

永赢中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022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2022年01月01日起至2022年6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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	66
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	永赢中证500ETF
场内简称	永赢500
基金主代码	159999
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年07月14日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	44,344,275.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020年08月12日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	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。主要投资策略有：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略和存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		永赢基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	许俊
	联系电话	021-20430340	95566
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-805-8888	95566
传真		021-51690177	010-66594942
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、23、27层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		马宇晖	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正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、23、27层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
本期已实现收益	-771,980.58
本期利润	-6,517,139.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1355
本期加权平均净值利润率	-13.13%
本期基金份额净值增长率	-11.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润	2,396,206.05
期末可供分配基金份额利润	0.0540
期末基金资产净值	46,740,481.05
期末基金份额净值	1.0540
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	5.40%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	7.74%	1.10%	7.10%	1.10%	0.64%	0.00%
过去三个月	3.15%	1.71%	2.04%	1.75%	1.11%	-0.04%

过去六个月	-11.32%	1.60%	-12.30%	1.63%	0.98%	-0.03%
过去一年	-4.18%	1.30%	-5.20%	1.33%	1.02%	-0.03%
自基金合同生效起至今	5.40%	1.22%	-6.46%	1.26%	11.86%	-0.04%

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

2、本基金业绩比较基准为：中证500指数收益率。

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



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2022年6月30日，本基金管理人共管理97只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢稳益债券型证券投资基金、永赢双利债券型证券投资基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢天天利货币市场基金、永赢永益债券型证券投资基金、永赢丰利债券型证券投资基金、永赢增益债券型证券投资基金、永赢恒益债券型证券投资基金、永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠益债券型证券投资基金、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢嘉益债券型证券投资基金、永赢裕益债券型证券投资基金、永赢祥益债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢诚益债券型证券投资基金、永赢通益债券型证券投资基金、永赢昌益债券型证券投资基金、永赢宏益债券型证券投资基金、永赢伟益债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、永赢智益纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢沪深300指数型发起式证券投资基金、永赢众利债券型证券投资基金、永赢同利债券型证券投资基金、永赢昌利债券型证券投资基金、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、永赢乾元三年定期开放混合型证券投资基金、永赢科技驱动混合型证券投资基金、永赢元利债券型证券投资基金、永赢易弘债券型证券投资基金、永赢股息优选混合型证券投资基金、永赢沪深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、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券

投资基金、永赢鑫享混合型证券投资基金、永赢鼎利债券型证券投资基金、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金、永赢成长领航混合型证券投资基金、永赢泰宁63个月定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫欣混合型证券投资基金、永赢稳健增利18个月持有期混合型证券投资基金、永赢鑫盛混合型证券投资基金、永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠添益混合型证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢港股通优质成长一年持有期混合型证券投资基金、永赢深证创新100交易型开放式指数证券投资基金、永赢乾益债券型证券投资基金、永赢鑫辰混合型证券投资基金、永赢中债-3-5年政策性金融债指数证券投资基金、永赢长远价值混合型证券投资基金、永赢信利碳中和主题一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢轩益债券型证券投资基金、永赢深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢合享混合型发起式证券投资基金、永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、永赢安盈90天滚动持有债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增强债券型证券投资基金、永赢优质精选混合型发起式证券投资基金、永赢添添欣12个月持有期混合型证券投资基金、永赢养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、永赢卓越臻选股票型发起式证券投资基金及永赢新能源智选混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从 业 年 限	说明
		任职 日期	离任 日期		
万纯	权益投资部指数与数量投资部副总监/基金经理	2020-07-14	-	8	万纯先生，北京大学硕士，8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。

					监（主持工作）。
罗少文	基金经理助理	2021-12-22	-	4	罗少文先生，北京大学金融学硕士，4年证券相关从业经验。曾任国泰基金管理有限公司量化研究员，现任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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢中证500ETF基金份额净值为1.0540元，本报告期内，基金份额净值增长率为-11.32%，同期业绩比较基准收益率为-12.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年上半年，A股在经历大幅杀跌后迎来反弹，不过指数走势整体仍呈分化趋势，其中各个宽基指数回调幅度整体差异不大，期间沪深300下跌9.22%，创业板指下跌15.41%，中证500下跌12.30%，市场情绪在经过3-4月份的“至暗时刻”后迎来大幅回暖。行业层面，一季度市场在悲观情绪影响下市场出现普遍回调，二季度领涨的行业主要集中在前期杀跌相对严重的赛道股：首先是景气度仍处在高位的新能源及光伏产业链，其次是减税利好刺激下的汽车产业链；但目前这些赛道股的行情持续情况可能仍需要中报业绩的不断验证。

站在二季度关口展望未来一段时间，就市场大环境而言，全年或将经历从政策发力到经济企稳的切换过程，预计交易逻辑先完成由现实向预期靠拢的过程，但是最终也会出现从预期向现实靠拢的过程。如果国内稳增长能够兑现，且能够实现较好的稳增长目标，全球供应链错配情况将会得到缓解，叠加在美国经济复苏趋势下，全球通胀回落、人民币汇率保持韧性，那么国内稳增长和疫后修复的交易逻辑就绑定的比较自然，后续也将更有可能迎来“高景气转机”。在生产资料价格中枢高位震荡、稳增长力度加码、新兴产业增长一致预期较强且政策不断支持的背景下，价值与成长可能将会相对均衡，待大宗商品价格回落及国内宽信用政策进一步落地后，市场情绪有望进一步回暖。

