

永赢中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:中国银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 28 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26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2021年01月01日起至2021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	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末上市基金前十名持有人	65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	66
§9 开放式基金份额变动.....	66
§10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	永赢中证500ETF
场内简称	永赢500
基金主代码	159999
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年07月14日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	42,344,275.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020年8月12日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>通常情形下，本基金主要采取完全复制法进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重分配投资于每只股票的具体金额，进而形成股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票发生增发或配股、成份股停牌或因法律法规原因被限制投资、市场流动性不足等情况，对股票投资组合进行实时调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>

(1) 定期调整：根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

(2) 不定期调整

①当标的指数成份股发生增发、配股等股权变动而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

②根据基金申购赎回情况，调整股票投资组合，以有效跟踪标的指数；

③根据法律法规规定，成份股在标的指数中的权重因其他原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当的调整，力争降低跟踪误差。

2、债券投资策略

(1) 本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

(2) 可转换债券投资策略

本基金将着重对可转债对应的基础股票的分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行重点选择，并在对应可转债估值合理的前提下集中投资，以分享正股上涨带来的收益。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。

3、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券、住房抵押贷款支持证券等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

4、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与股指期货交易。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

5、国债期货投资策略

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与国债期货交易。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

6、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融

	<p>通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p> <p>7、存托凭证投资策略</p> <p>本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	永赢基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧
	联系电话	021-51690145
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com
客户服务电话	400-805-8888	95566
传真	021-51690177	010-66594942
注册地址	浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	马宇晖	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正	www.maxwealthfund.com

文的管理人互联网网址	
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)		
	本期已实现收益	3,009,097.00	
本期利润	4,665,850.35		
加权平均基金份额本期利润	0.0999		
本期加权平均净值利润率	9.58%		
本期基金份额净值增长率	7.06%		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)		
	期末可供分配利润	3,537,436.31	
	期末可供分配基金份额利润	0.0835	
	期末基金资产净值	46,579,121.43	
	期末基金份额净值	1.1000	
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)		
	基金份额累计净值增长率	10.00%	

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

益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.41%	0.72%	1.18%	0.73%	0.23%	-0.01%
过去三个月	9.34%	0.68%	8.86%	0.68%	0.48%	0.00%
过去六个月	7.06%	0.97%	6.93%	0.99%	0.13%	-0.02%
自基金合同生效起至今	10.00%	1.13%	-1.32%	1.20%	11.32%	-0.07%

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

2、本基金业绩比较基准为：中证500指数收益率。

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

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



- 注：1、本基金合同生效日为2020年07月14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%，华侨银行有限公司持股28.51%。

截止2021年6月30日，本基金管理人共管理78只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢稳益债券型证券投资基金、永赢双利债券型证券投资基金、永赢丰益债

券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢天天利货币市场基金、永赢永益债券型证券投资基金、永赢丰利债券型证券投资基金、永赢增益债券型证券投资基金、永赢恒益债券型证券投资基金、永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢嘉益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢裕益债券型证券投资基金、永赢祥益债券型证券投资基金、永赢通益债券型证券投资基金、永赢诚益债券型证券投资基金、永赢伟益债券型证券投资基金、永赢昌益债券型证券投资基金、永赢宏益债券型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢智益纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢沪深300指数型发起式证券投资基金、永赢众利债券型证券投资基金、永赢同利债券型证券投资基金、永赢昌利债券型证券投资基金、永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢乾元三年定期开放混合型证券投资基金、永赢科技驱动混合型证券投资基金、永赢元利债券型证券投资基金、永赢易弘债券型证券投资基金、永赢股息优选混合型证券投资基金、永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金、永赢中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金、永赢医药健康股票型证券投资基金、永赢邦利债券型证券投资基金、永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金、永赢瑞宁87个月定期开放债券型证券投资基金、永赢成长领航混合型证券投资基金、永赢鼎利债券型证券投资基金、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金、永赢泰宁63个月定期开放债券型证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢鑫享混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫欣混合型证券投资基金、永赢稳健增利18个月持有期混合型证券投资基金、永赢鑫盛混合型证券投资基金、永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、永赢惠添益混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢港股通优质成长一年持有期混合型证券投资基金、永赢深证创新100交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万纯	权益投资部指数与数量投资部副总监/基金经理	2020-07-14	-	7	万纯先生，北京大学硕士，7年证券相关从业经验。曾任中国证券登记结算有限责任公司技术部基金业务组经理助理；平安基金管理有限公司指数投资部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司权益投资部指数与数量投资部副总监（主持工作）。
蔡路平	基金经理助理	2020-08-21	2021-06-17	4	蔡路平先生，硕士，4年证券相关从业经验。曾任南华基金管理有限公司量化投资部基金经理助理，永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理助理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年上半年，大盘先后经历了春季躁动，大盘蓝筹高歌猛进；交易结构恶化，核心资产抱团瓦解；再通胀交易升温，从全球定价向国内定价扩散；高景气持续，科技成长再度回归四个阶段，大盘整体呈现宽幅震荡，上证综指上涨3.4%，但板块间轮动加速，结构分化较为显著。风格方面，大盘向中盘下沉，成长价值趋于均衡。板块方面，科技周期共振，产业趋势与盈利弹性相互博弈。沪深300因核心资产表现分化，指数上涨0.24%；中盘风格的代表-中证500指数在业绩弹性和估值修复驱动下，指数上涨近7%。行业层面，化工、钢铁、电力设备及新能源涨幅居前，非银金融、家电、国防军工、房地产领跌。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢中证500ETF基金份额净值为1.1000元，本报告期内，基金份额净值增长率为7.06%，同期业绩比较基准收益率为6.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2021年下半年，国内经济率先步入疫后新常态，经济增长高点已过，增速逐级回落；海外经济因疫情退出时间较晚，仍处于经济持续修复状态。国内外政策导向或出现错位，国内更关注增长放缓下的“稳”，海外更关注自发修复下的“退”。尤其是国内当前投资放缓、消费恢复偏弱，多地水涝冲击等，下半年“稳增长”诉求较强。流动性层面，7月9日央行公告全面降准，表明货币政策定调没有市场担忧的紧，但也不必有过于宽松的预期。微观流动性层面，居民资金在连续2年半的高收益下有望持续增加对权益资产的配置，但由于上半年已经贡献万亿资金，下半年边际提振作用有限；此外，需重点关注海外经济持续修复下，外资边际撤出风险。行业层面，仍需围绕业绩增长确定性进行配置，重点观察窗口为7月和10月的季报披露期。重点关注以新能源车产业和芯片为代表的硬科技、以医疗为代表的消费升级、以碳中和为代表的能源革命和双碳国策下的周期成长领域。

