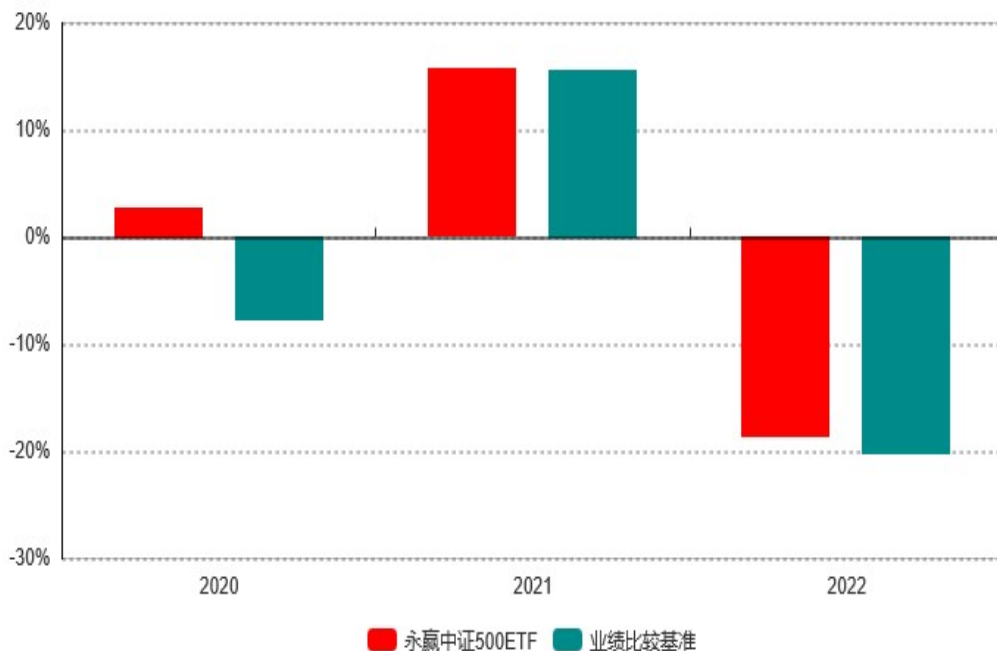
永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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。

### 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：本基金合同于2020年7月14日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金的合同生效日为2020年7月14日，截至本报告期末，本基金未进行过利润分配。

## §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%，华侨银行有限公司持股28.51%。

截止2022年12月31日，本基金管理人共管理114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、永赢润益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢嘉益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盛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、永赢通益债券型证券投资基金、永赢诚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、永赢合益债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、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、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢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、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢乾元三年定期开放混合型证券投资基金、永赢科技驱动混合型证券投资基金、永赢元利债券型证券投资基金、永赢易弘债券型证券投资基金、永赢股息优选混合型证券投资基金、永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金、永赢中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金、永赢医药健康股票型证券投资基金、永赢邦利债券型证券投资基金、永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金、永赢瑞宁87个月定期开放债券型证券投资基金、永赢成长领航混合型证券投资基金、永赢鼎利债券型证券投资基金、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金、永赢泰宁63个月定期开放债券型证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢鑫享混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫欣混合型证券投资基金、永赢稳健增利18个月持有期混合型证券投资基金、永赢鑫盛混合型证券投资基金、永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、永赢惠添益混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢港股通优质成长一年持有期

混合型证券投资基金、永赢深证创新100交易型开放式指数证券投资基金、永赢乾益债券型证券投资基金、永赢鑫辰混合型证券投资基金、永赢中债-3-5年政策性金融债指数证券投资基金、永赢长远价值混合型证券投资基金、永赢信利碳中和主题一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢轩益债券型证券投资基金、永赢深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、永赢合享混合型发起式证券投资基金、永赢安盈90天滚动持有债券型发起式证券投资基金、永赢优质精选混合型发起式证券投资基金、永赢稳健增强债券型证券投资基金、永赢添添欣12个月持有期混合型证券投资基金、永赢养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、永赢卓越臻选股票型发起式证券投资基金、永赢新能源智选混合型发起式证券投资基金、永赢坤益债券型证券投资基金、永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金、永赢宏泰短债债券型证券投资基金、永赢添添悦6个月持有期混合型证券投资基金、永赢优质生活混合型证券投资基金、永赢安悦60天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢湖北国有企业债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、永赢半导体产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢低碳环保智选混合型发起式证券投资基金、永赢安泰中短债债券型证券投资基金、永赢医药创新智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费鑫选6个月持有期混合型证券投资基金、永赢消费龙头智选混合型发起式证券投资基金、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基金、永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金、永赢季季享90天持有期中短债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万纯	权益投资部指数与数量投资部副总监/基金经理	2020-07-14	-	8	万纯先生，北京大学硕士，8年证券相关从业经验。曾任中国证券登记结算有限责任公司技术部基金业务组经理助理，平安基金管理有限公司指数投资

					部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司权益投资部指数与数量投资部副总监（主持工作）兼权益投资部智能投研部副总监（主持工作）。
罗少文	基金经理助理	2021-12-22	2022-09-13	4	罗少文先生，北京大学金融学硕士，4年证券相关从业经验。曾任国泰基金管理有限公司量化研究员，永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理助理。
张璐	基金经理助理	2022-09-13	2022-11-07	8	张璐先生，上海交通大学硕士研究生，8年证券相关从业经验。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化研究员，华泰证券（上海）资产管理有限公司量化研究员、基金经理，锐方（上海）投资管理有限公司投资经理，永赢基金管理有限公司投资经理，现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。
刘庭宇	基金经理助理	2022-11-07	-	4	刘庭宇先生，上海财经大学金融硕士，4年证券相关从业经验。曾任鹏扬基金管理有限公司量化分析师，现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理助理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢中证500交易型开放式指数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为，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）严格控制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。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有2次，原因是指数投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

## 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

本基金2022年全年运作中，A股市场在众多超预期利空因素作用下连续回调，以科技板块为代表的成长风格跌幅较深，价值板块明显占优，大小盘风格较均衡。2022上半年先后经历美联储收紧货币政策、俄乌冲突爆发、新冠疫情冲击，给市场情绪和A股企业盈利带来负面影响；五月六月随着稳增长力度加码和企业复工复产，市场迎来快速反弹；下半年受停贷事件、美国通胀超预期及多地疫情反复的影响，市场继续震荡下行；年末随着地产融资及疫情防控政策优化，市场小幅回暖。报告期内，沪深300指数下跌21.6%，中证500指数下跌20.3%，创业板指下跌29.4%。行业层面，煤炭、综合行业领涨，社会服务、交通运输跌幅较浅，电子、建筑材料、传媒、计算机、电力设备、国防军工行业领跌。中证500指数成分股行业分布相对均衡且市值偏向中小盘。

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢中证500ETF基金份额净值为0.9675元，本报告期内，基金份额净值增长率为-18.60%，同期业绩比较基准收益率为-20.31%。

## 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2023年，内需修复和海外流动性改善是贯穿全年的重要主线。随着美联储加息进入尾声、美元和美债利率走弱推动资金流入新兴市场，国内宏观经济复苏、企业

盈利回升，同时国内宏观流动性有望维持合理充裕，目前主要宽基指数均处于历史估值中低位水平，因此对权益市场或可保持积极乐观。当前看全年价值与成长风格均衡，上半年的政策重心和一季报业绩情况将决定中期风格是价值还是成长。行业方面可以关注四条主线机会：一是受益于政策支持且尚未高估的数字经济板块（计算机、半导体、通信），二是估值低位、受益政策优化的医疗板块，三是受益于经济复苏和政策超预期的金融板块，四是大安全主题下能源安全（储能）、信息安全和国防安全的机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022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，持续健全、完善内控建设，提升风险管理水平，确保基金管理业务规范运作。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