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，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,210,781.27	916,350.31
结算备付金		469,080.95	761,878.23
存出保证金		204,645.26	569.01
交易性金融资产	6.4.7.2	45,073,561.68	55,987,707.28
其中：股票投资		45,073,561.68	55,987,707.28
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
债权投资		—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资		—	—

其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	99.34
资产总计		46,958,069.16	57,666,604.17
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021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		-	-
应付清算款		768.01	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,902.98	7,264.40
应付托管费		1,967.70	2,421.48
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	335.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	208,949.42	194,284.43
负债合计		217,588.11	204,305.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	44,344,275.00	48,344,275.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	2,396,206.05	9,118,023.25
净资产合计		46,740,481.05	57,462,298.25
负债和净资产总计		46,958,069.16	57,666,604.17

注：（1）报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.0540元，基金份额总额44,344,275.00份。

（2）比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-6,338,059.73	4,926,038.30
1. 利息收入		1,618.90	4,144.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,618.90	4,144.84
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-635,304.45	3,273,509.27
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,052,813.31	2,630,801.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-123,703.39	225,825.25
股利收益	6.4.7.15	541,212.25	416,882.40
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,745,158.46	1,656,753.35
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	40,784.28	-8,369.16
减：二、营业总支出		179,079.31	260,187.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	36,974.57	36,380.03
2. 托管费	6.4.10.2. 2	12,324.94	12,126.69
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	812.98
8. 其他费用	6.4.7.19	129,779.80	210,868.25
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-6,517,139.04	4,665,850.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-6,517,139.04	4,665,850.35
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		-6,517,139.04	4,665,850.35

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	48,344,275.00	-	9,118,023.25	57,462,298.25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	48,344,275.00	-	9,118,023.25	57,462,298.25
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	-	-6,721,817.20	-10,721,817.20
（一）、综合收益总额	-	-	-6,517,139.04	-6,517,139.04
（二）、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）	-4,000,000.00	-	-204,678.16	-4,204,678.16
其中：1. 基金申购款	4,000,000.00	-	-17,646.08	3,982,353.92

2. 基金赎回款	-8,000,000.00	-	-187,032.08	-8,187,032.08
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	44,344,275.00	-	2,396,206.05	46,740,481.05
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	72,344,275.00	-	1,988,737.77	74,333,012.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	72,344,275.00	-	1,988,737.77	74,333,012.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-30,000,000.00	-	2,246,108.66	-27,753,891.34
(一)、综合收益总额	-	-	4,665,850.35	4,665,850.35
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-30,000,000.00	-	-2,419,741.69	-32,419,741.69
其中：1. 基金申购款	24,000,000.00	-	560,973.15	24,560,973.15

	0			5
2. 基金赎回款	-54,000,000.00	-	-2,980,714.84	-56,980,714.84
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	42,344,275.00	-	4,234,846.43	46,579,121.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

芦特尔

汪成杰

虞俏依

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、企业债、公司债、次级债、地方政府债、金融债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关

规定)。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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

本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2022年6月30日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022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

除下述变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币916,350.31元，自应收利息转入的重分类金额为人民币99.01元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币916,449.32元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币569.01元，自应收利息转入的重分类金额为人民币0.33元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币569.34元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币99.34元，转出至银行存款的重分类金额为人民币99.01元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币0.33元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（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 2022年06月30日
活期存款	1,210,781.27
等于：本金	1,210,655.60
加：应计利息	125.67
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	1,210,781.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		47,314,807.06	-	45,073,561.68	-2,241,245.38
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		47,314,807.06	-	45,073,561.68	-2,241,245.38

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日		
		合同/名义金额	公允价值	
			资产	负债
利率衍生工具		-	-	-
货币衍生工具		-	-	-
权益衍生工具		1,238,260.00	-	-
股指期货		1,238,260.00	-	-
其他衍生工具		-	-	-
合计		1,238,260.00	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2209	中证500股指期货2209合约	1.00	1,272,800.00	34,540.00
合计				34,540.00
减：可抵销 期货暂收 款				34,540.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	14,442.05
其中：交易所市场	14,442.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.37
应付指数使用费	105,000.00

合计	208,949.42
----	------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,344,275.00	48,344,275.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-8,000,000.00	-8,000,000.00
本期末	44,344,275.00	44,344,275.00

6.4.7.8 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
本期期初	6,460,035.53	2,657,987.72	9,118,023.25
本期利润	-771,980.58	-5,745,158.46	-6,517,139.04
本期基金份额交易产生的变动数	-482,526.78	277,848.62	-204,678.16
其中：基金申购款	501,952.70	-519,598.78	-17,646.08
基金赎回款	-984,479.48	797,447.40	-187,032.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,205,528.17	-2,809,322.12	2,396,206.05

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	1,460.26
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	147.76

其他	10.88
合计	1,618.90

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-532,076.59
股票投资收益——赎回差价收入	-520,736.72
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	-1,052,813.31