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，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,601,323.21	3,598,583.86
结算备付金		406,730.39	2,670,941.37
存出保证金		225,435.30	873,248.50
交易性金融资产	6.4.7.2	44,796,402.12	68,394,780.91

其中：股票投资		44,796,402.12	68,394,780.91
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,503,358.90
应收利息	6.4.7.5	149.87	565.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		47,030,040.89	77,041,479.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		326,738.85	2,390,735.34
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,130.68	10,898.68
应付托管费		2,043.55	3,632.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	20,743.50	107,954.41
应交税费		755.51	245.31
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	94,507.37	195,000.00
负债合计		450,919.46	2,708,466.63
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	42,344,275.00	72,344,275.00
未分配利润	6.4.7.10	4,234,846.43	1,988,737.77
所有者权益合计		46,579,121.43	74,333,012.77
负债和所有者权益总计		47,030,040.89	77,041,479.40

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.1000元，基金份额总额42,344,275.00份。

6.2 利润表

会计主体：永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年0 6月30日
一、收入		4,926,038.30
1. 利息收入		4,144.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,144.84
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,273,509.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,630,801.62
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.3	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	225,825.25
股利收益	6.4.7.16	416,882.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,656,753.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-8,369.16
减：二、费用		260,187.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	36,380.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,126.69
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	111,713.89
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		812.98
7. 其他费用	6.4.7.20	99,154.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,665,850.35
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,665,850.35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	72,344,275.00	1,988,737.77	74,333,012.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动	-	4,665,850.35	4,665,850.35

数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-30,000,000.00	-2,419,741.69	-32,419,741.69
其中:1.基金申购款	24,000,000.00	560,973.15	24,560,973.15
2.基金赎回款	-54,000,000.00	-2,980,714.84	-56,980,714.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	42,344,275.00	4,234,846.43	46,579,121.43

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

黄庆

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

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

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

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

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

本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率。

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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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2021年6月30日的财务状况以及自2021年1月1日起至2021年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

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

6.4.6.1 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，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

6.4.7 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 2021年06月30日	
	活期存款	1,601,323.21
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
合计	1,601,323.21	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	43,199,220.75	44,796,402.12	1,597,181.37
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	43,199,220.75	44,796,402.12	1,597,181.37

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	

	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
股指期货	-	-	-	-
其他衍生工具	1,290,440.00	-	-	注
合计	1,290,440.00	-	-	-

注：其他衍生工具具体如下：

项目	本期末 2021年6月30日			
	持仓量 (买/卖)	合约名义金 额	合约市值	公允价值变动
股指期货	1.00	1,290,440.00	1,333,400.00	42,960.00
国债期货	-	-	-	-
黄金延期合约	-	-	-	-
总额合计				42,960.00
减：可抵销期货暂收款	-	-		42,960.00
股指期货投资净额	-	-		-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	132.69
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	11.78
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	5.40
合计	149.87

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	20,743.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	20,743.50

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	59,507.37
应付指数使用费	35,000.00
合计	94,507.37

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,344,275.00	72,344,275.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-54,000,000.00	-54,000,000.00
本期末	42,344,275.00	42,344,275.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,591,312.97	397,424.80	1,988,737.77
本期利润	3,009,097.00	1,656,753.35	4,665,850.35
本期基金份额交易产生的变动数	-1,062,973.66	-1,356,768.03	-2,419,741.69
其中：基金申购款	939,969.59	-378,996.44	560,973.15
基金赎回款	-2,002,943.25	-977,771.59	-2,980,714.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,537,436.31	697,410.12	4,234,846.43

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
	活期存款利息收入

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	878.64
其他	374.79
合计	4,144.84

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,173,788.60
股票投资收益——赎回差价收入	457,013.02
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,630,801.62

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	45,218,454.93
减：卖出股票成本总额	43,044,666.33
买卖股票差价收入	2,173,788.60

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
赎回基金份额对价总额	56,980,714.84
减：现金支付赎回款总额	25,507,173.84
减：赎回股票成本总额	31,016,527.98

赎回差价收入	457,013.02
--------	------------

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 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
	2021年01月01日至2021年06月30日
期货投资	225,825.25

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	416,882.40
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	416,882.40

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	1,672,033.35
——股票投资	1,672,033.35
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-15,280.00
——权证投资	-
——期货投资	-15,280.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,656,753.35

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	-8,369.16
合计	-8,369.16

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	111,143.91
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	569.98
合计	111,713.89

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,263.78
指数使用费	38,383.21
合计	99,154.36

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	36,380.03
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,126.69

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
永赢资产	22,999,908.00	54.3165%	0.00	0.00%

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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,601,323.21	2,891.41

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的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（2021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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开盘	数量（股）	期末成本	期末估值	备注
------	------	------	------	------	------	------	-------	------	------	----

				单价		单价		总额	总额	
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项停牌	56.35	2021-07-01	59.49	5,700	124,778.85	321,195.00	-
600811	东方集团	2021-06-30	重大事项停牌	3.05	2021-07-14	3.36	21,700	89,714.25	66,185.00	-

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2021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2021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，使本基金紧密跟踪标的指数。

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、自控和互控的第一道防线，部门内控和部门之间互相监督的第二道防线，合规管理及风险管理部门监控检查的第三道防线，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管理进行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

本期末及上年度末，本基金均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，本基金均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 2021年	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
--------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

06月30日							
资产							
银行存款	1,601,323.21	-	-	-	-	-	1,601,323.21
结算备付金	5,433.65	-	-	-	-	401,296.74	406,730.39
存出保证金	12,091.30	-	-	-	-	213,344.00	225,435.30
交易性金融资产	-	-	-	-	-	44,796,402.12	44,796,402.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	149.87	149.87
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,618,848.16	0.00	0.00	0.00	0.00	45,411,192.73	47,030,040.89
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	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	326,738.85	326,738.85
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,130.68	6,130.68
应付托管费	-	-	-	-	-	2,043.55	2,043.55
应付销售服务	-	-	-	-	-	-	-