1、持续加强制度建设。报告期内，公司根据法律法规、监管政策及业务开展实际情况，对公司制度进行了全面梳理、评估与更新，确保制度的合规性、有效性和可操作性，进一步完善公司制度体系。

2、新规解读及监管要求的落实。2022年，公司持续密切关注各项最新法律法规、监管政策，及时开展新规新政的传达和解读、并拟定落实方案，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。

3、强化合规培训。为进一步提升员工合规意识，强化员工执业行为的合规性，合规部组织多次面向不同对象，针对不同主题的合规培训，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开展专项培训等，并通过多样化的方式提高员工在合规培训中的参与度以及积极性。

4、深入开展内部审计工作。公司建立了全面的内部审计体系和流程，并设置审计部作为公司风险防控机制中的一道重要防线独立履行内部审计检查职责。2022年，公司有序开展各类专项审计、离任审查、年度/季度监察稽核项目、即时通讯工具例行检查、风险事件调查等内审工作，并聘请外部机构独立开展合规有效性评估、年度内控评价等项目。针对上述审计检查发现的问题，审计部牵头推进整改，促进制度体系及业务流程不断完善，为公司防范风险、完善内控管理提供有力支持。

#### 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/研究的分管领导、权益投资的分



管领导、基金运营的分管领导、基金运营部负责人、合规部负责人和风险管理部负责人。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### **4.9 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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形，基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

## **§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### **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，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### **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**

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §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（2023）专字第61090672_B01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	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照财务报表7.4.2所述编制基础编制。
形成审计意见的基础	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，我们独立于永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金，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。
强调事项	我们提醒财务报表使用者关注财务报表7.4.2对编制基础的说明。永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金管理层编制财务报表是为了满足《永赢中证500交易型开放式指数证券投资基

	金基金合同》及相关法律法规的要求。因此，财务报表不适用于其他用途。本段内容不影响已发表的审计意见。
其他事项	本报告仅供中国证券监督管理委员会及其派出机构、中国证券投资基金业协会和永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金份额持有人使用，而不应为除中国证券监督管理委员会及其派出机构、中国证券投资基金业协会和永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金份额持有人以外的其他方使用。
其他信息	永赢中证500交易型开放式指数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。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。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。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照财务报表7.4.2所述编制基础编制财务报表（包括确定该编制基础对于在具体情况下编制财务报表是可以接受的），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。治理层负责监督永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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：(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。(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。(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。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。	
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	石静筠	费泽旭
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层	
审计报告日期	2023-03-21	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
----	-----	--------------------	---------------------

<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	912,267.12	916,350.31
结算备付金		474,730.79	761,878.23
存出保证金		189,799.83	569.01
交易性金融资产	7.4.7.2	41,428,680.72	55,987,707.28
其中：股票投资		41,428,680.72	55,987,707.28
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	99.34
资产总计		43,005,478.46	57,666,604.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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		-	-
应付清算款		0.08	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,615.75	7,264.40
应付托管费		1,871.90	2,421.48
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	335.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	94,173.69	194,284.43
负债合计		101,661.42	204,305.92
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	44,344,275.00	48,344,275.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-1,440,457.96	9,118,023.25
净资产合计		42,903,817.04	57,462,298.25
负债和净资产总计		43,005,478.46	57,666,604.17

注：（1）报告截止日2022年12月31日，基金份额净值0.9675元，基金份额总额44,344,275.00份。

（2）比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-10,133,724.82	9,452,993.98
1.利息收入		3,899.10	6,589.42
其中：存款利息收入	7.4.7.9	3,899.10	6,589.42
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列 ）		-643,294.65	5,891,781.51
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,276,270.68	4,789,612.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收 益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-160,606.64	410,883.50
股利收益	7.4.7.15	793,582.67	691,285.70
以摊余成本计量的金 融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.16	-9,535,113.55	3,555,065.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	7.4.7.17	40,784.28	-442.01

减：二、营业总支出		220,078.23	471,123.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	70,716.67	78,355.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	23,572.22	26,118.66
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	1,479.19
8. 其他费用	7.4.7.19	125,789.34	365,169.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,353,803.05	8,981,870.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,353,803.05	8,981,870.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-10,353,803.05	8,981,870.46

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年01月01日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末	48,344,275.00	-	9,118,023.25	57,462,298.25



净资产（基金净值）				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	48,344,275.00	-	9,118,023.25	57,462,298.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	-	-10,558,481.21	-14,558,481.21
（一）、综合收益总额	-	-	-10,353,803.05	-10,353,803.05
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	-	-204,678.16	-4,204,678.16
其中：1.基金申购款	4,000,000.00	-	-17,646.08	3,982,353.92
2.基金赎回款	-8,000,000.00	-	-187,032.08	-8,187,032.08
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他	-	-	-	-

综合收益结转 留存收益				
四、本期期末 净资产（基金 净值）	44,344,275.00	-	-1,440,457.96	42,903,817.04
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末 净资产（基金 净值）	72,344,275.00	-	1,988,737.77	74,333,012.77
加：会计政策 变更	-	-	-	-
前期差错 更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初 净资产（基金 净值）	72,344,275.00	-	1,988,737.77	74,333,012.77
三、本期增减 变动额（减少 以“-”号填列）	-24,000,000.00	-	7,129,285.48	-16,870,714.52
（一）、综合 收益总额	-	-	8,981,870.46	8,981,870.46
（二）、本期 基金份额交易 产生的基金净 值变动数（净 值减少以“-” 号填列）	-24,000,000.00	-	-1,852,584.98	-25,852,584.98
其中：1.基金 申购款	32,000,000.00	-	1,373,002.11	33,373,002.11
2.基金	-56,000,000.00	-	-3,225,587.09	-59,225,587.09

赎回款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	48,344,275.00	-	9,118,023.25	57,462,298.25

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

汪成杰

虞俏依

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2771号《关于准予永赢中证500交易型开放式指数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作为管理人向社会公开募集,基金合同于2020年7月14日生效,首次设立募集规模为342,344,275.00份基金份额。本基金为交易型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为永赢基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、企业债、公司债、次级债、地方政府债、金融债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资

券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的90%。股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构对该比例要求有变更的,基金管理人在履行适当程序后,可以对该比例做相应调整。

本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率。

根据基金管理人于2023年3月14日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,本次会议审议了《关于永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》并于2023年2月10日起至2023年3月10日17:00止(以基金管理人收到表决票的时间为准)对该议案进行了投票表决。根据2023年3月13日的计票结果,该议案获得通过,大会决议自2023年3月13日起生效。本基金管理人决定本基金最后运作日为2023年3月13日,本基金自2023年3月14日起进入清算程序。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

根据财务报表7.4.1和7.4.8.2所述,本基金最后运作日为2023年3月13日,本基金自2023年3月14日起进入清算程序。因此,本财务报表未以持续经营为基础列报。

本财务报表系按照《永赢中证500交易型开放式指数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7.4.4所述的重要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表按照7.4.2所述编制基础编制。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### (2) 金融负债分类

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

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照

相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

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

#### 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。

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计



入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入计入投资收益；

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

#### 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费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(3) 每次基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值；