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	11,274,223.72
减：卖出股票成本总额	11,778,419.42
减：交易费用	27,880.89
买卖股票差价收入	-532,076.59

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
赎回基金份额对价总额	8,187,032.08
减：现金支付赎回款总额	4,367,460.08
减：赎回股票成本总额	4,340,308.72
减：交易费用	-
赎回差价收入	-520,736.72

6.4.7.10.4 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。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益**6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
----	--------

	2022年01月01日至2022年06月30日
股指期货投资收益	-123,703.39

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	541,212.25
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	541,212.25

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-5,779,698.46
——股票投资	-5,779,698.46
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	34,540.00
——权证投资	-
股指期货合约	34,540.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,745,158.46

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	—
ETF基金替代损益	40,784.28
合计	40,784.28

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	—
汇划手续费	272.43
指数使用费	70,000.00
合计	129,779.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内，本公司不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期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 2022年01月01日至202 2年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	36,974.57	36,380.03
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

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

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

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 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,324.94	12,126.69

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

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

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。

6.4.10.3 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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未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 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
永赢资产	32,077,908.00	72.3383%	32,077,908.00	66.3531%

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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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
中国银行	1,210,781.27	1,460.26	1,601,323.21	2,891.41

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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

				单 价						
002 670	国 盛 金 控	202 2-0 6-0 1	重 大 事 项 停 牌	9.6 0	2022- 07-14	9.99	7,500	79,465.0 5	72,000.0 0	-

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2022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2022年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金紧密跟踪标的指数。

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体系。五道防线分别为员工自律、自控和互控的第一道防线，部门内控和部门之间互相监督的第二道防线，合规管理及风险管理部门监控检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险管理进行监督管理的第五道防线。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，

确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有

的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	1,210,781.27	-	-	-	-	-	1,210,781.27
结算备付金	14.11	-	-	-	-	469,066.84	469,080.95
存出保证金	997.26	-	-	-	-	203,648.00	204,645.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	45,073,561.68	45,073,561.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,211,792.64	-	-	-	-	45,746,276.52	46,958,069.16
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	768.01	768.01
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,902.98	5,902.98
应付托	-	-	-	-	-	1,967.70	1,967.70

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	208,949.42	208,949.42
负债总计	-	-	-	-	-	217,588.11	217,588.11
利率敏感度缺口	1,211,792.64	-	-	-	-	45,528,688.41	46,740,481.05
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	916,350.31	-	-	-	-	-	916,350.31
结算备付金	-	-	-	-	-	761,878.23	761,878.23
存出保证金	569.01	-	-	-	-	-	569.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,987,707.28	55,987,707.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	99.34	99.34
资产总计	916,919.32	-	-	-	-	56,749,684.85	57,666,604.17
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负	-	-	-	-	-	-	-

债							
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,264.40	7,264.40
应付托管费	-	-	-	-	-	2,421.48	2,421.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	335.61	335.61
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	194,284.43	194,284.43
负债总计	-	-	-	-	-	204,305.92	204,305.92
利率敏感度缺口	916,919.32	-	-	-	-	56,545,378.93	57,462,298.25

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债券，无重大利率风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021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	45,073,561.68	96.43	55,987,707.28	97.43
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	45,073,561.68	96.43	55,987,707.28	97.43

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准增加1%	459,344.59	564,205.21
	业绩比较基准减少1%	-459,344.59	-564,205.21

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	45,001,561.68	55,879,275.28
第二层次	72,000.00	108,432.00
第三层次	-	-
合计	45,073,561.68	55,987,707.28

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2022年8月29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	45,073,561.68	95.99
	其中：股票	45,073,561.68	95.99
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	1,679,862.22	3.58
8	其他各项资产	204,645.26	0.44
9	合计	46,958,069.16	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	437,365.20	0.94
B	采矿业	1,920,354.98	4.11
C	制造业	27,019,189.86	57.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,400,188.00	3.00
E	建筑业	533,782.00	1.14
F	批发和零售业	1,828,356.32	3.91
G	交通运输、仓储和邮政业	1,253,228.60	2.68
H	住宿和餐饮业	96,720.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,279,138.10	7.02
J	金融业	3,859,634.00	8.26
K	房地产业	1,122,142.62	2.40
L	租赁和商务服务业	512,003.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	444,471.00	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	328,290.00	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	96,410.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	603,725.00	1.29
S	综合	338,563.00	0.72
	合计	45,073,561.68	96.43

