

永赢长远价值混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年06月30日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 13 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 14 |
| 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 16 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 16 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 17 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表 | 17 |
| 6.2 利润表 | 19 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 21 |
| 6.4 报表附注 | 23 |
| §7 投资组合报告 | 58 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 58 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 58 |
| 7.3 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 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 65 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 68 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 69 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 69 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 69 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 69 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 69 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 69 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 70 |
| §8 基金份额持有人信息 | 70 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 71 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 71 |

| | |
|---|----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 71 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 72 |
| §10 重大事件揭示..... | 72 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 72 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 72 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 72 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 73 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 73 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 73 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 73 |
| 10.8 其他重大事件..... | 74 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 75 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 75 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 75 |
| §12 备查文件目录..... | 75 |
| 12.1 备查文件目录..... | 75 |
| 12.2 存放地点..... | 76 |
| 12.3 查阅方式..... | 76 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称 | 永赢长远价值混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 永赢长远价值混合 | |
| 基金主代码 | 012406 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021年09月13日 | |
| 基金管理人 | 永赢基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 6,058,176,817.39份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 永赢长远价值混合A | 永赢长远价值混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012406 | 012407 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,568,925,643.57份 | 489,251,173.82份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | <p>本基金以价值投资理念为指导，采用稳健的资产配置和股票投资策略，充分考虑个股的安全边际，精选具有持续成长性和核心竞争力的企业，在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。</p> |
| 投资策略 | <p>本基金以价值投资理念为指导，采用稳健的大类资产配置和股票投资策略。在资产配置中，通过以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析法来确定投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例，并结合对市场估值、市场资金、投资主体行为和市场信心影响等因素的综合判断进行灵活调整。在股票投资中，采取“自下而上和自上而下相结合”的策略，结合行业中观景气比较下的轮动投资策略，并辅以严格的投资组合风险控制，优选能够为股东创造价值的可持续成长公司，以获得长期持续稳健的投资收益。在投资组合的构建上，主要关注以下两个方</p> |

| | |
|--------|---|
| | 面：一是具有较大市场空间、持续经营确定性强、盈利能力和核心竞争力突出的企业；二是综合考量周期与产业的边际变化，在具备安全边际的前提下，把握企业盈利拐点的确定性机会。本基金主要投资策略包含大类资产配置、股票精选策略、固定收益投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*75%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）*5% |
| 风险收益特征 | <p>本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 汪成杰 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 021-20430340 | 95559 |
| | 电子邮箱 | wangcj@maxwealthfund.com | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-805-8888 | 95559 |
| 传真 | | 021-51690177 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 浙江省宁波市鄞州区中山东路466号 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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 | 中国（上海）长宁区仙霞路18号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200336 |
| 法定代表人 | | 马宇晖 | 任德奇 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.maxwealthfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|------------------------------------|
| 注册登记机构 | 永赢基金管理有限公司 | 上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日) | |
|---------------|----------------------------------|-----------------|
| | 永赢长远价值混合 A | 永赢长远价值混合 C |
| 本期已实现收益 | -470,920,081.32 | -41,284,527.35 |
| 本期利润 | -514,157,288.33 | -44,851,098.60 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0869 | -0.0864 |
| 本期加权平均净值利润率 | -14.53% | -14.49% |
| 本期基金份额净值增长率 | -13.52% | -13.62% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2023年06月30日) | |
| 期末可供分配利润 | -2,488,945,371.24 | -219,599,415.85 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.4469 | -0.4488 |
| 期末基金资产净值 | 3,080,481,116.48 | 269,657,562.05 |
| 期末基金份额净值 | 0.5532 | 0.5512 |

| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2023年06月30日) | |
|--------------|-----------------------|---------|
| | 基金份额累计净值增长率 | -44.68% |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

永赢长远价值混合A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月 | 1.00% | 0.68% | 1.20% | 0.71% | -0.20% | -0.03% |
| 过去三个月 | -7.43% | 0.90% | -3.78% | 0.67% | -3.65% | 0.23% |
| 过去六个月 | -13.52% | 0.97% | -0.29% | 0.68% | -13.23% | 0.29% |
| 过去一年 | -33.09% | 1.22% | -10.78% | 0.80% | -22.31% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | -44.68% | 1.32% | -18.16% | 0.89% | -26.52% | 0.43% |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*75%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）*5%。

永赢长远价值混合C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

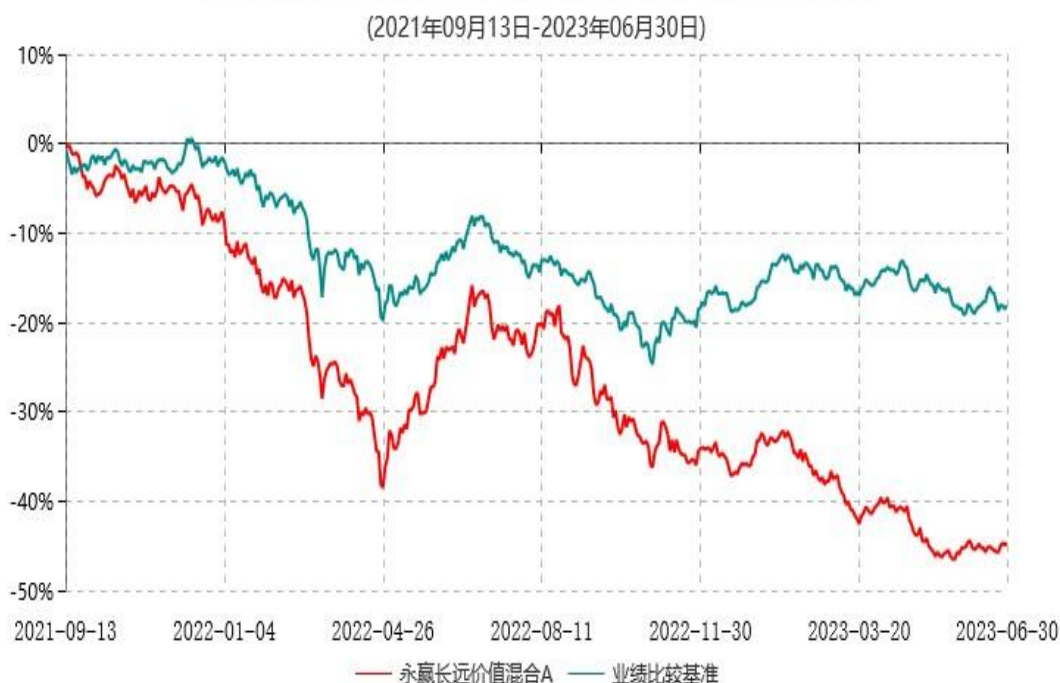
| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|--------|
| 过去一个月 | 0.99% | 0.67% | 1.20% | 0.71% | -0.21% | -0.04% |
| 过去三个月 | -7.49% | 0.90% | -3.78% | 0.67% | -3.71% | 0.23% |
| 过去六个月 | -13.62% | 0.97% | -0.29% | 0.68% | -13.33% | 0.29% |
| 过去一年 | -33.23% | 1.22% | -10.78% | 0.80% | -22.45% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | -44.88% | 1.32% | -18.16% | 0.89% | -26.72% | 0.43% |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*75%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）*5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

永赢长远价值混合A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。

永赢长远价值混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2023年6月30日，本基金管理人共管理117只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢稳益债券型证券投资基金、永赢双利债券型证券投资基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢天天利货币市场基金、永赢永益债券型证券投资基金、永赢丰利债券型证券投资基金、

永赢增益债券型证券投资基金、永赢恒益债券型证券投资基金、永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠益债券型证券投资基金、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢嘉益债券型证券投资基金、永赢裕益债券型证券投资基金、永赢祥益债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢诚益债券型证券投资基金、永赢通益债券型证券投资基金、永赢昌益债券型证券投资基金、永赢宏益债券型证券投资基金、永赢伟益债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、永赢智益纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢沪深300指数型发起式证券投资基金、永赢众利债券型证券投资基金、永赢同利债券型证券投资基金、永赢昌利债券型证券投资基金、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、永赢乾元三年定期开放混合型证券投资基金、永赢科技驱动混合型证券投资基金、永赢元利债券型证券投资基金、永赢易弘债券型证券投资基金、永赢股息优选混合型证券投资基金、永赢中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、永赢医药健康股票型证券投资基金、永赢邦利债券型证券投资基金、永赢瑞宁87个月定期开放债券型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫享混合型证券投资基金、永赢鼎利债券型证券投资基金、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金、永赢成长领航混合型证券投资基金、永赢泰宁63个月定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫欣混合型证券投资基金、永赢稳健增利18个月持有期混合型证券投资基金、永赢鑫盛混合型证券投资基金、永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠添益混合型证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢港股通优质成长一年持有期混合型证券投资基金、永赢深证创新100交易型开放式指数证券投资基金、永赢乾益债券型证券投资基金、永赢鑫辰混合型证券投资基金、永赢中债-3-5年政策性金融债指数证券投资基金、永赢长远价值混合型证券投资基金、永赢信利碳中和主题一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢轩益债券型证券投资基金、永赢深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢合享混合型发起式证券投资基金、永赢慧盈一年

