

永赢智能领先混合型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	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	17
§6 中期财务会计报告(未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
§9 开放式基金份额变动	64
§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
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	永赢智能领先混合型证券投资基金	
基金简称	永赢智能领先	
基金主代码	006266	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年03月26日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	480,460,292.58份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢智能领先A	永赢智能领先C
下属分级基金的交易代码	006266	006269
报告期末下属分级基金的份额总额	374,777,718.92份	105,682,573.66份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于智能领先主题相关上市公司股票，在控制风险的前提下，力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	自2017年以来，国家政府报告中已连续两年提及人工智能概念，并将推动人工智能发展的方向逐步转为技术和产业的融合，以达成加快人工智能深度应用，“智能+”的理念可以说正延伸至人民生活的各个行业中。 本基金所指的“智能领先”涵盖了现今社会中大部分“智能”领域，主要是指将先进制造技术、信息技术与人工智能等结合，使得企业能创造、开发、提供智能化的产品、装备或服务，从而推进制造行业生产过程智能化，全面提升企业研发、生产、管理和服务的智能化水平，最终服务提高百姓生活品质，为人民生活提供便捷性、舒适性及改善性的行业、企业或者主题。

从具体运用的角度来说，本基金所指的智能领先包括以下投资主题：智能家居、网络安全、5G、智能安防、智能汽车、智能交通、智能物流、智能电力、智能娱乐、智能穿戴、商业智能、智能建筑、智慧医疗、智慧城市、智慧能源、智能建筑等。

1、资产配置策略

本基金通过对宏观经济环境的研究、结合国家财政政策、货币政策形势以及证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。

2、股票投资策略

本基金在积极进行主题、行业配置的基础上，通过定量筛选和定性分析相结合的方式考察和筛选具有综合性比较优势的品种。具体而言，首先根据定量指标进行初选，主要依据盈利能力、成长性、现金流状况、偿债能力、营运能力等。在定量初选的基础上，定性方面考虑公司与资产市场的利益是否一致；公司的发展是否得到政策的鼓励；公司的发展布局 and 战略的合理性和可行性；公司管理层的领导能力和执行能力；公司在资源、技术、品牌方面的核心竞争力；公司企业文化、治理结构等。最后由基金经理结合定量和定性研究以及实地调研，筛选出行业增长空间广阔、发展布局合理、基本面健康、最具比较优势的个股作为本基金的核心投资标的，进行重点投资。

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。

3、固定收益投资策略

本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。

4、中小企业私募债投资策略

本基金对中小企业私募债的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面，根据宏观经济运行状况的分析和预判，灵活调整组合的久期。信用风险控制方面，对个券信用资质进行详尽的分析，对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量，尽可能地缩小信用风险暴露。流动性控制方面，要根据中小企业私募债整体的流动性情况来调整持仓规模，在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

5、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（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）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。

6、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

7、股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

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，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。
业绩比较基准	中证800指数收益率*80%+中国债券总指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中风险和中等预期收益产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		永赢基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧	陆志俊
	联系电话	021-51690145	95559
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-805-8888	95559
传真		021-51690177	021-62701216
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		马宇晖	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	永赢基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	永赢智能领先A	永赢智能领先C
本期已实现收益	87,420,033.58	25,681,157.59
本期利润	178,470,114.83	48,694,947.84
加权平均基金份额本期利润	0.4231	0.3510
本期加权平均净值利润率	17.30%	14.48%
本期基金份额净值增长率	20.44%	20.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	永赢智能领先A	永赢智能领先C
期末可供分配利润	461,706,853.02	128,648,137.55
期末可供分配基金份额利润	1.2319	1.2173
期末基金资产净值	1,092,609,831.47	306,155,733.61
期末基金份额净值	2.9154	2.8969
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	永赢智能领先A	永赢智能领先C
基金份额累计净值增长率	191.54%	189.69%

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

永赢智能领先A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	10.42%	1.70%	-1.02%	0.62%	11.44%	1.08%
过去三个月	32.73%	1.69%	4.05%	0.71%	28.68%	0.98%
过去六个月	20.44%	2.14%	1.93%	0.97%	18.51%	1.17%
过去一年	111.12%	2.00%	19.07%	1.02%	92.05%	0.98%
自基金合同 生效起至今	191.54%	1.73%	30.56%	1.04%	160.9 8%	0.69%