(4) 本基金收益分配采用现金方式；

(5) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配；在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算，如本基金实施份额拆分、合并，将按经过拆分、合并调整后的基金份额折算日各类别的基金份额净值来计算相应基金份额的净值增长率）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算或拆分、合并，则以基金份额折算或拆分、合并日为初始日重新计算）；

(6) 法律法规、监管机关、注册登记机构、证券交易所另有规定的，从其规定。

#### 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

根据《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号--套期会计》、《企业会计准则第37号--金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于2022年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币916,350.31元，自应收利息转入的重分类金额为人民币99.01元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币916,449.32元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币569.01元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.33元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币569.34元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币99.34元，转出至银行存款的重分类金额为人民币99.01元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币0.33元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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 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。

#### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改

征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 7.4.6.4 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。

#### 7.4.6.5 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。

### 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	912,267.12	916,350.31
等于：本金	912,169.91	916,350.31
加：应计利息	97.21	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-

存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	912,267.12	916,350.31

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	47,486,781.19	-	41,428,680.72	-6,058,100.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,486,781.19	-	41,428,680.72	-6,058,100.47
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	52,449,254.20	-	55,987,707.28	3,538,453.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

	合计	-	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	52,449,254.20	-	55,987,707.28	3,538,453.08

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,113,440.00	-	-	-
--股指期货	1,113,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,113,440.00	-	-	-
项目	上年度末 2021年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2303	中证500股指期货2303合约	1.00	1,174,880.00	61,440.00
合计				61,440.00
减：可抵销期货暂收款				61,440.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	99.34
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	99.34

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021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	-	-
应付交易费用	10,865.56	14,284.43
其中：交易所市场	10,865.56	14,284.43
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	80,000.00	110,000.00
应付指数使用费	3,308.13	70,000.00
合计	94,173.69	194,284.43

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,344,275.00	48,344,275.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-8,000,000.00	-8,000,000.00
本期末	44,344,275.00	44,344,275.00

#### 7.4.7.8 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
本期期初	6,460,035.53	2,657,987.72	9,118,023.25
本期利润	-818,689.50	-9,535,113.55	-10,353,803.05
本期基金份额交易产生的变动数	-482,526.78	277,848.62	-204,678.16
其中：基金申购款	501,952.70	-519,598.78	-17,646.08
基金赎回款	-984,479.48	797,447.40	-187,032.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,158,819.25	-6,599,277.21	-1,440,457.96

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	3,632.04	5,120.37
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	242.47	1,066.14
其他	24.59	402.91
合计	3,899.10	6,589.42

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至20 22年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至20 21年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-755,533.96	4,297,391.83
股票投资收益——赎回差价收入	-520,736.72	492,220.48
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-1,276,270.68	4,789,612.31

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	18,566,679.43	56,703,416.65
减：卖出股票成本总额	19,275,089.48	52,406,024.82
减：交易费用	47,123.91	-
买卖股票差价收入	-755,533.96	4,297,391.83

**7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
赎回基金份额对价总额	8,187,032.08	59,225,587.09
减：现金支付赎回款总额	4,367,460.08	26,556,945.09
减：赎回股票成本总额	4,340,308.72	32,176,421.52
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-520,736.72	492,220.48

**7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益--申购差价收入。

**7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益--证券出借差价收入。

**7.4.7.11 债券投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

**7.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.13 贵金属投资收益**

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 衍生工具收益****7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
----	--------	-------------

	2022年01月01日至2022年 12月31日	2021年01月01日至2021年 12月31日
股指期货投资收益	-160,606.64	410,883.50
合计	-160,606.64	410,883.50

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
股票投资产生的股利收益	793,582.67	691,285.70
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	793,582.67	691,285.70

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-9,596,553.55	3,613,305.06
——股票投资	-9,596,553.55	3,613,305.06
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	61,440.00	-58,240.00
——权证投资	-	-
——股指期货合约	61,440.00	-58,240.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增	-	-

值税		
合计	-9,535,113.55	3,555,065.06

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
ETF基金替代损益	40,784.28	-442.01
合计	40,784.28	-442.01

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	50,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	452.43	1,508.78
指数使用费	45,238.93	108,383.21
其他	97.98	-
交易费用	-	145,277.96
合计	125,789.34	365,169.95

### 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

根据基金管理人于2023年3月14日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，本次会议审议了《关于永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》并于2023年2月10日起至2023年3月10日17:00止（以基金管理人收到表决票的时间为准）对该议案进行了投票表决。根据2023年3月13日的计票结果，该议案获得通过，大会决议自2023年3月13日起生效。本基金管理人决定本基金最后运作日为2023年3月13日，本基金自2023年3月14日起进入清算程序。

截至财务报表批准日，除上述事项外，本基金无其他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
中国银行股份有限公司 ("中国银行")	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
华侨银行有限公司 ("华侨银行")	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
永赢国际资产管理有限公司 ("永赢国际")	基金管理人的子公司

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的相关批复，永赢基金管理有限公司已在香港特别行政区政府的公司注册处办理完成香港子公司--永赢国际资产管理有限公司的注册登记手续，并于2022年11月14日获得香港证券及期货事务监察委员会颁发的第四号（就证券提供意见）及第九号（提供资产管理）牌照。

### 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债券回购交易。

### 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 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	70,716.67	78,355.72
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	23,572.22	26,118.66

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

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

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**

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。

**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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
永赢资产	32,077,908.00	72.3383%	32,077,908.00	66.3531%

**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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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
中国银行	912,267.12	3,632.04	916,350.31	5,120.37



**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--固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2022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**

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
600038	中直股份	2022-12-26	重大事项停牌	46.41	2023-01-10	51.05	1,900	95,273.84	88,179.00	-
300850	新强联	2022-12-30	重大事项停牌	53.28	2023-01-10	56.88	1,300	77,987.00	69,264.00	-

### 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2022年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022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证券款余额。

### 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

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体系。五道防线分别为员工自律及业务部门的自控和互控的第一道防线，合规风控部门监督管理的第二道防线，审计部事后检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险控制监督管理的第五道防线。

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

### 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行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本期末及上年度末，本基金均未持有短期债券投资。

#### **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**

本期末及上年度末，本基金均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**

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

#### **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制的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注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。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 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。

本基金可以投资于固定收益品种，且持有银行存款等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	912,267.12	-	-	-	-	-	912,267.12
结算备付金	-	-	-	-	-	474,730.79	474,730.79
存出保证金	1,819.03	-	-	-	-	187,980.80	189,799.83
交易性金融资产	-	-	-	-	-	41,428,680.72	41,428,680.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	914,086.15	-	-	-	-	42,091,392.31	43,005,478.46
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	0.08	0.08
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,615.75	5,615.75
应付托管费	-	-	-	-	-	1,871.90	1,871.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	94,173.69	94,173.69
负债总计	-	-	-	-	-	101,661.42	101,661.42
利率敏感度缺口	914,086.15	-	-	-	-	41,989,730.89	42,903,817.04
上年度末 2021 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	916,350.31	-	-	-	-	-	916,350.31
结算备付金	-	-	-	-	-	761,878.23	761,878.23
存出保证金	569.01	-	-	-	-	-	569.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,987,707.28	55,987,707.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	99.34	99.34
资产总计	916,919.32	-	-	-	-	56,749,684.85	57,666,604.17
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,264.40	7,264.40
应付托管费	-	-	-	-	-	2,421.48	2,421.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	335.61	335.61
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	194,284.43	194,284.43
负债总计	-	-	-	-	-	204,305.92	204,305.92
利率敏感度缺口	916,919.32	-	-	-	-	56,545,378.93	57,462,298.25