持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、永赢安盈90天滚动持有债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增强债券型证券投资基金、永赢优质精选混合型发起式证券投资基金、永赢添添欣12个月持有期混合型证券投资基金、永赢养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、永赢卓越臻选股票型发起式证券投资基金、永赢新能源智选混合型发起式证券投资基金、永赢坤益债券型证券投资基金、永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金、永赢宏泰短债债券型证券投资基金、永赢添添悦6个月持有期混合型证券投资基金、永赢优质生活混合型证券投资基金、永赢安悦60天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢湖北国有企业债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、永赢半导体产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢低碳环保智选混合型发起式证券投资基金、永赢安泰中短债债券型证券投资基金、永赢医药创新智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费鑫选6个月持有期混合型证券投资基金、永赢消费龙头智选混合型发起式证券投资基金、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基金、永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金、永赢季季享90天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢昭利债券型证券投资基金、永赢恒欣稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金、永赢数字经济智选混合型发起式证券投资基金、永赢月月享30天持有期短债债券型证券投资基金、永赢先进制造智选混合型发起式证券投资基金、永赢浩益一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 常远 | 基金经理 | 2021-09-13 | - | 12 | 常远先生，同济大学理学博士，12年证券相关从业经验。曾任易方达基金管理有限公司权益投资部基金经理，现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。 |
| 许拓 | 基金经理 | 2023-06-06 | - | 10 | 许拓先生，硕士，10年证 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 券相关从业经验。曾任中欧基金管理有限公司研究员；中信证券股份有限公司研究员；农银汇理基金管理有限公司权益基金经理。现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回溯过往我们可以看到股票回报率不管在时间还是在空间上都是非线性分布，全面的大牛市或者大熊市出现的次数较少且延续的时间均较短，而震荡市占据了绝大多数时间段。不同指数、行业、个股的主要收益或者亏损都出现在较短的一段时间内，体现了明显的周期回归特性；特定时间段内的主要收益来源也仅仅只在个别指数、行业或者个股，体现了明显的马太效应。

基于此，作为主动管理基金经理，必须保持专注和耐心。相信专注的力量，深入研究找到阶段性可能回报较好的资产，并耐心持有，相信价格终会反应价值并能获取合理回报。因此，主动管理在操作上既要阶段性持股，也要周期性轮动。

主动管理的投资资产选择方面，我们相信所选择的资产必须尊重时代大势、尊重产业规律、尊重市场特征。首先，资产管理行业存在的核心要义即通过支持国家和社会的发展获取合理回报，因此所选择资产应该遵循国家导向、社会需要。其次，任何产业都有其自身的产业规律，盈利景气成周期性波动，盈利较好的时候资本市场更愿意给与更高的估值，但周期终会回归，产业规律最终会主导企业价值。再次，资本市场的偏好阶段性会有明显的不同，市场对大小市值、产业方向、价值主题的选择会不断变化，逆资本市场特征可能需要付出更多的时间成本。

主动管理的投资策略操作方面，我们强调选对产业为获取收益之矛、做好策略为优化收益之盾。投资的根本是投资特定产业阶段的优秀企业，选对阶段性景气度不断上升的产业能较为高效的获取收益，但是产业景气的波动虽然有规律可循，但仍较难把握，必须适当的做好股票策略以应对产业景气并未按照预想演化、股票估值高低等问题。

具体的基金管理中，我们比较偏好左侧适度重仓景气度未被充分认知、仍有较好性价比的行业。我们认为左侧投资在一定意义上更有利于争取低风险高收益，因为一般情况下左侧投资时股票并未被充分定价、估值性价比较高，虽然付出一定的时间成本，但是与之相对应的回报往往也较为可观。当然，左侧投资比较考验投资管理人的特质，需要具备大局观、独立性、前瞻性，同时考验研究深度和投资耐性，要求能够适当阶段性偏离和对抗市场，执行难度很大，需要反复历练。

概括起来看，我们在管理基金过程中将保持专注和耐心，深入理解并运用“周期回归”和“马太效应”两大投资原理，秉持“尊重时代大势、尊重产业规律、尊重市场特征”的投资理念，利用“产业研究为获取收益之矛、股票策略为控制回撤之盾”的投资框架，左侧投资“量、价或者盈利弹性”可能出现较大变化的行业和个股，注重估值性

价比，积极但不激进，行稳致远，努力控制回撤，将为持有人获取良好收益作为奋斗目标。

上半年的股票投资难度较大，也给基金操作带来了困扰。

上半年从结果上看，国内环境复苏力度较弱，美国经济韧性超预期，但是期间市场对宏观经济的预期波动较大。年初在疫情放开迅速过峰后，市场预期国内宏观经济将强劲复苏，但春节后宏观经济基本面复苏力度并未超预期，目前市场已开始逐步修正过于乐观的经济预期；虽然央行在6月份进行了降息，但市场对经济的预期逐步转向悲观；但国内整体流动性仍宽松，金融市场流动性较为充足。与此同时，美国经济韧性不断超预期，美联储上半年不断加息，甚至指引下半年仍有加息可能，以致外资不断流出。

在此背景下，A股总体表现一般，主要指数维持震荡，但期间波动较大、分化明显，主题投资是较好的获益方向。春节前，经济复苏预期强，所以顺周期相关行业表现较强，其中建材、轻工、食品饮料等行业表现均不错；而春节后经济预期不断走弱，海外AI产业取得突破，国内中特估值被重视，主题投资此起彼伏，通信、传媒、计算机、机械、建筑等行业表现较强，部分高股息标的也有明显涨幅。H股市场由于经济基本面复苏力度不及乐观预期，且外资持续流出，叠加港股市场缺乏主题行情的基础，在年初反弹后维持震荡偏弱状况。

上半年，为了提升组合的稳定性，控制组合风险，本基金在二季度适当降低了权益仓位，并对持仓结构进行了调整，降低了行业集中度，分散了个股的持仓比例。鉴于宏观经济复苏力度仍不稳定，消费行业估值仍不够便宜，本基金调整了消费行业配置比例；由于国内经济暂未明显复苏，美元持续强势，海外资金持续流出，港股大盘继续承压，本基金降低了港股的持仓比例。基于组合稳定性考虑，本基金充分考虑性价比，在反复比选后，增配了中特估值背景下的稳定运营的公共事业、高股息的银行、低估值的建筑交运地产、长期发展前景相对确定的军工等行业，以降低组合波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢长远价值混合A基金份额净值为0.5532元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.52%，同期业绩比较基准收益率为-0.29%；截至报告期末永赢长远价值混合C基金份额净值为0.5512元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.62%，同期业绩比较基准收益率为-0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内宏观经济复苏力度虽然仍偏弱，但是市场对经济刺激力度加大的预期不断提升，年中政治局会议定调中对房地产、资本市场、民营经济的表态超预期，叠加库存周期有逐步见底可能，市场对复苏预期可能逐步加强，但国内宏观经济复苏的进程是曲折的，复苏的力度在高质量发展背景下可能不会特别强烈。海外经济韧性暂时

看仍较强，但美元指数有所弱化，美国金融结构的债务问题仍然存在风险，下半年有弱化可能。

在此判断下，基本面推动市值上涨难度较大，顺周期相关资产有估值修复的必要而缺乏明显的向上弹性，部分估值较低、基本面仍在恢复的板块仍然具备投资性价比；但是资本市场重要程度被提升，政治局明确提出要活跃资本市场、提振资本市场信心，叠加当前金融市场流动性较为充裕，资产荒背景下股票市场可能存在较多增量资金，因此主题投资可能仍是主要获利方向，AI、中特估值及新涌现的主题仍值得重点关注。

可能的变数在于国内稳定经济的政策力度超预期，部分行业存在补库存可能，叠加总量相关行业前期跌幅明显，或有较好的反弹机会；此外，港股经历了明显的下杀，一旦极度悲观预期有所修正，港股弹性也可能较大。

下半年，本基金在操作上将继续践行自己的投资认知，投资上更加追求稳健，争取在努力控制回撤的基础上为投资者获取收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。本基金管理人估值委员会成员包括公司总经理、督察长、固定收益投资/研究的分管领导、权益投资的分管领导、基金运营的分管领导、基金运营部负责人、合规部负责人和风险管理部负责人。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在永赢长远价值混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，永赢基金管理有限公司在永赢长远价值混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由永赢基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关永赢长远价值混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢长远价值混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 139,597,195.79 | 330,436,122.76 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,780,035,312.69 | 4,064,137,792.44 |
| 其中：股票投资 | | 2,678,622,339.92 | 4,064,137,792.44 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 101,412,972.77 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 435,663,273.81 | - |
| 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 | | 3,308,971.20 | - |
| 应收申购款 | | 156,994.44 | 303,477.96 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 3,358,761,747.93 | 4,394,877,393.16 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | 35,852,821.93 |
| 应付赎回款 | | 3,660,341.20 | 5,358,336.38 |
| 应付管理人报酬 | | 4,121,945.99 | 5,642,669.21 |
| 应付托管费 | | 686,990.98 | 940,444.89 |
| 应付销售服务费 | | 44,049.01 | 61,470.56 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |

| | | | |
|-------------|---------|-------------------|-------------------|
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 109,742.22 | 220,018.78 |
| 负债合计 | | 8,623,069.40 | 48,075,761.75 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 6,058,176,817.39 | 6,796,228,259.05 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | -2,708,038,138.86 | -2,449,426,627.64 |
| 净资产合计 | | 3,350,138,678.53 | 4,346,801,631.41 |
| 负债和净资产总计 | | 3,358,761,747.93 | 4,394,877,393.16 |

注：（1）报告截止日2023年06月30日，基金份额净值0.5530元，基金份额总额6,058,176,817.39份。其中A类基金份额净值0.5532元，份额总额5,568,925,643.57份；C类基金份额净值0.5512元，份额总额489,251,173.82份。