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 800 指数收益率*80%+中国债券总指数收益率*20%。

永赢智能领先C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	10.39%	1.70%	-1.02%	0.62%	11.41%	1.08%
过去三个月	32.65%	1.69%	4.05%	0.71%	28.60%	0.98%
过去六个月	20.32%	2.14%	1.93%	0.97%	18.39%	1.17%
过去一年	110.71%	2.00%	19.07%	1.02%	91.64%	0.98%
自基金合同	189.69%	1.73%	30.56%	1.04%	159.1	0.69%

生效起至今					3%	
-------	--	--	--	--	----	--

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 800 指数收益率*80%+中国债券总指数收益率*20%。

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



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

永赢智能领先C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

		金经理（助理） 期限		券 从 业 年 限	
		任职 日期	离任 日期		
于航	基金经理	2020-06-30	-	11	于航先生，复旦大学理学博士，11年证券相关从业经验。曾在中海基金管理有限公司先后任投研中心助理分析师、分析师、高级分析师兼基金经理助理，权益投资部基金经理。现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《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、《永赢智能领先混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，分别于每季度和每年度对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，每季度对连续四个季度期间内、不同

时间窗下不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年上半年，A股指数依然走势纠结，沪深300指数上涨0.24%，创业板指数上涨17.22%。主要原因在于二三月份由于预期过于一致造成市场大幅调整，但上市公司估值合理且一季度业绩和年报业绩较好，特别是战略新兴产业板块的公司基本面趋势依然向上，指数回撤空间并不大；而宏观方面对通胀和流动性的担忧并没有变成通胀高企和货币收紧的现实。因此科技和消费的上涨的动力没有消失，反而得到加强。

本基金上半年继续坚持在战略新兴产业中自下而上选择好行业里好公司的投资理念，押注中国产业升级、冲破封锁直至引领全球。本基所持有的标的经受住了年报和一季报的考验，几乎所有标的业绩均符合预期或者超预期，这是对本基金在逆境中一直坚守信念最大的支持，当然这依赖于强大的投研团队。在本报告期内，本基金增加了集成电路的持仓，但整体结构变动不大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢智能领先A基金份额净值为2.9154元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为20.44%，同期业绩比较基准收益率为1.93%；截至报告期末永赢智能领先C基金份额净值为2.8969元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为20.32%，同期业绩比较基准收益率为1.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球疫情反复，经济复苏并不牢固，货币政策难以转向，因此A股市场的宏观环境大概率不会变。从中观角度看，景气行业比如新能源汽车、半导体、CXO、工控等下半年依然会持续景气，这一方面来自于产业趋势，另外一方面疫情影响以及紧张的国际形势使得我们国家供应链安全度提升的迫切性大大增强，国产化趋势会继续加强而非衰落；还有，当前涌现出了一大批“种子选手”，它们把我们国家在各个行业的水平都提高了一大截，世界对中国制造的印象正由低质仿冒变成质优价廉。一大批“国货之光”的品牌涌现出来，占领国内年轻消费者的心，刮起一股国潮之风。可以说，这是

一个前所未有的伟大时代，未来很长一段时间我们将一起见证一个国家在几乎所有行业的产业链环节上实现跃迁。由此，虽然市场结构性行情如火如荼，长期来看，我们依然对后市充满信心。

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、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：永赢智能领先混合型证券投资基金

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	59,794,662.72	78,594,632.13
结算备付金		1,799,585.78	2,315,603.36
存出保证金		513,297.94	370,405.58
交易性金融资产	6.4.7.2	1,353,559,785.45	957,081,139.34
其中：股票投资		1,291,559,785.45	957,081,139.34
基金投资		-	-
债券投资		62,000,000.00	-
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		25,297,233.11	-
应收利息	6.4.7.5	1,289,261.58	15,864.93
应收股利		-	-
应收申购款		9,950,175.55	15,029,587.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		1,452,204,002.13	1,053,407,233.21
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		10,192,713.66	13,261,227.42
应付赎回款		39,948,047.53	10,692,054.52
应付管理人报酬		1,763,738.96	1,019,036.49
应付托管费		293,956.48	169,839.40
应付销售服务费		53,161.08	27,527.05
应付交易费用	6.4.7.7	1,021,893.30	867,178.76
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	164,926.04	208,682.56
负债合计		53,438,437.05	26,245,546.20
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	480,460,292.58	424,851,085.20
未分配利润	6.4.7.10	918,305,272.50	602,310,601.81
所有者权益合计		1,398,765,565.08	1,027,161,687.01
负债和所有者权益总计		1,452,204,002.13	1,053,407,233.21