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票组合。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600522	中天科技	16,400	378,840.00	0.81
2	601615	明阳智能	10,500	354,900.00	0.76
3	600256	广汇能源	27,200	286,688.00	0.61
4	002497	雅化集团	8,100	264,465.00	0.57
5	002240	盛新锂能	4,200	253,512.00	0.54
6	002180	纳思达	4,900	248,038.00	0.53
7	600141	兴发集团	5,600	246,344.00	0.53
8	300769	德方纳米	600	245,208.00	0.52
9	600157	永泰能源	154,100	245,019.00	0.52
10	000009	中国宝安	17,900	241,471.00	0.52
11	300073	当升科技	2,600	234,884.00	0.50
12	600096	云天化	7,300	229,804.00	0.49
13	002384	东山精密	9,900	227,007.00	0.49
14	600392	盛和资源	9,800	221,480.00	0.47
15	002407	多氟多	4,400	215,204.00	0.46
16	600765	中航重机	6,560	211,100.80	0.45
17	600885	宏发股份	5,040	210,924.00	0.45
18	300390	天华超净	2,400	209,760.00	0.45
19	600399	抚顺特钢	11,600	207,640.00	0.44
20	600233	圆通速递	10,000	203,900.00	0.44
21	688180	君实生物	2,700	203,418.00	0.44
22	688122	西部超导	2,200	202,840.00	0.43
23	688099	晶晨股份	2,000	202,000.00	0.43

24	300285	国瓷材料	5,600	201,152.00	0.43
25	002756	永兴材料	1,300	197,873.00	0.42
26	600487	亨通光电	13,600	197,744.00	0.42
27	601555	东吴证券	28,510	197,574.30	0.42
28	600499	科达制造	9,200	189,888.00	0.41
29	600732	爱旭股份	5,700	188,214.00	0.40
30	300037	新宙邦	3,560	187,113.60	0.40
31	600563	法拉电子	900	184,644.00	0.40
32	603613	国联股份	2,055	182,073.00	0.39
33	601108	财通证券	23,100	181,797.00	0.39
34	000983	山西焦煤	13,500	180,765.00	0.39
35	002268	卫 士 通	4,200	180,222.00	0.39
36	603077	和邦生物	41,900	178,494.00	0.38
37	300012	华测检测	7,600	176,396.00	0.38
38	688390	固德威	560	175,285.60	0.38
39	000519	中兵红箭	6,000	174,900.00	0.37
40	600862	中航高科	6,200	174,220.00	0.37
41	600486	扬农化工	1,300	173,264.00	0.37
42	300363	博腾股份	2,200	171,578.00	0.37
43	000630	铜陵有色	52,400	170,824.00	0.37
44	600298	安琪酵母	3,500	170,625.00	0.37
45	603456	九洲药业	3,300	170,610.00	0.37
46	002385	大北农	21,800	170,258.00	0.36
47	601058	赛轮轮胎	15,100	170,177.00	0.36
48	300144	宋城演艺	11,000	168,850.00	0.36
49	000988	华工科技	7,200	166,824.00	0.36
50	600418	江淮汽车	9,600	164,736.00	0.35
51	601077	渝农商行	44,200	163,540.00	0.35
52	000783	长江证券	27,400	162,482.00	0.35
53	600153	建发股份	12,400	162,068.00	0.35
54	603517	绝味食品	2,800	161,896.00	0.35

55	603026	石大胜华	1,100	159,885.00	0.34
56	002625	光启技术	9,200	158,884.00	0.34
57	601168	西部矿业	13,300	157,339.00	0.34
58	002056	横店东磁	5,900	157,058.00	0.34
59	002028	思源电气	4,400	156,904.00	0.34
60	603444	吉比特	400	155,200.00	0.33
61	002353	杰瑞股份	3,800	153,140.00	0.33
62	600988	赤峰黄金	9,600	153,120.00	0.33
63	603605	珀莱雅	920	151,965.60	0.33
64	002185	华天科技	16,200	151,956.00	0.33
65	002797	第一创业	23,700	151,917.00	0.33
66	000932	华菱钢铁	29,700	151,173.00	0.32
67	002603	以岭药业	6,160	149,688.00	0.32
68	601636	旗滨集团	11,700	149,175.00	0.32
69	600521	华海药业	6,500	147,550.00	0.32
70	603589	口子窖	2,500	146,525.00	0.31
71	601128	常熟银行	19,100	145,924.00	0.31
72	002326	永太科技	4,400	144,892.00	0.31
73	601607	上海医药	8,000	144,640.00	0.31
74	002078	太阳纸业	11,700	144,027.00	0.31
75	000830	鲁西化工	8,300	143,507.00	0.31
76	600109	国金证券	15,800	142,200.00	0.30
77	601872	招商轮船	24,300	139,968.00	0.30
78	000738	航发控制	4,900	137,690.00	0.29
79	603939	益丰药房	2,600	137,358.00	0.29
80	000728	国元证券	21,900	136,218.00	0.29
81	600177	雅戈尔	20,200	133,926.00	0.29
82	600546	山煤国际	6,800	132,328.00	0.28
83	300146	汤臣倍健	6,100	132,065.00	0.28
84	000970	中科三环	7,020	131,835.60	0.28
85	600705	中航产融	38,100	131,826.00	0.28