（2）银行存款中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.2 利润表

会计主体：永赢长远价值混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023年01月01日至 2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日 |
|----------------|---------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | -524,967,939.94 | -754,463,649.34 |
| 1.利息收入 | | 1,303,857.21 | 1,999,430.22 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 1,185,494.11 | 1,999,430.22 |
| 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 | | 118,363.10 | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-” | | -479,506,381.30 | -1,223,300,033.43 |

| | | | |
|---------------------------------|------------|-----------------|-------------------|
| 填列) | | | |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -504,228,566.76 | -1,255,912,814.10 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 115,978.77 | - |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 24,606,206.69 | 32,612,780.67 |
| 以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -46,803,778.26 | 465,957,402.20 |
| 4.汇兑收益（损失以“-” 号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-” 号填列） | 6.4.7.17 | 38,362.41 | 879,551.67 |
| 减：二、营业总支出 | | 34,040,446.99 | 50,685,310.69 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 28,770,843.69 | 42,923,573.67 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 4,795,140.57 | 7,153,928.95 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 308,727.09 | 473,407.58 |
| 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 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 165,735.64 | 134,400.49 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | -559,008,386.93 | -805,148,960.03 |

| | | | |
|-------------------|--|-----------------|-----------------|
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -559,008,386.93 | -805,148,960.03 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -559,008,386.93 | -805,148,960.03 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：永赢长远价值混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | | |
|----------------------|-------------------------------|--------|-------------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 6,796,228,259.05 | - | -2,449,426,627.64 | 4,346,801,631.41 |
| 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） | 6,796,228,259.05 | - | -2,449,426,627.64 | 4,346,801,631.41 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -738,051,441.66 | - | -258,611,511.22 | -996,662,952.88 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -559,008,386.93 | -559,008,386.93 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值 | -738,051,441.66 | - | 300,396,875.71 | -437,654,565.95 |

| | | | | |
|--|------------------------------------|--------|-------------------|------------------|
| 变动数(净值减少以“-”号填列) | | | | |
| 其中: 1.基金申购款 | 93,926,469.72 | - | -36,799,197.38 | 57,127,272.34 |
| 2.基金赎回款 | -831,977,911.38 | - | 337,196,073.09 | -494,781,838.29 |
| (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) | 6,058,176,817.39 | - | -2,708,038,138.86 | 3,350,138,678.53 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 7,819,934,562.82 | - | -596,595,323.52 | 7,223,339,239.30 |
| 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) | 7,819,934,562.82 | - | -596,595,323.52 | 7,223,339,239.30 |

| | | | | |
|--|------------------|---|-------------------|-------------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -676,743,276.65 | - | -641,312,712.21 | -1,318,055,988.86 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -805,148,960.03 | -805,148,960.03 |
| （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） | -676,743,276.65 | - | 163,836,247.82 | -512,907,028.83 |
| 其中：1.基金申购款 | 223,631,026.81 | - | -47,807,425.11 | 175,823,601.70 |
| 2.基金赎回款 | -900,374,303.46 | - | 211,643,672.93 | -688,730,630.53 |
| （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） | 7,143,191,286.17 | - | -1,237,908,035.73 | 5,905,283,250.44 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

芦特尔

汪成杰

虞俏依

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

永赢长远价值混合型证券投资基金（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[2021]1556号《关于准予永赢长远价值混合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2021年9月13日正式生效，首次设立募集规模为7,925,913,683.04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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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的股票（含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、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）。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：股票资产占基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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投资比例合计不低于基金资产净值的5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 \times 75%+中债-综合全价（总值）指数收益率 \times 20%+恒生指数收益率（按估值汇率折算） \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日的财务状况以及自2023年1月1日起至2023年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个体，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发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款 | 78,183,960.46 |
| 等于：本金 | 78,168,141.87 |
| 加：应计利息 | 15,818.59 |
| 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 | 61,413,235.33 |
| 等于：本金 | 61,345,351.43 |
| 加：应计利息 | 67,883.90 |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 139,597,195.79 |

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 | | | |
|---------------|--------------------|------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 2,738,841,004.99 | - | 2,678,622,339.92 | -60,218,665.07 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 922,402.77 | 101,412,972.77 | 21,300.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 922,402.77 | 101,412,972.77 | 21,300.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,839,310,274.99 | 922,402.77 | 2,780,035,312.69 | -60,197,365.07 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 | |
|-------|--------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 435,663,273.81 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 435,663,273.81 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 646.28 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 109,095.94 |
| 合计 | 109,742.22 |

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 永赢长远价值混合A

金额单位：人民币元

| 项目 (永赢长远价值混合A) | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-------------------|-------------------------------|
|-------------------|-------------------------------|

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|------------------|------------------|
| 上年度末 | 6,238,572,761.20 | 6,238,572,761.20 |
| 本期申购 | 62,623,924.08 | 62,623,924.08 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -732,271,041.71 | -732,271,041.71 |
| 本期末 | 5,568,925,643.57 | 5,568,925,643.57 |

6.4.7.7.2 永赢长远价值混合C

金额单位：人民币元

| 项目 (永赢长远价值混合C) | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|-------------------|-------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 557,655,497.85 | 557,655,497.85 |
| 本期申购 | 31,302,545.64 | 31,302,545.64 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -99,706,869.67 | -99,706,869.67 |
| 本期末 | 489,251,173.82 | 489,251,173.82 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 永赢长远价值混合A

单位：人民币元

| 项目 (永赢长远价值混合A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-------------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 本期期初 | -2,283,881,974.94 | 36,295,886.98 | -2,247,586,087.96 |
| 本期利润 | -470,920,081.32 | -43,237,207.01 | -514,157,288.33 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 265,856,685.02 | 7,442,164.18 | 273,298,849.20 |
| 其中：基金申购款 | -24,009,602.53 | -220,394.32 | -24,229,996.85 |
| 基金赎回款 | 289,866,287.55 | 7,662,558.50 | 297,528,846.05 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -2,488,945,371.24 | 500,844.15 | -2,488,444,527.09 |

6.4.7.8.2 永赢长远价值混合C

单位：人民币元

| 项目 (永赢长远价值混合C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-------------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 本期期初 | -205,034,071.35 | 3,193,531.67 | -201,840,539.68 |
| 本期利润 | -41,284,527.35 | -3,566,571.25 | -44,851,098.60 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 26,719,182.85 | 378,843.66 | 27,098,026.51 |
| 其中：基金申购款 | -12,343,738.72 | -225,461.81 | -12,569,200.53 |
| 基金赎回款 | 39,062,921.57 | 604,305.47 | 39,667,227.04 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -219,599,415.85 | 5,804.08 | -219,593,611.77 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 724,189.66 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 461,304.45 |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 1,185,494.11 |

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 11,136,588,446.01 |
| 减：卖出股票成本总额 | 11,610,119,650.07 |
| 减：交易费用 | 30,697,362.70 |

| | |
|----------|-----------------|
| 买卖股票差价收入 | -504,228,566.76 |
|----------|-----------------|

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 115,990.77 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -12.00 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 115,978.77 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | - |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | - |
| 减：应计利息总额 | - |
| 减：交易费用 | 12.00 |
| 买卖债券差价收入 | -12.00 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 24,606,206.69 |
| 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 | 24,606,206.69 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|----------------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -46,803,778.26 |
| ——股票投资 | -46,825,078.26 |
| ——债券投资 | 21,300.00 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增 | - |

| | |
|----|----------------|
| 值税 | |
| 合计 | -46,803,778.26 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 35,778.85 |
| 基金转换费收入 | 2,583.56 |
| 合计 | 38,362.41 |

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 审计费用 | 49,588.57 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 11,076.74 |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 证券组合费 | 36,562.96 |
| 合计 | 165,735.64 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，本公司不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|-----------------------|
| 永赢基金管理有限公司("永赢基金") | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 交通银行股份有限公司("交通银行") | 基金托管人、基金销售机构 |
| 宁波银行股份有限公司("宁波银行") | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2023年01月01日至2023年06月30日 | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 28,770,843.69 | 42,923,573.67 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 12,873,956.37 | 19,307,859.20 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,795,140.57 | 7,153,928.95 |

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | |
|----------------|-------------------------------|-----------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 永赢长远价值混合A | 永赢长远价值混合C | 合计 |
| 永赢基金 | 0.00 | 3,542.13 | 3,542.13 |
| 宁波银行 | 0.00 | 23,738.12 | 23,738.12 |
| 交通银行 | 0.00 | 9,877.77 | 9,877.77 |
| 合计 | 0.00 | 37,158.02 | 37,158.02 |
| 获得销售 | 上年度可比期间 | | |

| 服务费的各关联方名称 | 2022年01月01日至2022年06月30日 | | |
|------------|-------------------------|-----------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 永赢长远价值混合A | 永赢长远价值混合C | 合计 |
| 永赢基金 | 0.00 | 4,799.22 | 4,799.22 |
| 宁波银行 | 0.00 | 29,223.98 | 29,223.98 |
| 交通银行 | 0.00 | 13,489.56 | 13,489.56 |
| 合计 | 0.00 | 47,512.76 | 47,512.76 |

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times C$ 类基金销售服务费年费率 / 当年天数

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

永赢长远价值混合A

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2023年01月01日至 2023年06月30日 | 2022年01月01日至 2022年06月30日 |
|---------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 报告期初持有的基金份额 | 61,587,586.44 | 61,587,586.44 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 61,587,586.44 | 61,587,586.44 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.0166% | 0.8622% |

永赢长远价值混合C

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2023年01月01日至 2023年06月30日 | 2022年01月01日至 2022年06月30日 |
| 报告期初持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.0000% | 0.0000% |

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|-------|-------------------------|--------|-------------------------|--------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 | | 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| | | | | |

| | | | | |
|------|---------------|------------|----------------|--------------|
| 交通银行 | 78,183,960.46 | 724,189.66 | 329,565,159.39 | 1,555,524.28 |
|------|---------------|------------|----------------|--------------|

