

永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2024 年 03 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§ 2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	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、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2	基金净值表现 .....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	10
§ 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遵规守信情况的说明 .....	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	17
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	17
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	18
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	19
4.9	管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....	19
4.10	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	19
§ 5	托管人报告 .....	19
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	19
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 .....	19
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	19
§ 6	审计报告 .....	19
6.1	审计报告基本信息 .....	19
6.2	审计报告的基本内容 .....	19
§ 7	年度财务报表 .....	21
7.1	资产负债表 .....	21
7.2	利润表 .....	23
7.3	净资产变动表 .....	24
7.4	报表附注 .....	25
§ 8	投资组合报告 .....	58
8.1	期末基金资产组合情况 .....	58
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	58
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	59
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	63

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	66
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	66
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	66
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	66
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	66
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	66
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12	投资组合报告附注 .....	67
§ 9	基金份额持有人信息 .....	68
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	68
§ 10	开放式基金份额变动 .....	68
§ 11	重大事件揭示 .....	69
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	69
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	69
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4	基金投资策略的改变 .....	69
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8	其他重大事件 .....	71
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	72
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
§ 13	备查文件目录 .....	73
13.1	备查文件目录 .....	73
13.2	存放地点 .....	73
13.3	查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	永赢消费主题	
基金主代码	006252	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 06 日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	425,391,113.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢消费主题 A	永赢消费主题 C
下属分级基金的交易代码	006252	006253
报告期末下属分级基金的份额总额	268,275,882.26 份	157,115,231.37 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于消费主题相关上市公司股票,在控制风险的前提下,力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>基于对消费行业发展形势和未来趋势的深刻理解,本基金对于消费行业的界定按照申万行业分类标准,划分为三类:即主要消费、可选消费和其他消费。主要消费指主要与居民的基本生活需求高度相关的商品或服务;可选消费指非居民生活必需的,主要用于改善居民生活质量的商品和服务,居民可以自行选择是否进行消费。此外其他消费指居民日常生活中直接或间接使用的其他商品或服务,这类商品或服务拉动一系列与消费相关的产业发展、升级,对于拉动消费形成直接或间接作用。</p> <p>根据前文定义,主要消费包括食品饮料、家用电器、农林牧渔、纺织服饰、医药生物、轻工制造、交通运输、公用事业、环保等;可选消费包括汽车、社会服务、商贸零售、金融、银行、电子、通信、传媒、房地产、建筑材料、建筑装饰、电力设备、机械设备、计算机、美容护理等;其他消费包括民用军工用品。</p> <p>本基金主要投资策略包括资产配置策略(本基金的股票投资组合比例将按照上述消费行业的预测平均市盈率(PE)与预测平均市盈增长比率(PEG)来判断。当预测的平均 PE 与 PEG 在较低阈值区间时,本基金将按照规定保持较高仓位的股票类资产配置比例,从而争取为基金能够用较低成本抓住机遇获取潜在收益;当预测的平均 PE 与 PEG 在较高阈值区间时,本基金将按照规定保持较低仓位的股票类资产配置比例,从而为基金控制风险。当预测的平均 PE 与 PEG 在剩余其他阈值区间时,本基金将保持适中的股票类资产比例。)、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略和资产支持证券投资策略、权证投资策略和股指期货投资策略。</p>

业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率*60%+中国债券总指数收益率*40%
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,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中风险和中等预期收益产品。

### 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	朱萍
	联系电话	021-20430340	021-31888888
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-805-8888	95528
传真		021-51690177	021-63602540
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	上海市中山东一路12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	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		马宇晖	张为忠

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和	2023年		2022年		2021年	
	永赢消费主	永赢消费主	永赢消费主	永赢消费主	永赢消费主	永赢消费主

指标	题 A	题 C	题 A	题 C	题 A	题 C
本期已实现收益	-222,267,0 70.24	-126,583,5 60.22	-456,343,69 6.40	-225,838,1 29.77	52,833,696. 16	42,330,531. 36
本期利润	-266,620,6 17.03	-153,632,2 80.56	-563,481,08 7.58	-270,092,7 16.03	14,852,956. 29	16,062,396. 83
加权平均基金份额本期利润	-0.8221	-0.8322	-1.1425	-1.1276	0.0206	0.0474
本期加权平均净值利润率	-36.03%	-36.91%	-38.27%	-38.28%	0.56%	1.30%
本期基金份额净值增长率	-32.59%	-32.72%	-27.75%	-27.89%	10.28%	10.06%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	永赢消费主题 A	永赢消费主题 C	永赢消费主题 A	永赢消费主题 C	永赢消费主题 A	永赢消费主题 C
期末可供分配利润	-56,956,42 3.67	-35,833,34 0.95	197,042,843 .46	103,735,86 1.42	1,078,686,2 20.45	491,617,260 .05
期末可供分配基金份额利润	-0.2123	-0.2281	0.5102	0.4912	1.4831	1.4614
期末基金资产净值	471,218,31 5.44	272,809,06 2.36	1,006,224,8 61.64	545,082,39 6.55	2,623,077,0 33.25	1,204,068,3 72.41
期末基金份额净值	1.7565	1.7364	2.6056	2.5809	3.6064	3.5793
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	永赢消费主题 A	永赢消费主题 C	永赢消费主题 A	永赢消费主题 C	永赢消费主题 A	永赢消费主题 C
基金份额累计净值增长率	75.65%	73.64%	160.56%	158.09%	260.64%	257.93%

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

## 永赢消费主题 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
过去三个月	-10.63%	0.87%	-3.29%	0.59%	-7.34%	0.28%
过去六个月	-22.19%	1.07%	-4.01%	0.61%	-18.18%	0.46%
过去一年	-32.59%	1.10%	-6.98%	0.62%	-25.61%	0.48%
过去三年	-46.29%	1.42%	-19.16%	0.88%	-27.13%	0.54%
过去五年	81.57%	1.47%	48.93%	0.89%	32.64%	0.58%
自基金合同生 效起至今	75.65%	1.45%	47.89%	0.89%	27.76%	0.56%

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

2、本基金业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率\*60%+中国债券总指数收益率\*40%。

## 永赢消费主题 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
过去三个月	-10.68%	0.87%	-3.29%	0.59%	-7.39%	0.28%
过去六个月	-22.26%	1.07%	-4.01%	0.61%	-18.25%	0.46%
过去一年	-32.72%	1.10%	-6.98%	0.62%	-25.74%	0.48%
过去三年	-46.61%	1.42%	-19.16%	0.88%	-27.45%	0.54%
过去五年	79.53%	1.47%	48.93%	0.89%	30.60%	0.58%
自基金合同生 效起至今	73.64%	1.45%	47.89%	0.89%	25.75%	0.56%

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

2、本基金业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率\*60%+中国债券总指数收益率\*40%。

### 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



永赢消费主题A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年11月06日-2023年12月31日)



