

永赢中证全指医疗器械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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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04月22日（基金合同生效日）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	9
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	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	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末上市基金前十名持有人	58

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	医疗器械ETF
场内简称	医疗器械
基金主代码	159883
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年04月22日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	192,037,843.00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	2021-04-30

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在2%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内。 1、股票投资策略 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。

(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。

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通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。 7、存托凭证投资策略 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。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中证全指医疗器械指数收益率
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧	张燕
	联系电话	021-51690145	0755-83199084
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-805-8888	95555
传真		021-51690177	0755-83195201
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		马宇晖	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道210号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04月22日(基金合同生效日) - 2021年06月30日)
本期已实现收益	3,961,058.66
本期利润	15,187,638.27
加权平均基金份额本期利润	0.0762
本期加权平均净值利润率	7.54%
本期基金份额净值增长率	6.20%
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	3,960,088.60
期末可供分配基金份额利润	0.0206
期末基金资产净值	203,940,151.24
期末基金份额净值	1.0620

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	6.20%

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。

4、本基金合同生效日为2021年4月22日，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

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	1.73%	1.65%	0.88%	1.69%	0.85%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	6.20%	1.54%	12.44%	1.68%	-6.24%	-0.14%

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：中证全指医疗器械指数收益率。

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

永赢中证全指医疗器械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2021年4月22日，截至本报告期末本基金合同生效未满1年；
2、本基金建仓期为本基金合同生效日起6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§ 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	2021-04-22	-	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	2021-05-07	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、《永赢中证全指医疗器械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、取信于社会的原則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4月22日医疗器械ETF成立以来，市场主线由再通胀交易升温向高景气成长切换，大盘整体虽呈现宽幅震荡，但板块间轮动加速。电气设备、电子和化工领涨，农林牧渔、房地产和家电领跌，其中医药生物整体涨幅位居前列，市场在微观流动性充沛、双百行情提振下，持续追逐具有业绩确定性及未来高景气的赛道行业。年中成分股调整，中证医疗器械指数纳入中上游医美龙头企业，在国产创新驱动基础上新增消费升级驱动，上市以来跟踪指数涨幅为5.2%。

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

截至报告期末医疗器械基金份额净值为1.0620元，本报告期内，基金份额净值增长率为6.20%，同期业绩比较基准收益率为12.44%。

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。

医疗器械发展展望，后疫情时代下医疗设备在医疗新基建、诊疗恢复和国产替代加速下，需求持续释放。高值耗材第二轮骨科国采较冠脉支架集采较为温和，市场学习效应较强，后期重点关注创新器械申报及审批进展。IVD方面，新冠疫情点状反复，阶段性检测需求仍在，但后期重点关注创新产品迭代下的国产和出海机遇。医美方面，受益于“颜值经济”崛起，互联网效应叠加悦己需求，医美渗透率快速提升。尽管下游服务机构面临一定的监管风险，但对中上游研发能力较强且拥有三类注册证的医美企业，具有较强的核心竞争力。

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，符合相关法规及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：永赢中证全指医疗器械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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	5,599,146.09
结算备付金		929,951.77
存出保证金		65,778.31
交易性金融资产	6.4.7.2	199,388,124.81

其中：股票投资		199,388,124.81
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		240,743.29
应收利息	6.4.7.5	788.33
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		206,224,532.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30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		1,811,288.06
应付赎回款		—
应付管理人报酬		84,856.05
应付托管费		16,971.23
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	318,903.92
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—

其他负债	6.4.7.8	52,362.10
负债合计		2,284,381.36
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	192,037,843.00
未分配利润	6.4.7.10	11,902,308.24
所有者权益合计		203,940,151.24
负债和所有者权益总计		206,224,532.60

注：（1）报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.0620元，基金份额总额192,037,843.00份。

（2）本基金基金合同于2021年4月22日生效。

6.2 利润表

会计主体：永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年04月22日（基金合同 生效日）至2021年06月30 日
一、收入		15,930,220.84
1. 利息收入		45,154.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,711.48
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		18,443.47
证券出借利息收入		—
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,524,967.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,770,605.63
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	—

贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	754,362.33
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,226,579.61
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	133,518.32
减：二、费用		742,582.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	189,426.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	37,885.44
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	461,409.76
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	53,860.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,187,638.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,187,638.27

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年04月22日（基金合同生效日）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）	251,037,843.00	-	251,037,843.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动	-	15,187,638.27	15,187,638.27