永赢中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	20,743.50	20,743.50
应付税费	-	-	-	-	-	755.51	755.51
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	94,507.37	94,507.37
负债总计	-	-	-	-	-	450,919.46	450,919.46
利率敏感度缺口	1,618,848.16	0.00	0.00	0.00	0.00	44,960,273.27	46,579,121.43
上年度末 2020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	3,598,583.86	-	-	-	-	-	3,598,583.86
结算备付金	185,057.05	-	-	-	-	2,485,884.32	2,670,941.37
存出保证金	61,242.10	-	-	-	-	812,006.40	873,248.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	68,394,780.91	68,394,780.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,503,358.90	1,503,358.90
应收利息	-	-	-	-	-	565.86	565.86
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,844,883.01	-	-	-	-	73,196,596.39	77,041,479.40
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	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,390,735.34	2,390,735.34
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,898.68	10,898.68
应付托管费	-	-	-	-	-	3,632.89	3,632.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	107,954.41	107,954.41
应付税费	-	-	-	-	-	245.31	245.31
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	195,000.00	195,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,708,466.63	2,708,466.63
利率敏感度缺口	3,844,883.01	-	-	-	-	70,488,129.76	74,333,012.77

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

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。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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 2021年06月30日		上年度末 2020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	44,796,402.12	96.17	68,394,780.91	92.01
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	44,796,402.12	96.17	68,394,780.91	92.01

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日

	业绩比较基准增加1%	455, 536. 30	675, 194. 14
	业绩比较基准减少1%	-455, 536. 30	-675, 194. 14

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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 44,409,022.12元，属于第二层次的余额为人民币 387,380.00元，属于第三层次的余额为人民币0.00元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下：上年度末余额人民币1,184,636.74元，本期变动人民币-1,184,636.74元，本期末人民币0.00元。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2021年8月27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	44,796,402.12	95.25
	其中：股票	44,796,402.12	95.25
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	2,008,053.60	4.27
8	其他各项资产	225,585.17	0.48
9	合计	47,030,040.89	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	436,758.00	0.94
B	采矿业	1,561,737.85	3.35
C	制造业	28,285,353.34	60.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,081,498.30	2.32
E	建筑业	826,240.00	1.77
F	批发和零售业	1,528,007.75	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	865,021.20	1.86

H	住宿和餐饮业	239,661.00	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,799,038.80	8.16
J	金融业	2,622,650.60	5.63
K	房地产业	1,464,065.28	3.14
L	租赁和商务服务业	591,199.00	1.27
M	科学研究和技术服务业	118,930.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	382,873.00	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	28,863.00	0.06
Q	卫生和社会工作	118,730.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	450,633.00	0.97
S	综合	395,142.00	0.85
	合计	44,796,402.12	96.17

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票组合。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002709	天赐材料	4,200	447,636.00	0.96

2	000799	酒鬼酒	1,600	408,960.00	0.88
3	603486	科沃斯	1,600	364,928.00	0.78
4	600089	特变电工	27,200	349,520.00	0.75
5	000009	中国宝安	18,900	345,303.00	0.74
6	002340	格林美	35,000	327,250.00	0.70
7	002074	国轩高科	7,400	322,344.00	0.69
8	600460	士兰微	5,700	321,195.00	0.69
9	300285	国瓷材料	5,900	287,625.00	0.62
10	601233	桐昆股份	11,700	281,853.00	0.61
11	300207	欣旺达	8,100	263,736.00	0.57
12	002185	华天科技	16,000	246,240.00	0.53
13	300316	晶盛机电	4,800	242,400.00	0.52
14	600885	宏发股份	3,800	238,260.00	0.51
15	601636	旗滨集团	11,700	217,152.00	0.47
16	603444	吉比特	400	212,000.00	0.46
17	600733	北汽蓝谷	15,600	210,288.00	0.45
18	300037	新宙邦	2,100	210,210.00	0.45
19	300146	汤臣倍健	6,200	203,980.00	0.44
20	300253	卫宁健康	12,500	203,375.00	0.44
21	688099	晶晨股份	1,800	201,960.00	0.43
22	002648	卫星石化	5,140	201,436.60	0.43
23	600884	杉杉股份	8,400	195,888.00	0.42
24	002625	光启技术	9,400	195,614.00	0.42
25	601127	小康股份	2,900	193,343.00	0.42
26	002223	鱼跃医疗	5,000	190,650.00	0.41
27	600219	南山铝业	52,400	188,640.00	0.40
28	002353	杰瑞股份	4,200	187,740.00	0.40
29	002138	顺络电子	4,800	186,096.00	0.40
30	603589	口子窖	2,700	182,763.00	0.39
31	688002	睿创微纳	1,800	179,694.00	0.39
32	603737	三棵树	1,020	179,520.00	0.39

33	600779	水井坊	1,400	176,890.00	0.38
34	002797	第一创业	24,600	175,644.00	0.38
35	000547	航天发展	9,300	175,491.00	0.38
36	600704	物产中大	22,200	174,714.00	0.38
37	300699	光威复材	2,300	174,685.00	0.38
38	002444	巨星科技	5,100	173,808.00	0.37
39	002212	天融信	8,700	171,999.00	0.37
40	000988	华工科技	7,300	171,696.00	0.37
41	601099	太平洋	49,800	168,822.00	0.36
42	002422	科伦药业	8,400	167,580.00	0.36
43	601168	西部矿业	13,900	165,827.00	0.36
44	002385	大北农	24,200	164,560.00	0.35
45	000807	云铝股份	13,700	163,030.00	0.35
46	600739	辽宁成大	7,800	162,318.00	0.35
47	300308	中际旭创	4,200	161,784.00	0.35
48	600392	盛和资源	9,100	157,976.00	0.34
49	601117	中国化学	18,000	157,680.00	0.34
50	000830	鲁西化工	8,400	157,332.00	0.34
51	002439	启明星辰	5,400	156,654.00	0.34
52	002180	纳思达	4,800	154,560.00	0.33
53	000636	风华高科	5,100	154,122.00	0.33
54	600862	中航高科	5,000	153,900.00	0.33
55	600754	锦江酒店	2,700	153,765.00	0.33
56	002078	太阳纸业	11,500	153,525.00	0.33
57	603893	瑞芯微	1,100	153,406.00	0.33
58	600699	均胜电子	6,000	153,120.00	0.33
59	600068	葛洲坝	20,200	151,298.00	0.32
60	600315	上海家化	2,500	150,350.00	0.32
61	002030	达安基因	7,060	149,954.40	0.32
62	002250	联化科技	5,300	147,870.00	0.32
63	300088	长信科技	17,900	147,854.00	0.32