86	300088	长信科技	17,700	131,334.00	0.28
87	002138	顺络电子	4,800	130,800.00	0.28
88	600160	巨化股份	9,900	130,185.00	0.28
89	600348	华阳股份	8,400	129,864.00	0.28
90	000999	华润三九	2,884	129,780.00	0.28
91	300699	光威复材	2,200	129,514.00	0.28
92	002572	索菲亚	4,700	129,250.00	0.28
93	601696	中银证券	9,700	129,010.00	0.28
94	600549	厦门钨业	5,953	128,703.86	0.28
95	601990	南京证券	15,400	128,436.00	0.27
96	000998	隆平高科	7,700	128,282.00	0.27
97	002507	涪陵榨菜	3,700	127,724.00	0.27
98	002557	洽洽食品	2,200	125,246.00	0.27
99	300724	捷佳伟创	1,400	125,090.00	0.27
100	600875	东方电气	7,600	125,020.00	0.27
101	000831	五矿稀土	4,000	125,000.00	0.27
102	600516	方大炭素	16,400	124,640.00	0.27
103	600497	驰宏锌锗	24,000	124,560.00	0.27
104	300308	中际旭创	4,000	124,200.00	0.27
105	002673	西部证券	18,900	123,606.00	0.26
106	002030	达安基因	7,160	123,080.40	0.26
107	600143	金发科技	12,900	122,808.00	0.26
108	600482	中国动力	7,800	122,538.00	0.26
109	300676	华大基因	1,700	121,890.00	0.26
110	000039	中集集团	8,800	121,880.00	0.26
111	002465	海格通信	13,400	121,806.00	0.26
112	603267	鸿远电子	900	120,897.00	0.26
113	002624	完美世界	8,400	120,708.00	0.26
114	000807	云铝股份	12,100	119,548.00	0.26
115	002508	老板电器	3,300	118,899.00	0.25
116	601699	潞安环能	8,100	118,422.00	0.25

117	300136	信维通信	7,000	117,950.00	0.25
118	603345	安井食品	700	117,509.00	0.25
119	000960	锡业股份	7,000	117,390.00	0.25
120	002409	雅克科技	2,100	116,571.00	0.25
121	000975	银泰黄金	11,960	116,490.40	0.25
122	300357	我武生物	2,200	114,466.00	0.24
123	600704	物产中大	22,300	114,399.00	0.24
124	000629	攀钢钒钛	30,000	114,000.00	0.24
125	603127	昭衍新药	1,000	113,800.00	0.24
126	600079	人福医药	7,100	113,600.00	0.24
127	300058	蓝色光标	17,300	112,969.00	0.24
128	600739	辽宁成大	7,700	112,266.00	0.24
129	002422	科伦药业	6,000	112,200.00	0.24
130	605117	德业股份	400	111,956.00	0.24
131	601997	贵阳银行	19,200	111,552.00	0.24
132	600372	中航电子	5,700	110,523.00	0.24
133	002506	协鑫集成	29,700	110,484.00	0.24
134	002223	鱼跃医疗	4,300	110,338.00	0.24
135	600415	小商品城	19,800	110,286.00	0.24
136	000547	航天发展	9,200	109,848.00	0.24
137	002739	万达电影	8,000	109,200.00	0.23
138	300253	卫宁健康	12,400	108,872.00	0.23
139	300418	昆仑万维	6,800	108,800.00	0.23
140	002372	伟星新材	4,500	108,180.00	0.23
141	300296	利亚德	14,800	108,040.00	0.23
142	600062	华润双鹤	4,200	107,772.00	0.23
143	002439	启明星辰	5,400	107,622.00	0.23
144	600867	通化东宝	10,400	107,536.00	0.23
145	000636	风华高科	5,700	107,103.00	0.23
146	600315	上海家化	2,500	106,875.00	0.23
147	600699	均胜电子	6,800	106,828.00	0.23

148	600859	王府井	4,100	106,518.00	0.23
149	600637	东方明珠	14,700	105,105.00	0.22
150	600026	中远海能	10,100	104,333.00	0.22
151	603198	迎驾贡酒	1,600	104,224.00	0.22
152	300832	新产业	2,300	103,753.00	0.22
153	002299	圣农发展	5,400	103,572.00	0.22
154	300558	贝达药业	1,700	103,360.00	0.22
155	600039	四川路桥	9,800	103,194.00	0.22
156	002156	通富微电	6,700	103,180.00	0.22
157	601016	节能风电	21,400	102,720.00	0.22
158	600536	中国软件	2,530	102,692.70	0.22
159	600171	上海贝岭	4,100	102,623.00	0.22
160	300474	景嘉微	1,500	102,585.00	0.22
161	600879	航天电子	15,800	102,542.00	0.22
162	300026	红日药业	13,300	102,410.00	0.22
163	600236	桂冠电力	16,800	102,312.00	0.22
164	601198	东兴证券	11,400	101,460.00	0.22
165	688185	康希诺	500	99,540.00	0.21
166	600985	淮北矿业	6,800	99,008.00	0.21
167	600848	上海临港	7,300	98,988.00	0.21
168	688521	芯原股份	2,000	98,800.00	0.21
169	002936	郑州银行	36,720	98,776.80	0.21
170	600642	申能股份	17,300	98,264.00	0.21
171	000750	国海证券	27,000	98,010.00	0.21
172	000513	丽珠集团	2,700	97,767.00	0.21
173	000623	吉林敖东	6,600	97,416.00	0.21
174	600673	东阳光	10,800	97,092.00	0.21
175	002273	水晶光电	8,000	96,880.00	0.21
176	600316	洪都航空	3,200	96,768.00	0.21
177	600258	首旅酒店	3,900	96,720.00	0.21
178	000887	中鼎股份	5,300	96,672.00	0.21