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)	-59,000,000.00	-3,285,330.03	-62,285,330.03
其中: 1. 基金申购款	144,000,000.00	240,776.98	144,240,776.98
2. 基金赎回款	-203,000,000.00	-3,526,107.01	-206,526,107.01
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)	192,037,843.00	11,902,308.24	203,940,151.24

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

永赢中证全指医疗器械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[2021]714号《关于准予永赢中证全指医疗器械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自2021年4月6日至2021年4月16日止期间向社会公开发行募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2021)验字第61090672_B07号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2021年4月22日生效。本基金为交易型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币251,025,310.00元,其中以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币250,947,900.00元,折合250,947,900.00份基金份额;以股票认购方式按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币77,410.00元,折合77,410.00份基金份额;有效认购资金在首次募集期间产生的利

息为人民币13,155.83元，其中通过管理人进行的网下现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息为人民币2,519.96元，折合基金份额2,519.00份，剩余人民币0.96元计入基金财产，不折算为投资者基金份额；网上现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息人民币10,635.87元，折合基金份额10,014.00份，剩余人民币621.87元计入基金财产，不折算为投资者基金份额。与首次募集相关的资产总额为人民币251,038,465.83元，折合251,037,843.00份基金份额。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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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（包括主板、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业务。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%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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：中证全指医疗器械指数收益率。

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（以下统称“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4月22日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系自2021年4月22日（基金合同生效日）起至2021年6月30日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 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的股票、债券等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

投资者申购本基金时交付的股票于申购日计入股票投资，股票投资成本以申购日该股票收盘价确认的价值入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

投资者赎回本基金时交付的股票于赎回日确认股票差价收入，交付的股票的成本于赎回日采用加权平均法结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认；

国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(6) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(7) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 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。

本基金持有的金融工具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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）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；

(13) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入。

(14) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为现金分红；

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

(4) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

(5) 若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(6) 法律法规、监管机构、登记机构、证券交易所另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 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。

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事业费附加的单位外）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	5,599,146.09
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	5,599,146.09

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	188,161,545.20	199,388,124.81	11,226,579.61
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	188,161,545.20	199,388,124.81	11,226,579.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 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	505.64
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	253.09
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	29.60
合计	788.33

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	318,903.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	318,903.92

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	52,362.10
合计	52,362.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	251,037,843.00	251,037,843.00
本期申购	144,000,000.00	144,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-203,000,000.00	-203,000,000.00
本期末	192,037,843.00	192,037,843.00

注：本基金基金合同于2021年4月22日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币251,025,310.00元，其中以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除

认购费后的净认购金额为人民币250,947,900.00元，折合250,947,900.00份基金份额；以股票认购方式按认购期最后一日的均价计算的金额为人民币77,410.00元，折合77,410.00份基金份额；有效认购资金在首次募集期间产生的利息为人民币13,155.83元，其中通过管理人进行的网下现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息为人民币2,519.96元，折合基金份额2,519.00份，剩余人民币0.96元计入基金财产，不折算为投资者基金份额；网上现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息人民币10,635.87元，折合基金份额10,014.00份，剩余人民币621.87元计入基金财产，不折算为投资者基金份额。与首次募集相关的资产总额为人民币251,038,465.83元，折合251,037,843.00份基金份额。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,961,058.66	11,226,579.61	15,187,638.27
本期基金份额交易产生的变动数	-970.06	-3,284,359.97	-3,285,330.03
其中：基金申购款	1,238,727.81	-997,950.83	240,776.98
基金赎回款	-1,239,697.87	-2,286,409.14	-3,526,107.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,960,088.60	7,942,219.64	11,902,308.24

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日
活期存款利息收入	21,968.13
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	4,590.70
其他	152.65
合计	26,711.48

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04月22日（基金合同生效日）至2021年 06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,586,256.14
股票投资收益——赎回差价收入	2,184,349.49
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	3,770,605.63

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04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30 日
卖出股票成交总额	103,039,104.85
减：卖出股票成本总额	101,452,848.71
买卖股票差价收入	1,586,256.14

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04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30 日
赎回基金份额对价总额	206,526,107.01
减：现金支付赎回款总额	31,102,165.01
减：赎回股票成本总额	173,239,592.51
赎回差价收入	2,184,349.49

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 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 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

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	754,362.33
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	754,362.33

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04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	11,226,579.61
——股票投资	11,226,579.61
——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	11,226,579.61

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日
基金赎回费收入	—
ETF基金替代损益	132,895.49

其他	622.83
合计	133,518.32

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日
交易所市场交易费用	461,409.76
银行间市场交易费用	—
合计	461,409.76

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日
审计费用	19,291.30
信息披露费	33,070.80
证券出借违约金	—
汇划手续费	1,498.28
合计	53,860.38