64	000630	铜陵有色	54,100	147,152.00	0.32
65	002507	涪陵榨菜	3,900	146,874.00	0.32
66	600486	扬农化工	1,300	145,301.00	0.31
67	600201	生物股份	8,244	143,857.80	0.31
68	002013	中航机电	14,200	142,994.00	0.31
69	600563	法拉电子	900	142,524.00	0.31
70	002075	沙钢股份	13,000	141,830.00	0.30
71	000039	中集集团	7,800	141,804.00	0.30
72	002127	南极电商	14,400	140,688.00	0.30
73	000513	丽珠集团	2,800	140,056.00	0.30
74	002028	思源电气	4,500	138,555.00	0.30
75	300001	特锐德	4,600	138,506.00	0.30
76	002511	中顺洁柔	4,897	134,912.35	0.29
77	601997	贵阳银行	18,800	134,608.00	0.29
78	600177	雅戈尔	20,300	133,777.00	0.29
79	002273	水晶光电	9,000	132,210.00	0.28
80	000021	深科技	6,900	132,066.00	0.28
81	300223	北京君正	1,300	131,196.00	0.28
82	002080	中材科技	5,000	130,850.00	0.28
83	601005	重庆钢铁	49,000	130,830.00	0.28
84	600549	厦门钨业	6,253	130,249.99	0.28
85	002092	中泰化学	12,600	129,402.00	0.28
86	000050	深天马 A	9,100	129,038.00	0.28
87	002299	圣农发展	5,400	128,952.00	0.28
88	600988	赤峰黄金	8,600	128,914.00	0.28
89	300168	万达信息	8,800	128,480.00	0.28
90	002603	以岭药业	4,400	128,304.00	0.28
91	603290	斯达半导	400	128,000.00	0.27
92	600171	上海贝岭	4,200	127,806.00	0.27
93	002465	海格通信	13,400	126,764.00	0.27
94	000739	普洛药业	4,300	126,420.00	0.27

95	300009	安科生物	8,460	126,054.00	0.27
96	300482	万孚生物	1,940	125,498.60	0.27
97	000983	山西焦煤	15,100	125,481.00	0.27
98	600867	通化东宝	10,500	125,370.00	0.27
99	600536	中国软件	2,200	125,246.00	0.27
100	000825	太钢不锈	16,700	125,083.00	0.27
101	600516	方大炭素	16,800	124,992.00	0.27
102	601128	常熟银行	20,000	124,000.00	0.27
103	600637	东方明珠	15,100	123,669.00	0.27
104	600066	宇通客车	9,900	123,651.00	0.27
105	000998	隆平高科	7,700	123,508.00	0.27
106	300463	迈克生物	2,900	122,061.00	0.26
107	300357	我武生物	1,900	121,828.00	0.26
108	688208	道通科技	1,400	121,786.00	0.26
109	600418	江淮汽车	9,700	120,571.00	0.26
110	002152	广电运通	9,200	119,876.00	0.26
111	600879	航天电子	15,900	119,568.00	0.26
112	600316	洪都航空	3,100	119,288.00	0.26
113	600827	百联股份	5,900	118,885.00	0.26
114	300244	迪安诊断	3,100	118,730.00	0.25
115	600487	亨通光电	10,400	118,560.00	0.25
116	300070	碧水源	16,200	118,422.00	0.25
117	600380	健康元	8,620	118,352.60	0.25
118	600369	西南证券	24,300	118,341.00	0.25
119	300618	寒锐钴业	1,500	118,260.00	0.25
120	000932	华菱钢铁	17,900	118,140.00	0.25
121	603605	珀莱雅	600	118,026.00	0.25
122	000723	美锦能源	15,600	117,936.00	0.25
123	000750	国海证券	27,800	117,872.00	0.25
124	002156	通富微电	4,900	117,796.00	0.25
125	300271	华宇软件	6,100	117,425.00	0.25

126	002373	千方科技	7,000	116,900.00	0.25
127	300296	利亚德	14,900	116,518.00	0.25
128	601689	拓普集团	3,100	116,033.00	0.25
129	600038	中直股份	2,200	116,028.00	0.25
130	600166	福田汽车	33,600	115,920.00	0.25
131	002131	利欧股份	49,500	115,830.00	0.25
132	000975	银泰黄金	12,160	115,641.60	0.25
133	600529	山东药玻	3,400	115,430.00	0.25
134	000960	锡业股份	7,200	115,416.00	0.25
135	600909	华安证券	20,620	114,853.40	0.25
136	002572	索菲亚	4,700	113,740.00	0.24
137	300383	光环新网	7,900	113,681.00	0.24
138	601615	明阳智能	7,000	113,330.00	0.24
139	002690	美亚光电	2,000	111,520.00	0.24
140	002926	华西证券	11,500	110,745.00	0.24
141	601198	东兴证券	10,100	110,393.00	0.24
142	600642	申能股份	17,900	109,906.00	0.24
143	601866	中远海发	29,100	109,125.00	0.23
144	002065	东华软件	13,600	107,848.00	0.23
145	300115	长盈精密	5,220	107,532.00	0.23
146	000623	吉林敖东	6,900	106,881.00	0.23
147	600998	九州通	6,900	106,053.00	0.23
148	603156	养元饮品	3,700	105,746.00	0.23
149	600271	航天信息	8,100	105,543.00	0.23
150	603638	艾迪精密	2,460	105,460.20	0.23
151	002500	山西证券	15,700	105,347.00	0.23
152	601699	潞安环能	8,800	103,928.00	0.22
153	600415	小商品城	20,100	103,515.00	0.22
154	000012	南玻 A	10,000	102,400.00	0.22
155	600895	张江高科	5,600	102,312.00	0.22
156	600153	建发股份	12,600	102,060.00	0.22