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值2.9113元，基金份额总额480,460,292.58份。其中A类基金份额净值2.9154元，份额总额374,777,718.92份；C类基金份额净值2.8969元，份额总额105,682,573.66份。

6.2 利润表

会计主体：永赢智能领先混合型证券投资基金

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06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		243,810,649.17	58,492,558.39
1. 利息收入		844,369.65	403,544.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	241,073.76	403,544.94
债券利息收入		603,295.89	—
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）		124,122,352.91	188,967,482.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	121,247,781.88	182,432,381.52
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. 2	—	—
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	2,874,571.03	6,535,100.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	114,063,871.50	-134,114,858.14
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	4,780,055.11	3,236,389.14
减：二、费用		16,645,586.50	10,608,395.19

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,237,900.60	6,712,942.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,706,316.75	1,118,823.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	335,570.34	40,060.62
4. 交易费用	6.4.7.19	4,255,244.52	2,620,804.65
5. 利息支出		2,375.34	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,375.34	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	108,178.95	115,763.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		227,165,062.67	47,884,163.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		227,165,062.67	47,884,163.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢智能领先混合型证券投资基金

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）	424,851,085.20	602,310,601.81	1,027,161,687.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	227,165,062.67	227,165,062.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值	55,609,207.38	88,829,608.02	144,438,815.40

变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	664,838,493.03	1,019,869,771.18	1,684,708,264.21
2. 基金赎回款	-609,229,285.65	-931,040,163.16	-1,540,269,448.81
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)	480,460,292.58	918,305,272.50	1,398,765,565.08
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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)	783,220,198.19	220,795,983.58	1,004,016,181.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	47,884,163.20	47,884,163.20
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)	-256,751,964.67	-68,307,176.12	-325,059,140.79
其中: 1. 基金申购款	640,124,853.93	207,386,634.34	847,511,488.27
2. 基金赎回款	-896,876,818.60	-275,693,810.46	-1,172,570,629.06
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)	526,468,233.52	200,372,970.66	726,841,204.18
---------------------	----------------	----------------	----------------

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

永赢智能领先混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1149号文《关于准予永赢智能领先混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函〔2019〕177号《关于准予永赢智能领先混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准，由永赢基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于2019年3月26日生效，首次设立募集规模为1,919,557,617.23份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金基金份额分为A类和C类基金份额。对于A类基金份额，投资者认购/申购时收取认购/申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费；对于C类基金份额，投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于智能领先主题相关的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，以备支付基金份额持有人的赎回款项。

本基金业绩比较基准为：中证800指数收益率*80%+中国债券总指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（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	59,794,662.72
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	59,794,662.72

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		951,757,297.22	1,291,559,785.45	339,802,488.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	62,026,200.01	62,000,000.00	-26,200.01
	银行间市场	-	-	-
	合计	62,026,200.01	62,000,000.00	-26,200.01
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,013,783,497.23	1,353,559,785.45	339,776,288.22

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	10,001.60
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	809.80
应收债券利息	1,278,219.18
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	231.00
合计	1,289,261.58

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	1,021,893.30
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,021,893.30

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	65,747.09

应付证券出借违约金	—
预提费用	99,178.95
合计	164,926.04

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 永赢智能领先A

金额单位：人民币元

项目 (永赢智能领先A)	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	328,813,607.48	328,813,607.48
本期申购	418,585,083.80	418,585,083.80
本期赎回（以“-”号填列）	-372,620,972.36	-372,620,972.36
本期末	374,777,718.92	374,777,718.92

6.4.7.9.2 永赢智能领先C

金额单位：人民币元

项目 (永赢智能领先C)	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	96,037,477.72	96,037,477.72
本期申购	246,253,409.23	246,253,409.23
本期赎回（以“-”号填列）	-236,608,313.29	-236,608,313.29
本期末	105,682,573.66	105,682,573.66