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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04月22日（基金合同生效日）至2021年06 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	189,426.99
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0.5%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04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	37,885.44

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.1%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	
	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	77,001,497.00	40.097%

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04月22日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	5,599,146.09	21,968.13

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
3010	申菱	2021	2022	新股	8.29	8.29	782	6,48	6,48	-

18	环境	-06- 28	-01- 07	限售				2.78	2.78	
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2021 -07- 07	认购 新发 证券	8.29	8.29	7,029	58,2 70.4 1	58,2 70.4 1	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2021 -07- 06	认购 新发 证券	10.6 4	10.6 4	3,789	40,3 14.9 6	40,3 14.9 6	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	新股 限售	10.6 4	10.6 4	421	4,47 9.44	4,47 9.44	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	新股 限售	9.46	9.46	290	2,74 3.40	2,74 3.40	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2021 -07- 06	认购 新发 证券	9.46	9.46	2,609	24,6 81.1 4	24,6 81.1 4	-
3010 15	百洋 医药	2021 -06- 22	2021 -12- 30	新股 限售	7.64	38.8 3	405	3,09 4.20	15,7 26.1 5	-
3010 09	可靠 股份	2021 -06- 08	2021 -12- 17	新股 限售	12.5 4	27.8 9	489	6,13 2.06	13,6 38.2 1	-
3010 16	雷尔 伟	2021 -06- 23	2021 -12- 30	新股 限售	13.7 5	32.9 8	275	3,78 1.25	9,06 9.50	-
3010 04	嘉益 股份	2021 -06- 18	2021 -12- 27	新股 限售	7.81	21.9 4	312	2,43 6.72	6,84 5.28	-
3010 11	华立 科技	2021 -06- 09	2021 -12- 17	新股 限售	14.2 0	33.8 4	175	2,48 5.00	5,92 2.00	-
3010	德迈	2021	2021	新股	5.29	14.4	303	1,60	4,37	-

07	仕	-06-04	-12-16	限售		4		2.87	5.32	
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末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

- 1、本期末，本基金未持有短期债券投资；
- 2、本基金于2021年4月22日成立，无上年度末数据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

- 1、本期末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券；
- 2、本基金于2021年4月22日成立，无上年度末数据。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

- 1、本期末，本基金未持有短期同业存单投资；
- 2、本基金于2021年4月22日成立，无上年度末数据。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

- 1、本期末，本基金未持有长期债券投资；
- 2、本基金于2021年4月22日成立，无上年度末数据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

- 1、本期末，本基金未持有长期资产支持证券投资；
- 2、本基金于2021年4月22日成立，无上年度末数据。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

- 1、本期末，本基金未持有长期同业存单投资；
- 2、本基金于2021年4月22日成立，无上年度末数据。

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 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,599,146.09	-	-	-	-	-	5,599,146.09
结算备付金	929,951.77	-	-	-	-	-	929,951.77
存出保证金	65,778.31	-	-	-	-	-	65,778.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	199,388,124.81	199,388,124.81
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	240,743.29	240,743.29
应收利息	-	-	-	-	-	788.33	788.33
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,594,876.17	-	-	-	-	199,629,656.43	206,224,532.60
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	-	-	-	-	-	1,811,288.06	1,811,288.06
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	84,856.05	84,856.05
应付托管费	-	-	-	-	-	16,971.23	16,971.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	318,903.92	318,903.92
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	52,362.10	52,362.10
负债总计	-	-	-	-	-	2,284,381.36	2,284,381.36
利率敏感度缺口	6,594,876.17	-	-	-	-	197,345,275.07	203,940,151.24

注：本基金于2021年4月22日成立，无上年度末数据；

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

- 1、本报告期末，本基金未持有债券，无重大利率风险；
- 2、本基金于2021年4月22日成立，无上年度末数据。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	199,388,124.81	97.77
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	199,388,124.81	97.77

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
	业绩比较基准增加1%	1,757,776.84
	业绩比较基准减少1%	-1,757,776.84

注：本基金于2021年4月22日成立，无上年度末数据。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199,187,613.04元，属于第二层次的余额为人民币123,266.51元，属于第三层次的余额为人民币77,245.26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：

本期变动人民币77,245.26元，本期末人民币77,245.26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	199,388,124.81	96.68
	其中：股票	199,388,124.81	96.68
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	6,529,097.86	3.17
8	其他各项资产	307,309.93	0.15
9	合计	206,224,532.60	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	199,174,054.62	97.66
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	199,174,054.62	97.66

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

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	198,344.04	0.10
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	15,726.15	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	214,070.19	0.10