157	600188	兖州煤业	6,600	101,376.00	0.22
158	603260	合盛硅业	1,300	99,983.00	0.21
159	300630	普利制药	1,900	99,560.00	0.21
160	600535	天士力	6,700	99,227.00	0.21
161	600667	太极实业	10,900	99,190.00	0.21
162	600707	彩虹股份	10,500	98,805.00	0.21
163	002294	信立泰	3,000	98,700.00	0.21
164	600390	五矿资本	16,500	98,670.00	0.21
165	600256	广汇能源	29,600	98,568.00	0.21
166	300418	昆仑万维	6,000	98,280.00	0.21
167	300024	机器人	9,200	98,164.00	0.21
168	002382	蓝帆医疗	4,700	97,995.00	0.21
169	300474	景嘉微	1,000	97,920.00	0.21
170	002372	伟星新材	4,700	97,149.00	0.21
171	688321	微芯生物	2,100	96,999.00	0.21
172	002670	国盛金控	8,500	96,815.00	0.21
173	600008	首创环保	32,130	96,711.30	0.21
174	600060	海信视像	5,700	96,330.00	0.21
175	600155	华创阳安	9,000	96,300.00	0.21
176	000027	深圳能源	10,500	96,285.00	0.21
177	600497	驰宏锌锗	22,300	96,113.00	0.21
178	600208	新湖中宝	31,600	96,064.00	0.21
179	600498	烽火通信	5,100	95,013.00	0.20
180	000878	云南铜业	7,400	94,942.00	0.20
181	002557	洽洽食品	2,200	94,820.00	0.20
182	603858	步长制药	4,200	94,458.00	0.20
183	600141	兴发集团	5,000	94,150.00	0.20
184	688029	南微医学	300	93,507.00	0.20
185	002019	亿帆医药	5,400	93,150.00	0.20
186	002221	东华能源	8,500	93,075.00	0.20
187	300251	光线传媒	8,600	92,966.00	0.20

188	600765	中航重机	4,100	92,865.00	0.20
189	000718	苏宁环球	11,200	92,848.00	0.20
190	600372	中航电子	5,600	92,680.00	0.20
191	600511	国药股份	2,800	92,568.00	0.20
192	600409	三友化工	9,100	92,001.00	0.20
193	002174	游族网络	5,300	91,001.00	0.20
194	603866	桃李面包	2,900	90,480.00	0.19
195	002390	信邦制药	8,600	90,128.00	0.19
196	600170	上海建工	32,500	89,700.00	0.19
197	002146	荣盛发展	15,900	89,676.00	0.19
198	002966	苏州银行	12,200	89,670.00	0.19
199	600801	华新水泥	5,100	89,607.00	0.19
200	002506	协鑫集成	25,700	89,436.00	0.19
201	688088	虹软科技	1,600	89,200.00	0.19
202	002683	宏大爆破	3,200	88,864.00	0.19
203	600875	东方电气	8,100	88,857.00	0.19
204	601717	郑煤机	7,600	88,388.00	0.19
205	300058	蓝色光标	14,600	88,330.00	0.19
206	002408	齐翔腾达	7,100	88,182.00	0.19
207	000997	新大陆	5,300	87,927.00	0.19
208	000401	冀东水泥	7,100	87,685.00	0.19
209	603707	健友股份	2,100	87,675.00	0.19
210	600160	巨化股份	9,900	87,516.00	0.19
211	000738	航发控制	4,200	87,486.00	0.19
212	000686	东北证券	10,300	87,035.00	0.19
213	002958	青农商行	20,300	86,884.00	0.19
214	600663	陆家嘴	6,500	86,580.00	0.19
215	600258	首旅酒店	3,600	85,896.00	0.18
216	002268	卫士通	4,400	85,712.00	0.18
217	300315	掌趣科技	20,100	85,425.00	0.18
218	002195	二三四五	41,700	84,651.00	0.18

219	300017	网宿科技	14,400	84,240.00	0.18
220	000540	中天金融	30,800	84,084.00	0.18
221	600859	王府井	2,900	83,752.00	0.18
222	600325	华发股份	12,400	83,576.00	0.18
223	603225	新凤鸣	4,100	83,230.00	0.18
224	002831	裕同科技	2,800	83,132.00	0.18
225	603712	七一二	2,300	83,030.00	0.18
226	000060	中金岭南	18,300	82,716.00	0.18
227	601992	金隅集团	30,600	82,314.00	0.18
228	601016	节能风电	22,000	82,280.00	0.18
229	600732	爱旭股份	5,900	82,128.00	0.18
230	600027	华电国际	23,800	81,872.00	0.18
231	000158	常山北明	7,100	81,579.00	0.18
232	000961	中南建设	13,700	81,104.00	0.17
233	600567	山鹰国际	23,500	81,075.00	0.17
234	002429	兆驰股份	13,300	80,731.00	0.17
235	603077	和邦生物	38,700	80,496.00	0.17
236	300212	易华录	2,980	80,191.80	0.17
237	600282	南钢股份	22,500	80,100.00	0.17
237	002595	豪迈科技	3,000	80,100.00	0.17
239	600216	浙江医药	5,000	80,050.00	0.17
240	000999	华润三九	2,984	79,822.00	0.17
241	601577	长沙银行	8,900	79,566.00	0.17
242	600500	中化国际	10,100	79,386.00	0.17
243	600839	四川长虹	27,100	78,861.00	0.17
244	002191	劲嘉股份	7,400	78,736.00	0.17
245	600528	中铁工业	9,700	78,570.00	0.17
246	000671	阳光城	15,100	78,520.00	0.17
247	600737	中粮糖业	7,800	78,078.00	0.17
248	002056	横店东磁	6,000	78,000.00	0.17
249	603883	老百姓	1,480	77,966.40	0.17

250	000898	鞍钢股份	17,500	77,875.00	0.17
251	002081	金螳螂	9,800	77,616.00	0.17
252	603927	中科软	1,800	77,310.00	0.17
253	000709	河钢股份	31,100	76,506.00	0.16
254	600598	北大荒	5,100	76,296.00	0.16
255	002124	天邦股份	10,860	76,128.60	0.16
256	600580	卧龙电驱	5,700	75,810.00	0.16
257	600728	佳都科技	10,200	75,582.00	0.16
258	300182	捷成股份	15,100	75,349.00	0.16
259	603198	迎驾贡酒	1,700	75,310.00	0.16
260	000729	燕京啤酒	10,400	75,296.00	0.16
261	000581	威孚高科	3,600	74,988.00	0.16
262	002242	九阳股份	2,300	74,727.00	0.16
263	600808	马钢股份	17,400	74,646.00	0.16
264	002203	海亮股份	7,000	74,480.00	0.16
265	000488	晨鸣纸业	9,100	74,074.00	0.16
266	002387	维信诺	7,100	74,053.00	0.16
267	002010	传化智联	9,600	74,016.00	0.16
268	000930	中粮科技	8,200	73,882.00	0.16
269	002281	光迅科技	3,000	73,800.00	0.16
270	300166	东方国信	5,900	72,924.00	0.16
271	600820	隧道股份	13,700	72,473.00	0.16
272	002745	木林森	5,400	72,360.00	0.16
273	000629	攀钢钒钛	31,400	71,906.00	0.15
274	002004	华邦健康	11,500	71,415.00	0.15
275	600755	厦门国贸	8,600	70,606.00	0.15
276	002563	森马服饰	5,900	70,505.00	0.15
277	002396	星网锐捷	3,300	70,455.00	0.15
278	002048	宁波华翔	3,600	70,200.00	0.15
279	600970	中材国际	7,600	69,692.00	0.15
280	300002	神州泰岳	14,300	69,355.00	0.15