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 永赢智能领先A

单位：人民币元

项目 (永赢智能领先A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	332,950,915.03	134,166,101.96	467,117,016.99

本期利润	87,420,033.58	91,050,081.25	178,470,114.83
本期基金份额交易产生的变动数	41,335,904.41	30,909,076.32	72,244,980.73
其中：基金申购款	442,869,203.83	206,477,778.03	649,346,981.86
基金赎回款	-401,533,299.42	-175,568,701.71	-577,102,001.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	461,706,853.02	256,125,259.53	717,832,112.55

6.4.7.10.2 永赢智能领先C

单位：人民币元

项目 (永赢智能领先C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	96,201,991.07	38,991,593.75	135,193,584.82
本期利润	25,681,157.59	23,013,790.25	48,694,947.84
本期基金份额交易产生的变动数	6,764,988.89	9,819,638.40	16,584,627.29
其中：基金申购款	258,406,674.22	112,116,115.10	370,522,789.32
基金赎回款	-251,641,685.33	-102,296,476.70	-353,938,162.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	128,648,137.55	71,825,022.40	200,473,159.95

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	215,397.07
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	21,606.64
其他	4,070.05
合计	241,073.76

6.4.7.12 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	1,591,419,907.74
减：卖出股票成本总额	1,470,172,125.86
买卖股票差价收入	121,247,781.88

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

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01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,874,571.03
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	2,874,571.03

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	114,063,871.50
——股票投资	114,090,071.51
——债券投资	-26,200.01
——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	114,063,871.50

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	4,728,673.05
基金转换费收入	51,382.06
合计	4,780,055.11

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	4,255,244.52
银行间市场交易费用	-
合计	4,255,244.52

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	108,178.95

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内本公司不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,237,900.60	6,712,942.39
其中：支付销售机构的客户维护费	4,143,395.14	2,479,986.58

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

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

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	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,706,316.75	1,118,823.72

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢智能领先A	永赢智能领先C	合计
永赢基金	0.00	785.69	785.69
交通银行	0.00	10,063.13	10,063.13
宁波银行	0.00	29,441.56	29,441.56
合计	0.00	40,290.38	40,290.38
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢智能领先A	永赢智能领先C	合计
永赢基金	0.00	5,717.82	5,717.82

交通银行	0.00	670.86	670.86
宁波银行	0.00	17,546.34	17,546.34
合计	0.00	23,935.02	23,935.02

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

$H = E \times C$ 类基金销售服务费年费率 / 当年天数

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

永赢智能领先A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	8,054,691.90

报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	8,054,691.90
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	1.5299%

永赢智能领先C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	59,794,662.72	215,397.07	44,029,170.18	386,970.94

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——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
688169	石头科技	2021-05-31	2021-11-29	询价转让流通受限	1,111.00	1,138.55	22,000	24,442,000.00	25,048,100.00	-
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股限售	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688538	和辉光电-U	2021-05-20	2021-11-29	新股限售	2.65	3.38	300,124	795,328.60	1,014,419.12	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688677	海泰新光	2021-02-18	2021-08-26	新股限售	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	认购新发证券	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-	2021-10-	新股限售	33.22	87.50	925	30,728.5	80,937.5	-

		15	26					0	0	
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	认购新发证券	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688350	富淼科技	2021-01-21	2021-07-28	新股限售	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	认购新发证券	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	认购新发证券	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688260	昀冢科技	2021-03-25	2021-10-08	新股限售	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-
688655	迅捷兴	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	认购新发证券	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	新股限售	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688367	工大高科	2021-06-	2021-12-	新股限售	11.53	17.94	1,717	19,797.0	30,802.9	-