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

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	300760	迈瑞医疗	59,900	28,754,995.00	14.10
2	300595	欧普康视	150,438	15,577,854.90	7.64
3	300896	爱美客	19,200	15,146,496.00	7.43
4	300003	乐普医疗	372,000	11,948,640.00	5.86
5	300529	健帆生物	119,300	10,302,748.00	5.05
6	300677	英科医疗	64,900	8,099,520.00	3.97
7	002223	鱼跃医疗	206,900	7,889,097.00	3.87
8	002030	达安基因	290,300	6,165,972.00	3.02
9	688363	华熙生物	19,600	5,446,056.00	2.67
10	603392	万泰生物	19,800	5,131,764.00	2.52

11	300482	万孚生物	79,100	5,116,979.00	2.51
12	300463	迈克生物	115,100	4,844,559.00	2.38
13	300685	艾德生物	46,533	4,843,154.64	2.37
14	688016	心脉医疗	9,356	4,253,331.16	2.09
15	688139	海尔生物	37,400	3,930,740.00	1.93
16	603658	安图生物	51,400	3,894,578.00	1.91
17	002382	蓝帆医疗	185,000	3,857,250.00	1.89
18	300298	三诺生物	100,600	3,150,792.00	1.54
19	300326	凯利泰	213,800	2,905,542.00	1.42
20	688029	南微医学	9,204	2,868,794.76	1.41
21	688298	东方生物	11,700	2,545,920.00	1.25
22	600587	新华医疗	96,000	2,174,400.00	1.07
23	603987	康德莱	78,400	2,038,400.00	1.00
24	300639	凯普生物	61,036	2,014,798.36	0.99
25	688366	昊海生科	9,600	2,009,280.00	0.99
26	688198	佰仁医疗	8,500	1,938,000.00	0.95
27	688399	硕世生物	11,400	1,922,040.00	0.94
28	300358	楚天科技	100,700	1,884,097.00	0.92
29	600055	万东医疗	111,500	1,867,625.00	0.92
30	300406	九强生物	86,100	1,698,753.00	0.83
31	300642	透景生命	18,800	1,613,228.00	0.79
32	300633	开立医疗	46,700	1,474,786.00	0.72
33	603387	基蛋生物	65,380	1,469,742.40	0.72
34	603301	振德医疗	33,100	1,453,752.00	0.71
35	300832	新产业	23,570	1,451,912.00	0.71
36	300653	正海生物	17,600	1,378,080.00	0.68
37	300206	理邦仪器	85,000	1,351,500.00	0.66
38	300238	冠昊生物	63,200	1,282,328.00	0.63
39	300453	三鑫医疗	82,000	1,276,740.00	0.63
40	300273	和佳医疗	186,700	1,200,481.00	0.59
41	300439	美康生物	56,400	1,088,520.00	0.53

42	605369	拱东医疗	9,000	1,035,180.00	0.51
43	002950	奥美医疗	55,900	925,704.00	0.45
44	002901	大博医疗	12,600	918,414.00	0.45
45	002551	尚荣医疗	169,200	915,372.00	0.45
46	002932	明德生物	9,300	907,401.00	0.44
47	300869	康泰医学	12,400	878,168.00	0.43
48	300396	迪瑞医疗	41,000	854,030.00	0.42
49	688085	三友医疗	16,196	706,631.48	0.35
50	603222	济民医疗	40,400	654,480.00	0.32
51	300246	宝莱特	29,400	571,536.00	0.28
52	300314	戴维医疗	33,600	537,936.00	0.26
53	688108	赛诺医疗	47,468	519,299.92	0.25
54	603976	正川股份	12,800	486,656.00	0.24

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

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	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
2	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
3	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
4	301015	百洋医药	405	15,726.15	0.01
5	301009	可靠股份	489	13,638.21	0.01
6	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
7	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
8	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
9	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
10	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
11	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
12	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300760	迈瑞医疗	43,067,681.96	21.12
2	300003	乐普医疗	25,552,882.99	12.53
3	300529	健帆生物	24,440,256.73	11.98
4	300595	欧普康视	22,492,426.87	11.03
5	300677	英科医疗	22,115,518.20	10.84
6	300896	爱美客	13,478,339.00	6.61
7	300482	万孚生物	13,079,425.69	6.41
8	002223	鱼跃医疗	11,630,234.39	5.70
9	002382	蓝帆医疗	8,953,060.26	4.39
10	688029	南微医学	7,911,089.04	3.88
11	002030	达安基因	7,133,591.31	3.50
12	688016	心脉医疗	7,071,486.31	3.47
13	688363	华熙生物	6,813,215.97	3.34
14	300298	三诺生物	6,454,020.62	3.16
15	603392	万泰生物	6,094,834.00	2.99
16	603301	振德医疗	5,794,172.86	2.84
17	603987	康德莱	5,711,175.60	2.80
18	300463	迈克生物	5,459,545.00	2.68
19	600587	新华医疗	5,235,350.81	2.57
20	603658	安图生物	5,101,373.70	2.50
21	300326	凯利泰	5,024,529.00	2.46
22	300685	艾德生物	4,550,632.14	2.23
23	688139	海尔生物	4,482,820.83	2.20
24	600055	万东医疗	4,190,897.30	2.05