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|----------|----------|----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 001282 | 三联锻造 | 2023-05-15 | 6个月 | 新股限售 | 27.93 | 33.03 | 105.00 | 2,932.65 | 3,468.15 | - |
| 001324 | 长青科技 | 2023-05-12 | 6个月 | 新股限售 | 18.88 | 19.60 | 114.00 | 2,152.32 | 2,234.40 | - |
| 001328 | 登康口腔 | 2023-03-29 | 6个月 | 新股限售 | 20.68 | 25.49 | 145.00 | 2,998.60 | 3,696.05 | - |
| 001360 | 南矿集团 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股限售 | 15.38 | 14.87 | 177.00 | 2,722.26 | 2,631.99 | - |
| 001367 | 海森药业 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股限售 | 44.48 | 39.48 | 55.00 | 2,446.40 | 2,171.40 | - |
| 001380 | 华纬科技 | 2023-05-09 | 6个月 | 新股限售 | 28.84 | 30.78 | 170.00 | 4,902.80 | 5,232.60 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|--------|-----------|-----------|---|
| 300804 | 广康生化 | 2023-06-15 | 6个月 | 新股限售 | 42.45 | 32.97 | 226.00 | 9,593.70 | 7,451.22 | - |
| 301141 | 中科磁业 | 2023-03-27 | 6个月 | 新股限售 | 41.20 | 42.69 | 262.00 | 10,794.40 | 11,184.78 | - |
| 301157 | 华塑科技 | 2023-03-01 | 6个月 | 新股限售 | 56.50 | 52.93 | 150.00 | 8,475.00 | 7,939.50 | - |
| 301170 | 锡南科技 | 2023-06-16 | 6个月 | 新股限售 | 34.00 | 34.93 | 250.00 | 8,500.00 | 8,732.50 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 1个月内(含) | 认购新发证券 | 25.82 | 25.82 | 2,754 | 71,108.28 | 71,108.28 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 6个月 | 新股限售 | 25.82 | 25.82 | 306.00 | 7,900.92 | 7,900.92 | - |
| 301203 | 国泰环保 | 2023-03-28 | 6个月 | 新股限售 | 46.13 | 34.40 | 225.00 | 10,379.25 | 7,740.00 | - |
| 301210 | 金杨股份 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股限售 | 57.88 | 49.17 | 281.00 | 16,264.28 | 13,816.77 | - |
| 301225 | 恒勃股份 | 2023-06-08 | 6个月 | 新股限售 | 35.66 | 33.26 | 333.00 | 11,874.78 | 11,075.58 | - |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023-06-08 | 6个月 | 新股限售 | 72.50 | 58.42 | 165.00 | 11,962.50 | 9,639.30 | - |
| 301246 | 宏源药业 | 2023-03-10 | 6个月 | 新股限售 | 50.00 | 30.71 | 931.00 | 46,550.00 | 28,591.01 | - |
| 301260 | 格力博 | 2023-01-20 | 6个月 | 新股限售 | 30.85 | 23.63 | 3,121 | 96,282.85 | 73,749.23 | - |
| 3012 | 恒工 | 2023 | 1个月内 | 认购 | 36.90 | 36.90 | 1,775 | 65,49 | 65,49 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|---------|-------|-------|--------|------------|------------|---|
| 61 | 精密 | -06-29 | (含) | 新发证券 | | | | 7.50 | 7.50 | |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 6个月 | 新股限售 | 36.90 | 36.90 | 198.00 | 7,306.20 | 7,306.20 | - |
| 301262 | 海看股份 | 2023-06-13 | 6个月 | 新股限售 | 30.22 | 25.50 | 692.00 | 20,912.24 | 17,646.00 | - |
| 301281 | 科源制药 | 2023-03-28 | 6个月 | 新股限售 | 44.18 | 25.10 | 241.00 | 10,647.38 | 6,049.10 | - |
| 301281 | 科源制药 | 2023-05-26 | 5个月 | 新股限售-送股 | - | 25.10 | 96.00 | - | 2,409.60 | - |
| 301291 | 明阳电气 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股限售 | 38.13 | 31.03 | 1,206 | 45,984.78 | 37,422.18 | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023-06-29 | 1个月内(含) | 认购新发证券 | 19.99 | 19.99 | 5,241 | 104,767.59 | 104,767.59 | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023-06-29 | 6个月 | 新股限售 | 19.99 | 19.99 | 583.00 | 11,654.17 | 11,654.17 | - |
| 301293 | 三博脑科 | 2023-04-25 | 6个月 | 新股限售 | 29.60 | 71.42 | 333.00 | 9,856.80 | 23,782.86 | - |
| 301295 | 美硕科技 | 2023-06-19 | 6个月 | 新股限售 | 37.40 | 36.07 | 215.00 | 8,041.00 | 7,755.05 | - |
| 301301 | 川宁生物 | 2022-12-20 | 6个月 | 新股限售 | 5.00 | 8.96 | 3,574 | 17,870.00 | 32,023.04 | - |
| 301303 | 真兰仪表 | 2023-02-13 | 6个月 | 新股限售 | 26.80 | 22.32 | 1,058 | 28,354.40 | 23,614.56 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|------|-------|--------|--------|-----------|-----------|---|
| 301305 | 朗坤环境 | 2023-05-15 | 6个月 | 新股限售 | 25.25 | 19.69 | 753.00 | 19,013.25 | 14,826.57 | - |
| 301307 | 美利信 | 2023-04-14 | 6个月 | 新股限售 | 32.34 | 31.86 | 687.00 | 22,217.58 | 21,887.82 | - |
| 301310 | 鑫宏业 | 2023-05-26 | 6个月 | 新股限售 | 67.28 | 65.43 | 409.00 | 27,517.52 | 26,760.87 | - |
| 301315 | 威士顿 | 2023-06-13 | 6个月 | 新股限售 | 32.29 | 51.12 | 226.00 | 7,297.54 | 11,553.12 | - |
| 301317 | 鑫磊股份 | 2023-01-12 | 6个月 | 新股限售 | 20.67 | 26.17 | 694.00 | 14,344.98 | 18,161.98 | - |
| 301320 | 豪江智能 | 2023-06-01 | 6个月 | 新股限售 | 13.06 | 20.62 | 642.00 | 8,384.52 | 13,238.04 | - |
| 301323 | 新莱福 | 2023-05-29 | 6个月 | 新股限售 | 39.06 | 39.36 | 228.00 | 8,905.68 | 8,974.08 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023-05-04 | 6个月 | 新股限售 | 76.80 | 107.95 | 364.00 | 27,955.20 | 39,293.80 | - |
| 301332 | 德尔玛 | 2023-05-09 | 6个月 | 新股限售 | 14.81 | 13.73 | 1,122 | 16,616.82 | 15,405.06 | - |
| 301337 | 亚华电子 | 2023-05-16 | 6个月 | 新股限售 | 32.60 | 30.37 | 232.00 | 7,563.20 | 7,045.84 | - |
| 301345 | 涛涛车业 | 2023-03-10 | 6个月 | 新股限售 | 73.45 | 46.64 | 266.00 | 19,537.70 | 12,406.24 | - |
| 301355 | 南王科技 | 2023-06-02 | 6个月 | 新股限售 | 17.55 | 16.75 | 563.00 | 9,880.65 | 9,430.25 | - |
| 3013 | 北方 | 2023 | 6个月 | 新股 | 50.00 | 48.39 | 190.00 | 9,50 | 9,19 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|--------------------|-------------|----------------|-------|-------|--------|----------------|----------------|---|
| 57 | 长龙 | -04-1 1 | | 限售 | | | | 0.00 | 4.10 | |
| 3013 58 | 湖南 裕能 | 2023 -02-0 1 | 6个月 | 新股 限售 | 23.77 | 42.89 | 2,023 | 48,08 6.71 | 86,76 6.47 | - |
| 3013 60 | 荣旗 科技 | 2023 -04-1 7 | 6个月 | 新股 限售 | 71.88 | 92.60 | 134.00 | 9,63 1.92 | 12,40 8.40 | - |
| 3013 73 | 凌玮 科技 | 2023 -01-2 0 | 6个月 | 新股 限售 | 33.73 | 31.85 | 277.00 | 9,34 3.21 | 8,82 2.45 | - |
| 3013 76 | 致欧 科技 | 2023 -06-1 4 | 6个月 | 新股 限售 | 24.66 | 22.51 | 420.00 | 10,35 7.20 | 9,45 4.20 | - |
| 3013 82 | 蜂助 手 | 2023 -05-0 9 | 6个月 | 新股 限售 | 23.80 | 32.84 | 408.00 | 9,71 0.40 | 13,39 8.72 | - |
| 3013 83 | 天键 股份 | 2023 -05-3 1 | 6个月 | 新股 限售 | 46.16 | 35.72 | 493.00 | 22,75 6.88 | 17,60 9.96 | - |
| 3013 86 | 未来 电器 | 2023 -03-2 1 | 6个月 | 新股 限售 | 29.99 | 23.79 | 378.00 | 11,33 6.22 | 8,99 2.62 | - |
| 3013 87 | 光大 同创 | 2023 -04-1 0 | 6个月 | 新股 限售 | 58.32 | 45.36 | 307.00 | 17,90 4.24 | 13,92 5.52 | - |
| 3013 95 | 仁信 新材 | 2023 -06-2 1 | 1个月内 (含) | 认购 新发 证券 | 26.68 | 26.68 | 4,676 | 124,7 55.68 | 124,7 55.68 | - |
| 3013 95 | 仁信 新材 | 2023 -06-2 1 | 6个月 | 新股 限售 | 26.68 | 26.68 | 520.00 | 13,87 3.60 | 13,87 3.60 | - |
| 3013 97 | 溯联 股份 | 2023 -06-1 5 | 6个月 | 新股 限售 | 53.27 | 40.20 | 362.00 | 19,28 3.74 | 14,55 2.40 | - |
| 3013 99 | 英特 科技 | 2023 -05-1 | 6个月 | 新股 限售 | 43.99 | 51.57 | 293.00 | 12,88 9.07 | 15,11 0.01 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|--------|------------|------------|---|
| | | 6 | | | | | | | | |
| 301408 | 华人健康 | 2023-02-22 | 6个月 | 新股限售 | 16.24 | 16.95 | 879.00 | 14,274.96 | 14,899.05 | - |
| 301419 | 阿莱德 | 2023-02-02 | 6个月 | 新股限售 | 24.80 | 43.85 | 330.00 | 8,184.00 | 14,470.50 | - |
| 301428 | 世纪恒通 | 2023-05-10 | 6个月 | 新股限售 | 26.35 | 30.60 | 229.00 | 6,034.15 | 7,007.40 | - |
| 301429 | 森泰股份 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股限售 | 28.75 | 21.02 | 499.00 | 14,346.25 | 10,488.98 | - |
| 301439 | 泓淋电力 | 2023-03-10 | 6个月 | 新股限售 | 19.99 | 16.90 | 949.00 | 18,970.51 | 16,038.10 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023-06-30 | 1个月内(含) | 认购新发证券 | 57.66 | 57.66 | 4,338 | 250,129.08 | 250,129.08 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023-06-30 | 6个月 | 新股限售 | 57.66 | 57.66 | 482.00 | 27,792.12 | 27,792.12 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023-06-26 | 1个月内(含) | 认购新发证券 | 39.78 | 39.78 | 2,356 | 93,721.68 | 93,721.68 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023-06-26 | 6个月 | 新股限售 | 39.78 | 39.78 | 262.00 | 10,422.36 | 10,422.36 | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股限售 | 6.58 | 7.58 | 4,016 | 26,425.28 | 30,441.28 | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股限售 | 10.36 | 11.84 | 875.00 | 9,065.00 | 10,360.00 | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股限售 | 11.66 | 12.26 | 664.00 | 7,742.24 | 8,140.64 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|------|-------|-------|--------|------------|------------|---|
| 603125 | 常青科技 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股限售 | 25.98 | 24.53 | 160.00 | 4,156.80 | 3,924.80 | - |
| 603135 | 中重科技 | 2023-03-29 | 6个月 | 新股限售 | 17.80 | 17.89 | 628.00 | 11,178.40 | 11,234.92 | - |
| 603137 | 恒尚节能 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股限售 | 15.90 | 17.09 | 139.00 | 2,210.10 | 2,375.51 | - |
| 603172 | 万丰股份 | 2023-04-28 | 6个月 | 新股限售 | 14.58 | 16.13 | 122.00 | 1,778.76 | 1,967.86 | - |
| 688249 | 晶合集成 | 2023-04-24 | 6个月 | 新股限售 | 19.86 | 18.06 | 7,405 | 147,063.30 | 133,734.30 | - |
| 688334 | 西高院 | 2023-06-09 | 6个月 | 新股限售 | 14.16 | 16.21 | 888.00 | 12,574.08 | 14,394.48 | - |
| 688352 | 颀中科技 | 2023-04-11 | 6个月 | 新股限售 | 12.10 | 12.07 | 2,361 | 28,568.10 | 28,497.27 | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023-05-12 | 6个月 | 新股限售 | 23.60 | 64.67 | 831.00 | 19,611.60 | 53,740.77 | - |
| 688433 | 华曙高科 | 2023-04-07 | 6个月 | 新股限售 | 26.66 | 31.50 | 418.00 | 11,143.88 | 13,167.00 | - |
| 688458 | 美芯晟 | 2023-05-15 | 6个月 | 新股限售 | 75.00 | 90.76 | 221.00 | 16,575.00 | 20,057.96 | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023-04-28 | 6个月 | 新股限售 | 5.69 | 5.41 | 13,800 | 78,522.00 | 74,658.00 | - |
| 688472 | 阿特斯 | 2023-06-02 | 6个月 | 新股限售 | 11.10 | 17.04 | 6,261 | 69,497.10 | 106,687.44 | - |
| 6884 | 晶升 | 2023 | 6个月 | 新股 | 32.52 | 42.37 | 402.00 | 13,07 | 17,03 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|---------|--------|--------|--------|------------|------------|---|
| 78 | 股份 | -04-13 | | 限售 | | | | 3.04 | 2.74 | |
| 688479 | 友车科技 | 2023-05-04 | 6个月 | 新股限售 | 33.99 | 29.49 | 332.00 | 11,284.68 | 9,790.68 | - |
| 688484 | 南芯科技 | 2023-03-28 | 6个月 | 新股限售 | 39.99 | 36.71 | 1,008 | 40,309.92 | 37,003.68 | - |
| 688507 | 索辰科技 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股限售 | 245.56 | 122.11 | 140.00 | 34,378.40 | 17,095.40 | - |
| 688507 | 索辰科技 | 2023-06-20 | 4个月 | 新股限售-送股 | - | 122.11 | 67.00 | - | 8,181.37 | - |
| 688512 | 慧智微 | 2023-05-08 | 6个月 | 新股限售 | 20.92 | 19.16 | 721.00 | 15,083.32 | 13,814.36 | - |
| 688523 | 航天环宇 | 2023-05-26 | 6个月 | 新股限售 | 21.86 | 23.85 | 472.00 | 10,317.92 | 11,257.20 | - |
| 688531 | 日联科技 | 2023-03-24 | 6个月 | 新股限售 | 152.38 | 135.97 | 346.00 | 52,723.48 | 47,045.62 | - |
| 688535 | 华海诚科 | 2023-03-28 | 6个月 | 新股限售 | 35.00 | 51.23 | 161.00 | 5,635.00 | 8,248.03 | - |
| 688539 | 高华科技 | 2023-04-11 | 6个月 | 新股限售 | 38.22 | 43.49 | 5,334 | 203,865.48 | 231,975.66 | - |
| 688543 | 国科军工 | 2023-06-14 | 6个月 | 新股限售 | 43.67 | 53.05 | 410.00 | 17,904.70 | 21,750.50 | - |
| 688552 | 航天南湖 | 2023-05-08 | 6个月 | 新股限售 | 21.17 | 23.50 | 956.00 | 20,238.52 | 22,466.00 | - |
| 6885 | 航天 | 2023 | 6个月 | 新股 | 12.68 | 22.31 | 726.00 | 9,20 | 16,19 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|--------|--------|--------|--------|-----------|-----------|---|
| 62 | 软件 | -05-15 | | 限售 | | | | 5.68 | 7.06 | |
| 688570 | 天玛智控 | 2023-05-29 | 6个月 | 新股限售 | 30.26 | 25.33 | 884.00 | 26,749.84 | 22,391.72 | - |
| 688581 | 安杰思 | 2023-05-12 | 6个月 | 新股限售 | 125.80 | 118.03 | 163.00 | 20,505.40 | 19,238.89 | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股限售 | 26.74 | 40.68 | 648.00 | 17,327.52 | 26,360.64 | - |
| 688593 | 新相微 | 2023-05-25 | 6个月 | 新股限售 | 11.18 | 14.59 | 959.00 | 10,721.62 | 13,991.81 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 1个月内(含) | 认购新发证券 | 55.00 | 55.00 | 1,251 | 68,805.00 | 68,805.00 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 6个月 | 新股限售 | 55.00 | 55.00 | 140.00 | 7,700.00 | 7,700.00 | - |
| 688620 | 安凯微 | 2023-06-15 | 6个月 | 新股限售 | 10.68 | 12.34 | 1,016 | 10,850.88 | 12,537.44 | - |
| 688623 | 双元科技 | 2023-05-31 | 6个月 | 新股限售 | 125.88 | 86.79 | 178.00 | 22,406.64 | 15,448.62 | - |
| 688629 | 华丰科技 | 2023-06-16 | 6个月 | 新股限售 | 9.26 | 18.59 | 708.00 | 6,556.08 | 13,161.72 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023-06-19 | 6个月 | 新股限售 | 25.28 | 29.87 | 336.00 | 8,494.08 | 10,036.32 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款

