

# 永赢优质生活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:浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商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	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68

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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢优质生活混合型证券投资基金	
基金简称	永赢优质生活混合	
基金主代码	015287	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年08月23日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	222,373,821.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢优质生活混合A	永赢优质生活混合C
下属分级基金的交易代码	015287	015288
报告期末下属分级基金的份额总额	146,165,905.63份	76,207,915.80份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于优质生活主题相关的资产，在力争控制组合风险的前提下，实现资产净值的中长期稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，在优质生活主题所涵盖“衣、食、居、行、康、乐、美”七大领域寻找可持续成长的优质企业，从而实现基金的投资目标。本基金主要投资策略包含大类资产配置策略、股票投资策略、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×70%+恒生指数收益率×10%+中债-综合指数（全价）收益率×20%
风险收益特征	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。本基金可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。
--	-----

## 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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	朱巍
	联系电话	021-20430340	0571-87659806
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-805-8888	95527
传真		021-51690177	0571-88268688
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	杭州市萧山区鸿宁路1788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	杭州市拱墅区环城西路76号
邮政编码		200120	310006
法定代表人		马宇晖	陆建强

## 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)	
	永赢优质生活混合 A	永赢优质生活混合 C
本期已实现收益	-19,500,964.87	-10,498,236.17
本期利润	-19,810,821.31	-10,416,974.05
加权平均基金份额本期利润	-0.1234	-0.1219
本期加权平均净值利润率	-13.95%	-13.81%
本期基金份额净值增长率	-13.19%	-13.45%
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	-27,145,197.84	-14,470,404.40
期末可供分配基金份额利润	-0.1857	-0.1899
期末基金资产净值	119,020,707.79	61,737,511.40
期末基金份额净值	0.8143	0.8101
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	-18.57%	-18.99%

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

永赢优质生活混合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	-2.72%	1.07%	1.44%	0.72%	-4.16%	0.35%
过去三个月	-5.03%	0.91%	-3.63%	0.67%	-1.40%	0.24%
过去六个月	-13.19%	0.90%	-0.30%	0.68%	-12.89%	0.22%
自基金合同 生效起至今	-18.57%	0.72%	-5.21%	0.83%	-13.36%	-0.11%

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×70%+恒生指数收益率×10%+中债-综合指数（全价）收益率×20%。

#### 永赢优质生活混合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	-2.77%	1.07%	1.44%	0.72%	-4.21%	0.35%
过去三个月	-5.17%	0.91%	-3.63%	0.67%	-1.54%	0.24%
过去六个月	-13.45%	0.90%	-0.30%	0.68%	-13.15%	0.22%
自基金合同 生效起至今	-18.99%	0.72%	-5.21%	0.83%	-13.78%	-0.11%

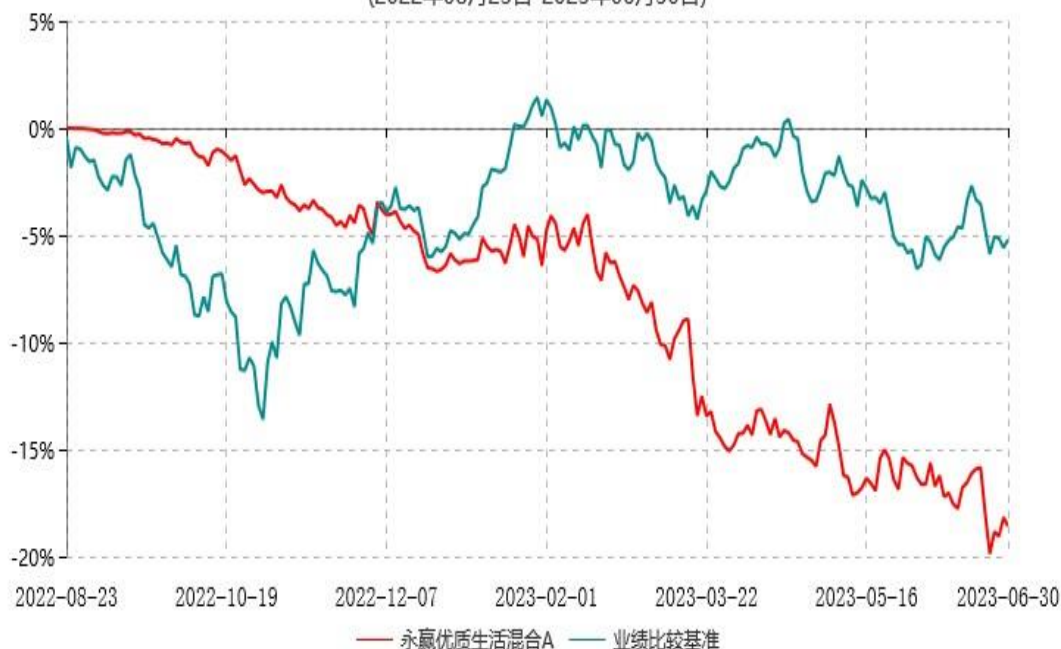
注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债-综合指数（全价）收益率×20%。

### 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



永赢优质生活混合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  
(2022年08月23日-2023年06月30日)



注：1、本基金合同生效日为2022年8月23日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；  
2、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。

永赢优质生活混合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  
(2022年08月23日-2023年06月30日)



注：1、本基金合同生效日为2022年8月23日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；  
2、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

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		
光磊	基金经理兼投资经理	2022-08-23	-	15	光磊先生，浙江大学理学硕士，15年证券相关从业经验。曾任汇添富基金管理有限公司投资研究部高级行业分析师，华宝兴业基金管理有限公司国内投资部基金经理助理，华宝基金管理有限公司国内投资部投资副总监、基金经理，永赢基金管理有限公司权益投资部副总监。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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
光磊	公募基金	2	188,632,210.88	2021-12-28
	私募资产管理计划	1	16,751,715.82	2022-07-21
	其他组合	-	-	-