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300003	乐普医疗	8,085,121.34	3.96
2	300529	健帆生物	7,279,696.40	3.57
3	300760	迈瑞医疗	6,483,723.00	3.18
4	300595	欧普康视	6,395,539.00	3.14
5	688029	南微医学	6,356,312.10	3.12
6	603987	康德莱	4,434,015.00	2.17
7	300677	英科医疗	4,069,048.59	2.00
8	600587	新华医疗	3,982,711.00	1.95
9	603301	振德医疗	3,897,350.84	1.91
10	688016	心脉医疗	3,871,522.70	1.90
11	300482	万孚生物	3,837,640.50	1.88
12	002223	鱼跃医疗	3,270,251.00	1.60
13	600055	万东医疗	2,893,771.00	1.42
14	688363	华熙生物	2,549,146.92	1.25
15	002382	蓝帆医疗	2,474,975.00	1.21
16	688198	佰仁医疗	1,965,910.38	0.96
17	300326	凯利泰	1,913,132.00	0.94
18	688366	昊海生科	1,733,467.99	0.85
19	002950	奥美医疗	1,419,841.50	0.70
20	603309	维力医疗	1,377,132.00	0.68

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	342,327,911.50
卖出股票收入（成交）总额	103,039,104.85

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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	65,778.31
2	应收证券清算款	240,743.29

3	应收股利	—
4	应收利息	788.33
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	307,309.93

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301018	申菱环境	64,753.19	0.03	认购新发证券
2	301020	密封科技	44,794.40	0.02	认购新发证券
3	301021	英诺激光	27,424.54	0.01	认购新发证券
4	301015	百洋医药	15,726.15	0.01	新股限售
5	301009	可靠股份	13,638.21	0.01	新股限售

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
6,179	31,079.11	89,883,254.00	46.8050%	102,154,589.00	53.1950%

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	77,001,497.00	40.10%
2	中信建投证券股份有限公司	3,169,360.00	1.65%
3	越亮传奇科技股份有限公司	2,838,408.00	1.48%
4	张爱芹	2,702,900.00	1.41%
5	广发证券股份有限公司	2,491,034.00	1.30%
6	方正证券股份有限公司	1,911,903.00	1.00%
7	程水根	1,441,300.00	0.75%
8	赵和花	1,103,600.00	0.57%
9	丁健	1,100,000.00	0.57%
10	冯伟春	1,000,000.00	0.52%

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	25,800.00	0.01%

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、基金投资和研究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(2021年04月22日)基金份额总额	251,037,843.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	144,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	203,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	192,037,843.00

§ 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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	
长江证券	2	45,591,971.71	10.25%	33,340.45	10.45%	新增
方正证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	2	330,531,909.40	74.29%	236,218.96	74.07%	新增
招商证券	2	927,187.91	0.21%	678.06	0.21%	—
甬兴证券	2	—	—	—	—	新增
开源证券	3	67,871,827.35	15.25%	48,666.45	15.26%	—

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
长江证券	—	—	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—	—	—
民生证	—	—	—	—	—	—	—	—

券								
兴业证 券	-	-	308,900,00 0.00	100.0 0%	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证 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
2	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
3	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
4	永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2021-03-30
5	永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2021-03-30
6	永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2021-03-30
7	永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2021-03-30
8	永赢中证全指医疗器械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	2021-03-30
9	永赢基金管理有限公司关于永赢中证全指医疗器械交易型开放式	中国证监会规定媒介	2021-04-15

	指数证券投资基金提前结束募集的公告		
10	永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2021-04-23
11	永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-04-27
12	永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会规定媒介	2021-04-27
13	永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证监会规定媒介	2021-04-27
14	永赢基金管理有限公司关于永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-29
15	永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-04-30
16	关于永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-30
17	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	20210422 - 20210630	77,001,497.00	0.00	0.00	77,001,497.00	40.10%
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全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
2. 《永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢中证全指医疗器械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