项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | 101,412,972.77 | - |
| 合计 | 101,412,972.77 | - |

注：1、国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级；
2、上年度末，本基金未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有

的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 年 06 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------------|----------------|--------|----------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 139,597,195.79 | - | - | - | - | - | 139,597,195.79 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | 101,412,972.77 | - | - | 2,678,622,339.92 | 2,780,035,312.69 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 435,663,273.81 | - | - | - | - | - | 435,663,273.81 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 3,308,971.20 | 3,308,971.20 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 156,994.44 | 156,994.44 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 575,260,469.60 | - | 101,412,972.77 | - | - | 2,682,088,305.56 | 3,358,761,747.93 |
| 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 | - | - | - | - | - | 3,660,341.20 | 3,660,341.20 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 4,121,945.99 | 4,121,945.99 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 686,990.98 | 686,990.98 |

| | | | | | | | |
|---------------------|----------------|-------|----------------|------|------|------------------|------------------|
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 44,049.01 | 44,049.01 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 109,742.22 | 109,742.22 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 8,623,069.40 | 8,623,069.40 |
| 利率敏感度缺口 | 575,260,469.60 | - | 101,412,972.77 | - | - | 2,673,465,236.16 | 3,350,138,678.53 |
| 上年度末 2022年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 233,669,371.13 | - | - | - | - | - | 233,669,371.13 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 96,766,751.63 | - | - | - | - | - | 96,766,751.63 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 4,064,137,792.44 | 4,064,137,792.44 |
| 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 | - | - | - | - | - | 303,477.96 | 303,477.96 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 330,436,122.76 | - | - | - | - | 4,064,441,270.40 | 4,394,877,393.16 |
| 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 | - | - | - | - | - | 35,852,821.93 | 35,852,821.93 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 5,358,336.38 | 5,358,336.38 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 5,642,669.21 | 5,642,669.21 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 940,444.89 | 940,444.89 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 61,470.56 | 61,470.56 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 220,018.78 | 220,018.78 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 48,075,761.75 | 48,075,761.75 |
| 利率敏感度缺口 | 330,436,122.76 | - | - | - | - | 4,016,365,508.65 | 4,346,801,631.41 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|-------------------------|-----------------------------|---------------------|
| 假设 | 1. 市场利率曲线向上、向下平行移动50个基点 | | |
| 假设 | 2. 其他市场变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 市场利率平行上升50个基点 | -271,989.59 | - |
| | 市场利率平行下降50个基点 | 271,989.59 | - |