281	600803	新奥股份	4,200	69,342.00	0.15
282	600022	山东钢铁	40,100	68,972.00	0.15
283	000598	兴蓉环境	13,200	68,772.00	0.15
284	603000	人民网	4,000	68,760.00	0.15
285	601106	中国一重	20,100	68,139.00	0.15
286	600398	海澜之家	9,400	68,056.00	0.15
287	600881	亚泰集团	23,700	67,545.00	0.15
288	600037	歌华有线	7,000	67,270.00	0.14
289	002925	盈趣科技	1,710	66,536.10	0.14
290	601456	国联证券	4,300	66,220.00	0.14
291	600811	东方集团	21,700	66,185.00	0.14
292	600348	华阳股份	8,900	66,038.00	0.14
293	002002	鸿达兴业	16,800	66,024.00	0.14
294	600039	四川路桥	10,500	65,835.00	0.14
295	000883	湖北能源	14,300	65,637.00	0.14
296	603885	吉祥航空	4,300	65,618.00	0.14
297	601880	辽港股份	38,200	65,322.00	0.14
298	000690	宝新能源	12,700	64,897.00	0.14
299	600597	光明乳业	4,500	64,845.00	0.14
300	600782	新钢股份	11,600	64,728.00	0.14
300	000778	新兴铸管	17,400	64,728.00	0.14
302	600645	中源协和	2,800	64,260.00	0.14
303	002867	周大生	3,250	64,252.50	0.14
304	601118	海南橡胶	12,600	64,134.00	0.14
305	000887	中鼎股份	5,300	64,024.00	0.14
306	600260	ST凯乐	7,200	63,936.00	0.14
307	603568	伟明环保	2,800	63,924.00	0.14
308	600908	无锡银行	11,000	63,800.00	0.14
309	600967	内蒙一机	6,300	63,756.00	0.14
310	002701	奥瑞金	12,400	63,736.00	0.14
311	600126	杭钢股份	12,400	63,612.00	0.14

312	002249	大洋电机	12,100	63,525.00	0.14
313	002183	怡亚通	11,000	63,030.00	0.14
314	002705	新宝股份	2,400	63,000.00	0.14
315	600410	华胜天成	8,100	62,856.00	0.13
316	002085	万丰奥威	11,200	62,720.00	0.13
317	600718	东软集团	6,400	62,592.00	0.13
318	600985	淮北矿业	5,100	62,271.00	0.13
319	600026	中远海能	10,100	62,216.00	0.13
320	601179	中国西电	15,100	62,212.00	0.13
321	000528	柳工	7,500	61,500.00	0.13
322	002110	三钢闽光	9,100	61,334.00	0.13
323	000877	天山股份	4,700	61,241.00	0.13
324	600167	联美控股	6,800	60,724.00	0.13
325	600446	金证股份	4,200	60,648.00	0.13
326	600572	康恩贝	13,600	60,384.00	0.13
327	002368	太极股份	3,000	60,180.00	0.13
328	000970	中科三环	6,300	60,165.00	0.13
329	601200	上海环境	5,000	59,850.00	0.13
330	600064	南京高科	6,400	59,456.00	0.13
331	000402	金融街	8,800	59,400.00	0.13
332	300072	三聚环保	10,300	59,122.00	0.13
333	600329	中新药业	2,100	58,989.00	0.13
334	002266	浙富控股	11,800	58,882.00	0.13
335	000990	诚志股份	4,600	58,558.00	0.13
336	002128	露天煤业	5,600	58,296.00	0.13
337	000089	深圳机场	7,500	58,275.00	0.13
338	601598	中国外运	11,500	58,075.00	0.12
339	603650	彤程新材	1,200	57,720.00	0.12
340	600517	国网英大	8,400	57,204.00	0.12
341	600158	中体产业	5,000	57,050.00	0.12
342	000400	许继电气	4,500	56,970.00	0.12

343	300026	红日药业	13,300	56,525.00	0.12
344	601718	际华集团	19,400	54,708.00	0.12
345	300376	易事特	6,800	54,672.00	0.12
345	000519	中兵红箭	5,100	54,672.00	0.12
347	003035	南网能源	5,500	54,670.00	0.12
348	601975	招商南油	25,500	54,570.00	0.12
349	600120	浙江东方	12,740	54,527.20	0.12
350	600195	中牧股份	4,500	53,820.00	0.12
351	600307	酒钢宏兴	23,100	53,592.00	0.12
352	002233	塔牌集团	5,200	53,456.00	0.11
353	000959	首钢股份	9,500	53,390.00	0.11
354	000685	中山公用	6,500	53,040.00	0.11
355	600507	方大特钢	7,800	52,884.00	0.11
356	601333	广深铁路	24,900	52,788.00	0.11
357	600376	首开股份	9,400	52,640.00	0.11
358	000090	天健集团	9,500	52,535.00	0.11
359	600435	北方导航	6,600	52,404.00	0.11
360	001914	招商积余	3,046	52,330.28	0.11
361	601000	唐山港	21,700	52,297.00	0.11
362	002440	闰土股份	5,900	52,215.00	0.11
363	002505	鹏都农牧	23,300	52,192.00	0.11
364	000559	万向钱潮	9,600	50,976.00	0.11
365	600804	鹏博士	10,500	50,820.00	0.11
366	002839	张家港行	9,200	50,048.00	0.11
367	600673	东阳光	11,100	49,839.00	0.11
368	603228	景旺电子	1,900	49,780.00	0.11
369	300133	华策影视	8,400	49,728.00	0.11
370	600373	中文传媒	5,000	49,300.00	0.11
371	600643	爱建集团	7,000	48,860.00	0.10
372	601860	紫金银行	13,300	48,279.00	0.10
373	000967	盈峰环境	7,000	48,090.00	0.10