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

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债券，无重大利率风险。

#### 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例( %)		值比例( %)
交易性金融资产—股票投资	41,428,680.72	96.56	55,987,707.28	97.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	41,428,680.72	96.56	55,987,707.28	97.43

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险		
	2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准增加1%	421,720.10	564,205.21
	业绩比较基准减少1%	-421,720.10	-564,205.21

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

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法



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

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	41,271,237.72	55,879,275.28
第二层次	157,443.00	108,432.00
第三层次	-	-
合计	41,428,680.72	55,987,707.28

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比同期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,184,636.74	1,184,636.74
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	566,793.44	566,793.44
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	566,205.61	566,205.61
当期利得或损失总额	-	-51,637.69	-51,637.69
其中：计入损益的利得或损失	-	-51,637.69	-51,637.69
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或	-	-	-

损失的变动——公允价值变动损益			
-----------------	--	--	--

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2023年3月21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	41,428,680.72	96.33
	其中：股票	41,428,680.72	96.33
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	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金	-	-

	融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	1,386,997.91	3.23
8	其他各项资产	189,799.83	0.44
9	合计	43,005,478.46	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

## 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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	393,313.60	0.92
B	采矿业	1,827,532.05	4.26
C	制造业	25,182,319.71	58.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,387,045.10	3.23
E	建筑业	361,690.00	0.84
F	批发和零售业	1,762,886.58	4.11
G	交通运输、仓储和邮政业	930,681.00	2.17
H	住宿和餐饮业	109,120.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,974,181.10	6.93
J	金融业	3,600,419.00	8.39
K	房地产业	861,788.28	2.01
L	租赁和商务服务业	481,596.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	449,506.00	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	230,405.30	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	77,903.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	551,126.00	1.28

S	综合	247,168.00	0.58
	合计	41,428,680.72	96.56

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

### 8.2.2 报告期末（积极投资）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积极投资的股票组合。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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

### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002340	格林美	33,300	247,419.00	0.58
2	300012	华测检测	10,900	243,070.00	0.57
3	600157	永泰能源	144,100	220,473.00	0.51
4	002384	东山精密	8,900	220,097.00	0.51
5	688777	中控技术	2,300	208,909.00	0.49
6	300724	捷佳伟创	1,800	205,236.00	0.48
7	603613	国联股份	2,255	199,432.20	0.46
8	688122	西部超导	2,100	198,849.00	0.46
9	002422	科伦药业	7,400	196,914.00	0.46
10	300003	乐普医疗	8,500	195,245.00	0.46
11	002385	大北农	21,800	194,020.00	0.45
12	600487	亨通光电	12,800	192,768.00	0.45
13	688063	派能科技	600	189,390.00	0.44
14	002966	苏州银行	23,730	184,619.40	0.43
15	603606	东方电缆	2,700	183,141.00	0.43
16	600885	宏发股份	5,440	181,750.40	0.42

17	688390	固德威	560	180,930.40	0.42
18	600765	中航重机	5,760	179,078.40	0.42
19	603345	安井食品	1,100	178,068.00	0.42
20	600079	人福医药	7,400	176,786.00	0.41
21	600096	云天化	8,300	174,632.00	0.41
22	002497	雅化集团	7,500	174,375.00	0.41
23	601555	东吴证券	26,010	169,845.30	0.40
24	600352	浙江龙盛	16,900	167,310.00	0.39
25	002625	光启技术	9,800	166,796.00	0.39
26	002407	多氟多	5,000	166,600.00	0.39
27	002603	以岭药业	5,460	163,581.60	0.38
28	000009	中国宝安	13,400	162,006.00	0.38
29	002738	中矿资源	2,400	159,984.00	0.37
30	601058	赛轮轮胎	15,900	159,318.00	0.37
31	603688	石英股份	1,200	157,584.00	0.37
32	601233	桐昆股份	10,900	157,505.00	0.37
33	600988	赤峰黄金	8,600	155,230.00	0.36
34	600489	中金黄金	18,900	154,791.00	0.36
35	603605	珀莱雅	920	154,081.60	0.36
36	600298	安琪酵母	3,400	153,748.00	0.36
37	002028	思源电气	4,000	152,880.00	0.36
38	300390	天华超净	2,700	150,876.00	0.35
39	300146	汤臣倍健	6,600	150,612.00	0.35
40	601108	财通证券	21,100	150,232.00	0.35
41	000807	云铝股份	13,500	150,120.00	0.35
42	000630	铜陵有色	47,800	149,136.00	0.35
43	300144	宋城演艺	10,200	148,920.00	0.35
44	600418	江淮汽车	11,300	148,369.00	0.35
45	600536	中国软件	2,530	147,574.90	0.34
46	603939	益丰药房	2,300	146,832.00	0.34
47	300073	当升科技	2,600	146,640.00	0.34

48	603517	绝味食品	2,400	146,616.00	0.34
49	600859	王府井	5,200	146,328.00	0.34
50	300037	新宙邦	3,360	146,059.20	0.34
51	600399	抚顺特钢	10,200	145,962.00	0.34
52	600141	兴发集团	5,000	145,000.00	0.34
53	300699	光威复材	2,000	144,500.00	0.34
54	600563	法拉电子	900	143,892.00	0.34
55	300285	国瓷材料	5,200	143,364.00	0.33
56	601077	渝农商行	40,100	141,553.00	0.33
57	600873	梅花生物	13,800	140,484.00	0.33
58	300568	星源材质	6,600	140,316.00	0.33
59	603456	九洲药业	3,300	140,019.00	0.33
60	002192	融捷股份	1,400	137,060.00	0.32
61	603816	顾家家居	3,200	136,672.00	0.32
62	600160	巨化股份	8,800	136,488.00	0.32
63	002138	顺络电子	5,200	136,136.00	0.32
64	601128	常熟银行	17,800	134,390.00	0.31
65	002185	华天科技	16,200	134,298.00	0.31
66	688099	晶晨股份	1,900	133,969.00	0.31
67	000783	长江证券	25,100	133,783.00	0.31
68	603589	口子窖	2,300	132,641.00	0.31
69	600153	建发股份	9,700	132,405.00	0.31
70	300357	我武生物	2,400	132,240.00	0.31
71	605358	立昂微	3,100	132,060.00	0.31
72	000629	钒钛股份	27,900	131,967.00	0.31
73	601699	潞安环能	7,800	131,430.00	0.31
74	601162	天风证券	45,000	129,150.00	0.30
75	000683	远兴能源	16,400	128,576.00	0.30
76	601607	上海医药	7,200	128,376.00	0.30
77	603596	伯特利	1,600	127,680.00	0.30
78	600392	盛和资源	9,100	127,400.00	0.30