注：上年度末，本基金未持有债券，无重大利率风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 | | | |
|-------------------|---------------------|----------------|-------------------|----------------|
| | 美元折 合人民 币 | 港币折合人民 币 | 其他币 种折合 人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | 181,787,276.03 | - | 181,787,276.03 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | 3,308,971.20 | - | 3,308,971.20 |
| 应收申购款 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产合计 | - | 185,096,247.23 | - | 185,096,247.23 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口 净额 | - | 185,096,247.23 | - | 185,096,247.23 |
| 项目 | 上年度末 2022年12月31日 | | | |
| | 美元折 合人民 币 | 港币折合人民 币 | 其他币 种折合 人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |

| | | | | |
|---------------|---|------------------|---|------------------|
| 银行存款 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | 1,388,114,366.56 | - | 1,388,114,366.56 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产合计 | - | 1,388,114,366.56 | - | 1,388,114,366.56 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 1,388,114,366.56 | - | 1,388,114,366.56 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 所有外币相对于人民币升值5% | 9,254,812.36 | 69,405,718.33 |
| | 所有外币相对于人民币贬值5% | -9,254,812.36 | -69,405,718.33 |

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 | | 上年度末 2022年12月31日 | |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 2,678,622,339.92 | 79.96 | 4,064,137,792.44 | 93.50 |
| 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 | 2,678,622,339.92 | 79.96 | 4,064,137,792.44 | 93.50 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险 | | |
|----|--|-----------------------------|---------------------|
| | 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 业绩比较基准增加1% | 35,439,315.93 | 52,658,298.46 |
| | 业绩比较基准减少1% | -35,439,315.93 | -52,658,298.46 |

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | 2,675,826,318.63 | 4,061,964,640.95 |
| 第二层次 | 102,310,429.99 | - |
| 第三层次 | 1,898,564.07 | 2,173,151.49 |
| 合计 | 2,780,035,312.69 | 4,064,137,792.44 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2023年8月28日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 2,678,622,339.92 | 79.75 |
| | 其中：股票 | 2,678,622,339.92 | 79.75 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 101,412,972.77 | 3.02 |
| | 其中：债券 | 101,412,972.77 | 3.02 |
| | 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 | 435,663,273.81 | 12.97 |
| | 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 | 139,597,195.79 | 4.16 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,465,965.64 | 0.10 |
| 9 | 合计 | 3,358,761,747.93 | 100.00 |

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币181,787,276.03元,占期末净值比例5.43%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|---------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |

| | | | |
|---|------------------|------------------|-------|
| B | 采矿业 | 10,123,644.00 | 0.30 |
| C | 制造业 | 419,586,034.37 | 12.52 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 833,990,477.97 | 24.89 |
| E | 建筑业 | 450,669,017.52 | 13.45 |
| F | 批发和零售业 | 144,190.93 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 130,367,243.34 | 3.89 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 411,971.07 | 0.01 |
| J | 金融业 | 511,257,017.88 | 15.26 |
| K | 房地产业 | 131,863,758.90 | 3.94 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 14,394.48 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 22,566.57 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 23,782.86 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,360,964.00 | 0.25 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,496,835,063.89 | 74.53 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----------|---------------|---------------|
| 原材料 | - | - |
| 非日常生活消费品 | 57,126,341.79 | 1.71 |
| 日常消费品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | 64,856,830.61 | 1.94 |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | - | - |

| | | |
|------|----------------|------|
| 通讯业务 | - | - |
| 公用事业 | 9,756,493.78 | 0.29 |
| 房地产 | 50,047,609.85 | 1.49 |
| 合计 | 181,787,276.03 | 5.43 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 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