	合计	3	205,383,926.70	-
--	----	---	----------------	---

#### 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、《永赢优质生活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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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

2023年上半年市场先扬后抑，在一季度权益市场总体保持上涨结构，但结构分化剧烈：1月市场对疫情优化政策后的场景复苏充满期待，消费服务类的行业相对表现较好；2月之后市场密切关心经济复苏的节奏和力度，与经济周期密切相关的行业有较好表现；3月市场上关于“强预期，弱现实”的经济复苏声音渐渐多了起来，叠加海外人工智能相关的各类信息，产业界的变化反应在二级市场，科技类公司有较好表现。但另一方面，市场也体现出了较强的存量博弈和轮动特征，特别是3月中旬以来TMT板块的成交额开

始占市场总成交量的比例超过40%，对其他行业也形成了一定冲击。进入二季度之后市场波动继续加大，在前期定价复苏中过于乐观的行业出现了业绩预期和估值的双重调整；叠加美元的阶段性走强，北上的配置型资金有流出压力，食品饮料、医药等行业调整幅度较大。而以人工智能为代表的科技进步仍在产业中快速推进，带动大模型、算力、数据、应用等多个领域的行业有较好表现，市场分化加剧。

从上半年整体表现看，上证指数上涨3.65%，深证成指为0.10%，中小综指为2.25%，创业板指为-5.61%，科创50为4.71%。本基金一季度仍处于建仓期，之前的主要配置方向在消费和医药上，并叠加一部分偏价值的公司，实际完成建仓是在1月；2月之后市场风格的转变，以及3月中旬后流动性的影响对本基金造成的冲击较大。二季度主要的调整方向是根据基金的投资范围，优化了消费股的配置结构，配置于竞争力更强的公司上；同时根据医药行业景气度的变化，增配了部分经营改善的创新药、专利药和中药公司，并结合TMT行业的变化，适度配置了游戏行业的龙头公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢优质生活混合A基金份额净值为0.8143元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.19%，同期业绩比较基准收益率为-0.30%；截至报告期末永赢优质生活混合C基金份额净值为0.8101元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.45%，同期业绩比较基准收益率为-0.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着市场的波动和预期变化，我们认为二级市场对于经济复苏的预期已经得到了修正，后续伴随着经济的持续复苏和美联储加息预期的再次兑现，国内权益市场的机会大于风险。我们将坚持在经济复苏和产业景气两个维度继续积极寻找投资机会，并密切关注相关政策的出台，期待权益市场能伴随经济数据的改善有更好表现。

#### 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人--永赢基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对永赢基金管理有限公司编制和披露的永赢优质生活混合型证券投资基金2023年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：永赢优质生活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

<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,606,655.33	67,450,060.11
结算备付金		3,861,189.37	80,177,874.97
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	163,122,154.69	110,315,069.01
其中：股票投资		163,122,154.69	93,198,514.22
基金投资		-	-
债券投资		-	17,116,554.79
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	-	-
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		2,267.18	33,361.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		181,592,266.57	257,976,365.66
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		411,132.96	1,417,317.59
应付管理人报酬		231,137.91	349,700.20
应付托管费		38,522.97	58,283.39
应付销售服务费		31,390.68	55,861.24
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	121,862.86	160,969.95
负债合计		834,047.38	2,042,132.37
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	222,373,821.43	273,074,488.12
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-41,615,602.24	-17,140,254.83
净资产合计		180,758,219.19	255,934,233.29
负债和净资产总计		181,592,266.57	257,976,365.66

注：(1)报告截止日2023年6月30日，基金份额净值0.8129元，基金份额总额222,373,821.43份。其中A类基金份额净值0.8143元，份额总额146,165,905.63份；C类基金份额净值0.8101元，份额总额76,207,915.80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：永赢优质生活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0 6月30日
一、营业总收入		-28,022,794.84

1.利息收入		115,698.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	99,026.05
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		16,672.71
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-27,920,400.47
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-29,442,989.71
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-44.69
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	407,844.19
股利收益	6.4.7.15	1,114,789.74
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	-228,594.32
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	10,501.19
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,205,000.52</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,624,076.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	270,679.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	225,862.04
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		1,489.36

8. 其他费用	6.4.7.19	82,893.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-30,227,795.36
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-30,227,795.36
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-30,227,795.36

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：永赢优质生活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）	273,074,488.12	-	-17,140,254.83	255,934,233.29
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）	273,074,488.12	-	-17,140,254.83	255,934,233.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-50,700,666.69	-	-24,475,347.41	-75,176,014.10
（一）、综合收益总额	-	-	-30,227,795.36	-30,227,795.36
（二）、本期基	-50,700,666.69	-	5,752,447.95	-44,948,218.74

金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	2,307,047.51	-	-258,083.79	2,048,963.72
2.基金赎回款	-53,007,714.20	-	6,010,531.74	-46,997,182.46
(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)	222,373,821.43	-	-41,615,602.24	180,758,219.19

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

永赢优质生活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[2022]317号《关于准予永赢优质生活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募集,基金合同于2022年8月23日生效,首次设立募集规模为332,599,635.13份基金份额

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，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

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，创业板及其他经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（包括国债，央行票据，金融债，企业债，公司债，中期票据，短期融资券，超短期融资券，次级债，政府支持机构债，政府支持债券，地方政府债，可交换债券，可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券），资产支持证券，债券回购，同业存单，银行存款，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%；投资于优质生活主题相关上市公司股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%。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×70%+恒生指数收益率×10%+中债-综合指数（全价）收益率×20%。

#### 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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6 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	11,071,616.32
等于：本金	11,070,977.03
加：应计利息	639.29
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	3,535,039.01
等于：本金	3,534,559.99
加：应计利息	479.02
减：坏账准备	-
合计	14,606,655.33