179	600580	卧龙电驱	6,700	96,614.00	0.21
180	000729	燕京啤酒	10,000	96,600.00	0.21
181	300244	迪安诊断	3,100	96,410.00	0.21
182	600170	上海建工	31,400	95,142.00	0.20
183	601717	郑煤机	6,600	95,106.00	0.20
184	600038	中直股份	2,100	94,920.00	0.20
185	002203	海亮股份	8,200	94,710.00	0.20
186	600325	华发股份	12,400	93,868.00	0.20
187	300383	光环新网	9,000	93,780.00	0.20
188	600801	华新水泥	4,800	93,648.00	0.20
189	300017	网宿科技	17,400	93,264.00	0.20
190	002131	利欧股份	47,900	92,926.00	0.20
191	600369	西南证券	23,400	92,898.00	0.20
192	601162	天风证券	29,200	92,856.00	0.20
193	002092	中泰化学	11,900	92,344.00	0.20
194	002195	二三四五	40,700	91,575.00	0.20
195	600008	首创环保	31,530	91,437.00	0.20
196	300482	万孚生物	2,240	91,190.40	0.20
197	600909	华安证券	20,020	91,091.00	0.19
198	601005	重庆钢铁	47,600	90,916.00	0.19
199	300024	机器人	9,000	90,720.00	0.19
200	603568	伟明环保	2,700	90,099.00	0.19
201	600027	华电国际	22,900	89,997.00	0.19
202	600529	山东药玻	3,200	89,440.00	0.19
203	600166	福田汽车	31,600	89,428.00	0.19
204	000825	太钢不锈	16,300	88,835.00	0.19
205	002373	千方科技	7,900	87,848.00	0.19
206	002500	山西证券	15,300	87,822.00	0.19
207	002926	华西证券	11,200	87,808.00	0.19
208	000050	深天马 A	8,800	87,736.00	0.19
209	603233	大参林	2,800	87,640.00	0.19

210	300618	寒锐钴业	1,500	86,880.00	0.19
211	000739	普洛药业	4,200	86,688.00	0.19
212	600271	航天信息	7,900	86,426.00	0.18
213	603218	日月股份	3,400	86,360.00	0.18
214	600118	中国卫星	4,300	86,344.00	0.18
215	002212	天融信	8,500	86,275.00	0.18
216	002683	广东宏大	3,100	86,273.00	0.18
217	300677	英科医疗	3,400	86,224.00	0.18
218	601866	中远海发	28,600	85,800.00	0.18
219	002065	东华软件	13,500	85,320.00	0.18
220	600208	新湖中宝	30,900	85,284.00	0.18
221	688009	中国通号	18,800	85,164.00	0.18
222	002250	联化科技	5,200	85,124.00	0.18
223	002444	巨星科技	4,500	84,780.00	0.18
224	000027	深圳能源	13,200	84,612.00	0.18
225	002430	杭氧股份	2,700	84,402.00	0.18
226	002294	信立泰	3,000	84,300.00	0.18
227	688256	寒武纪	1,300	84,110.00	0.18
228	600863	内蒙华电	22,900	83,585.00	0.18
229	002249	大洋电机	13,600	83,504.00	0.18
230	688002	睿创微纳	2,100	83,412.00	0.18
231	000400	许继电气	4,300	82,560.00	0.18
232	601992	金隅集团	29,800	82,546.00	0.18
233	002152	广电运通	8,900	82,503.00	0.18
234	600066	宇通客车	9,500	82,175.00	0.18
235	600820	隧道股份	13,400	82,008.00	0.18
236	600380	健康元	6,620	81,757.00	0.17
237	000060	中金岭南	18,300	81,618.00	0.17
238	300009	安科生物	8,060	81,486.60	0.17
239	002183	怡亚通	11,300	81,473.00	0.17
240	002191	劲嘉股份	7,600	81,472.00	0.17

241	300182	捷成股份	14,800	81,400.00	0.17
242	002985	北摩高科	1,389	81,367.62	0.17
243	300070	碧水源	15,600	81,276.00	0.17
244	000401	冀东水泥	7,700	81,004.00	0.17
245	600755	厦门国贸	10,800	81,000.00	0.17
246	600998	九州通	6,800	80,988.00	0.17
247	603858	步长制药	4,100	80,811.00	0.17
248	300168	万达信息	8,500	80,240.00	0.17
249	002831	裕同科技	2,700	79,785.00	0.17
250	000878	云南铜业	7,000	79,730.00	0.17
251	000778	新兴铸管	16,500	79,530.00	0.17
252	603156	养元饮品	3,500	79,520.00	0.17
253	002408	齐翔腾达	9,800	79,478.00	0.17
254	600970	中材国际	8,200	79,458.00	0.17
255	600827	百联股份	6,000	79,260.00	0.17
256	002396	星网锐捷	3,500	79,240.00	0.17
257	000021	深科技	6,800	79,152.00	0.17
258	002966	苏州银行	12,930	78,873.00	0.17
259	600056	中国医药	5,320	78,842.40	0.17
260	600390	五矿资本	16,100	78,729.00	0.17
261	600667	太极实业	10,600	78,228.00	0.17
262	603658	安图生物	1,600	78,224.00	0.17
263	000997	新大陆	5,900	77,939.00	0.17
264	300001	特锐德	4,500	77,895.00	0.17
265	600528	中铁工业	9,600	77,280.00	0.17
266	300251	光线传媒	8,100	76,707.00	0.16
267	600839	四川长虹	26,600	76,608.00	0.16
268	002221	东华能源	8,200	76,342.00	0.16
269	002244	滨江集团	8,800	76,120.00	0.16
270	002128	电投能源	5,300	75,896.00	0.16
271	002019	亿帆医药	5,400	75,492.00	0.16