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 | 601985 | 中国核电 | 26,671,900 | 188,036,895.00 | 5.61 |
| 2 | 003816 | 中国广核 | 53,187,000 | 165,411,570.00 | 4.94 |
| 2 | H01816 | 中广核电力 | 5,599,000 | 9,756,493.78 | 0.29 |
| 3 | 600011 | 华能国际 | 16,703,143 | 154,671,104.18 | 4.62 |
| 4 | 601668 | 中国建筑 | 24,823,100 | 142,484,594.00 | 4.25 |
| 5 | 601288 | 农业银行 | 30,255,800 | 106,802,974.00 | 3.19 |
| 5 | H01288 | 农业银行 | 5,761,000 | 16,359,502.48 | 0.49 |
| 6 | 601939 | 建设银行 | 16,714,048 | 104,629,940.48 | 3.12 |
| 6 | H00939 | 建设银行 | 3,470,000 | 16,220,301.94 | 0.48 |
| 7 | 601988 | 中国银行 | 26,378,900 | 103,141,499.00 | 3.08 |
| 7 | H03988 | 中国银行 | 5,610,000 | 16,241,046.49 | 0.48 |
| 8 | 601598 | 中国外运 | 22,753,049 | 106,029,208.34 | 3.16 |
| 9 | 600027 | 华电国际 | 15,802,161 | 105,716,457.09 | 3.16 |
| 10 | 300750 | 宁德时代 | 460,101 | 105,266,507.79 | 3.14 |
| 11 | 000539 | 粤电力A | 13,556,677 | 98,963,742.10 | 2.95 |
| 12 | 601398 | 工商银行 | 14,703,400 | 70,870,388.00 | 2.12 |
| 12 | H01398 | 工商银行 | 4,161,000 | 16,035,979.70 | 0.48 |
| 13 | 000543 | 皖能电力 | 10,728,466 | 70,807,875.60 | 2.11 |
| 14 | 601318 | 中国平安 | 1,362,031 | 63,198,238.40 | 1.89 |
| 15 | H02331 | 李宁 | 1,470,000 | 57,126,341.79 | 1.71 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|---------------|------|
| 16 | 601390 | 中国中铁 | 7,345,953 | 55,682,323.74 | 1.66 |
| 17 | 000928 | 中钢国际 | 5,655,900 | 54,579,435.00 | 1.63 |
| 18 | 601186 | 中国铁建 | 5,443,100 | 53,614,535.00 | 1.60 |
| 19 | 000733 | 振华科技 | 555,600 | 53,254,260.00 | 1.59 |
| 20 | 600875 | 东方电气 | 2,855,000 | 53,245,750.00 | 1.59 |
| 21 | 001979 | 招商蛇口 | 3,978,835 | 51,844,220.05 | 1.55 |
| 22 | 600970 | 中材国际 | 3,959,100 | 50,478,525.00 | 1.51 |
| 23 | 601991 | 大唐发电 | 15,221,400 | 50,382,834.00 | 1.50 |
| 24 | H03900 | 绿城中国 | 6,915,000 | 50,047,609.85 | 1.49 |
| 25 | 600048 | 保利发展 | 3,739,500 | 48,725,685.00 | 1.45 |
| 26 | 600862 | 中航高科 | 1,394,100 | 35,284,671.00 | 1.05 |
| 27 | 601669 | 中国电建 | 5,833,900 | 33,486,586.00 | 1.00 |
| 28 | 002049 | 紫光国微 | 351,300 | 32,758,725.00 | 0.98 |
| 29 | 601868 | 中国能建 | 13,967,500 | 32,683,950.00 | 0.98 |
| 30 | 600325 | 华发股份 | 3,177,041 | 31,293,853.85 | 0.93 |
| 31 | 601601 | 中国太保 | 1,123,900 | 29,198,922.00 | 0.87 |
| 32 | 601333 | 广深铁路 | 4,877,700 | 19,315,692.00 | 0.58 |
| 33 | 688439 | 振华风光 | 171,082 | 18,788,225.24 | 0.56 |
| 34 | 600582 | 天地科技 | 3,164,861 | 18,451,139.63 | 0.55 |
| 35 | 000768 | 中航西飞 | 679,900 | 18,187,325.00 | 0.54 |
| 36 | 600893 | 航发动力 | 425,300 | 17,973,178.00 | 0.54 |
| 37 | 002025 | 航天电器 | 265,900 | 16,964,420.00 | 0.51 |
| 38 | 601611 | 中国核建 | 1,991,700 | 16,829,865.00 | 0.50 |
| 39 | 600372 | 中航电子 | 1,104,300 | 16,763,274.00 | 0.50 |
| 40 | 601688 | 华泰证券 | 1,214,000 | 16,716,780.00 | 0.50 |
| 41 | 600030 | 中信证券 | 844,200 | 16,698,276.00 | 0.50 |
| 42 | 600019 | 宝钢股份 | 2,848,300 | 16,007,446.00 | 0.48 |
| 43 | 600820 | 隧道股份 | 1,796,100 | 10,794,561.00 | 0.32 |
| 44 | 600938 | 中国海油 | 558,700 | 10,123,644.00 | 0.30 |
| 45 | 600373 | 中文传媒 | 627,700 | 8,360,964.00 | 0.25 |
| 46 | 688375 | 国博电子 | 85,592 | 6,778,886.40 | 0.20 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 47 | 603128 | 华贸物流 | 551,300 | 5,022,343.00 | 0.15 |
| 48 | 002149 | 西部材料 | 213,700 | 3,588,023.00 | 0.11 |
| 49 | 000738 | 航发控制 | 97,800 | 2,386,320.00 | 0.07 |
| 50 | 301291 | 明阳电气 | 12,054 | 391,066.98 | 0.01 |
| 51 | 301486 | 致尚科技 | 4,820 | 277,921.20 | 0.01 |
| 52 | 688539 | 高华科技 | 5,334 | 231,975.66 | 0.01 |
| 53 | 688543 | 国科军工 | 4,094 | 228,607.10 | 0.01 |
| 54 | 301262 | 海看股份 | 6,917 | 190,389.75 | 0.01 |
| 55 | 688629 | 华丰科技 | 7,073 | 160,957.02 | 0.00 |
| 56 | 301397 | 溯联股份 | 3,618 | 152,606.80 | 0.00 |
| 57 | 301210 | 金杨股份 | 2,801 | 143,168.37 | 0.00 |
| 58 | 301395 | 仁信新材 | 5,196 | 138,629.28 | 0.00 |
| 59 | 688620 | 安凯微 | 10,157 | 135,209.66 | 0.00 |
| 60 | 688249 | 晶合集成 | 7,405 | 133,734.30 | 0.00 |
| 61 | 301315 | 威士顿 | 2,253 | 132,828.53 | 0.00 |
| 62 | 301292 | 海科新源 | 5,824 | 116,421.76 | 0.00 |
| 63 | 688472 | 阿特斯 | 6,261 | 106,687.44 | 0.00 |
| 64 | 301488 | 豪恩汽电 | 2,618 | 104,144.04 | 0.00 |
| 65 | 301232 | 飞沃科技 | 1,643 | 99,339.12 | 0.00 |
| 66 | 301376 | 致欧科技 | 4,192 | 98,850.60 | 0.00 |
| 67 | 301170 | 锡南科技 | 2,496 | 92,283.70 | 0.00 |
| 68 | 301358 | 湖南裕能 | 2,023 | 86,766.47 | 0.00 |
| 69 | 301202 | 朗威股份 | 3,060 | 79,009.20 | 0.00 |
| 70 | 688603 | 天承科技 | 1,391 | 76,505.00 | 0.00 |
| 71 | 688469 | 中芯集成 | 13,800 | 74,658.00 | 0.00 |
| 72 | 301260 | 格力博 | 3,121 | 73,749.23 | 0.00 |
| 73 | 301261 | 恒工精密 | 1,973 | 72,803.70 | 0.00 |
| 74 | 688361 | 中科飞测 | 831 | 53,740.77 | 0.00 |
| 75 | 688531 | 日联科技 | 346 | 47,045.62 | 0.00 |
| 76 | 688623 | 双元科技 | 512 | 46,133.20 | 0.00 |
| 77 | 301325 | 曼恩斯特 | 364 | 39,293.80 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 78 | 001282 | 三联锻造 | 1,045 | 37,026.15 | 0.00 |
| 79 | 688484 | 南芯科技 | 1,008 | 37,003.68 | 0.00 |
| 80 | 301301 | 川宁生物 | 3,574 | 32,023.04 | 0.00 |
| 81 | 601061 | 中信金属 | 4,016 | 30,441.28 | 0.00 |
| 82 | 301246 | 宏源药业 | 931 | 28,591.01 | 0.00 |
| 83 | 688352 | 硕中科技 | 2,361 | 28,497.27 | 0.00 |
| 84 | 301310 | 鑫宏业 | 409 | 26,760.87 | 0.00 |
| 85 | 603137 | 恒尚节能 | 1,382 | 26,502.14 | 0.00 |
| 86 | 688582 | 芯动联科 | 648 | 26,360.64 | 0.00 |
| 87 | 688507 | 索辰科技 | 207 | 25,276.77 | 0.00 |
| 88 | 301293 | 三博脑科 | 333 | 23,782.86 | 0.00 |
| 89 | 301303 | 真兰仪表 | 1,058 | 23,614.56 | 0.00 |
| 90 | 688552 | 航天南湖 | 956 | 22,466.00 | 0.00 |
| 91 | 688570 | 天玛智控 | 884 | 22,391.72 | 0.00 |
| 92 | 301307 | 美利信 | 687 | 21,887.82 | 0.00 |
| 93 | 688458 | 美芯晟 | 221 | 20,057.96 | 0.00 |
| 94 | 688581 | 安杰思 | 163 | 19,238.89 | 0.00 |
| 95 | 301317 | 鑫磊股份 | 694 | 18,161.98 | 0.00 |
| 96 | 301383 | 天键股份 | 493 | 17,609.96 | 0.00 |
| 97 | 688478 | 晶升股份 | 402 | 17,032.74 | 0.00 |
| 98 | 688562 | 航天软件 | 726 | 16,197.06 | 0.00 |
| 99 | 301439 | 泓淋电力 | 949 | 16,038.10 | 0.00 |
| 100 | 301332 | 德尔玛 | 1,122 | 15,405.06 | 0.00 |
| 101 | 301399 | 英特科技 | 293 | 15,110.01 | 0.00 |
| 102 | 301408 | 华人健康 | 879 | 14,899.05 | 0.00 |
| 103 | 301305 | 朗坤环境 | 753 | 14,826.57 | 0.00 |
| 104 | 301419 | 阿莱德 | 330 | 14,470.50 | 0.00 |
| 105 | 688334 | 西高院 | 888 | 14,394.48 | 0.00 |
| 106 | 688593 | 新相微 | 959 | 13,991.81 | 0.00 |
| 107 | 301387 | 光大同创 | 307 | 13,925.52 | 0.00 |
| 108 | 688512 | 慧智微 | 721 | 13,814.36 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|-----------|------|
| 109 | 301382 | 蜂助手 | 408 | 13,398.72 | 0.00 |
| 110 | 301320 | 豪江智能 | 642 | 13,238.04 | 0.00 |
| 111 | 688433 | 华曙高科 | 418 | 13,167.00 | 0.00 |
| 112 | 301360 | 荣旗科技 | 134 | 12,408.40 | 0.00 |
| 113 | 301345 | 涛涛车业 | 266 | 12,406.24 | 0.00 |
| 114 | 688523 | 航天环宇 | 472 | 11,257.20 | 0.00 |
| 115 | 603135 | 中重科技 | 628 | 11,234.92 | 0.00 |
| 116 | 301141 | 中科磁业 | 262 | 11,184.78 | 0.00 |
| 117 | 301225 | 恒勃股份 | 333 | 11,075.58 | 0.00 |
| 118 | 301429 | 森泰股份 | 499 | 10,488.98 | 0.00 |
| 119 | 601065 | 江盐集团 | 875 | 10,360.00 | 0.00 |
| 120 | 688631 | 莱斯信息 | 336 | 10,036.32 | 0.00 |
| 121 | 688479 | 友车科技 | 332 | 9,790.68 | 0.00 |
| 122 | 301355 | 南王科技 | 563 | 9,430.25 | 0.00 |
| 123 | 301357 | 北方长龙 | 190 | 9,194.10 | 0.00 |
| 124 | 301386 | 未来电器 | 378 | 8,992.62 | 0.00 |
| 125 | 301323 | 新莱福 | 228 | 8,974.08 | 0.00 |
| 126 | 301373 | 凌玮科技 | 277 | 8,822.45 | 0.00 |
| 127 | 301281 | 科源制药 | 337 | 8,458.70 | 0.00 |
| 128 | 688535 | 华海诚科 | 161 | 8,248.03 | 0.00 |
| 129 | 601133 | 柏诚股份 | 664 | 8,140.64 | 0.00 |
| 130 | 301157 | 华塑科技 | 150 | 7,939.50 | 0.00 |
| 131 | 301295 | 美硕科技 | 215 | 7,755.05 | 0.00 |
| 132 | 301203 | 国泰环保 | 225 | 7,740.00 | 0.00 |
| 133 | 300804 | 广康生化 | 226 | 7,451.22 | 0.00 |
| 134 | 301337 | 亚华电子 | 232 | 7,045.84 | 0.00 |
| 135 | 301428 | 世纪恒通 | 229 | 7,007.40 | 0.00 |
| 136 | 001380 | 华纬科技 | 170 | 5,232.60 | 0.00 |
| 137 | 603125 | 常青科技 | 160 | 3,924.80 | 0.00 |
| 138 | 001328 | 登康口腔 | 145 | 3,696.05 | 0.00 |
| 139 | 001360 | 南矿集团 | 177 | 2,631.99 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 140 | 001324 | 长青科技 | 114 | 2,234.40 | 0.00 |
| 141 | 001367 | 海森药业 | 55 | 2,171.40 | 0.00 |
| 142 | 603172 | 万丰股份 | 122 | 1,967.86 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|--------------------|
| 1 | 000858 | 五粮液 | 218,847,911.05 | 5.03 |
| 2 | 000938 | 紫光股份 | 214,729,051.29 | 4.94 |
| 3 | H00700 | 腾讯控股 | 210,085,725.20 | 4.83 |
| 4 | 601985 | 中国核电 | 182,166,315.16 | 4.19 |
| 5 | 000063 | 中兴通讯 | 179,642,886.81 | 4.13 |
| 6 | 003816 | 中国广核 | 162,966,019.00 | 3.75 |
| 7 | 002230 | 科大讯飞 | 160,000,513.09 | 3.68 |
| 8 | 600011 | 华能国际 | 158,400,214.23 | 3.64 |
| 9 | 601668 | 中国建筑 | 151,526,776.00 | 3.49 |
| 10 | 600809 | 山西汾酒 | 147,232,952.35 | 3.39 |
| 11 | 600325 | 华发股份 | 146,598,901.85 | 3.37 |
| 12 | 688223 | 晶科能源 | 145,247,375.82 | 3.34 |
| 13 | 600546 | 山煤国际 | 144,968,351.25 | 3.34 |
| 14 | 300750 | 宁德时代 | 142,284,523.05 | 3.27 |
| 15 | 601288 | 农业银行 | 140,333,631.00 | 3.23 |
| 16 | 002304 | 洋河股份 | 138,120,399.00 | 3.18 |
| 17 | 601939 | 建设银行 | 137,310,260.04 | 3.16 |
| 18 | 001979 | 招商蛇口 | 134,544,950.70 | 3.10 |
| 19 | 688012 | 中微公司 | 131,620,597.20 | 3.03 |
| 20 | 002415 | 海康威视 | 125,869,733.22 | 2.90 |
| 21 | 002594 | 比亚迪 | 125,477,991.40 | 2.89 |
| 22 | 300604 | 长川科技 | 123,477,124.09 | 2.84 |