374	601991	大唐发电	18,100	47,784.00	0.10
375	002155	湖南黄金	6,147	47,639.25	0.10
376	600582	天地科技	12,200	47,580.00	0.10
377	000758	中色股份	10,000	47,500.00	0.10
378	601608	中信重工	12,700	47,498.00	0.10
379	600056	中国医药	3,900	47,385.00	0.10
379	002038	双鹭药业	4,500	47,385.00	0.10
381	002936	郑州银行	12,900	47,343.00	0.10
382	600266	城建发展	9,900	46,926.00	0.10
383	000563	陕国投 A	14,500	46,690.00	0.10
384	601958	金钼股份	7,200	46,656.00	0.10
385	000681	视觉中国	3,600	46,548.00	0.10
386	600131	国网信通	3,500	46,340.00	0.10
387	605358	立昂微	400	46,232.00	0.10
388	002416	爱施德	4,600	46,138.00	0.10
389	600388	龙净环保	5,400	46,008.00	0.10
390	601098	中南传媒	5,200	45,864.00	0.10
391	600901	江苏租赁	8,800	45,760.00	0.10
392	600095	湘财股份	3,900	45,669.00	0.10
393	300113	顺网科技	3,500	45,290.00	0.10
394	600062	华润双鹤	3,800	45,258.00	0.10
395	600928	西安银行	9,700	45,202.00	0.10
396	300180	华峰超纤	9,100	45,045.00	0.10
397	002399	海普瑞	2,800	44,604.00	0.10
398	600959	江苏有线	14,600	44,530.00	0.10
399	600259	广晟有色	1,300	43,953.00	0.09
400	002458	益生股份	4,400	43,868.00	0.09
401	600649	城投控股	9,200	43,792.00	0.09
402	600094	大名城	11,600	43,732.00	0.09
403	000415	渤海租赁	18,000	43,560.00	0.09
404	300257	开山股份	3,000	43,110.00	0.09

405	003022	联泓新科	1,400	42,980.00	0.09
406	600764	中国海防	1,500	42,450.00	0.09
407	600006	东风汽车	5,800	42,340.00	0.09
408	600556	天下秀	4,000	42,240.00	0.09
409	600776	东方通信	3,400	42,160.00	0.09
410	601611	中国核建	5,800	41,876.00	0.09
411	600717	天津港	10,660	41,787.20	0.09
412	600546	山煤国际	5,800	41,644.00	0.09
413	600648	外高桥	2,800	41,384.00	0.09
414	002317	众生药业	4,800	41,328.00	0.09
415	002985	北摩高科	422	41,145.00	0.09
416	600633	浙数文化	5,700	40,926.00	0.09
417	000717	韶钢松山	8,900	40,851.00	0.09
418	300741	华宝股份	800	40,576.00	0.09
419	002434	万里扬	5,000	40,550.00	0.09
420	600863	内蒙华电	17,100	39,843.00	0.09
421	002375	亚厦股份	5,000	39,600.00	0.09
422	600021	上海电力	5,700	39,387.00	0.08
423	601928	凤凰传媒	5,500	39,270.00	0.08
424	000078	海王生物	12,000	39,120.00	0.08
425	600835	上海机电	2,400	39,000.00	0.08
426	002244	滨江集团	9,300	38,967.00	0.08
427	000062	深圳华强	2,300	38,893.00	0.08
428	600968	海油发展	15,000	38,850.00	0.08
429	000501	鄂武商 A	3,300	38,610.00	0.08
430	601828	美凯龙	3,200	38,400.00	0.08
431	600729	重庆百货	1,383	37,963.35	0.08
432	000028	国药一致	1,000	37,840.00	0.08
433	002424	贵州百灵	5,100	37,536.00	0.08
434	600623	华谊集团	4,200	37,002.00	0.08
435	600377	宁沪高速	3,600	35,136.00	0.08

436	600339	中油工程	12,200	34,648.00	0.07
437	600312	平高电气	5,900	34,456.00	0.07
438	002468	申通快递	4,500	34,290.00	0.07
439	600639	浦东金桥	2,500	34,125.00	0.07
440	600787	中储股份	6,400	34,112.00	0.07
441	600566	济川药业	1,900	34,010.00	0.07
442	002583	海能达	6,700	33,768.00	0.07
443	601969	海南矿业	2,900	33,727.00	0.07
444	000826	启迪环境	6,300	33,705.00	0.07
445	600823	世茂股份	8,300	33,532.00	0.07
446	000031	大悦城	9,300	33,480.00	0.07
447	000869	张裕 A	900	33,426.00	0.07
448	600466	蓝光发展	11,200	33,040.00	0.07
449	601778	晶科科技	6,000	32,760.00	0.07
450	002815	崇达技术	2,600	32,448.00	0.07
451	603888	新华网	1,500	31,755.00	0.07
452	603708	家家悦	1,800	31,266.00	0.07
453	603355	莱克电气	500	31,115.00	0.07
454	002532	天山铝业	3,700	31,043.00	0.07
455	601298	青岛港	5,000	30,900.00	0.07
456	000156	华数传媒	4,000	30,840.00	0.07
457	002635	安洁科技	2,100	30,723.00	0.07
458	000937	冀中能源	7,700	30,261.00	0.06
459	603786	科博达	400	30,200.00	0.06
460	603317	天味食品	1,020	30,018.60	0.06
461	000813	德展健康	6,600	29,964.00	0.06
462	002948	青岛银行	6,000	29,820.00	0.06
463	601228	广州港	9,200	29,256.00	0.06
464	002302	西部建设	3,700	29,230.00	0.06
465	002901	大博医疗	400	29,156.00	0.06
466	600350	山东高速	4,700	28,905.00	0.06