272	600598	北大荒	5,100	75,276.00	0.16
273	600511	国药股份	2,800	74,984.00	0.16
274	603707	健友股份	2,650	74,730.00	0.16
275	002266	浙富控股	15,500	74,245.00	0.16
276	000012	南玻A	10,000	74,200.00	0.16
277	000987	越秀金控	10,530	74,025.90	0.16
278	002505	鹏都农牧	21,800	73,902.00	0.16
279	600201	生物股份	7,944	72,767.04	0.16
280	600498	烽火通信	5,000	72,400.00	0.15
281	600895	张江高科	5,800	72,210.00	0.15
282	002155	湖南黄金	5,947	72,196.58	0.15
283	600155	华创阳安	8,500	72,080.00	0.15
284	002670	国盛金控	7,500	72,000.00	0.15
285	603885	吉祥航空	4,000	71,960.00	0.15
286	002127	南极电商	13,400	71,556.00	0.15
287	000883	湖北能源	14,000	71,540.00	0.15
288	000930	中粮科技	7,900	71,416.00	0.15
289	002124	天邦食品	10,560	70,963.20	0.15
290	600297	广汇汽车	27,100	70,731.00	0.15
291	600718	东软集团	6,100	70,211.00	0.15
292	002511	中顺洁柔	5,597	70,074.44	0.15
293	688006	杭可科技	1,000	70,060.00	0.15
294	000686	东北证券	10,000	69,900.00	0.15
295	603712	七一二	2,200	69,300.00	0.15
296	601880	辽港股份	40,700	69,190.00	0.15
297	688208	道通科技	2,100	69,132.00	0.15
298	002153	石基信息	4,340	68,875.80	0.15
299	601179	中国西电	14,700	68,796.00	0.15
300	600060	海信视像	5,500	68,750.00	0.15
301	600282	南钢股份	21,800	68,670.00	0.15
302	600782	新钢股份	13,600	68,544.00	0.15

303	600535	天士力	6,500	68,315.00	0.15
304	000709	河钢股份	30,200	68,252.00	0.15
305	600064	南京高科	6,200	68,200.00	0.15
306	600566	济川药业	2,500	67,900.00	0.15
307	600037	歌华有线	7,200	67,608.00	0.14
308	300376	易事特	8,300	67,396.00	0.14
309	000581	威孚高科	3,500	67,375.00	0.14
310	600022	山东钢铁	38,600	67,164.00	0.14
311	600409	三友化工	8,200	67,158.00	0.14
312	002701	奥瑞金	12,900	67,080.00	0.14
313	600216	浙江医药	4,900	66,885.00	0.14
314	300630	普利制药	1,900	66,785.00	0.14
315	002002	鸿达兴业	18,000	66,780.00	0.14
316	002939	长城证券	6,500	66,040.00	0.14
317	600259	广晟有色	1,300	65,845.00	0.14
318	600500	中化国际	9,900	65,835.00	0.14
319	000656	金科股份	23,000	65,780.00	0.14
320	300463	迈克生物	3,200	65,568.00	0.14
321	600663	陆家嘴	6,300	65,268.00	0.14
322	600728	佳都科技	10,100	65,246.00	0.14
323	601577	长沙银行	8,200	65,026.00	0.14
324	000598	兴蓉环境	12,700	64,897.00	0.14
325	002595	豪迈科技	2,900	64,786.00	0.14
326	002532	天山铝业	9,900	64,647.00	0.14
327	603225	新凤鸣	5,600	64,624.00	0.14
328	600567	山鹰国际	23,200	64,264.00	0.14
329	600808	马钢股份	16,900	64,051.00	0.14
330	600517	国网英大	12,300	63,837.00	0.14
331	002958	青农商行	19,200	63,744.00	0.14
332	002004	华邦健康	11,400	63,612.00	0.14
333	601456	国联证券	5,100	62,577.00	0.13