79	688567	孚能科技	4,700	127,041.00	0.30
80	002568	百润股份	3,400	127,024.00	0.30
81	600521	华海药业	5,800	126,788.00	0.30
82	601168	西部矿业	12,400	126,480.00	0.29
83	600499	科达制造	8,900	126,469.00	0.29
84	000932	华菱钢铁	26,900	126,430.00	0.29
85	600109	国金证券	14,500	126,150.00	0.29
86	600161	天坛生物	5,300	125,769.00	0.29
87	000831	中国稀土	3,800	124,944.00	0.29
88	600486	扬农化工	1,200	124,680.00	0.29
89	002223	鱼跃医疗	3,900	124,254.00	0.29
90	600027	华电国际	21,100	124,068.00	0.29
91	002797	第一创业	21,800	122,734.00	0.29
92	603077	和邦生物	40,100	121,904.00	0.28
93	002078	太阳纸业	10,500	120,960.00	0.28
94	000999	华润三九	2,584	120,957.04	0.28
95	600862	中航高科	5,400	120,366.00	0.28
96	000975	银泰黄金	10,860	119,894.40	0.28
97	002025	航天电器	1,800	119,250.00	0.28
98	688385	复旦微电	1,700	118,677.00	0.28
99	601872	招商轮船	21,200	118,508.00	0.28
100	601636	旗滨集团	10,400	118,456.00	0.28
101	002294	信立泰	3,600	118,260.00	0.28
102	002439	启明星辰	4,500	117,360.00	0.27
103	600143	金发科技	12,100	117,249.00	0.27
104	600497	驰宏锌锗	23,100	116,886.00	0.27
105	002532	天山铝业	15,100	116,572.00	0.27
106	002268	电科网安	3,800	116,014.00	0.27
107	601696	中银证券	10,800	114,156.00	0.27
108	300253	卫宁健康	11,100	114,108.00	0.27
109	600177	雅戈尔	18,000	113,940.00	0.27



110	603737	三棵树	1,000	113,830.00	0.27
111	002299	圣农发展	4,800	113,712.00	0.27
112	601990	南京证券	14,300	113,399.00	0.26
113	600705	中航产融	34,400	112,832.00	0.26
114	000591	太阳能	15,200	111,416.00	0.26
115	600348	华阳股份	7,800	111,150.00	0.26
116	000738	航发控制	4,300	110,252.00	0.26
117	000998	隆平高科	6,800	109,276.00	0.25
118	600258	首旅酒店	4,400	109,120.00	0.25
119	600549	厦门钨业	5,553	108,561.15	0.25
120	600026	中远海能	9,000	108,450.00	0.25
121	000728	国元证券	17,000	107,610.00	0.25
122	002273	水晶光电	9,100	107,289.00	0.25
123	600482	中国动力	7,000	107,030.00	0.25
124	300604	长川科技	2,400	106,992.00	0.25
125	002850	科达利	900	106,929.00	0.25
126	002624	完美世界	8,400	106,848.00	0.25
127	000988	华工科技	6,500	106,665.00	0.25
128	000519	中兵红箭	5,400	106,056.00	0.25
129	002673	西部证券	17,400	105,966.00	0.25
130	601997	贵阳银行	19,200	105,408.00	0.25
131	300136	信维通信	6,300	104,013.00	0.24
132	002507	涪陵榨菜	4,000	103,080.00	0.24
133	002430	杭氧股份	2,600	102,336.00	0.24
134	300363	博腾股份	2,500	102,125.00	0.24
135	002092	中泰化学	13,500	100,710.00	0.23
136	000703	恒逸石化	14,300	100,529.00	0.23
137	300832	新产业	2,000	100,280.00	0.23
138	002557	洽洽食品	2,000	100,000.00	0.23
139	600325	华发股份	11,000	99,660.00	0.23
140	600529	山东药玻	3,500	99,400.00	0.23

140	002739	万达电影	7,100	99,400.00	0.23
142	002056	横店东磁	5,300	99,322.00	0.23
143	603233	大参林	2,500	99,000.00	0.23
144	002030	达安基因	6,360	98,961.60	0.23
145	002465	海格通信	12,000	97,440.00	0.23
146	300308	中际旭创	3,600	97,308.00	0.23
147	601666	平煤股份	9,000	97,290.00	0.23
148	601198	东兴证券	12,600	97,272.00	0.23
149	002156	通富微电	5,900	97,232.00	0.23
150	600704	物产中大	20,200	97,162.00	0.23
151	000729	燕京啤酒	9,100	96,642.00	0.23
152	601016	节能风电	25,320	96,469.20	0.22
153	600655	豫园股份	12,600	95,886.00	0.22
154	600879	航天电子	14,100	95,880.00	0.22
155	002409	雅克科技	1,900	95,703.00	0.22
156	300088	长信科技	15,900	94,923.00	0.22
157	002080	中材科技	4,400	94,292.00	0.22
158	603444	吉比特	300	93,852.00	0.22
159	600415	小商品城	17,800	93,272.00	0.22
160	000830	鲁西化工	7,500	92,925.00	0.22
161	603658	安图生物	1,500	92,775.00	0.22
162	600546	山煤国际	6,400	92,736.00	0.22
163	688116	天奈科技	1,200	92,568.00	0.22
164	002353	杰瑞股份	3,300	92,103.00	0.21
165	002683	广东宏大	3,400	91,664.00	0.21
166	000960	锡业股份	6,500	91,650.00	0.21
166	000878	云南铜业	7,800	91,650.00	0.21
168	688301	奕瑞科技	200	91,576.00	0.21
169	603267	鸿远电子	900	91,044.00	0.21
170	600516	方大炭素	14,800	90,576.00	0.21
171	603160	汇顶科技	1,800	90,360.00	0.21

172	600170	上海建工	34,700	90,220.00	0.21
173	000623	吉林敖东	6,000	89,940.00	0.21
174	300373	扬杰科技	1,700	89,420.00	0.21
175	600166	福田汽车	31,600	88,796.00	0.21
176	600637	东方明珠	13,300	88,445.00	0.21
177	600038	中直股份	1,900	88,179.00	0.21
178	300017	网宿科技	15,800	88,164.00	0.21
179	300418	昆仑万维	6,100	87,901.00	0.20
180	601577	长沙银行	13,000	87,880.00	0.20
181	002531	天顺风能	5,800	87,754.00	0.20
182	002372	伟星新材	4,100	87,494.00	0.20
183	002326	永太科技	4,000	87,320.00	0.20
184	603712	七一二	2,500	87,300.00	0.20
185	600642	申能股份	15,900	87,291.00	0.20
186	600699	均胜电子	6,200	87,110.00	0.20
187	002203	海亮股份	7,700	87,010.00	0.20
188	600739	辽宁成大	6,900	86,871.00	0.20
189	601456	国联证券	7,700	86,625.00	0.20
190	000970	中科三环	6,320	86,204.80	0.20
191	002508	老板电器	3,100	86,056.00	0.20
192	000400	许继电气	4,300	85,871.00	0.20
193	000155	川能动力	4,800	85,632.00	0.20
194	688002	睿创微纳	2,300	85,537.00	0.20
195	002444	巨星科技	4,500	85,410.00	0.20
196	689009	九号公司	2,800	85,372.00	0.20
197	600673	东阳光	9,800	85,162.00	0.20
198	600380	健康元	7,520	84,900.80	0.20
199	600909	华安证券	18,320	84,088.80	0.20
200	000039	中集集团	11,900	83,776.00	0.20
201	600867	通化东宝	9,100	83,538.00	0.19
202	603026	胜华新材	900	83,070.00	0.19