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	165,656,730.68	-	163,122,154.69	-2,534,575.99
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	165,656,730.68	-	163,122,154.69	-2,534,575.99

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 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	-
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	81,822.86
其他	40,040.00
合计	121,862.86

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 永赢优质生活混合A

金额单位：人民币元

项目 (永赢优质生活混合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	171,174,971.11	171,174,971.11
本期申购	1,044,783.18	1,044,783.18
本期赎回(以“-”号填列)	-26,053,848.66	-26,053,848.66

本期末	146,165,905.63	146,165,905.63
-----	----------------	----------------

#### 6.4.7.7.2 永赢优质生活混合C

金额单位：人民币元

项目 (永赢优质生活混合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	101,899,517.01	101,899,517.01
本期申购	1,262,264.33	1,262,264.33
本期赎回（以“-”号填列）	-26,953,865.54	-26,953,865.54
本期末	76,207,915.80	76,207,915.80

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 永赢优质生活混合A

单位：人民币元

项目 (永赢优质生活混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-9,274,000.85	-1,342,106.58	-10,616,107.43
本期利润	-19,500,964.87	-309,856.44	-19,810,821.31
本期基金份额交易产生的变动数	3,195,710.09	86,020.81	3,281,730.90
其中：基金申购款	-120,590.42	1,743.87	-118,846.55
基金赎回款	3,316,300.51	84,276.94	3,400,577.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-25,579,255.63	-1,565,942.21	-27,145,197.84

##### 6.4.7.8.2 永赢优质生活混合C

单位：人民币元

项目 (永赢优质生活混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-5,726,817.76	-797,329.64	-6,524,147.40

本期利润	-10,498,236.17	81,262.12	-10,416,974.05
本期基金份额交易产生的变动数	2,566,821.38	-96,104.33	2,470,717.05
其中：基金申购款	-143,031.75	3,794.51	-139,237.24
基金赎回款	2,709,853.13	-99,898.84	2,609,954.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,658,232.55	-812,171.85	-14,470,404.40

#### 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	13,834.45
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	22,132.65
结算备付金利息收入	63,058.95
其他	-
合计	99,026.05

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	1,224,337,657.16
减：卖出股票成本总额	1,250,433,416.59
减：交易费用	3,347,230.28
买卖股票差价收入	-29,442,989.71

#### 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	41,153.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-41,198.67
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	-44.69

**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	17,173,913.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,025,086.00
减：应计利息总额	190,008.77
减：交易费用	17.67
买卖债券差价收入	-41,198.67

**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**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023年01月01日至2023年06月30日
股指期货投资收益	407,844.19

**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	1,114,789.74
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	1,114,789.74

**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	-228,594.32
——股票投资	-285,980.32
——债券投资	57,386.00
——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	-228,594.32
----	-------------

#### 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	10,208.36
基金转换费收入	292.83
合计	10,501.19

#### 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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	822.73
证券组合费	247.54
合计	82,893.13

### 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
浙商银行股份有限公司("浙商银行")	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
	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,624,076.58



其中：支付销售机构的客户维护费	688,146.30
-----------------	------------

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
当期发生的基金应支付的托管费	270,679.41

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		
	永赢优质生活混合A	永赢优质生活混合C	合计
永赢基金	0.00	7.96	7.96
浙商银行	0.00	127,041.62	127,041.62
宁波银行	0.00	21,302.14	21,302.14
合计	0.00	148,351.72	148,351.72

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0.60%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{C类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

永赢优质生活混合A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	10,002,972.22
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,002,972.22
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.4983%

永赢优质生活混合C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00

报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	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 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
浙商银行	11,071,616.32	13,834.45

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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	证券	成功	受限期	流通	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日		受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	估值总额	
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	64	1,787.52	2,113.92	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股限售	18.88	19.60	103	1,944.64	2,018.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股限售	20.68	25.49	84	1,737.12	2,141.16	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	123	1,891.74	1,829.01	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股限售	44.48	39.48	40	1,779.20	1,579.20	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股限售	28.84	30.78	113	3,258.92	3,478.14	-
300804	广康生化	2023-06-15	6个月	新股限售	42.45	32.97	165	7,004.25	5,440.05	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新股限售	41.20	42.69	190	7,828.00	8,111.10	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股限售	34.00	34.93	138	4,692.00	4,820.34	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内(含)	认购新发证券	25.82	25.82	1,437	37,103.34	37,103.34	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	160	4,131.20	4,131.20	-
301203	国泰环保	2023-03-2	6个月	新股限售	46.13	34.40	135	6,227.55	4,644.00	-

		8								
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股限售	57.88	49.17	131	7,582.28	6,441.27	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	新股限售	35.66	33.26	204	7,274.64	6,785.04	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月	新股限售	72.50	58.42	91	6,597.50	5,316.22	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	新股限售	50.00	30.71	248	12,400.00	7,616.08	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内(含)	认购新发证券	36.90	36.90	1,014	37,416.60	37,416.60	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	36.90	113	4,169.70	4,169.70	-
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	新股限售	30.22	25.50	263	7,947.86	6,706.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股限售	44.18	25.10	154	6,803.72	3,865.40	-
301281	科源制药	2023-05-26	5个月	新股限售-送股	-	25.10	62	-	1,556.20	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股限售	38.13	31.03	249	9,494.37	7,726.47	-
301292	海科新源	2023-06-29	1个月内(含)	认购新发证券	19.99	19.99	2,934	58,650.66	58,650.66	-
3012	海科	2023	6个月	新股	19.99	19.99	327	6,53	6,53	-