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。

永赢消费主题C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

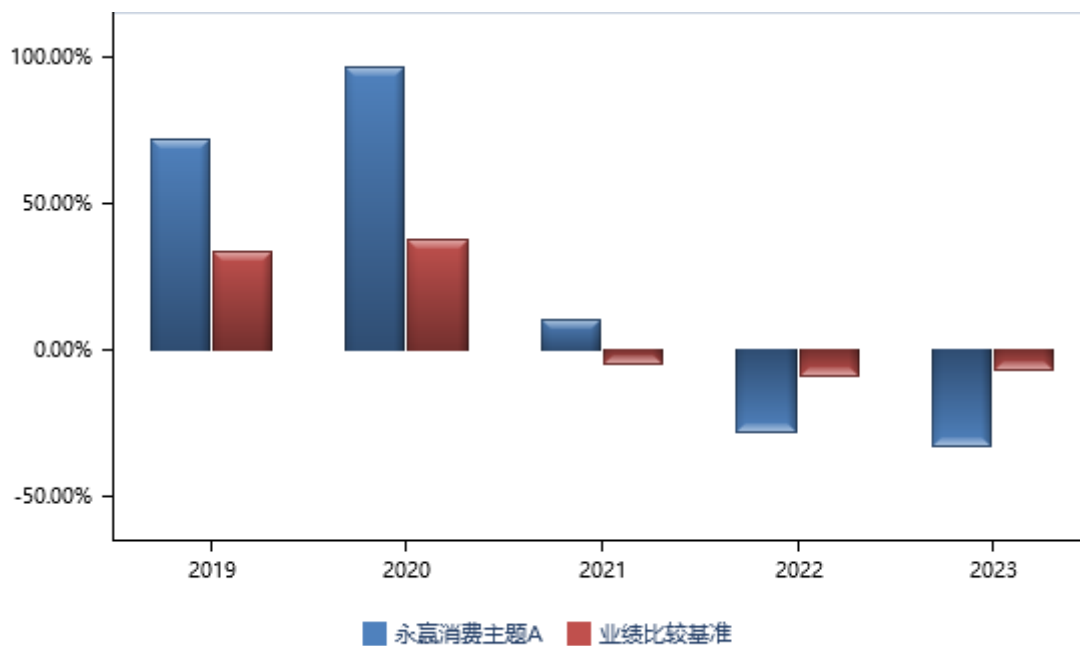
(2018年11月06日-2023年12月31日)



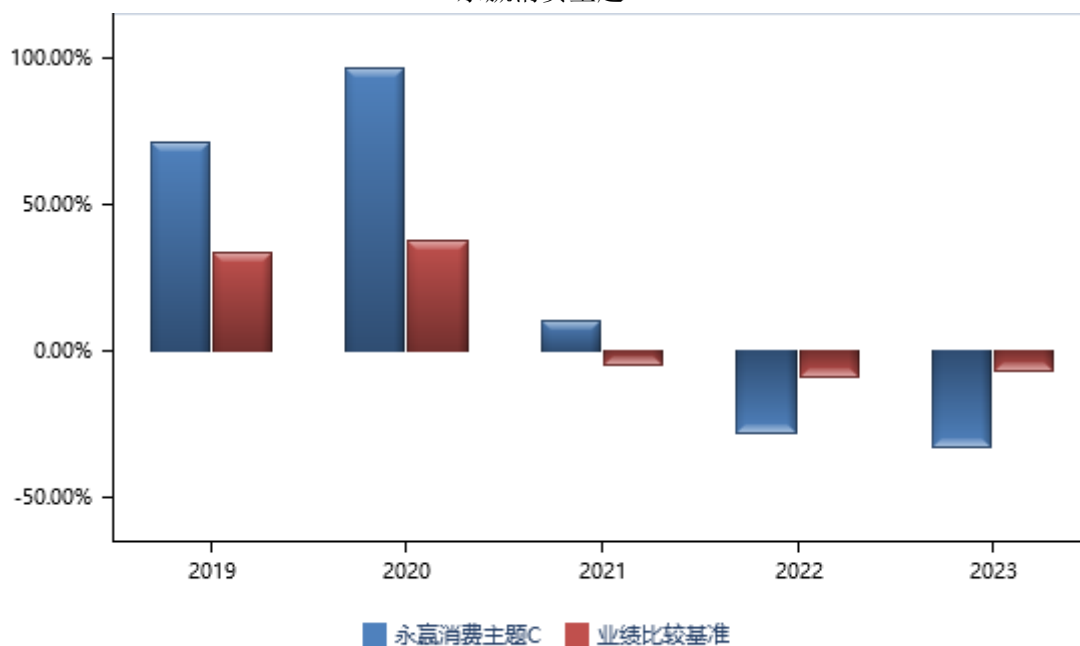
注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

永赢消费主题 A



永赢消费主题 C



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年均未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 121 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、永赢通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、永赢中债-1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢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、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、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、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基金、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（FOF）、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、永赢匠心增利债券型证券投资基金、永赢启源混合型发起式证券投资基金、永赢中证沪深港黄金产业

股票交易型开放式指数证券投资基金、永赢睿信混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
常远	基金经理	2019年12月12日	-	12年	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。

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、《永赢消费主题灵活配置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 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

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

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建

议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上证指数下跌 3.7%，深证综指下跌 6.97%，创业板指下跌 19.41%，中证消费指数也下跌 19.22%。权益市场总体回调较为明显，尤其是消费板块，在 2022 年的基础上又下跌较多。永赢消费主题基金净值也出现了较大回撤，其中所持有的白酒、家居、食品、医药等行业全年都出现了较为显著的下跌。

2023 年 1 季度是疫情管控放开后的第一个季度，各项生产和消费指标数据相对比较强劲，市场当时也出现了比较乐观的倾向。从实际周期位置看，当时还处于去库存周期的下行中段，尚未见底。当 2023 年 2 季度各项经济指标数据，尤其是消费数据再次出现明显回落后，我们判断库存变化所反映的经济周期已经见底了，但是后面的市场走势与我们的判断存在差异。

首先，不同于以往我们所经历的库存周期，从 2021 年四季度开始的库存下行周期同步叠加了宏观债务周期拐点，使得经济下行深度和持续时间都超出了过去十几年来 A 股市场的经验预期。改革开放以来的 40 多年，尤其是中国“入世”之后的 20 年，中国各地方政府 GDP 竞赛式的发展模式都不自觉地走到了或多或少依靠土地财政和债务增加来刺激经济增长的道路上，这条路走了几十年之后所积累的资产泡沫和债务风险越来越高，所能带来的资本回报也在边际递减。实际从 2021 年房地产销售面积和地方政府债务余额都创历史新高之后，在短期库存周期和长期债务周期两个维度上，