		21	28					1	8	
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	-
3009 53	震裕 科技	2021 -03- 11	2021 -09- 22	新股 限售	28.7 7	99.8 5	240	6,90 4.80	23,9 64.0 0	-
3010 09	可靠 股份	2021 -06- 08	2021 -12- 17	新股 限售	12.5 4	27.8 9	801	10,0 44.5 4	22,3 39.8 9	-
3009 41	创识 科技	2021 -02- 02	2021 -08- 09	新股 限售	21.3 1	49.9 4	399	8,50 2.69	19,9 26.0 6	-
3010 15	百洋 医药	2021 -06- 22	2021 -12- 30	新股 限售	7.64	38.8 3	462	3,52 9.68	17,9 39.4 6	-
6882 26	威腾 电气	2021 -06- 28	2021 -07- 07	认购 新发 证券	6.42	6.42	2,693	17,2 89.0 6	17,2 89.0 6	-
3009 32	三友 联众	2021 -01- 15	2021 -07- 22	新股 限售	24.6 9	31.7 1	492	12,1 47.4 8	15,6 01.3 2	-
3009 82	苏文 电能	2021 -04- 19	2021 -10- 27	新股 限售	15.8 3	45.2 9	317	5,01 8.11	14,3 56.9 3	-
3009 40	南极 光	2021 -01- 27	2021 -08- 03	新股 限售	12.7 6	43.3 8	307	3,91 7.32	13,3 17.6 6	-
3006 14	百川 畅银	2021 -05- 18	2021 -11- 25	新股 限售	9.19	40.3 8	329	3,02 3.51	13,2 85.0 2	-
3009 37	药易 购	2021 -01- 07	2021 -07- 07	新股 限售	12.2 5	53.7 1	244	2,98 9.00	13,1 05.2	-

		20	27						4	
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股限售	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	认购新发证券	31.56	31.56	349	11,014.4	11,014.4	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-	2021-12-	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

		23	30							
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021-06-04	2021-08-25	新股限售-送股	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	认购新发证券	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
3009	川网	2021	2021	新股	6.79	26.8	301	2,04	8,06	-

87	传媒	-04-28	-11-11	限售		1		3.79	9.81	
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股限售	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股限售	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
3009	中洲	2021	2021	新股	12.1	22.4	283	3,43	6,36	-

63	特材	-03-30	-10-11	限售	3	9		2.79	4.67	
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
3010	扬电	2021	2021	新股	8.05	24.2	170	1,36	4,12	-

12	科技	-06-15	-12-22	限售		6		8.50	4.20	
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
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	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：（1）以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

（2）本基金持有的限售股冠中生态，于2021年6月4日实施2020年年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每10股转增5股，因转增所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致。

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，使本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体系。五道防线分别为员工自律、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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	62,000,000.00	-
合计	62,000,000.00	-

注：1、国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级；

2、上年度末，本基金未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	59,794,662.72	-	-	-	-	-	59,794,662.72
结算备付金	1,799,585.78	-	-	-	-	-	1,799,585.78
存出保证金	513,297.94	-	-	-	-	-	513,297.94
交易性金融资产	62,000,000.00	-	-	-	-	1,291,559,785.45	1,353,559,785.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收证 券清算 款	-	-	-	-	-	25,297,233.11	25,297,233.11
应收利 息	-	-	-	-	-	1,289,261.58	1,289,261.58
应收股 利	-	-	-	-	-	-	-
应收申 购款	-	-	-	-	-	9,950,175.55	9,950,175.55
其他资 产	-	-	-	-	-	-	-
资产总 计	124,107,546.44	0.00	0.00	0.00	0.00	1,328,096,455.69	1,452,204,002.13
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	-	-	-	-	-	10,192,713.66	10,192,713.66
应付赎 回款	-	-	-	-	-	39,948,047.53	39,948,047.53
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	1,763,738.96	1,763,738.96
应付托 管费	-	-	-	-	-	293,956.48	293,956.48
应付销 售服务 费	-	-	-	-	-	53,161.08	53,161.08
应付交 易费用	-	-	-	-	-	1,021,893.30	1,021,893.30
应付税 费	-	-	-	-	-	-	-
应付利 息	-	-	-	-	-	-	-
应付利 润	-	-	-	-	-	-	-
其他负 债	-	-	-	-	-	164,926.04	164,926.04
负债总 计	-	-	-	-	-	53,438,437.05	53,438,437.05
利率敏 感度缺 口	124,107,546.44	0.00	0.00	0.00	0.00	1,274,658,018.64	1,398,765,565.08
上年度	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