92	新源	-06-29		限售				6.73	6.73	
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股限售	29.60	71.42	197	5,831.20	14,069.74	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6个月	新股限售	37.40	36.07	185	6,919.00	6,672.95	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	新股限售	25.25	19.69	272	6,868.00	5,355.68	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	新股限售	32.34	31.86	238	7,696.92	7,582.68	-
301310	鑫宏业	2023-05-26	6个月	新股限售	67.28	65.43	147	9,890.16	9,618.21	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	161	5,198.69	8,230.32	-
301320	豪江智能	2023-06-01	6个月	新股限售	13.06	20.62	582	7,600.92	12,000.84	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	111	4,335.66	4,368.96	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	新股限售	76.80	107.95	100	7,680.00	10,795.00	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	437	6,471.97	6,000.01	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股限售	32.60	30.37	148	4,824.80	4,494.76	-
301345	涛涛车业	2023-03-1	6个月	新股限售	73.45	46.64	77	5,655.65	3,591.28	-

		0								
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	新股限售	17.55	16.75	299	5,247.45	5,008.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新股限售	50.00	48.39	121	6,050.00	5,855.19	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	新股限售	71.88	92.60	81	5,822.28	7,500.60	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	238	5,869.08	5,357.38	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	新股限售	23.80	32.84	200	4,760.00	6,568.00	-
301383	天键股份	2023-05-31	6个月	新股限售	46.16	35.72	192	8,862.72	6,858.24	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股限售	29.99	23.79	220	6,597.80	5,233.80	-
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股限售	58.32	45.36	170	9,914.40	7,711.20	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内(含)	认购新发证券	26.68	26.68	2,454	65,472.72	65,472.72	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	273	7,283.64	7,283.64	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股限售	53.27	40.20	140	7,457.80	5,628.00	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股限售	43.99	51.57	157	6,906.43	8,096.49	-

301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	新股限售	26.35	30.60	169	4,453.15	5,171.40	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	新股限售	28.75	21.02	361	10,378.75	7,588.22	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新股限售	19.99	16.90	301	6,016.99	5,086.90	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内(含)	认购新发证券	57.66	57.66	1,104	63,656.64	63,656.64	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	57.66	123	7,092.18	7,092.18	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内(含)	认购新发证券	39.78	39.78	1,447	57,561.66	57,561.66	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	161	6,404.58	6,404.58	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股限售	6.58	7.58	606	3,987.48	4,593.48	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	237	2,455.32	2,806.08	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股限售	11.66	12.26	208	2,425.28	2,550.08	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	70	1,818.60	1,717.10	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股限售	15.90	17.09	137	2,178.30	2,341.33	-



603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股限售	14.58	16.13	121	1,764.18	1,951.73	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	1,123	22,302.78	20,281.38	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	新股限售	14.16	16.21	352	4,984.32	5,705.92	-
688343	云天励飞	2023-03-28	6个月	新股限售	43.92	50.67	3,078	135,185.76	155,962.26	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	新股限售	12.10	12.07	555	6,715.50	6,698.85	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	176	4,153.60	11,381.92	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	新股限售	26.66	31.50	167	4,452.22	5,260.50	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	新股限售	75.00	90.76	77	5,775.00	6,988.52	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	新股限售	5.69	5.41	2,091	11,897.79	11,312.31	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股限售	11.10	17.04	675	7,492.50	11,502.00	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	新股限售	32.52	42.37	229	7,447.08	9,702.73	-
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	136	4,622.64	4,010.64	-
6884	南芯	2023	6个月	新股	39.99	36.71	206	8,23	7,56	-

84	科技	-03-28		限售				7.94	2.26	
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	新股限售	20.92	19.16	282	5,899.44	5,403.12	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	266	5,814.76	6,344.10	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股限售	152.38	135.97	81	12,342.78	11,013.57	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	134	4,690.00	6,864.82	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	新股限售	43.67	53.05	130	5,677.10	6,896.50	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	新股限售	21.17	23.50	270	5,715.90	6,345.00	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	新股限售	12.68	22.31	395	5,008.60	8,812.45	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	新股限售	30.26	25.33	208	6,294.08	5,268.64	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	46	5,786.80	5,429.38	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	新股限售	26.74	40.68	202	5,401.48	8,217.36	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	427	4,773.86	6,229.93	-
688603	天承科技	2023-06-3	1个月内(含)	认购新发	55.00	55.00	813	44,715.00	44,715.00	-

		0		证券						
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	91	5,005.00	5,005.00	-
688620	安凯微	2023-06-15	6个月	新股限售	10.68	12.34	564	6,023.52	6,959.76	-
688623	二元科技	2023-05-31	6个月	新股限售	125.88	86.79	52	6,545.76	4,513.08	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6个月	新股限售	9.26	18.59	467	4,324.42	8,681.53	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	153	3,867.84	4,570.11	-

#### 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6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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	-	17,116,554.79
合计	-	17,116,554.79

注：1、国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级；

2、本期末，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	14,606,655.33	-	-	-	-	-	14,606,655.33
结算备付金	3,861,189.37	-	-	-	-	-	3,861,189.37
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	163,122,154.69	163,122,154.69
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	-	-	-	-	-	2,267.18	2,267.18
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,467,844.70	-	-	-	-	163,124,421.87	181,592,266.57
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	-	-	-	-	-	411,132.96	411,132.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	231,137.91	231,137.91
应付托管费	-	-	-	-	-	38,522.97	38,522.97
应付销售服务费	-	-	-	-	-	31,390.68	31,390.68
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	121,862.86	121,862.86
负债总计	-	-	-	-	-	834,047.38	834,047.38
利率敏感度缺口	18,467,844.70	-	-	-	-	162,290,374.49	180,758,219.19
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	625,663.13	-	-	-	-	-	625,663.13