我们都到了一个顶点，事后看也可能是拐点。

从 2023 年国家地产政策到财政货币政策的导向看，明确地在努力摆脱以往经济发展的旧模式，而在加速经济的转型升级。过去依靠地方政府不断增加债务杠杆和房地产投资相辅相成的经济发展方式在近几年不断地被纠正。只不过原有模式的惯性太大，可替代的新的经济增长要素尚不成熟，因此转型的阵痛也显著地传导到了资本市场。这是一个中国资本市场过去二十年都未曾经历的宏观背景。

其次，这次的经济下行发生在全球科技红利消退和地缘政治紧张加剧的大背景下，使得经济、金融层面的动荡更为显著。移动互联网产业红利、网络流量红利和新能源产业红利相继越过发展增速的顶点之后，下一个可能的科技大浪潮尚未来临，这不仅在中国，也在全球范围内造成了经济增长放缓和利益分配矛盾加剧的问题。历史上往往这些时候可能伴随地缘政治上的不稳定，外部局势的巨大变化也增加了国内资本市场的不确定性。在上述多重因素的作用下，国内 A 股市场一部分资金去寻找类债券资产实施避险，另一部分资金则选择在热门主题、小市值标的之间反复切换赚“快钱”；反而对于企业长期成长的预期变得极为悲观，给予白马龙头公司的业绩成长折价颇为显著，造成这些公司股价面临业绩和估值的“双杀”。

如此极端的分化，也造成了我们原来的投资策略面临了巨大挑战，价值投资法则在成长股投资上的前提条件被颠覆了。过去一年，本基金也曾尝试了多种对抗周期冲击的方式，但当市场在面对大周期拐点和内外部不确定性下，对于远期信心的缺失导致了理性的价值测算无法为股价托底，更缺乏向上的动力。

虽然经历了投资上的严峻考验，也承受了投资业绩上的巨大压力。但是我们并没有简单地随波逐流，也没有轻易改变自己的投资体系；而是认真反思，寻找问题根源，积极探索能够在更高维度上协调自身投资理念和市场变化的新方法。

首先，我们客观地分析出，经济发展的新旧动能转换必然会伴随一段时间的阵痛，比如结构性失业、金融市场的波动、资产价格（包括房价）的下滑等。正因为如此，在 2023 年末的中央经济工作会议中才会提到“先立后破”，也是为了尽量缓解经济转型过程中给民生和社会带来的影响。所以我们有理由相信，中央财政可能将会在新的一年里更加积极有为。但是地方债务发行、地产价格上涨将会持续受到较为严格的控制。政府或将引导更多的社会资源，包括人力、资本等投入到可以形成国家核心竞争力和支撑国家长期稳进发展的“硬科技”产业当中。中国的新能源汽车和光伏、风电等行业已经在过去 10 年成功发展壮大起来，并走向全球。我们期待和酝酿着新的产业机会，一旦新的产业机会出现，并形成具有一定规模的产业链，将会带动中国经济进一步走向升级之路，也会使得居民收入和财富再次稳定上升。



其次，我们认识到，要实现中国经济的转型升级，实现摆脱土地财政和地方举债式发展的模式，是需要较长一段时间，并不是一蹴而就的。这就要求我们在权益市场投资上，更应该冷静思考，认真总结和分析周期因素、政策因素、外部影响的作用途径和量级，结合所投资行业的发展阶段，公司的质地、估值水平等谨慎布局。在原有成长股的投资框架内，我们提高了股价安全边际的权重；加深对于优质资产和高成长性个股商业模式、核心能力与成长风险的理解，耐心等待投资时机。这些微观层面的调整背后有着清晰的逻辑判断作为支撑，能够在中长期进一步完善我们的投资框架。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢消费主题 A 基金份额净值为 1.7565 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-32.59%，同期业绩比较基准收益率为-6.98%；截至报告期末永赢消费主题 C 基金份额净值为 1.7364 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-32.72%，同期业绩比较基准收益率为-6.98%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从权益市场环境来看，2024 年外部世界依然动荡。美国通胀虽有缓解，但是距离下一次的美联储降息可能尚需时日；逆全球化和产业链“去中国化”的影响将持续存在。这些都是国内权益市场的不确定性因素，但是核心因素还是看国内的变化，地方债务控制水平、地产销售和开工何时能够达到新的平衡状态、宏观调节政策的力度与方向等。2024 年我们在保持对市场谨慎的前提下，更加乐观了一些。毕竟国内库存周期底部已经基本确认，海外通胀压力又进一步缓解，重要的地方债务和房地产问题大概率也会迎来逐步解决方案和措施。除此之外，中国制造业能力还在持续增强，并且走向全球；以 AI 为代表的新的科技方向更为成熟；中国以半导体高端制造为核心的技术突破还将继续。虽然短期没见到质的变化，但是过去 3 年困扰资本市场的种种因素都有所缓解，而股票估值也基本接近历史低位，投资价值凸现。

有鉴于此，本产品将继续秉持在大消费中寻找高性价比标的的投资机会。目前看来，白酒、啤酒、食品等行业的估值所反映的前景已经较为悲观，已经具备较好的性价比；家电、家居、消费建材的估值相对安全，上行动力更多来自对宏观经济/地产政策的敏感度；医药创新药持续受到国内外资金层面的压力，尚需等待货币层面的实质宽松；其他医药的估值水平多数处于历史低位，在医疗降本和反腐的大背景下，可能发现一些超跌的细分投资机会；汽车工业竞争加剧，但是智能化和中国企业国际化的发展更为扎实。此外还有很多自下而上可以发掘的投资机会。新的一年，也是新周期的起点，我们时刻准备再出发。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障合规运作和投资者合法权益为出发点，坚持

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

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

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

2、新规解读及监管要求的落实。2023 年，公司持续密切关注各项最新法律法规、监管政策，及时开展新规新政的传达和解读、并拟定落实方案，由各相关部门进行具体落实，同时定期对落实情况跟踪检查。

3、强化合规培训。为进一步提升员工合规意识，强化员工执业行为的合规性，合规部组织多次面向不同对象，针对不同主题的合规培训，包括针对新员工的合规培训，面向全员的合规宣导以及邀请外部律师开展专项培训等，并通过多样化的方式提高员工在合规培训中的参与度以及积极性。

4、深入开展内部审计工作。公司建立了全面的内部审计体系和流程，并设置审计部作为公司风险防控机制中的一道重要防线独立履行内部审计检查职责。2023 年，公司有序开展各类专项审计、离任审查、年度/季度监察稽核项目、即时通讯工具例行检查、风险事件调查等内审工作，并聘请外部机构独立开展信息技术专项审计、年度内控评价等项目。针对上述审计检查发现的问题，审计部牵头推进整改，促进制度体系及业务流程不断完善，为公司防范风险、完善内控管理提供有力支持。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，未发生会计师事务所出具非标准审计报告的情形。

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

本报告期内本基金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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由永赢基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70077306_B37 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是

	<p>重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	石静筠   沈熙苑
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
审计报告日期	2024年03月25日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金  
报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	65,631,022.15	91,868,418.28
结算备付金		2,914,307.05	11,938,798.39