末 2020年 12月31 日							
资产							
银行存款	78,594,632.13	-	-	-	-	-	78,594,632.13
结算备付金	2,315,603.36	-	-	-	-	-	2,315,603.36
存出保证金	370,405.58	-	-	-	-	-	370,405.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	957,081,139.34	957,081,139.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	15,864.93	15,864.93
应收股利	-	-	-	-	-	-	0.00
应收申购款	-	-	-	-	-	15,029,587.87	15,029,587.87
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	81,280,641.07	0.00	0.00	0.00	0.00	972,126,592.14	1,053,407,233.21
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	0.00
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	0.00
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	0.00
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,261,227.42	13,261,227.42
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,692,054.52	10,692,054.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,019,036.49	1,019,036.49
应付托	-	-	-	-	-	169,839.40	169,839.40

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	27,527.05	27,527.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	867,178.76	867,178.76
应付税费	-	-	-	-	-	-	0.00
应付利息	-	-	-	-	-	-	0.00
应付利润	-	-	-	-	-	-	0.00
其他负债	-	-	-	-	-	208,682.56	208,682.56
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	26,245,546.20	26,245,546.20
利率敏感度缺口	81,280,641.07	0.00	0.00	0.00	0.00	945,881,045.94	1,027,161,687.01

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率曲线向上、向下平行移动50个基点		
假设	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-13,330.00	-
	市场利率平行下降50个基点	13,330.00	-

注：上年度末，本基金未持有债券，无重大利率风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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	1,291,559,785.45	92.34	957,081,139.34	93.18
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	1,291,559,785.45	92.34	957,081,139.34	93.18

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%	25,544,698.89	14,723,369.25
	业绩比较基准减少1%	-25,544,698.89	-14,723,369.25

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1,258,716,287.43 元，属于第二层次的余额为人民币62,354,186.77元，属于第三层次余额为人民币32,489,311.25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59,155,833.88元，本期变动人民币-26,666,522.63元，本期末人民币32,489,311.25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	1,291,559,785.45	88.94
	其中：股票	1,291,559,785.45	88.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,000,000.00	4.27
	其中：债券	62,000,000.00	4.27
	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	61,594,248.50	4.24
8	其他各项资产	37,049,968.18	2.55
9	合计	1,452,204,002.13	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,100,038,046.17	78.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.37
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	49,324.90	0.00
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	60,788,115.90	4.35
J	金融业	34,721.10	0.00

K	房地产业	1,797.90	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	82,818,571.92	5.92
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	42,588,070.98	3.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,291,559,785.45	92.34

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	203,515	108,839,822.00	7.78
2	300124	汇川技术	1,366,288	101,460,546.88	7.25
3	300760	迈瑞医疗	184,113	88,383,445.65	6.32
4	002460	赣锋锂业	715,263	86,611,196.67	6.19
5	603259	药明康德	528,888	82,818,571.92	5.92
6	601012	隆基股份	768,559	68,278,781.56	4.88
7	600399	抚顺特钢	3,556,085	64,507,381.90	4.61
8	002410	广联达	890,351	60,721,938.20	4.34
9	688200	华峰测控	127,497	60,348,155.01	4.31
10	601799	星宇股份	267,351	60,346,467.72	4.31
11	603345	安井食品	223,294	56,721,141.88	4.06
12	603799	华友钴业	475,200	54,267,840.00	3.88

13	688169	石头科技	45,009	54,062,449.00	3.87
14	002371	北方华创	192,600	53,423,388.00	3.82
15	688012	中微公司	304,086	50,453,949.12	3.61
16	688116	天奈科技	404,263	47,703,034.00	3.41
17	600703	三安光电	1,482,200	47,504,510.00	3.40
18	688122	西部超导	664,497	43,105,920.39	3.08
19	300015	爱尔眼科	600,001	42,588,070.98	3.04
20	002594	比亚迪	149,300	37,474,300.00	2.68
21	601865	福莱特	350,900	13,871,077.00	0.99
22	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.37
23	688538	和辉光电-U	300,124	1,014,419.12	0.07
24	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.02
25	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.01
26	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
27	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
28	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
29	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
30	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.00
31	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
32	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
33	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
34	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.00
35	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.00
36	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
37	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
38	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
39	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
40	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
41	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
42	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
43	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00

44	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
45	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
46	301015	百洋医药	514	20,859.78	0.00
47	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
48	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
49	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
50	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
51	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
52	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
53	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
54	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
55	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
56	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
57	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
58	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
59	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
60	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
61	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
62	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
63	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
64	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
65	300991	创益通	335	9,662.50	0.00
66	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
67	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
68	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
69	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
70	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
71	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
72	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
73	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
74	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00