结算备付金	80,177,874.97	-	-	-	-	-	80,177,874.97
存出保证金	66,824,396.98	-	-	-	-	-	66,824,396.98
交易性金融资产	-	-	17,116,554.79	-	-	93,198,514.22	110,315,069.01
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	-	-	-	-	-	33,361.57	33,361.57
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	147,627,935.08	-	17,116,554.79	-	-	93,231,875.79	257,976,365.66
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	-	-	-	-	-	1,417,317.59	1,417,317.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	349,700.20	349,700.20
应付托管费	-	-	-	-	-	58,283.39	58,283.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	55,861.24	55,861.24
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	160,969.95	160,969.95



负债总计	-	-	-	-	-	2,042,132.37	2,042,132.37
利率敏感度缺口	147,627,935.08	-	17,116,554.79	-	-	91,189,743.42	255,934,233.29

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	-	-45,196.26
	市场利率平行下降50个基点	-	45,196.26

注：本报告期末，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	-	5,701,819.35	-	5,701,819.35
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	-	5,701,819.35	-	5,701,819.35
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	-	5,701,819.35	-	5,701,819.35
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				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 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%	285,090.97	-
	所有外币相对于人民币贬值5%	-285,090.97	-

注：上年度末，本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

#### 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	163,122,154.69	90.24	93,198,514.22	36.42
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	163,122,154.69	90.24	93,198,514.22	36.42

#### 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%	1,017,367.44	557,689.90
	业绩比较基准减少1%	-1,017,367.44	-557,689.90

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	162,086,443.60	93,198,514.22
第二层次	405,199.65	17,116,554.79
第三层次	630,511.44	-
合计	163,122,154.69	110,315,069.01

#### 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	163,122,154.69	89.83
	其中：股票	163,122,154.69	89.83
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	18,467,844.70	10.17
8	其他各项资产	2,267.18	0.00
9	合计	181,592,266.57	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5,701,819.35元，占期末净值比例3.15%。

## 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	-	-
C	制造业	127,013,613.37	70.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,891.41	0.00
F	批发和零售业	2,711,154.86	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,183,167.36	12.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,653,456.92	2.02
N	水利、环境和公共设施管理业	9,999.68	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,844,051.74	1.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	157,420,335.34	87.09

### 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	-	-

日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	5,701,819.35	3.15
工业	-	-
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	5,701,819.35	3.15

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	000568	泸州老窖	39,700	8,319,929.00	4.60
2	600276	恒瑞医药	134,080	6,422,432.00	3.55
3	000596	古井贡酒	25,400	6,283,452.00	3.48
4	600519	贵州茅台	3,500	5,918,500.00	3.27
5	600572	康恩贝	812,800	5,567,680.00	3.08
6	688793	倍轻松	95,924	5,170,303.60	2.86
7	002555	三七互娱	137,600	4,799,488.00	2.66
8	600587	新华医疗	134,600	4,755,418.00	2.63
9	300760	迈瑞医疗	15,800	4,736,840.00	2.62
10	688617	惠泰医疗	12,392	4,631,510.00	2.56
11	688566	吉贝尔	116,664	4,551,062.64	2.52
12	688036	传音控股	30,869	4,537,743.00	2.51
13	600529	山东药玻	162,000	4,409,640.00	2.44
14	603444	吉比特	8,400	4,125,324.00	2.28

15	H02273	固生堂	89,000	4,078,194.13	2.26
16	600329	达仁堂	83,700	3,757,293.00	2.08
17	000860	顺鑫农业	111,400	3,753,066.00	2.08
18	300002	神州泰岳	261,200	3,656,800.00	2.02
19	600129	太极集团	61,100	3,634,839.00	2.01
20	000729	燕京啤酒	283,900	3,540,233.00	1.96
21	002517	恺英网络	217,300	3,420,302.00	1.89
22	002558	巨人网络	180,200	3,230,986.00	1.79
23	600079	人福医药	118,900	3,203,166.00	1.77
24	600557	康缘药业	103,300	2,836,618.00	1.57
25	600211	西藏药业	45,300	2,690,820.00	1.49
26	002262	恩华药业	86,700	2,672,961.00	1.48
27	300452	山河药辅	149,500	2,607,280.00	1.44
28	600422	昆药集团	124,600	2,581,712.00	1.43
29	000333	美的集团	43,400	2,557,128.00	1.41
30	300396	迪瑞医疗	66,000	2,144,340.00	1.19
31	000921	海信家电	76,600	2,064,370.00	1.14
32	688626	翔宇医疗	44,074	2,005,807.74	1.11
33	002605	姚记科技	41,600	1,931,488.00	1.07
34	688169	石头科技	6,023	1,931,455.64	1.07
35	000999	华润三九	31,000	1,880,460.00	1.04
36	301230	泓博医药	40,880	1,835,512.00	1.02
37	300244	迪安诊断	71,400	1,829,982.00	1.01
38	301096	百诚医药	29,900	1,812,239.00	1.00
39	688266	泽璟制药	38,436	1,789,195.80	0.99
40	300633	开立医疗	32,600	1,776,700.00	0.98
41	603517	绝味食品	47,200	1,753,480.00	0.97
42	H00013	和黄医药	95,500	1,623,625.22	0.90
43	600419	天润乳业	91,800	1,488,996.00	0.82
44	688050	爱博医疗	7,222	1,482,893.26	0.82
45	601607	上海医药	64,400	1,443,204.00	0.80