存出保证金		601,268.11	1,256,404.01
交易性金融资产	7.4.7.2	691,435,911.31	1,453,794,204.24
其中：股票投资		691,435,911.31	1,453,794,204.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	21,119,419.42
应收股利		-	-
应收申购款		336,412.34	1,404,025.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		760,918,920.96	1,581,381,270.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		13,404,300.86	-
应付赎回款		552,621.14	22,927,763.83
应付管理人报酬		768,566.21	2,017,990.48
应付托管费		128,094.39	336,331.76
应付销售服务费		46,725.83	97,374.99
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	7.4.7.6	1,991,234.73	4,694,550.92
负债合计		16,891,543.16	30,074,011.98
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	425,391,113.63	597,385,559.86
未分配利润	7.4.7.8	318,636,264.17	953,921,698.33
净资产合计		744,027,377.80	1,551,307,258.19
负债和净资产总计		760,918,920.96	1,581,381,270.17

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7490 元，基金份额总额 425,391,113.63 份。

其中永赢消费主题 A 类基金份额净值 1.7565 元，份额总额 268,275,882.26 份；永赢消费主题 C 类基金份额净值 1.7364 元，份额总额 157,115,231.37 份。

## 7.2 利润表

会计主体：永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-400,131,554.75	-793,444,210.99
1. 利息收入		378,803.19	687,240.97
其中：存款利息收入	7.4.7.9	378,803.19	687,240.97
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-329,354,811.85	-643,828,481.68
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-341,518,707.23	-662,754,650.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	12,163,895.38	18,926,168.96
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-71,402,267.13	-151,391,977.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	246,721.04	1,089,007.16
<b>减：二、营业总支出</b>		20,121,342.84	40,129,592.62
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,349,340.47	32,971,177.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,724,890.22	5,495,196.14
3. 销售服务费		839,664.97	1,418,638.26
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	207,447.18	244,580.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-420,252,897.59	-833,573,803.61
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-420,252,897.59	-833,573,803.61
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-420,252,897.59	-833,573,803.61

### 7.3 净资产变动表

会计主体：永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	597,385,559.86	953,921,698.33	1,551,307,258.19
二、本期期初净资产	597,385,559.86	953,921,698.33	1,551,307,258.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-171,994,446.23	-635,285,434.16	-807,279,880.39
（一）、综合收益总额	-	-420,252,897.59	-420,252,897.59
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-171,994,446.23	-215,032,536.57	-387,026,982.80
其中：1. 基金申购款	125,131,089.33	179,229,951.09	304,361,040.42
2. 基金赎回款	-297,125,535.56	-394,262,487.66	-691,388,023.22
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	425,391,113.63	318,636,264.17	744,027,377.80
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,063,737,533.22	2,763,407,872.44	3,827,145,405.66
二、本期期初净资产	1,063,737,533.22	2,763,407,872.44	3,827,145,405.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-466,351,973.36	-1,809,486,174.11	-2,275,838,147.47
（一）、综合收益总额	-	-833,573,803.61	-833,573,803.61
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-466,351,973.36	-975,912,370.50	-1,442,264,343.86
其中：1. 基金申购款	340,216,575.01	673,668,586.10	1,013,885,161.11
2. 基金赎回款	-806,568,548.37	-1,649,580,956.60	-2,456,149,504.97
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	597,385,559.86	953,921,698.33	1,551,307,258.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

芦特尔

汪成杰

虞俏依



基金管理人负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

永赢消费主题灵活配置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[2018]1121号文《关于准予永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由永赢基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于2018年11月6日正式生效，首次设立募集规模为271,545,781.66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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、权证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比例为0%-95%，其中投资于消费主题相关的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，以备支付基金份额持有人的赎回款项。

本基金业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率\*60%+中国债券总指数收益率\*40%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

##### (2) 金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产

生的利得或损失，均计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

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

融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的每类基金份额净值减去相应份额类别每单位基金份额收益分配金额后均不能低于面值；

(4) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

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

##### 7.4.6.2 增值税

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

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

的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 7.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的



通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	65,631,022.15	91,868,418.28
等于：本金	65,621,533.36	91,857,116.05
加：应计利息	9,488.79	11,302.23
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	65,631,022.15	91,868,418.28

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		720,709,598.60	-	691,435,911.31	-29,273,687.29
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		720,709,598.60	-	691,435,911.31	-29,273,687.29
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,411,665,624.40	-	1,453,794,204.24	42,128,579.84
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		1,411,665,624.40	-	1,453,794,204.24	42,128,579.84

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	18.99	42.88
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,799,215.74	4,472,508.04
其中：交易所市场	1,799,215.74	4,472,508.04
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	192,000.00	222,000.00
合计	1,991,234.73	4,694,550.92

## 7.4.7.7 实收基金

永赢消费主题 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	386,183,624.62	386,183,624.62
本期申购	35,443,962.38	35,443,962.38
本期赎回（以“-”号填列）	-153,351,704.74	-153,351,704.74
本期末	268,275,882.26	268,275,882.26

永赢消费主题 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	211,201,935.24	211,201,935.24
本期申购	89,687,126.95	89,687,126.95
本期赎回（以“-”号填列）	-143,773,830.82	-143,773,830.82
本期末	157,115,231.37	157,115,231.37

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.8 未分配利润

永赢消费主题 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	197,042,843.46	422,998,393.56	620,041,237.02
本期期初	197,042,843.46	422,998,393.56	620,041,237.02
本期利润	-222,267,070.24	-44,353,546.79	-266,620,617.03

本期基金份额交易产生的变动数	-31,732,196.89	-118,745,989.92	-150,478,186.81
其中：基金申购款	11,377,708.65	37,315,318.46	48,693,027.11
基金赎回款	-43,109,905.54	-156,061,308.38	-199,171,213.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-56,956,423.67	259,898,856.85	202,942,433.18

永赢消费主题 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	103,735,861.42	230,144,599.89	333,880,461.31
本期期初	103,735,861.42	230,144,599.89	333,880,461.31
本期利润	-126,583,560.22	-27,048,720.34	-153,632,280.56
本期基金份额交易产生的变动数	-12,985,642.15	-51,568,707.61	-64,554,349.76
其中：基金申购款	32,694,850.81	97,842,073.17	130,536,923.98
基金赎回款	-45,680,492.96	-149,410,780.78	-195,091,273.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-35,833,340.95	151,527,171.94	115,693,830.99

## 7.4.7.9 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12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
活期存款利息收入	288,923.29	574,469.98
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	75,095.14	89,024.45
其他	14,784.76	23,746.54
合计	378,803.19	687,240.97

## 7.4.7.10 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12月31 日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	6,694,117,208.10	9,433,274,460.96
减：卖出股票成本总额	7,019,403,173.44	10,072,435,183.06
减：交易费用	16,232,741.89	23,593,928.54
买卖股票差价收入	-341,518,707.23	-662,754,650.64