75	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
76	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
77	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
78	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
79	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
80	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
81	605499	东鹏饮料	32	8,025.60	0.00
82	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
83	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
84	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
85	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
86	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
87	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
88	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
89	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
90	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
91	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
92	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
93	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
94	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
95	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
96	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
97	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
98	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
99	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
100	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
101	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
102	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
103	300917	特发服务	65	1,797.90	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002371	北方华创	79,199,250.52	7.71
2	688012	中微公司	75,454,839.90	7.35
3	688200	华峰测控	68,560,834.35	6.67
4	603799	华友钴业	66,830,607.47	6.51
5	600426	华鲁恒升	64,291,653.12	6.26
6	002594	比亚迪	63,269,329.98	6.16
7	600703	三安光电	61,524,273.66	5.99
8	688169	石头科技	59,064,090.11	5.75
9	600399	抚顺特钢	56,868,573.57	5.54
10	300124	汇川技术	55,795,986.36	5.43
11	002415	海康威视	55,393,365.60	5.39
12	601012	隆基股份	54,448,937.53	5.30
13	300750	宁德时代	54,371,483.46	5.29
14	002601	龙佰集团	47,960,757.48	4.67
15	002410	广联达	46,300,768.83	4.51
16	603259	药明康德	44,922,051.99	4.37
17	300760	迈瑞医疗	42,553,842.00	4.14
18	601799	星宇股份	42,419,153.45	4.13
19	600031	三一重工	41,428,530.19	4.03
20	000100	TCL科技	40,368,086.00	3.93
21	688116	天奈科技	40,015,062.56	3.90
22	600183	生益科技	38,972,776.18	3.79
23	601100	恒立液压	38,576,453.26	3.76
24	002460	赣锋锂业	34,800,909.56	3.39
25	600499	科达制造	33,552,333.33	3.27
26	603345	安井食品	30,781,835.22	3.00
27	603501	韦尔股份	29,895,761.28	2.91

28	300015	爱尔眼科	26,910,311.97	2.62
29	601899	紫金矿业	26,909,552.00	2.62
30	002756	永兴材料	26,526,823.00	2.58
31	688122	西部超导	25,849,855.56	2.52
32	600460	士兰微	21,479,764.00	2.09
33	688019	安集科技	21,413,805.37	2.08

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	600031	三一重工	73,751,502.11	7.18
2	688116	天奈科技	63,264,389.32	6.16
3	600426	华鲁恒升	63,052,530.20	6.14
4	002756	永兴材料	59,901,725.43	5.83
5	601012	隆基股份	55,038,831.91	5.36
6	002415	海康威视	54,733,817.98	5.33
7	300012	华测检测	53,857,303.99	5.24
8	601100	恒立液压	53,523,878.24	5.21
9	002594	比亚迪	52,061,606.00	5.07
10	300750	宁德时代	51,879,453.86	5.05
11	688169	石头科技	51,814,502.35	5.04
12	688111	金山办公	45,635,339.12	4.44
13	600845	宝信软件	44,029,580.18	4.29
14	603259	药明康德	43,934,131.40	4.28
15	000100	TCL科技	42,083,038.83	4.10
16	002371	北方华创	41,505,210.00	4.04
17	002601	龙佰集团	38,548,475.40	3.75
18	600183	生益科技	36,536,308.22	3.56
19	603605	珀莱雅	36,388,854.00	3.54

20	300124	汇川技术	36,061,325.60	3.51
21	300699	光威复材	34,758,351.90	3.38
22	603501	韦尔股份	33,009,687.34	3.21
23	002460	赣锋锂业	32,856,825.79	3.20
24	600499	科达制造	32,563,346.00	3.17
25	002409	雅克科技	31,466,731.42	3.06
26	688012	中微公司	31,364,991.60	3.05
27	601799	星宇股份	29,707,220.90	2.89
28	601899	紫金矿业	24,367,498.00	2.37
29	002410	广联达	23,947,046.00	2.33
30	603345	安井食品	23,650,177.00	2.30
31	300015	爱尔眼科	23,484,685.90	2.29
32	600460	士兰微	23,178,412.00	2.26
33	603799	华友钴业	22,939,354.14	2.23
34	002493	荣盛石化	22,768,485.00	2.22
35	600703	三安光电	22,611,730.40	2.20
36	600765	中航重机	22,295,131.81	2.17
37	300760	迈瑞医疗	21,207,666.22	2.06
38	688019	安集科技	20,678,982.71	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,690,560,700.46
卖出股票收入（成交）总额	1,591,419,907.74