467	603377	东方时尚	2,700	28,863.00	0.06
468	000553	安道麦A	3,100	28,737.00	0.06
469	300010	豆神教育	5,000	28,350.00	0.06
470	601139	深圳燃气	4,300	28,208.00	0.06
471	600640	号百控股	2,300	28,037.00	0.06
472	000061	农产品	5,000	27,600.00	0.06
473	600871	石化油服	13,800	27,186.00	0.06
474	001872	招商港口	1,600	27,072.00	0.06
475	000046	泛海控股	11,300	25,990.00	0.06
476	601568	北元集团	3,000	25,680.00	0.06
477	603515	欧普照明	1,000	25,670.00	0.06
478	603056	德邦股份	2,300	25,277.00	0.05
479	603379	三美股份	1,300	24,323.00	0.05
480	002653	海思科	1,100	23,672.00	0.05
481	002419	天虹股份	3,500	22,960.00	0.05
482	600657	信达地产	6,300	21,924.00	0.05
483	601512	中新集团	2,200	21,912.00	0.05
484	601003	柳钢股份	3,700	21,830.00	0.05
485	000537	广宇发展	4,100	21,443.00	0.05
486	603983	丸美股份	400	20,844.00	0.04
487	601801	皖新传媒	4,400	20,768.00	0.04
488	601187	厦门银行	2,100	19,908.00	0.04
489	601869	长飞光纤	800	19,488.00	0.04
490	600917	重庆燃气	2,300	18,791.00	0.04
491	002946	新乳业	1,200	18,180.00	0.04
492	603719	良品铺子	400	18,000.00	0.04
493	603868	飞科电器	400	16,824.00	0.04
494	000732	泰禾集团	7,200	15,552.00	0.03
495	600903	贵州燃气	1,600	14,720.00	0.03
496	002818	富森美	1,000	12,060.00	0.03
497	002423	中粮资本	1,300	11,765.00	0.03

498	603256	宏和科技	1,200	10,968.00	0.02
499	600956	新天绿能	900	10,539.00	0.02
500	601068	中铝国际	2,300	7,935.00	0.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票组合。

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	603444	吉比特	1,255,190.00	1.69
2	603290	斯达半导	696,596.00	0.94
3	603345	安井食品	581,412.00	0.78
4	603605	珀莱雅	545,294.00	0.73
5	601799	星宇股份	503,010.00	0.68
6	603737	三棵树	477,189.00	0.64
7	000799	酒鬼酒	444,620.00	0.60
8	600486	扬农化工	309,943.00	0.42
9	603893	瑞芯微	309,833.00	0.42
10	600563	法拉电子	286,161.00	0.38
11	603882	金域医学	281,754.00	0.38
12	601966	玲珑轮胎	274,931.38	0.37
13	002985	北摩高科	274,660.24	0.37
14	603816	顾家家居	244,426.00	0.33
15	603486	科沃斯	238,307.00	0.32
16	601636	旗滨集团	232,799.00	0.31
17	600426	华鲁恒升	225,848.00	0.30
18	600143	金发科技	223,503.00	0.30
19	300037	新宙邦	219,541.00	0.30
20	300253	卫宁健康	218,996.42	0.29

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	603444	吉比特	1,295,352.00	1.74
2	600426	华鲁恒升	867,736.40	1.17
3	603345	安井食品	803,133.00	1.08
4	300274	阳光电源	799,138.00	1.08
5	601799	星宇股份	771,331.92	1.04
6	603290	斯达半导	741,262.00	1.00
7	600143	金发科技	695,285.00	0.94
8	600132	重庆啤酒	680,306.00	0.92
9	603882	金域医学	675,417.00	0.91
10	600079	人福医药	549,559.00	0.74
11	603605	珀莱雅	546,526.00	0.74
12	601966	玲珑轮胎	509,877.00	0.69
13	603806	福斯特	495,265.20	0.67
14	603737	三棵树	490,317.00	0.66
15	300012	华测检测	439,668.00	0.59
16	600089	特变电工	439,253.00	0.59
17	600739	辽宁成大	412,056.00	0.55
18	600486	扬农化工	404,300.00	0.54
19	603816	顾家家居	393,877.00	0.53
20	300496	中科创达	384,306.00	0.52

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	35,732,696.17
卖出股票收入（成交）总额	45,218,454.93

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2109	中证500股指期货2109合约	1	1,333,400.00	42,960.00	-
公允价值变动总额合计（元）					42,960.00
股指期货投资本期收益（元）					225,825.25
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-15,280.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。根据基金合同规定，本基金可投资于以标的指数为基础资产的股指期货，并在相关法律法规的限制下，

起到配合基金日常投资管理需要，降低交易成本和跟踪误差的作用。报告期内，本基金严格遵守既定投资政策和投资目的，进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

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。

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	225,435.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	149.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	225,585.17

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基	流通受限情况说明
----	------	------	----------	----	----------

			允价值	金资 产净 值比 例 (%)	
1	600460	士兰微	321,195.00	0.69	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

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
562	75,345.69	24,542,238.00	57.958 8%	17,802,037.00	42.041 2%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	永赢资产管理有限公司	22,999,908.00	54.32%
2	中信建投证券股份有限公司	1,542,230.00	3.64%
3	李翠英	995,019.00	2.35%
4	何新平	800,069.00	1.89%
5	杨清萍	680,105.00	1.61%
6	程晓东	500,038.00	1.18%
7	张丽怡	399,011.00	0.94%
8	张红	300,020.00	0.71%

9	靳玮	300,008.00	0.71%
10	刘玉玲	300,003.00	0.71%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年07月14日)基金份额总额	342,344,275.00
本报告期期初基金份额总额	72,344,275.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	54,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	42,344,275.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
广发证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	42,953,001.79	53.15%	31,409.05	53.46%	-
五矿证券	2	-	-	-	-	新增
浙商证券	2	-	-	-	-	-

中信 证券	2	-	-	-	-	新增
海通 证券	3	37,865,278.94	46.85%	27,339.90	46.54%	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

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	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-22
2	永赢基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-26
3	永赢基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-06

4	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	2021-03-08
5	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-27
6	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新(2021年1号)	中国证监会规定媒介	2021-03-31
7	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2021年第1号)	中国证监会规定媒介	2021-03-31
8	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021-03-31
9	永赢基金管理有限公司关于旗下指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-31
10	关于永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-06
11	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
12	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2021-06-17

§ 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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序	持有基金份额比	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

类别	号	例达到或者超过 20%的时间区间					
机构	1	20210330 - 20210630	0.00	22,999,908.00	0.00	22,999,908.00	54.32%
产品特有风险							
本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。							

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. 中国证监会核准永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
2. 《永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新（如有）；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

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21世纪大厦21、22、27层

12.3 查阅方式

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

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司
二〇二一年八月二十八日