## 7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

## 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
股票投资产生的股利收益	12,163,895.38	18,926,168.96
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	12,163,895.38	18,926,168.96

#### 7.4.7.16 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12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1. 交易性金融资产	-71,402,267.13	-151,391,977.44
--股票投资	-71,402,267.13	-151,391,977.44
--债券投资	-	-
--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	-71,402,267.13	-151,391,977.44

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31 日
基金赎回费收入	244,322.82	1,083,841.19

基金转换费收入	2,398.22	5,165.97
合计	246,721.04	1,089,007.16

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
审计费用	60,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	9,447.18	16,580.97
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	207,447.18	244,580.97

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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
Oversea-Chinese Banking Corporation Limited（“Oversea-Chinese Banking”）	基金管理人的股东
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司
永赢国际资产管理有限公司（“永赢国际”）	基金管理人的子公司

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,349,340.47	32,971,177.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,304,888.49	9,529,607.86
应支付基金管理人的净管理费	10,044,451.98	23,441,569.39

注：2023年7月24日前，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。自2023年7月24日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

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 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,724,890.22	5,495,196.14

注：2023 年 07 月 24 日前，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。自 2023 年 07 月 24 日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢消费主题 A	永赢消费主题 C	合计
宁波银行	0.00	30,730.46	30,730.46
浦发银行	0.00	5,280.84	5,280.84
永赢基金	0.00	28,282.32	28,282.32
合计	0.00	64,293.62	64,293.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢消费主题 A	永赢消费主题 C	合计
宁波银行	0.00	40,330.77	40,330.77
浦发银行	0.00	7,955.02	7,955.02
永赢基金	0.00	272,122.98	272,122.98
合计	0.00	320,408.77	320,408.77

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：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。



### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

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

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

永赢消费主题 A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
报告期初持有的基金份额	0.00	20,029,020.95
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	20,029,020.95
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%

永赢消费主题 C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31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。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	65,631,022.15	288,923.29	91,868,418.28	574,469.98

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末 2023 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
688563	航材股份	2023年07月12日	6个月	新股限售	78.99	60.49	764	60,348.36	46,214.36	-
688548	广钢气体	2023年08月08日	6个月	新股限售	9.87	12.75	3,522	34,762.14	44,905.50	-

301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股限售	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301487	盟固利	2023年08月01日	6个月	新股限售	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
603296	华勤技术	2023年08月01日	6个月	新股限售	80.80	77.75	451	36,440.80	35,065.25	-
688549	中巨芯	2023年08月30日	6个月	新股限售	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
301291	明阳电气	2023年06月21日	6个月	新股限售	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
301348	蓝箭电子	2023年08月01日	6个月	新股限售	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
688702	盛科通信	2023年09月06日	6个月	新股限售	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	新股限售	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
301486	致尚科技	2023年06月30日	6个月	新股限售	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301511	德福科技	2023年08月08日	6个月	新股限售	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股限售	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
301498	乖宝宠物	2023年08月09日	6个月	新股限售	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301370	国科恒泰	2023年07月03日	6个月	新股限售	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301421	波长光电	2023年08月16日	6个月	新股限售	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301558	三态	2023年	6个月	新股限售	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-

	股份	09月21日		售						
688627	精智达	2023年07月11日	6个月	新股限售	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
301371	敷尔佳	2023年07月24日	6个月	新股限售	55.68	37.58	515	28,675.20	19,353.70	-
688591	泰凌微	2023年08月18日	6个月	新股限售	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
301559	中集环科	2023年09月26日	6个月	新股限售	24.22	18.24	996	24,123.12	18,167.04	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股限售	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301468	博盈特焊	2023年07月12日	6个月	新股限售	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301509	金凯生科	2023年07月26日	6个月	新股限售	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301362	民爆光电	2023年07月27日	6个月	新股限售	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
688612	威迈斯	2023年07月19日	6个月	新股限售	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股限售	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
301393	昊帆生物	2023年07月05日	6个月	新股限售	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
688610	埃科光电	2023年07月10日	6个月	新股限售	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股限售	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
301510	固高科技	2023年08月04日	6个月	新股限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-

		日								
301507	民生健康	2023年08月24日	6个月	新股限售	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301210	金杨股份	2023年06月21日	6个月	新股限售	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股限售	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古智能	2023年07月06日	6个月	新股限售	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688602	康鹏科技	2023年07月13日	6个月	新股限售	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688719	爱科赛博	2023年09月20日	6个月	新股限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
301550	斯菱股份	2023年09月06日	6个月	新股限售	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股限售	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301251	威尔高	2023年08月30日	6个月	新股限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
688592	司南导航	2023年08月07日	6个月	新股限售	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
301499	维科精密	2023年07月13日	6个月	新股限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	新股限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-

301528	多浦乐	2023年 08月17 日	6个月	新股限 售	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301329	信音电子	2023年 07月05 日	6个月	新股限 售	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301372	科净源	2023年 08月03 日	6个月	新股限 售	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301261	恒工精密	2023年 06月29 日	6个月	新股限 售	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301202	朗威股份	2023年 06月28 日	6个月	新股限 售	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301395	仁信新材	2023年 06月21 日	6个月	新股限 售	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
688716	中研股份	2023年 09月13 日	6个月	新股限 售	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301413	安培龙	2023年 12月11 日	6个月	新股限 售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301500	飞南资源	2023年 09月13 日	6个月	新股限 售	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301418	协昌科技	2023年 08月10 日	6个月	新股限 售	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301516	中远通	2023年 12月01 日	6个月	新股限 售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301272	英华特	2023年 07月06 日	6个月	新股限 售	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301469	恒达新材	2023年 08月10 日	6个月	新股限 售	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301519	舜禹股份	2023年 07月19 日	6个月	新股限 售	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301518	长华	2023年	6个月	新股限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-

	化学	07月26日		售						
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股限售	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦医药	2023年09月18日	6个月	新股限售	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
688638	誉辰智能	2023年07月04日	6个月	新股限售	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
301459	丰茂股份	2023年12月06日	6个月	新股限售	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
688573	信宇人	2023年08月09日	6个月	新股限售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股限售	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
688651	盛邦安全	2023年07月19日	6个月	新股限售	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
301517	陕西华达	2023年10月09日	6个月	新股限售	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股限售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德科技	2023年09月11日	6个月	新股限售	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
688657	浩辰软件	2023年09月25日	6个月	新股限售	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688646	逸飞激光	2023年07月21日	6个月	新股限售	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688671	碧兴物联	2023年08月02日	6个月	新股限售	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-