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	62,000,000.00	4.43

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	62,000,000.00	4.43

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019640	20国债10	620,000	62,000,000.00	4.43

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	513,297.94
2	应收证券清算款	25,297,233.11
3	应收股利	—
4	应收利息	1,289,261.58
5	应收申购款	9,950,175.55
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	37,049,968.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
永赢智能领先A	33,734	11,109.79	17,878,837.47	4.7705%	356,898,881.45	95.2295%
永赢智能领先C	61,712	1,712.51	853,479.85	0.8076%	104,829,093.81	99.1924%
合计	95,446	5,033.84	18,732,317.32	3.8988%	461,727,975.26	96.1012%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	永赢智能领先A	2,481,720.50	0.66%
	永赢智能领先C	385,575.61	0.36%
	合计	2,867,296.11	0.60%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	永赢智能领先A	50~100
	永赢智能领先C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢智能领先A	10~50
	永赢智能领先C	0~10
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢智能领先A	永赢智能领先C
基金合同生效日(2019年03月26日)基金份额总额	1, 903, 213, 376. 06	16, 344, 241. 17
本报告期期初基金份额总额	328, 813, 607. 48	96, 037, 477. 72
本报告期基金总申购份额	418, 585, 083. 80	246, 253, 409. 23
减：本报告期基金总赎回份额	372, 620, 972. 36	236, 608, 313. 29
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	374, 777, 718. 92	105, 682, 573. 66

§ 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，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	140,912,534.37	4.34%	103,049.00	4.39%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	20,570,171.50	0.63%	14,631.54	0.62%	-
长江证券	2	189,974,503.26	5.86%	137,715.47	5.87%	-
东北证券	2	161,365,478.18	4.97%	115,929.58	4.94%	-
东方财富	2	407,122,288.14	12.55%	293,865.11	12.53%	-
东方证券	2	34,228,398.81	1.06%	24,346.61	1.04%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正	2	248,183,946.06	7.65%	179,451.17	7.65%	-

证券						
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	508,264,953.15	15.67%	367,629.84	15.67%	-
国泰 君安 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
国元 证券	2	-	-	-	-	-
宏信 证券	2	103,995,318.77	3.21%	76,050.66	3.24%	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
华创 证券	2	404,279,503.83	12.46%	291,225.90	12.41%	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
华菁 证券	2	33,958,949.48	1.05%	24,605.80	1.05%	-
申万 宏源 证券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	55,030,952.84	1.70%	40,244.41	1.72%	-
西部 证券	2	233,472,402.14	7.20%	168,660.93	7.19%	-

信达证券	2	41,238,979.77	1.27%	29,932.54	1.28%	-
兴业证券	2	383,111,421.60	11.81%	277,778.10	11.84%	-
银河证券	2	56,180,736.90	1.73%	40,704.71	1.74%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	107,471,066.96	3.31%	77,361.15	3.30%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	114,791,551.78	3.54%	82,683.05	3.52%	-

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
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	62,026,200.01	100.00%	17,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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旗下部分	中国证监会规定	2021-01-07

	基金开展直销平台认购、申购费率优惠活动的公告	媒介	
2	永赢智能领先混合型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-22
3	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
4	永赢基金管理有限公司关于新增甬兴证券有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-29
5	永赢基金管理有限公司关于新增平安证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-02-01
6	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
7	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
8	永赢智能领先混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-27
9	永赢基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为永赢基金旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-31
10	永赢智能领先混合型证券投资基金2021年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
11	永赢基金管理有限公司关于新增腾安基金销售（深圳）有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-14
12	永赢基金管理有限公司关于调整部分基金最低赎回（含转换转出）份额和最低持有份额数额限制的公告	中国证监会规定媒介	2021-06-17
13	永赢基金管理有限公司关于新增国信证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-06-18

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准永赢智能领先混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《永赢智能领先混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢智能领先混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢智能领先混合型证券投资基金招募说明书》及其更新（如有）；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号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