203	600056	中国医药	4,820	83,048.60	0.19
204	300676	华大基因	1,600	82,704.00	0.19
205	002065	东华软件	14,600	82,636.00	0.19
206	000750	国海证券	24,700	82,251.00	0.19
207	600985	淮北矿业	6,400	81,920.00	0.19
208	600118	中国卫星	3,800	81,890.00	0.19
209	300474	景嘉微	1,500	81,855.00	0.19
210	000739	普洛药业	3,800	81,852.00	0.19
211	603127	昭衍新药	1,400	81,774.00	0.19
212	300058	蓝色光标	16,100	81,305.00	0.19
213	600008	首创环保	28,530	80,739.90	0.19
214	600369	西南证券	21,500	80,625.00	0.19
215	002152	广电运通	8,100	80,514.00	0.19
216	688009	中国通号	16,800	80,472.00	0.19
217	600372	中航电子	5,000	79,850.00	0.19
218	600998	九州通	6,100	79,544.00	0.19
219	601880	辽港股份	49,000	79,380.00	0.19
220	002831	裕同科技	2,400	79,368.00	0.18
221	000027	深圳能源	12,400	78,864.00	0.18
222	300558	贝达药业	1,600	78,832.00	0.18
223	000636	风华高科	5,300	78,599.00	0.18
224	002936	郑州银行	33,320	78,302.00	0.18
225	603883	老百姓	1,934	78,268.98	0.18
226	002408	齐翔腾达	11,100	78,144.00	0.18
227	000513	丽珠集团	2,400	77,952.00	0.18
228	000547	航天发展	8,300	77,937.00	0.18
229	300244	迪安诊断	3,100	77,903.00	0.18
230	002131	利欧股份	43,800	77,526.00	0.18
231	002506	协鑫集成	26,600	77,406.00	0.18
232	600378	昊华科技	1,800	77,238.00	0.18
233	300866	安克创新	1,300	77,051.00	0.18

234	002212	天融信	7,700	76,923.00	0.18
235	002926	华西证券	10,200	76,806.00	0.18
236	000887	中鼎股份	5,300	76,691.00	0.18
237	603893	瑞芯微	1,100	75,691.00	0.18
238	603858	步长制药	3,600	75,636.00	0.18
239	300776	帝尔激光	600	75,600.00	0.18
240	300026	红日药业	13,300	75,544.00	0.18
241	600271	航天信息	7,200	74,952.00	0.17
242	688521	芯原股份	1,700	74,919.00	0.17
243	600580	卧龙电驱	6,000	74,760.00	0.17
244	300682	朗新科技	3,400	74,732.00	0.17
245	300296	利亚德	13,200	74,712.00	0.17
246	002195	二三四五	37,100	74,571.00	0.17
247	002572	索菲亚	4,100	74,456.00	0.17
248	002250	联化科技	4,800	74,400.00	0.17
249	600435	北方导航	6,400	74,240.00	0.17
250	002500	山西证券	14,000	74,200.00	0.17
251	600390	五矿资本	14,600	74,168.00	0.17
252	600863	内蒙华电	21,200	73,988.00	0.17
253	600848	上海临港	6,200	73,904.00	0.17
254	300070	碧水源	15,600	73,788.00	0.17
255	603156	养元饮品	3,300	73,491.00	0.17
256	300383	光环新网	9,000	73,440.00	0.17
257	002368	太极股份	2,600	73,138.00	0.17
258	600021	上海电力	7,300	73,073.00	0.17
259	688185	康希诺	500	73,010.00	0.17
260	688779	长远锂科	5,000	72,950.00	0.17
261	002958	青农商行	25,200	72,828.00	0.17
262	601958	金钼股份	6,300	72,765.00	0.17
263	002183	怡亚通	11,300	72,659.00	0.17
264	688538	和辉光电	27,000	72,360.00	0.17

265	300024	机器人	8,000	71,840.00	0.17
266	300009	安科生物	7,660	71,697.60	0.17
267	002244	滨江集团	8,100	71,523.00	0.17
268	600755	厦门国贸	10,000	71,400.00	0.17
269	688256	寒武纪	1,300	70,928.00	0.17
270	600208	新湖中宝	27,900	70,866.00	0.17
271	600820	隧道股份	13,400	70,618.00	0.16
272	002155	湖南黄金	5,447	70,538.65	0.16
273	600316	洪都航空	2,800	70,532.00	0.16
274	000997	新大陆	5,400	70,254.00	0.16
275	300251	光线传媒	8,100	70,146.00	0.16
276	600315	上海家化	2,200	70,070.00	0.16
277	002511	中顺洁柔	5,097	70,032.78	0.16
278	601231	环旭电子	4,300	69,789.00	0.16
279	000060	中金岭南	17,000	69,700.00	0.16
280	000050	深天马 A	8,000	69,280.00	0.16
281	300850	新强联	1,300	69,264.00	0.16
282	600060	海信视像	5,100	69,054.00	0.16
283	601005	重庆钢铁	43,500	68,730.00	0.16
284	603927	中科软	2,320	68,695.20	0.16
285	601992	金隅集团	27,000	68,580.00	0.16
286	300001	特锐德	4,500	68,445.00	0.16
287	600566	济川药业	2,500	68,050.00	0.16
288	603218	日月股份	3,300	66,990.00	0.16
289	601717	郑煤机	6,000	66,960.00	0.16
289	600511	国药股份	2,400	66,960.00	0.16
291	600528	中铁工业	8,600	65,618.00	0.15
292	002939	长城证券	7,900	65,412.00	0.15
293	002128	电投能源	5,300	65,402.00	0.15
294	600201	生物股份	7,244	65,268.44	0.15
295	000021	深科技	6,100	65,209.00	0.15

296	600801	华新水泥	4,400	65,208.00	0.15
297	002153	石基信息	4,340	65,056.60	0.15
298	603568	伟明环保	3,510	65,040.30	0.15
299	300168	万达信息	7,700	64,911.00	0.15
300	603885	吉祥航空	4,000	64,720.00	0.15
301	600066	宇通客车	8,600	64,586.00	0.15
302	600171	上海贝岭	3,700	64,491.00	0.15
303	002127	南极电商	13,400	64,454.00	0.15
304	000825	太钢不锈	14,900	64,368.00	0.15
305	002373	千方科技	7,200	64,224.00	0.15
306	603000	人民网	3,800	64,106.00	0.15
307	600906	财达证券	8,400	63,588.00	0.15
308	600598	北大荒	4,600	63,296.00	0.15
309	600839	四川长虹	23,900	63,096.00	0.15
310	300677	英科医疗	3,000	63,090.00	0.15
311	600827	百联股份	5,200	63,024.00	0.15
312	600282	南钢股份	20,000	63,000.00	0.15
313	600535	天士力	5,800	62,408.00	0.15
314	600970	中材国际	7,300	62,196.00	0.14
315	601866	中远海发	25,700	62,194.00	0.14
316	601778	晶科科技	11,300	62,150.00	0.14
317	601665	齐鲁银行	14,900	62,133.00	0.14
318	600663	陆家嘴	6,300	61,362.00	0.14
319	601179	中国西电	13,300	61,313.00	0.14
320	000930	中粮科技	7,300	61,028.00	0.14
321	688188	柏楚电子	280	60,782.40	0.14
322	000709	河钢股份	26,800	60,568.00	0.14
323	600498	烽火通信	4,600	60,444.00	0.14
324	000778	新兴铸管	16,500	60,225.00	0.14
325	002595	豪迈科技	2,600	60,190.00	0.14
326	300618	寒锐钴业	1,500	60,075.00	0.14