		日								
688693	锆威特	2023年 08月10 日	6个月	新股限 售	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
603275	众辰科技	2023年 08月16 日	6个月	新股限 售	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
301533	威马农机	2023年 08月07 日	6个月	新股限 售	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
603062	麦加芯彩	2023年 10月31 日	6个月	新股限 售	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
301555	惠柏新材	2023年 10月24 日	6个月	新股限 售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301505	苏州规划	2023年 07月12 日	6个月	新股限 售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301529	福赛科技	2023年 08月31 日	6个月	新股限 售	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301515	港通医疗	2023年 07月13 日	6个月	新股限 售	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
688648	中邮科技	2023年 11月06 日	6个月	新股限 售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
001378	德冠新材	2023年 10月23 日	6个月	新股限 售	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
688450	光格科技	2023年 07月17 日	6个月	新股限 售	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
603004	鼎龙科技	2023年 12月20 日	6个月	新股限 售	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603270	金帝股份	2023年 08月25 日	6个月	新股限 售	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603119	浙江荣泰	2023年 07月21 日	6个月	新股限 售	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-



603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股限售	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603193	润本股份	2023年10月09日	6个月	新股限售	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
001306	夏厦精密	2023年11月09日	6个月	新股限售	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月01日	6个月	新股限售	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
603075	热威股份	2023年09月01日	6个月	新股限售	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股限售	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023年12月04日	6个月	新股限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603231	索宝蛋白	2023年12月06日	6个月	新股限售	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股限售	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年09月18日	6个月	新股限售	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股限售	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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							
货币资金	65,631,022.15	-	-	-	-	-	65,631,022.15
结算备付金	2,914,307.05	-	-	-	-	-	2,914,307.05
存出保证金	601,268.11	-	-	-	-	-	601,268.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	691,435,911.31	691,435,911.31
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						336,412.34	336,412.34
递延所得税资产							
其他资产							
资产总计	69,146,597.31					691,772,323.65	760,918,920.96
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						13,404,300.86	13,404,300.86
应付赎回款						552,621.14	552,621.14
应付管理人报酬						768,566.21	768,566.21
应付托管费						128,094.39	128,094.39
应付销售服务费						46,725.83	46,725.83
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						1,991,234.73	1,991,234.73
负债总计						16,891,543.16	16,891,543.16
利率敏感度缺口	69,146,597.31					674,880,780.49	744,027,377.80
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							
货币资金	91,868,418.28						91,868,418.28
结算备付金	11,938,798.39						11,938,798.39
存出保证金	1,256,404.01						1,256,404.01
交易性金融资产						1,453,794,204.24	1,453,794,204.24
衍生金融资产							
买入返售金融资产							
应收清算款						21,119,419.42	21,119,419.42
应收股利							

应收申购款	-	-	-	-	1,404,025.83	1,404,025.83
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	105,063,620.68	-	-	-	1,476,317,649.49	1,581,381,270.17
负债	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	22,927,763.83	22,927,763.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,017,990.48	2,017,990.48
应付托管费	-	-	-	-	336,331.76	336,331.76
应付销售服务费	-	-	-	-	97,374.99	97,374.99
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	4,694,550.92	4,694,550.92
负债总计	-	-	-	-	30,074,011.98	30,074,011.98
利率敏感度缺口	105,063,620.68	-	-	-	1,446,243,637.51	1,551,307,258.19

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债券，无重大利率风险。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	691,435,911.31	92.93	1,453,794,204.24	93.71
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	691,435,911.31	92.93	1,453,794,204.24	93.71

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险 2. 以下分析,除业绩比较基准发生变动,其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末(2023 年 12 月 31 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准增加 1%	9,689,586.85	21,660,179.22
	业绩比较基准减少 1%	-9,689,586.85	-21,660,179.22

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

## 7.4.14 公允价值

## 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

## 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
第一层次	690,142,248.08	1,452,228,307.53
第二层次	72,040.20	-
第三层次	1,221,623.03	1,565,896.71
合计	691,435,911.31	1,453,794,204.24

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,565,896.71	1,565,896.71
当期购买	-	2,651,518.08	2,651,518.08
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,269,858.26	3,269,858.26
当期利得或损失总额	-	274,066.50	274,066.50
其中：计入损益的利得或损失	-	274,066.50	274,066.50
期末余额	-	1,221,623.03	1,221,623.03
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	147,192.96	147,192.96
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	5,544,728.46	5,544,728.46
当期购买	-	1,436,471.81	1,436,471.81



当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	4,443,275.58	4,443,275.58
当期利得或损失总额	-	-972,027.98	-972,027.98
其中：计入损益的利得或损失	-	-972,027.98	-972,027.98
期末余额	-	1,565,896.71	1,565,896.71
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	129,424.90	129,424.90

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,221,623.03	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1462-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,565,896.71	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2063-2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 03 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	691,435,911.31	90.87
	其中：股票	691,435,911.31	90.87
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	68,545,329.20	9.01
8	其他各项资产	937,680.45	0.12
9	合计	760,918,920.96	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	634,008,173.49	85.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,125,931.68	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	155,955.24	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,236,178.46	3.12
J	金融业	10,360,182.00	1.39
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	36,981.40	0.00
M	科学研究和技术服务业	22,493,506.93	3.02
N	水利、环境和公共设施管理业	19,002.11	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	691,435,911.31	92.93

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	363,704	65,255,771.68	8.77
2	600809	山西汾酒	282,400	65,158,152.00	8.76
3	600519	贵州茅台	32,000	55,232,000.00	7.42
4	300308	中际旭创	332,800	37,576,448.00	5.05
5	300394	天孚通信	337,700	30,906,304.00	4.15
6	000858	五粮液	205,500	28,833,705.00	3.88
7	300122	智飞生物	462,500	28,263,375.00	3.80
8	000596	古井贡酒	114,800	26,725,440.00	3.59
9	002475	立讯精密	755,600	26,030,420.00	3.50
10	603259	药明康德	307,000	22,337,320.00	3.00
11	002653	海思科	882,700	20,434,505.00	2.75
12	002179	中航光电	474,110	18,490,290.00	2.49
13	688428	诺诚健华	1,380,133	15,871,529.50	2.13
14	600529	山东药玻	563,100	14,415,360.00	1.94
15	002555	三七互娱	760,000	14,295,600.00	1.92
16	601689	拓普集团	191,300	14,060,550.00	1.89
17	688331	荣昌生物	224,703	13,945,068.18	1.87
18	688012	中微公司	80,382	12,346,675.20	1.66
19	603296	华勤技术	148,751	11,882,752.25	1.60
20	688382	益方生物	784,647	11,879,555.58	1.60
21	002050	三花智控	395,100	11,615,940.00	1.56
22	300395	菲利华	301,600	11,026,496.00	1.48