| | | | | |
|----|--------|--------|----------------|------|
| 23 | 688262 | 国芯科技 | 117,055,396.52 | 2.69 |
| 24 | 600219 | 南山铝业 | 116,252,536.80 | 2.67 |
| 25 | 688111 | 金山办公 | 112,834,020.95 | 2.60 |
| 26 | 300168 | 万达信息 | 111,723,868.22 | 2.57 |
| 27 | 002129 | TCL中环 | 110,695,439.40 | 2.55 |
| 28 | H00291 | 华润啤酒 | 107,929,916.71 | 2.48 |
| 29 | 601988 | 中国银行 | 107,478,292.30 | 2.47 |
| 30 | 601598 | 中国外运 | 107,257,493.93 | 2.47 |
| 31 | 603833 | 欧派家居 | 103,724,304.40 | 2.39 |
| 32 | 600027 | 华电国际 | 103,378,468.11 | 2.38 |
| 33 | 688041 | 海光信息 | 101,430,167.32 | 2.33 |
| 34 | 300454 | 深信服 | 99,911,873.00 | 2.30 |
| 35 | 601100 | 恒立液压 | 99,101,529.00 | 2.28 |
| 36 | 688256 | 寒武纪 | 97,708,719.28 | 2.25 |
| 37 | H01209 | 华润万象生活 | 96,760,957.29 | 2.23 |
| 38 | 000539 | 粤电力 A | 93,895,649.18 | 2.16 |
| 39 | 600633 | 浙数文化 | 93,236,807.81 | 2.14 |
| 40 | 300820 | 英杰电气 | 92,624,067.45 | 2.13 |
| 41 | 300476 | 胜宏科技 | 89,345,816.16 | 2.06 |
| 42 | 002371 | 北方华创 | 89,004,074.00 | 2.05 |
| 43 | 600584 | 长电科技 | 88,143,504.55 | 2.03 |
| 44 | 688234 | 天岳先进 | 87,386,193.42 | 2.01 |

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1 | H00700 | 腾讯控股 | 397,646,454.25 | 9.15 |
| 2 | H03690 | 美团-W | 261,211,574.46 | 6.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|------|
| 3 | 002304 | 洋河股份 | 253,024,244.30 | 5.82 |
| 4 | 000938 | 紫光股份 | 225,531,076.72 | 5.19 |
| 5 | 000568 | 泸州老窖 | 218,984,756.98 | 5.04 |
| 6 | 300037 | 新宙邦 | 207,836,764.22 | 4.78 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 205,019,905.48 | 4.72 |
| 8 | 300751 | 迈为股份 | 198,596,604.61 | 4.57 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 198,574,919.83 | 4.57 |
| 10 | 000063 | 中兴通讯 | 192,866,247.40 | 4.44 |
| 11 | H01579 | 颐海国际 | 188,769,197.29 | 4.34 |
| 12 | 000858 | 五粮液 | 187,910,614.27 | 4.32 |
| 13 | 300604 | 长川科技 | 177,011,345.61 | 4.07 |
| 14 | H00291 | 华润啤酒 | 162,151,907.07 | 3.73 |
| 15 | 002230 | 科大讯飞 | 156,598,515.04 | 3.60 |
| 16 | 600546 | 山煤国际 | 153,963,179.00 | 3.54 |
| 17 | 601225 | 陕西煤业 | 150,258,858.60 | 3.46 |
| 18 | 002352 | 顺丰控股 | 144,290,249.00 | 3.32 |
| 19 | 600809 | 山西汾酒 | 132,915,171.75 | 3.06 |
| 20 | 600176 | 中国巨石 | 129,577,713.12 | 2.98 |
| 21 | 002415 | 海康威视 | 128,249,408.47 | 2.95 |
| 22 | 688223 | 晶科能源 | 126,691,143.69 | 2.91 |
| 23 | H09922 | 九毛九 | 126,266,711.32 | 2.90 |
| 24 | 601088 | 中国神华 | 124,776,689.04 | 2.87 |
| 25 | H02331 | 李宁 | 122,561,153.64 | 2.82 |
| 26 | 688111 | 金山办公 | 121,716,221.41 | 2.80 |
| 27 | 688012 | 中微公司 | 120,739,238.96 | 2.78 |
| 28 | H02269 | 药明生物 | 120,193,640.03 | 2.77 |
| 29 | 688122 | 西部超导 | 118,180,916.95 | 2.72 |
| 30 | 002594 | 比亚迪 | 117,762,223.00 | 2.71 |
| 31 | 300476 | 胜宏科技 | 115,386,925.97 | 2.65 |
| 32 | 600325 | 华发股份 | 111,392,987.46 | 2.56 |
| 33 | 688041 | 海光信息 | 110,393,541.70 | 2.54 |

| | | | | |
|----|--------|--------|----------------|------|
| 34 | 688256 | 寒武纪 | 110,162,013.04 | 2.53 |
| 35 | 002129 | TCL中环 | 109,675,433.38 | 2.52 |
| 36 | 002903 | 宇环数控 | 107,748,390.52 | 2.48 |
| 37 | 300679 | 电连技术 | 107,152,697.89 | 2.47 |
| 38 | 600219 | 南山铝业 | 106,834,405.75 | 2.46 |
| 39 | 600584 | 长电科技 | 104,976,087.04 | 2.42 |
| 40 | 300168 | 万达信息 | 101,650,458.50 | 2.34 |
| 41 | 688262 | 国芯科技 | 98,364,438.12 | 2.26 |
| 42 | 600633 | 浙数文化 | 98,136,323.78 | 2.26 |
| 43 | 603596 | 伯特利 | 96,618,500.00 | 2.22 |
| 44 | 601100 | 恒立液压 | 92,354,833.70 | 2.12 |
| 45 | H01209 | 华润万象生活 | 91,091,614.01 | 2.10 |
| 46 | 300454 | 深信服 | 89,695,880.00 | 2.06 |
| 47 | 002371 | 北方华创 | 89,438,961.00 | 2.06 |
| 48 | 002727 | 一心堂 | 89,262,338.84 | 2.05 |
| 49 | 600845 | 宝信软件 | 88,310,815.50 | 2.03 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|-------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 10,271,429,275.81 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 11,136,588,446.01 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 101,412,972.77 | 3.03 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|----------------|------|
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 101,412,972.77 | 3.03 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 019694 | 23国债01 | 1,003,000 | 101,412,972.77 | 3.03 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内,基金投资的前十名证券的发行主体中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年受到行政处罚,处罚金额分别合计为150万元、20351万元、3280万元。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 3,308,971.20 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 156,994.44 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,465,965.64 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|-----------|----------|-----------|---------------|---------|------------------|----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 永赢长远价值混合A | 56,792 | 98,058.28 | 96,874,291.25 | 1.7396% | 5,472,051,352.32 | 98.2604% |
| 永赢长远价值混合C | 22,692 | 21,560.51 | 1,720,344.01 | 0.3516% | 487,530,829.81 | 99.6484% |
| 合计 | 79,484 | 76,218.82 | 98,594,635.26 | 1.6275% | 5,959,582,182.13 | 98.3725% |

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 永赢长远价值混合A | 6,452,588.21 | 0.12% |
| | 永赢长远价值混合C | 3,189,007.71 | 0.65% |
| | 合计 | 9,641,595.92 | 0.16% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|----|------|-------------------|
|----|------|-------------------|

| | | |
|--|---------------|--------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金 | 永赢长远价值混合 A | 50~100 |
| | 永赢长远价值混合 C | >100 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基 金 | 永赢长远价值混合 A | >100 |
| | 永赢长远价值混合 C | 0 |
| | 合计 | >100 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 永赢长远价值混合A | 永赢长远价值混合C |
|--------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2021年09月13 日)基金份额总额 | 7,235,123,897.71 | 690,789,785.33 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 6,238,572,761.20 | 557,655,497.85 |
| 本报告期基金总申购份额 | 62,623,924.08 | 31,302,545.64 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 732,271,041.71 | 99,706,869.67 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 5,568,925,643.57 | 489,251,173.82 |

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|-------------------|--------------|---------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 安信证券 | 2 | 21,388,947,347.54 | 100.00% | 15,758,819.13 | 100.00% | - |

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |

| | | | | | | | | |
|----------|--------------------|---------|----------------------|---------|---|---|---|---|
| 安信证 券 | 100,469,27 0.00 | 100.00% | 1,053,962,00 0.00 | 100.00% | - | - | - | - |
|----------|--------------------|---------|----------------------|---------|---|---|---|---|

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-----------|------------|
| 1 | 永赢基金管理有限公司关于新增兴业证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-05 |
| 2 | 永赢长远价值混合型证券投资基金2022年第4季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-20 |
| 3 | 永赢基金管理有限公司关于新增中国中金财富证券有限公司为永赢长远价值混合型证券投资基金代销机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-16 |
| 4 | 永赢基金管理有限公司关于新增杭州银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-29 |
| 5 | 永赢长远价值混合型证券投资基金2022年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-30 |
| 6 | 永赢基金管理有限公司关于广州分公司办公地址变更的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-31 |
| 7 | 永赢基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-08 |
| 8 | 永赢长远价值混合型证券投资基金2023年第1季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-21 |
| 9 | 永赢基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为永赢基金旗下部分基 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-22 |

| | | | |
|----|--|-----------|------------|
| | 金代销机构并参加费率优惠活动的公告 | | |
| 10 | 永赢长远价值混合型证券投资基金（A份额）基金产品资料概要更新(2023年第1号) | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-31 |
| 11 | 永赢长远价值混合型证券投资基金招募说明书更新(2023年第1号) | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-31 |
| 12 | 永赢长远价值混合型证券投资基金（C份额）基金产品资料概要更新(2023年第1号) | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-31 |
| 13 | 永赢长远价值混合型证券投资基金（A份额）基金产品资料概要更新(2023年第2号) | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-07 |
| 14 | 永赢长远价值混合型证券投资基金更新招募说明书(2023年第2号) | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-07 |
| 15 | 永赢长远价值混合型证券投资基金增聘基金经理的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-07 |
| 16 | 永赢长远价值混合型证券投资基金（C份额）基金产品资料概要更新(2023年第2号) | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-07 |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予永赢长远价值混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《永赢长远价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《永赢长远价值混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《永赢长远价值混合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。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层

12.3 查阅方式

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

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司
二〇二三年八月三十日