327	300182	捷成股份	13,400	59,898.00	0.14
328	000012	南玻 A	8,900	59,719.00	0.14
329	600500	中化国际	9,000	59,490.00	0.14
330	600398	海澜之家	11,200	59,360.00	0.14
331	002701	奥瑞金	11,700	59,085.00	0.14
332	300861	美畅股份	1,200	58,992.00	0.14
333	002019	亿帆医药	4,800	58,800.00	0.14
334	000581	威孚高科	3,300	58,509.00	0.14
335	002124	天邦食品	9,560	58,411.60	0.14
336	000987	越秀资本	9,730	58,282.70	0.14
337	002985	北摩高科	1,289	58,133.90	0.14
338	600959	江苏有线	19,500	57,915.00	0.13
339	002396	星网锐捷	3,000	57,480.00	0.13
340	000598	兴蓉环境	11,700	57,213.00	0.13
341	300888	稳健医疗	800	57,200.00	0.13
342	300115	长盈精密	5,520	57,021.60	0.13
343	600297	广汇汽车	27,100	56,910.00	0.13
344	688208	道通科技	1,800	56,790.00	0.13
345	000401	冀东水泥	6,900	56,787.00	0.13
346	603707	健友股份	3,145	56,735.80	0.13
347	600895	张江高科	5,000	56,700.00	0.13
348	002505	鹏都农牧	21,800	56,244.00	0.13
349	600582	天地科技	10,800	56,160.00	0.13
350	600718	东软集团	5,600	55,720.00	0.13
351	002670	国盛金控	7,500	55,575.00	0.13
352	300482	万孚生物	1,740	55,453.80	0.13
353	002249	大洋电机	10,800	55,296.00	0.13
354	600329	达仁堂	1,900	55,290.00	0.13
355	603225	新凤鸣	5,000	54,400.00	0.13
356	002266	浙富控股	13,900	54,349.00	0.13
357	600517	国网英大	11,200	54,208.00	0.13



358	600409	三友化工	8,200	54,202.00	0.13
359	002690	美亚光电	2,260	54,014.00	0.13
360	000883	湖北能源	12,800	53,760.00	0.13
361	603866	桃李面包	3,460	53,284.00	0.12
362	000656	金科股份	27,700	52,907.00	0.12
363	600022	山东钢铁	35,700	52,836.00	0.12
364	002002	鸿达兴业	16,300	52,812.00	0.12
365	000089	深圳机场	6,700	52,662.00	0.12
366	300212	易华录	2,580	52,657.80	0.12
367	601000	唐山港	19,200	52,608.00	0.12
368	601106	中国一重	17,900	52,447.00	0.12
369	600871	石化油服	26,400	52,272.00	0.12
370	600259	广晟有色	1,300	52,260.00	0.12
371	600064	南京高科	7,880	52,086.80	0.12
372	600567	山鹰国际	21,000	52,080.00	0.12
373	000785	居然之家	12,700	51,943.00	0.12
374	688690	纳微科技	1,000	51,770.00	0.12
375	002468	申通快递	5,000	51,650.00	0.12
376	600216	浙江医药	4,400	51,436.00	0.12
377	002429	兆驰股份	14,700	51,303.00	0.12
378	300376	易事特	7,500	51,225.00	0.12
379	688029	南微医学	620	50,920.60	0.12
380	600131	国网信通	3,400	50,864.00	0.12
381	600782	新钢股份	12,400	50,716.00	0.12
382	601333	广深铁路	22,100	50,167.00	0.12
383	601718	际华集团	17,100	49,761.00	0.12
384	600667	太极实业	9,600	49,536.00	0.12
385	600507	方大特钢	8,200	49,364.00	0.12
386	601187	厦门银行	8,600	49,278.00	0.11
387	601118	海南橡胶	11,100	48,618.00	0.11
388	600728	佳都科技	9,200	48,576.00	0.11

389	601991	大唐发电	17,400	48,546.00	0.11
390	002191	劲嘉股份	6,700	48,441.00	0.11
391	300463	迈克生物	2,800	48,440.00	0.11
392	600597	光明乳业	4,500	48,420.00	0.11
393	600062	华润双鹤	2,700	48,303.00	0.11
394	000540	中天金融	31,800	48,018.00	0.11
395	600737	中粮糖业	6,900	47,886.00	0.11
396	600376	首开股份	8,400	47,796.00	0.11
397	000537	广宇发展	3,600	47,628.00	0.11
398	600808	马钢股份	16,900	47,489.00	0.11
399	600155	华创阳安	7,300	47,450.00	0.11
400	601156	东航物流	3,100	47,306.00	0.11
401	002048	宁波华翔	3,400	47,260.00	0.11
402	002745	木林森	5,800	47,038.00	0.11
403	601098	中南传媒	4,700	46,906.00	0.11
404	002081	金螳螂	9,600	46,560.00	0.11
405	002221	东华能源	6,100	46,543.00	0.11
406	002010	传化智联	8,700	46,458.00	0.11
407	000937	冀中能源	7,300	46,428.00	0.11
408	603379	三美股份	1,600	45,536.00	0.11
409	002416	爱施德	4,800	45,504.00	0.11
410	600967	内蒙一机	5,500	45,430.00	0.11
411	000156	华数传媒	6,000	44,940.00	0.10
412	000559	万向钱潮	9,200	44,804.00	0.10
413	603228	景旺电子	2,200	44,528.00	0.10
414	603317	天味食品	1,620	44,517.60	0.10
415	300072	海新能科	10,100	44,036.00	0.10
416	601568	北元集团	7,710	43,715.70	0.10
417	601598	中国外运	11,200	43,008.00	0.10
418	002423	中粮资本	6,000	42,960.00	0.10
419	600901	江苏金租	7,800	42,744.00	0.10

420	601611	中国核建	5,600	42,560.00	0.10
421	002281	光迅科技	2,700	42,444.00	0.10
422	600095	湘财股份	5,600	42,336.00	0.10
423	001914	招商积余	2,746	42,233.48	0.10
424	600707	彩虹股份	10,200	42,228.00	0.10
425	600373	中文传媒	4,400	42,108.00	0.10
426	003035	南网能源	7,400	41,958.00	0.10
427	300630	普利制药	1,700	41,922.00	0.10
428	603056	德邦股份	2,000	41,660.00	0.10
429	000898	鞍钢股份	15,600	41,652.00	0.10
430	600968	海油发展	14,400	41,472.00	0.10
431	002867	周大生	2,950	41,388.50	0.10
432	688289	圣湘生物	1,880	41,266.00	0.10
433	000402	金融街	7,800	40,950.00	0.10
434	002110	三钢闽光	8,600	40,420.00	0.09
435	600126	杭钢股份	9,700	40,061.00	0.09
436	600556	天下秀	5,900	39,766.00	0.09
437	002434	万里扬	4,900	39,445.00	0.09
438	301029	怡合达	600	39,444.00	0.09
439	601608	中信重工	11,200	39,088.00	0.09
440	000563	陕国投 A	12,900	39,087.00	0.09
441	300257	开山股份	2,600	39,000.00	0.09
442	601928	凤凰传媒	4,900	38,808.00	0.09
443	000415	渤海租赁	17,500	38,675.00	0.09
444	002948	青岛银行	11,480	38,572.80	0.09
445	000959	首钢股份	10,200	38,454.00	0.09
446	600195	中牧股份	3,300	38,346.00	0.09
447	001203	大中矿业	2,900	37,497.00	0.09
448	600167	联美控股	5,900	37,288.00	0.09
449	000967	盈峰环境	8,200	37,228.00	0.09
450	603650	彤程新材	1,200	36,996.00	0.09