23	600887	伊利股份	408,900	10,938,075.00	1.47
24	688271	联影医疗	76,242	10,445,916.42	1.40
25	600030	中信证券	508,600	10,360,182.00	1.39
26	000700	模塑科技	1,378,700	9,650,900.00	1.30
27	603587	地素时尚	629,500	8,252,745.00	1.11
28	603596	伯特利	116,500	8,073,450.00	1.09
29	002241	歌尔股份	382,000	8,025,820.00	1.08
30	300633	开立医疗	122,900	5,813,170.00	0.78
31	688076	诺泰生物	127,658	5,738,227.10	0.77
32	000333	美的集团	101,100	5,523,093.00	0.74
33	600150	中国船舶	173,000	5,093,120.00	0.68
34	688369	致远互联	145,491	5,035,443.51	0.68
35	603345	安井食品	43,100	4,508,691.00	0.61
36	600197	伊力特	203,500	4,426,125.00	0.59
37	688166	博瑞医药	113,573	3,975,055.00	0.53
38	002517	恺英网络	345,800	3,862,586.00	0.52
39	300969	恒帅股份	42,000	3,774,540.00	0.51
40	600872	中炬高新	132,700	3,728,870.00	0.50
41	603919	金徽酒	123,400	3,038,108.00	0.41
42	688525	佰维存储	47,200	2,957,552.00	0.40
43	603730	岱美股份	198,100	2,870,469.00	0.39
44	603197	保隆科技	39,800	2,244,720.00	0.30
45	600702	舍得酒业	20,000	1,934,000.00	0.26
46	301376	致欧科技	45,424	1,086,542.08	0.15
47	301526	国际复材	97,225	527,153.41	0.07
48	688652	京仪装备	4,157	247,131.25	0.03
49	601096	宏盛华源	39,171	213,323.88	0.03
50	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.02
51	601083	锦江航运	12,630	155,955.24	0.02
52	301508	中机认检	4,186	140,801.39	0.02
53	688653	康希通信	6,478	127,078.12	0.02
54	301516	中远通	6,033	124,517.13	0.02
55	301413	安培龙	1,633	118,542.96	0.02
56	301568	思泰克	2,456	109,572.88	0.01
57	688720	艾森股份	1,644	97,348.14	0.01
58	301459	丰茂股份	2,077	95,083.08	0.01
59	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.01
60	603004	鼎龙科技	1,948	69,190.05	0.01
61	688563	航材股份	764	46,214.36	0.01
62	688548	广钢气体	3,522	44,905.50	0.01
63	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.01

64	001358	兴欣新材	867	41,281.92	0.01
65	603231	索宝蛋白	1,610	37,546.81	0.01
66	603373	安邦护卫	876	36,981.40	0.00
67	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
68	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
69	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
70	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
71	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
72	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
73	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
74	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
75	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
76	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
77	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
78	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
79	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
80	301371	敷尔佳	515	19,353.70	0.00
81	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
82	301559	中集环科	996	18,167.04	0.00
83	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
84	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
85	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
86	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
87	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
88	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
89	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
90	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
91	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
92	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
93	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
94	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
95	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
96	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
97	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
98	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
99	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
100	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
101	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
102	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
103	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
104	301372	科净源	231	10,069.29	0.00

105	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
106	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
107	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
108	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
109	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
110	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
111	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
112	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
113	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
114	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
115	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
116	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
117	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
118	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
119	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
120	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
121	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
122	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
123	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
124	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
125	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
126	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
127	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
128	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
129	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
130	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
131	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
132	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
133	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
134	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
135	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
136	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
137	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
138	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
139	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
140	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
141	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
142	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
143	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
144	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002555	三七互娱	162,653,972.00	10.48
2	002304	洋河股份	152,292,293.00	9.82
3	600809	山西汾酒	138,604,851.87	8.93
4	600519	贵州茅台	138,207,121.39	8.91
5	600702	舍得酒业	126,771,559.74	8.17
6	601138	工业富联	124,032,602.76	8.00
7	000938	紫光股份	124,006,381.31	7.99
8	002594	比亚迪	99,705,707.64	6.43
9	002517	恺英网络	99,651,779.90	6.42
10	300308	中际旭创	95,317,797.77	6.14
11	688111	金山办公	83,946,742.77	5.41
12	002475	立讯精密	82,994,925.00	5.35
13	600633	浙数文化	80,432,351.05	5.18
14	000596	古井贡酒	79,617,037.00	5.13
15	600325	华发股份	77,316,705.36	4.98
16	600011	华能国际	74,769,630.00	4.82
17	002352	顺丰控股	74,006,521.74	4.77
18	601888	中国中免	72,804,774.00	4.69
19	600373	中文传媒	72,714,918.26	4.69
20	605168	三人行	72,149,331.73	4.65
21	300418	昆仑万维	71,120,604.35	4.58
22	603369	今世缘	70,190,373.16	4.52
23	300604	长川科技	68,251,999.85	4.40
24	601186	中国铁建	66,457,789.50	4.28
25	000858	五粮液	65,986,420.44	4.25
26	603345	安井食品	62,879,133.80	4.05
27	300394	天孚通信	61,783,723.82	3.98
28	300144	宋城演艺	60,360,478.10	3.89
29	000063	中兴通讯	59,688,781.00	3.85
30	002230	科大讯飞	56,889,112.44	3.67
31	300364	中文在线	53,618,306.68	3.46
32	601058	赛轮轮胎	53,525,814.20	3.45
33	601398	工商银行	53,058,962.57	3.42
34	600529	山东药玻	52,599,319.52	3.39
35	000333	美的集团	51,090,203.43	3.29
36	002463	沪电股份	46,464,164.52	3.00

37	300168	万达信息	43,756,604.81	2.82
38	603885	吉祥航空	43,733,546.50	2.82
39	688262	国芯科技	43,511,619.06	2.80
40	000988	华工科技	42,198,836.44	2.72
41	002020	京新药业	41,093,537.60	2.65
42	000568	泸州老窖	40,758,088.70	2.63
43	002812	恩捷股份	40,020,018.00	2.58
44	603259	药明康德	39,706,829.00	2.56
45	002179	中航光电	39,576,672.24	2.55
46	603899	晨光股份	37,748,251.78	2.43
47	601098	中南传媒	36,293,954.80	2.34
48	600559	老白干酒	35,583,582.00	2.29
49	002121	科陆电子	35,132,078.00	2.26
50	000651	格力电器	34,656,352.00	2.23
51	688234	天岳先进	34,644,011.04	2.23
52	300820	英杰电气	34,642,246.44	2.23
53	600600	青岛啤酒	33,959,980.65	2.19
54	688590	新致软件	33,409,112.44	2.15
55	300751	迈为股份	33,207,261.63	2.14
56	300679	电连技术	32,862,835.19	2.12
57	002050	三花智控	32,799,200.50	2.11
58	603919	金徽酒	32,780,658.84	2.11
59	000933	神火股份	32,694,017.00	2.11
60	601689	拓普集团	32,393,654.00	2.09
61	605589	圣泉集团	32,092,514.00	2.07