46	000423	东阿阿胶	27,000	1,443,150.00	0.80
47	600566	济川药业	45,500	1,321,320.00	0.73
48	603567	珍宝岛	84,300	1,261,128.00	0.70
49	603939	益丰药房	34,000	1,258,000.00	0.70
50	000989	九芝堂	78,400	1,085,056.00	0.60
51	002880	卫光生物	23,200	874,640.00	0.48
52	600066	宇通客车	57,700	850,498.00	0.47
53	688232	新点软件	15,132	814,252.92	0.45
54	603811	诚意药业	58,240	723,923.20	0.40
55	603889	新澳股份	94,000	705,940.00	0.39
56	688117	圣诺生物	11,484	331,887.60	0.18
57	605016	百龙创园	6,900	170,844.00	0.09
58	688343	云天励飞	3,078	155,962.26	0.09
59	301395	仁信新材	2,727	72,756.36	0.04
60	301486	致尚科技	1,227	70,748.82	0.04
61	301292	海科新源	3,261	65,187.39	0.04
62	301488	豪恩汽电	1,608	63,966.24	0.04
63	688603	天承科技	904	49,720.00	0.03
64	301261	恒工精密	1,127	41,586.30	0.02
65	301202	朗威股份	1,597	41,234.54	0.02
66	688249	晶合集成	1,123	20,281.38	0.01
67	301293	三博脑科	197	14,069.74	0.01
68	301320	豪江智能	582	12,000.84	0.01
69	688472	阿特斯	675	11,502.00	0.01
70	688361	中科飞测	176	11,381.92	0.01
71	688469	中芯集成	2,091	11,312.31	0.01
72	688531	日联科技	81	11,013.57	0.01
73	301325	曼恩斯特	100	10,795.00	0.01
74	688478	晶升股份	229	9,702.73	0.01
75	301310	鑫宏业	147	9,618.21	0.01
76	688562	航天软件	395	8,812.45	0.00

77	688629	华丰科技	467	8,681.53	0.00
78	301315	威士顿	161	8,230.32	0.00
79	688582	芯动联科	202	8,217.36	0.00
80	301141	中科磁业	190	8,111.10	0.00
81	301399	英特科技	157	8,096.49	0.00
82	301291	明阳电气	249	7,726.47	0.00
83	301387	光大同创	170	7,711.20	0.00
84	301246	宏源药业	248	7,616.08	0.00
85	301429	森泰股份	361	7,588.22	0.00
86	301307	美利信	238	7,582.68	0.00
87	688484	南芯科技	206	7,562.26	0.00
88	301360	荣旗科技	81	7,500.60	0.00
89	688458	美芯晟	77	6,988.52	0.00
90	688620	安凯微	564	6,959.76	0.00
91	688543	国科军工	130	6,896.50	0.00
92	688535	华海诚科	134	6,864.82	0.00
93	301383	天键股份	192	6,858.24	0.00
94	301225	恒勃股份	204	6,785.04	0.00
95	301262	海看股份	263	6,706.50	0.00
96	688352	硕中科技	555	6,698.85	0.00
97	301295	美硕科技	185	6,672.95	0.00
98	301382	蜂助手	200	6,568.00	0.00
99	301210	金杨股份	131	6,441.27	0.00
100	688552	航天南湖	270	6,345.00	0.00
101	688523	航天环宇	266	6,344.10	0.00
102	688593	新相微	427	6,229.93	0.00
103	301332	德尔玛	437	6,000.01	0.00
104	301357	北方长龙	121	5,855.19	0.00
105	688334	西高院	352	5,705.92	0.00
106	301397	溯联股份	140	5,628.00	0.00
107	300804	广康生化	165	5,440.05	0.00

108	688581	安杰思	46	5,429.38	0.00
109	301281	科源制药	216	5,421.60	0.00
110	688512	慧智微	282	5,403.12	0.00
111	301376	致欧科技	238	5,357.38	0.00
112	301305	朗坤环境	272	5,355.68	0.00
113	301232	飞沃科技	91	5,316.22	0.00
114	688570	天玛智控	208	5,268.64	0.00
115	688433	华曙高科	167	5,260.50	0.00
116	301386	未来电器	220	5,233.80	0.00
117	301428	世纪恒通	169	5,171.40	0.00
118	301439	泓淋电力	301	5,086.90	0.00
119	301355	南王科技	299	5,008.25	0.00
120	301170	锡南科技	138	4,820.34	0.00
121	301203	国泰环保	135	4,644.00	0.00
122	601061	中信金属	606	4,593.48	0.00
123	688631	莱斯信息	153	4,570.11	0.00
124	688623	双元科技	52	4,513.08	0.00
125	301337	亚华电子	148	4,494.76	0.00
126	301323	新莱福	111	4,368.96	0.00
127	688479	友车科技	136	4,010.64	0.00
128	301345	涛涛车业	77	3,591.28	0.00
129	001380	华纬科技	113	3,478.14	0.00
130	601065	江盐集团	237	2,806.08	0.00
131	601133	柏诚股份	208	2,550.08	0.00
132	603137	恒尚节能	137	2,341.33	0.00
133	001328	登康口腔	84	2,141.16	0.00
134	001282	三联锻造	64	2,113.92	0.00
135	001324	长青科技	103	2,018.80	0.00
136	603172	万丰股份	121	1,951.73	0.00
137	001360	南矿集团	123	1,829.01	0.00
138	603125	常青科技	70	1,717.10	0.00

139	001367	海森药业	40	1,579.20	0.00
140	300896	爱美客	3	1,334.85	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	000568	泸州老窖	25,786,158.00	10.08
2	000661	长春高新	20,997,049.83	8.20
3	600276	恒瑞医药	20,564,139.80	8.03
4	300896	爱美客	19,983,594.46	7.81
5	600199	金种子酒	18,838,464.00	7.36
6	600519	贵州茅台	17,464,656.45	6.82
7	688506	百利天恒	15,765,576.12	6.16
8	603486	科沃斯	15,305,880.40	5.98
9	688382	益方生物	15,052,469.89	5.88
10	000333	美的集团	15,006,208.00	5.86
11	000423	东阿阿胶	14,756,496.08	5.77
12	600600	青岛啤酒	14,649,485.00	5.72
13	600557	康缘药业	14,364,488.56	5.61
14	600702	舍得酒业	13,856,824.40	5.41
15	000729	燕京啤酒	13,669,803.00	5.34
16	002555	三七互娱	13,656,190.47	5.34
17	600132	重庆啤酒	13,475,509.00	5.27
18	603444	吉比特	13,065,255.00	5.10
19	300015	爱尔眼科	13,011,601.92	5.08
20	002558	巨人网络	12,744,115.29	4.98
21	301239	普瑞眼科	12,531,556.54	4.90
22	600690	海尔智家	12,363,301.46	4.83
23	600329	达仁堂	12,359,640.00	4.83