451	600307	酒钢宏兴	22,200	36,630.00	0.09
452	002925	盈趣科技	2,210	36,509.20	0.09
453	600339	中油工程	11,900	35,462.00	0.08
454	000990	诚志股份	4,000	35,200.00	0.08
455	688006	杭可科技	800	35,016.00	0.08
456	002705	新宝股份	2,100	34,965.00	0.08
457	002399	海普瑞	2,700	34,695.00	0.08
458	002146	荣盛发展	15,800	34,286.00	0.08
459	600928	西安银行	9,600	33,792.00	0.08
460	002653	海思科	1,500	33,375.00	0.08
461	002242	九阳股份	2,000	32,960.00	0.08
462	601828	美凯龙	7,000	32,830.00	0.08
463	300869	康泰医学	1,000	32,570.00	0.08
464	600006	东风汽车	5,800	32,364.00	0.08
465	600648	外高桥	2,700	32,265.00	0.08
466	603638	艾迪精密	2,160	32,227.20	0.08
467	600764	中国海防	1,400	32,144.00	0.07
468	600787	中储股份	6,400	31,808.00	0.07
469	000031	大悦城	8,300	31,208.00	0.07
470	600623	华谊集团	4,900	30,968.00	0.07
471	000961	中南建设	14,000	30,660.00	0.07
472	002563	森马服饰	5,800	30,392.00	0.07
473	601969	海南矿业	4,000	29,640.00	0.07
474	603719	良品铺子	800	29,496.00	0.07
475	688819	天能股份	800	29,392.00	0.07
476	688088	虹软科技	1,300	29,263.00	0.07
477	000553	安道麦A	3,200	28,960.00	0.07
478	601298	青岛港	5,100	28,611.00	0.07
479	000062	深圳华强	2,300	28,083.00	0.07
480	600377	宁沪高速	3,400	27,948.00	0.07
481	000869	张裕A	900	27,216.00	0.06

482	601139	深圳燃气	4,000	26,160.00	0.06
483	601869	长飞光纤	800	26,104.00	0.06
484	600350	山东高速	4,500	25,605.00	0.06
485	002945	华林证券	1,900	25,042.00	0.06
486	600299	安迪苏	3,000	24,780.00	0.06
487	001872	招商港口	1,600	22,976.00	0.05
488	601228	广州港	6,800	21,420.00	0.05
489	603868	飞科电器	300	20,199.00	0.05
490	603786	科博达	300	19,749.00	0.05
491	603355	莱克电气	700	19,628.00	0.05
492	600956	新天绿能	2,000	19,280.00	0.04
493	601158	重庆水务	3,700	18,981.00	0.04
494	300741	华宝股份	800	18,824.00	0.04
495	001227	兰州银行	4,500	16,965.00	0.04
496	600917	重庆燃气	2,100	16,716.00	0.04
497	600927	永安期货	1,000	16,120.00	0.04
498	600032	浙江新能	1,300	14,937.00	0.03
499	002901	大博医疗	400	13,612.00	0.03
500	688772	珠海冠宇	700	13,048.00	0.03

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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

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	002497	雅化集团	281,589.00	0.49
2	002240	盛新锂能	273,102.00	0.48
3	300012	华测检测	272,677.00	0.47
4	300769	德方纳米	271,624.00	0.47

5	600096	云天化	267,799.00	0.47
6	002340	格林美	265,734.00	0.46
7	688180	君实生物	225,126.00	0.39
8	300073	当升科技	215,285.00	0.37
9	688122	西部超导	213,544.00	0.37
10	002407	多氟多	211,554.00	0.37
11	300390	天华超净	210,471.00	0.37
12	688063	派能科技	209,574.00	0.36
13	603444	吉比特	206,279.00	0.36
14	002756	永兴材料	201,570.00	0.35
15	601058	赛轮轮胎	192,270.00	0.33
16	603345	安井食品	191,895.00	0.33
17	300003	乐普医疗	190,060.00	0.33
18	002738	中矿资源	187,816.00	0.33
19	601108	财通证券	187,748.00	0.33
20	603606	东方电缆	184,896.00	0.32

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。

#### 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

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	600256	广汇能源	457,372.00	0.80
2	600522	中天科技	425,528.00	0.74
3	601615	明阳智能	360,511.00	0.63
4	000733	振华科技	351,693.00	0.61
5	002340	格林美	303,681.00	0.53
6	600188	兖矿能源	299,788.00	0.52
7	603290	斯达半导	278,656.00	0.48
8	600732	爱旭股份	272,882.00	0.47
9	002180	纳思达	259,970.00	0.45

10	600233	圆通速递	253,281.00	0.44
11	603444	吉比特	250,238.00	0.44
12	300751	迈为股份	248,934.00	0.43
13	601117	中国化学	244,089.00	0.42
14	000723	美锦能源	242,149.00	0.42
15	600884	杉杉股份	216,627.00	0.38
16	688005	容百科技	212,856.00	0.37
17	605358	立昂微	205,124.08	0.36
18	600875	东方电气	199,327.00	0.35
19	300763	锦浪科技	195,180.00	0.34
20	000983	山西焦煤	193,853.00	0.34

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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	16,979,443.19
卖出股票收入（成交）总额	18,566,679.43

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

#### 8.5 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 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	189,799.83
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	189,799.83

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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(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
325	136,443.92	35,978,607.00	81.1347%	8,365,668.00	18.8653%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	永赢资产管理有限公司	32,077,908.00	72.34%
2	中信建投证券股份有限公司	3,900,699.00	8.80%
3	李翠英	995,019.00	2.24%
4	程晓东	569,138.00	1.28%
5	杨清萍	560,105.00	1.26%
6	张丽怡	399,011.00	0.90%
7	张红	300,020.00	0.68%
8	靳玮	300,008.00	0.68%
9	陈赛月	300,000.00	0.68%

10	郑慧英	200,085.00	0.45%
----	-----	------------	-------

### 9.3 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	-	-

### 9.4 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、基金投资和相关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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年07月14日)基金份额总额	342,344,275.00
本报告期期初基金份额总额	48,344,275.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	44,344,275.00

## §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，黄庆先生不再担任公司首席信息官职务，徐翔先生不再担任公司副总经理职务。本基金管理人已分别于2022年7月30日、2022年10月22日在规定信息披露媒介登载了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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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30,000.00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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生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	
中信建投	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	新增
东吴证券	2	-	-	-	-	新增
广发证券	2	-	-	-	-	-

华泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	14,136,302.53	39.80%	10,275.85	39.76%	-
申万宏源证券	2	6,166,883.00	17.36%	4,509.97	17.45%	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	996,911.77	2.81%	724.42	2.80%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	741,316.00	2.09%	537.30	2.08%	-
海通证券	3	13,479,145.72	37.95%	9,796.82	37.91%	-

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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	永赢基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-01
2	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-22
3	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-18
4	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-26
5	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
6	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2022年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2022-07-20
7	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-07-30
8	永赢基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2022-08-01
9	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2022年中期报告	中国证监会规定媒介	2022-08-30
10	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2022年第1号)	中国证监会规定媒介	2022-09-29
11	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新(2022年第1号)	中国证监会规定媒介	2022-09-29

12	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-10-22
13	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2022年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2022-10-26
14	永赢基金管理有限公司关于设立香港子公司及获批相关业务牌照的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-16

## §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	20220101 - 20221231	32,077,908.00	0.00	0.00	32,077,908.00	72.34%
	2	20220609 - 20220609	5,831,610.00	12,430,076.00	14,360,987.00	3,900,699.00	8.80%
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. 中国证监会准予永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
2. 《永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢中证500交易型开放式指数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号二十一世纪大厦  
21、22、23、27层

### 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：400-805-8888

永赢基金管理有限公司  
二〇二三年三月二十三日