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002304	洋河股份	231,742,543.16	14.94
2	600519	贵州茅台	177,454,519.73	11.44
3	600809	山西汾酒	162,489,555.75	10.47
4	000858	五粮液	137,994,646.90	8.90
5	000333	美的集团	124,202,093.78	8.01
6	002555	三七互娱	121,481,991.00	7.83
7	000596	古井贡酒	119,688,366.50	7.72
8	002352	顺丰控股	116,215,012.16	7.49
9	603345	安井食品	114,406,617.20	7.37
10	601138	工业富联	113,724,061.98	7.33
11	000938	紫光股份	113,584,889.98	7.32



12	600702	舍得酒业	112,530,672.53	7.25
13	603833	欧派家居	101,856,850.00	6.57
14	002594	比亚迪	101,754,317.26	6.56
15	600633	浙数文化	95,983,929.64	6.19
16	002517	恺英网络	82,685,690.91	5.33
17	600325	华发股份	76,807,209.20	4.95
18	600011	华能国际	74,311,812.03	4.79
19	688111	金山办公	73,819,547.53	4.76
20	603369	今世缘	70,295,597.00	4.53
21	000568	泸州老窖	69,480,736.00	4.48
22	300037	新宙邦	69,458,376.62	4.48
23	300604	长川科技	66,834,819.00	4.31
24	601888	中国中免	64,933,487.12	4.19
25	600373	中文传媒	62,034,737.22	4.00
26	300308	中际旭创	60,551,412.00	3.90
27	000063	中兴通讯	60,019,681.67	3.87
28	600199	金种子酒	59,341,840.96	3.83
29	002475	立讯精密	59,240,861.96	3.82
30	603486	科沃斯	57,457,999.00	3.70
31	300418	昆仑万维	56,994,560.00	3.67
32	601058	赛轮轮胎	53,792,212.00	3.47
33	601186	中国铁建	53,345,231.00	3.44
34	600872	中炬高新	53,169,179.29	3.43
35	300364	中文在线	53,108,137.09	3.42
36	605168	三人行	52,475,267.10	3.38
37	002230	科大讯飞	51,820,437.00	3.34
38	300012	华测检测	50,480,120.96	3.25
39	601398	工商银行	50,006,837.00	3.22
40	300144	宋城演艺	49,035,147.16	3.16
41	002463	沪电股份	48,785,463.00	3.14
42	603899	晨光股份	47,828,240.00	3.08
43	000988	华工科技	46,087,219.09	2.97
44	002727	一心堂	45,542,503.00	2.94
45	603596	伯特利	44,857,823.40	2.89
46	002020	京新药业	42,880,533.20	2.76
47	300168	万达信息	40,609,654.91	2.62
48	603885	吉祥航空	38,899,346.56	2.51
49	300679	电连技术	38,105,324.10	2.46
50	688262	国芯科技	37,487,068.33	2.42
51	600859	王府井	37,468,490.00	2.42
52	601098	中南传媒	36,645,732.00	2.36

53	600529	山东药玻	36,471,351.00	2.35
54	300820	英杰电气	36,017,898.72	2.32
55	000786	北新建材	35,940,970.00	2.32
56	600559	老白干酒	34,965,031.00	2.25
57	000537	中绿电	34,016,505.00	2.19
58	300394	天孚通信	33,986,880.00	2.19
59	300174	元力股份	33,608,338.00	2.17
60	000933	神火股份	33,433,900.27	2.16
61	002812	恩捷股份	33,152,238.00	2.14
62	688234	天岳先进	32,049,149.77	2.07
63	605589	圣泉集团	31,927,431.00	2.06
64	000651	格力电器	31,252,160.11	2.01

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,328,447,147.64
卖出股票收入（成交）总额	6,694,117,208.10

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	601,268.11
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	336,412.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	937,680.45

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
永赢消费 主题 A	54,532	4,919.60	4,065,818.29	1.5155%	264,210,063.97	98.4845%
永赢消费 主题 C	122,061	1,287.19	179,812.49	0.1144%	156,935,418.88	99.8856%
合计	176,593	2,408.88	4,245,630.78	0.9981%	421,145,482.85	99.0019%

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）。

### 9.2 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	永赢消费主题 A	716,711.57	0.27%
	永赢消费主题 C	319,916.87	0.20%
	合计	1,036,628.44	0.24%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	永赢消费主题 A	10~50
	永赢消费主题 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放 式基金	永赢消费主题 A	0
	永赢消费主题 C	10~50
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	永赢消费主题 A	永赢消费主题 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 06 日）基金 份额总额	216,648,074.95	54,897,706.71
本报告期初基金份额总额	386,183,624.62	211,201,935.24
本报告期基金总申购份额	35,443,962.38	89,687,126.95
减：本报告期基金总赎回份额	153,351,704.74	143,773,830.82

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	268,275,882.26	157,115,231.37

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

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

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为 60,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

国投证券	2	275,315,206.92	2.12%	199,728.17	2.12%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	1,722,856,138.41	13.26%	1,243,533.79	13.18%	-
方正证券	2	853,941,807.22	6.57%	616,137.48	6.53%	-
广发证券	2	2,221,876,400.31	17.10%	1,607,168.85	17.03%	-
国联证券	2	177,098,132.90	1.36%	129,748.68	1.37%	-
国泰君安 证券	2	660,032,450.19	5.08%	479,748.50	5.08%	-
国信证券	2	571,884,730.03	4.40%	419,634.29	4.45%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	276,970,841.87	2.13%	203,726.05	2.16%	-
华泰证券	2	2,660,533,952.52	20.48%	1,932,294.42	20.47%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	128,260,892.42	0.99%	93,612.84	0.99%	-
兴业证券	2	1,308,863,297.90	10.07%	951,849.56	10.08%	-
中信建投	2	875,528,097.02	6.74%	640,356.76	6.78%	-
中信证券	2	1,260,891,042.79	9.70%	920,778.69	9.76%	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	-

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢基金管理有限公司关于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年01月05日
2	永赢基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的声明	中国证监会规定媒介	2023年01月12日
3	永赢消费主题灵活配置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年01月20日
4	永赢基金管理有限公司关于新增江苏江南农村商业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年02月17日
5	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年03月29日
6	永赢消费主题灵活配置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年03月30日
7	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年03月31日
8	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年04月08日
9	永赢基金管理有限公司关于新增长城证	中国证监会规定媒介	2023年04月19日

	券股份有限公司为公司旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告		日
10	永赢消费主题灵活配置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 年 04 月 21 日
11	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 年 05 月 26 日
12	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 07 月 20 日
13	永赢消费主题灵活配置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 年 07 月 22 日
14	永赢基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 07 月 22 日
15	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2023 年 07 月 22 日
16	永赢消费主题灵活配置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 年 07 月 22 日
17	永赢消费主题灵活配置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 年 07 月 22 日
18	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2023 年 07 月 22 日
19	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 30 日
20	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 10 月 25 日
21	永赢消费主题灵活配置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 年 11 月 30 日
22	永赢消费主题灵活配置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 年 11 月 30 日
23	永赢消费主题灵活配置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 年 11 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息



无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢消费主题灵活配置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。

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

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

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司  
2024 年 03 月 27 日