24	301267	华夏眼科	12,052,016.00	4.71
25	688639	华恒生物	12,041,133.74	4.70
26	600129	太极集团	11,788,995.00	4.61
27	300009	安科生物	11,600,116.00	4.53
28	000596	古井贡酒	11,536,194.00	4.51
29	002594	比亚迪	11,125,127.10	4.35
30	603259	药明康德	10,810,658.75	4.22
31	688111	金山办公	10,252,674.29	4.01
32	000858	五粮液	10,183,106.68	3.98
33	601390	中国中铁	10,109,536.00	3.95
34	001979	招商蛇口	10,057,583.00	3.93
35	603939	益丰药房	10,032,108.09	3.92
36	600422	昆药集团	10,013,331.55	3.91
37	002508	老板电器	9,834,862.00	3.84
38	000999	华润三九	9,747,560.97	3.81
39	688197	首药控股	9,722,590.37	3.80
40	002422	科伦药业	9,423,964.00	3.68
41	H09966	康宁杰瑞 制药-B	9,012,331.58	3.52
42	600572	康恩贝	8,792,412.50	3.44
43	300760	迈瑞医疗	8,737,459.50	3.41
44	000063	中兴通讯	8,710,235.00	3.40
45	603896	寿仙谷	8,642,111.00	3.38
46	H00013	和黄医药	8,548,570.19	3.34
47	688133	泰坦科技	8,471,082.25	3.31
48	600845	宝信软件	8,400,588.29	3.28
49	601088	中国神华	8,116,698.34	3.17
50	688426	康为世纪	8,002,891.19	3.13
51	002517	恺英网络	7,967,246.50	3.11
52	300171	东富龙	7,800,449.00	3.05
53	000963	华东医药	7,697,499.00	3.01

54	603606	东方电缆	7,652,270.00	2.99
55	601225	陕西煤业	7,606,305.00	2.97
56	300452	山河药辅	7,606,048.00	2.97
57	300253	卫宁健康	7,605,409.00	2.97
58	600570	恒生电子	7,552,800.20	2.95
59	300750	宁德时代	7,475,804.00	2.92
60	688007	光峰科技	7,390,314.49	2.89
61	600587	新华医疗	7,367,429.00	2.88
62	688617	惠泰医疗	7,275,308.17	2.84
63	601800	中国交建	6,960,017.60	2.72
64	600941	中国移动	6,865,240.00	2.68
65	H02273	固生堂	6,712,061.20	2.62
66	002603	以岭药业	6,590,749.65	2.58
67	688169	石头科技	6,563,504.42	2.56
68	600079	人福医药	6,542,963.00	2.56
69	002230	科大讯飞	6,528,703.00	2.55
70	300866	安克创新	6,444,644.00	2.52
71	002262	恩华药业	6,324,442.00	2.47
72	300383	光环新网	6,282,162.85	2.45
73	002866	传艺科技	6,274,379.00	2.45
74	H03690	美团-W	6,217,991.94	2.43
75	600809	山西汾酒	6,094,573.00	2.38
76	002605	姚记科技	6,029,922.00	2.36
77	688235	百济神州	5,887,031.36	2.30
78	300759	康龙化成	5,777,592.00	2.26
79	000860	顺鑫农业	5,696,463.00	2.23
80	002311	海大集团	5,540,422.00	2.16
81	688315	诺禾致源	5,535,640.68	2.16
82	600383	金地集团	5,434,254.00	2.12
83	603738	泰晶科技	5,333,930.00	2.08
84	002624	完美世界	5,332,710.00	2.08

85	300633	开立医疗	5,263,498.00	2.06
86	603198	迎驾贡酒	5,248,101.00	2.05
87	603108	润达医疗	5,158,843.89	2.02

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	600199	金种子酒	23,168,535.00	9.05
2	000661	长春高新	18,164,252.20	7.10
3	688506	百利天恒	17,774,469.71	6.94
4	300896	爱美客	17,267,959.00	6.75
5	603486	科沃斯	16,103,221.00	6.29
6	600276	恒瑞医药	15,812,308.80	6.18
7	000568	泸州老窖	15,732,978.23	6.15
8	688382	益方生物	15,173,700.59	5.93
9	600600	青岛啤酒	13,834,899.48	5.41
10	601390	中国中铁	13,819,753.00	5.40
11	301239	普瑞眼科	13,254,236.99	5.18
12	000333	美的集团	12,899,700.00	5.04
13	000423	东阿阿胶	12,577,822.00	4.91
14	600702	舍得酒业	12,232,214.36	4.78
15	600690	海尔智家	12,138,227.25	4.74
16	600557	康缘药业	12,098,086.13	4.73
17	688639	华恒生物	11,792,174.98	4.61
18	300015	爱尔眼科	11,662,819.87	4.56
19	603259	药明康德	11,142,568.00	4.35
20	600132	重庆啤酒	11,026,902.50	4.31
21	300009	安科生物	10,914,881.00	4.26
22	002311	海大集团	10,779,208.00	4.21

23	603345	安井食品	10,762,766.00	4.21
24	688111	金山办公	10,640,606.92	4.16
25	600519	贵州茅台	10,586,872.00	4.14
26	688197	首药控股	10,529,663.72	4.11
27	001979	招商蛇口	10,465,097.00	4.09
28	301267	华夏眼科	10,446,606.74	4.08
29	002508	老板电器	10,440,190.00	4.08
30	002594	比亚迪	10,281,485.09	4.02
31	000858	五粮液	10,138,260.00	3.96
32	002558	巨人网络	9,777,423.14	3.82
33	000729	燕京啤酒	9,575,601.52	3.74
34	002422	科伦药业	9,544,086.43	3.73
35	600329	达仁堂	9,134,514.00	3.57
36	603444	吉比特	9,117,348.00	3.56
37	600383	金地集团	8,863,853.00	3.46
38	600129	太极集团	8,863,364.00	3.46
39	002555	三七互娱	8,785,920.00	3.43
40	H09966	康宁杰瑞 制药-B	8,746,383.10	3.42
41	603606	东方电缆	8,702,372.76	3.40
42	000063	中兴通讯	8,697,103.00	3.40
43	600845	宝信软件	8,669,752.40	3.39
44	603939	益丰药房	8,191,151.00	3.20
45	600048	保利发展	8,158,366.00	3.19
46	000999	华润三九	8,142,998.00	3.18
47	601088	中国神华	8,128,353.00	3.18
48	300171	东富龙	7,768,752.00	3.04
49	000963	华东医药	7,723,579.00	3.02
50	688426	康为世纪	7,722,198.24	3.02
51	600570	恒生电子	7,710,624.20	3.01
52	601225	陕西煤业	7,679,280.00	3.00



53	600422	昆药集团	7,641,195.00	2.99
54	601800	中国交建	7,583,752.74	2.96
55	001215	千味央厨	7,566,637.00	2.96
56	603896	寿仙谷	7,508,581.00	2.93
57	300750	宁德时代	7,208,887.00	2.82
58	300253	卫宁健康	7,185,046.00	2.81
59	002352	顺丰控股	7,179,980.00	2.81
60	688007	光峰科技	6,982,018.64	2.73
61	002230	科大讯飞	6,503,761.30	2.54
62	600941	中国移动	6,462,942.00	2.53
63	688133	泰坦科技	6,441,113.13	2.52
64	002603	以岭药业	6,419,202.22	2.51
65	688235	百济神州	6,224,669.78	2.43
66	300759	康龙化成	6,212,248.50	2.43
67	H03690	美团-W	6,182,142.46	2.42
68	600373	中文传媒	6,149,671.48	2.40
69	300866	安克创新	6,142,372.00	2.40
70	300383	光环新网	6,060,216.00	2.37
71	603108	润达医疗	5,783,766.00	2.26
72	600809	山西汾酒	5,778,097.00	2.26
73	601628	中国人寿	5,698,262.00	2.23
74	603000	人民网	5,572,067.00	2.18
75	601186	中国铁建	5,520,136.00	2.16
76	002866	传艺科技	5,443,611.00	2.13
77	600763	通策医疗	5,261,715.90	2.06
78	H00013	和黄医药	5,259,909.32	2.06
79	603027	千禾味业	5,230,038.48	2.04
80	002919	名臣健康	5,224,336.00	2.04
81	603738	泰晶科技	5,216,433.00	2.04
82	000938	紫光股份	5,140,194.12	2.01
83	002624	完美世界	5,124,177.00	2.00

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	1,320,643,037.38
卖出股票收入（成交）总额	1,224,337,657.16

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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

本组合的股指期货投资是对冲策略。当判断市场整体处于风险暴露的领域（如估值偏高、上涨幅度较大等情形下），但本基金对持仓个股仍较为看好时，会适当使用股指期货，以对冲市场整体的回撤风险。

### 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三七互娱网络科技集团股份有限公司因涉及信息披露违法违规被监管部门立案调查,公司公告各项经营活动正常有序开展。

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	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,267.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,267.18

### 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
永赢优质生活混合A	2,623	55,724.71	10,008,095.94	6.8471%	136,157,809.69	93.1529%
永赢优质生活混合C	1,805	42,220.45	200,055.00	0.2625%	76,007,860.80	99.7375%
合计	4,428	50,219.92	10,208,150.94	4.5905%	212,165,670.49	95.4095%

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	永赢优质生活混合A	1,091,387.66	0.75%
	永赢优质生活混合C	3,044.85	0.00%
	合计	1,094,432.51	0.49%

## 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	永赢优质生活混合 A	0
	永赢优质生活混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	永赢优质生活混合 A	50~100
	永赢优质生活混合 C	0
	合计	50~100

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢优质生活混合A	永赢优质生活混合C
基金合同生效日(2022年08月23 日)基金份额总额	186,686,370.15	145,913,264.98
本报告期期初基金份额总额	171,174,971.11	101,899,517.01
本报告期基金总申购份额	1,044,783.18	1,262,264.33
减：本报告期基金总赎回份额	26,053,848.66	26,953,865.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	146,165,905.63	76,207,915.80

## §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。

基金托管人于2023年5月17日发布公告，自2023年5月10日起丁文忠先生不再担任基金托管部门总经理；自2023年5月10日起聘任赵刚先生为基金托管部门总经理。

### 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	2,539,787,517.06	100.00%	1,851,728.23	100.00%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

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

#### 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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	成交金额	占当期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
财通证券	16,983,905.00	100.00%	130,344,000.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	永赢优质生活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
2	永赢优质生活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
3	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
4	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信息的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-08
5	永赢优质生活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
6	永赢基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为永赢基金旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-26
7	永赢优质生活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
8	永赢优质生活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
9	永赢优质生活混合型证券投资基金更新招募说明书(202	中国证监会规定媒介	2023-05-31

	3年第1号)		
--	--------	--	--

## §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优质生活混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《永赢优质生活混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《永赢优质生活混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《永赢优质生活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](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  
二〇二三年八月三十日