334	002745	木林森	6,400	62,528.00	0.13
335	603866	桃李面包	3,760	62,228.00	0.13
336	600597	光明乳业	4,900	61,887.00	0.13
337	688188	柏楚电子	280	61,611.20	0.13
338	600811	东方集团	21,700	61,411.00	0.13
339	000690	宝新能源	14,000	61,320.00	0.13
340	300115	长盈精密	5,920	61,035.20	0.13
341	601958	金钼股份	6,900	60,996.00	0.13
342	601106	中国一重	19,700	60,479.00	0.13
343	600572	康恩贝	13,600	60,248.00	0.13
344	601118	海南橡胶	12,400	59,272.00	0.13
345	601718	际华集团	19,000	58,900.00	0.13
346	603927	中科软	2,520	58,766.40	0.13
347	600737	中粮糖业	7,800	58,656.00	0.13
348	001914	招商积余	3,246	58,330.62	0.12
349	002390	信邦制药	8,300	57,353.00	0.12
350	600507	方大特钢	8,200	57,318.00	0.12
351	000089	深圳机场	7,400	57,128.00	0.12
352	600967	内蒙一机	6,200	56,544.00	0.12
353	600021	上海电力	5,500	56,375.00	0.12
354	002010	传化智联	8,700	55,941.00	0.12
355	600582	天地科技	11,700	55,926.00	0.12
356	002368	太极股份	2,900	55,709.00	0.12
357	002690	美亚光电	2,560	55,500.80	0.12
358	601000	唐山港	21,400	55,212.00	0.12
359	600435	北方导航	6,400	55,168.00	0.12
360	000898	鞍钢股份	17,100	55,062.00	0.12
361	000559	万向钱潮	9,200	54,648.00	0.12
362	000537	广宇发展	4,200	54,558.00	0.12
363	002048	宁波华翔	3,400	54,468.00	0.12
364	000937	冀中能源	7,300	54,458.00	0.12

365	601778	晶科科技	10,000	54,000.00	0.12
366	600195	中牧股份	4,400	53,944.00	0.12
367	002174	游族网络	5,500	53,735.00	0.11
368	601333	广深铁路	24,300	52,974.00	0.11
369	000540	中天金融	27,400	52,882.00	0.11
370	002705	新宝股份	2,400	52,776.00	0.11
371	002281	光迅科技	3,000	52,740.00	0.11
372	300166	东方国信	5,700	52,554.00	0.11
373	002468	申通快递	4,400	52,448.00	0.11
374	002110	三钢闽光	8,600	52,374.00	0.11
375	002233	塔牌集团	5,900	52,215.00	0.11
376	603883	老百姓	1,534	51,971.92	0.11
377	000402	金融街	8,700	51,765.00	0.11
378	300072	海新能科	10,100	51,106.00	0.11
379	688088	虹软科技	1,600	50,544.00	0.11
380	600764	中国海防	2,000	50,480.00	0.11
381	603638	艾迪精密	2,460	50,430.00	0.11
382	002416	爱施德	5,400	50,220.00	0.11
383	300212	易华录	2,880	50,112.00	0.11
384	600126	杭钢股份	9,700	49,664.00	0.11
385	600120	浙江东方	12,340	49,483.40	0.11
386	600167	联美控股	6,600	49,434.00	0.11
387	000990	诚志股份	4,500	49,275.00	0.11
388	600329	达仁堂	2,000	49,160.00	0.11
389	002429	兆驰股份	12,800	49,152.00	0.11
390	601098	中南传媒	5,200	49,088.00	0.11
391	000488	晨鸣纸业	8,700	49,068.00	0.10
392	600373	中文传媒	4,900	48,951.00	0.10
393	600446	金证股份	4,700	48,786.00	0.10
394	601200	上海环境	4,800	48,768.00	0.10
394	002081	金螳螂	9,600	48,768.00	0.10

396	002382	蓝帆医疗	5,100	48,705.00	0.10
397	000685	中山公用	6,300	48,384.00	0.10
398	002146	荣盛发展	15,800	47,874.00	0.10
399	688321	微芯生物	1,900	47,861.00	0.10
400	600707	彩虹股份	10,200	47,736.00	0.10
401	002925	盈趣科技	2,210	47,559.20	0.10
402	002399	海普瑞	2,700	47,466.00	0.10
403	601608	中信重工	12,400	46,996.00	0.10
404	601611	中国核建	5,600	46,984.00	0.10
405	600376	首开股份	9,500	46,645.00	0.10
406	001965	招商公路	6,100	46,543.00	0.10
407	603317	天味食品	1,620	46,121.40	0.10
408	002867	周大生	2,950	45,813.50	0.10
409	600131	国网信通	3,400	45,730.00	0.10
410	000158	常山北明	7,600	45,600.00	0.10
411	000528	柳 工	7,000	45,570.00	0.10
412	603868	飞科电器	600	45,450.00	0.10
413	600959	江苏有线	13,700	44,662.00	0.10
414	603228	景旺电子	1,900	44,327.00	0.09
415	000563	陕国投 A	14,200	44,304.00	0.09
416	600901	江苏租赁	8,600	44,118.00	0.09
417	688289	圣湘生物	1,480	43,822.80	0.09
418	600006	东风汽车	5,800	43,790.00	0.09
419	601598	中国外运	11,200	43,456.00	0.09
420	300257	开山股份	2,900	43,384.00	0.09
421	600307	酒钢宏兴	22,200	43,068.00	0.09
422	000961	中南建设	14,000	42,700.00	0.09
423	603000	人民网	3,800	42,560.00	0.09
424	601991	大唐发电	17,400	42,282.00	0.09
425	600398	海澜之家	8,900	42,275.00	0.09
426	002242	九阳股份	2,300	42,228.00	0.09

427	600717	天津港	10,460	41,944.60	0.09
428	002434	万里扬	4,900	41,895.00	0.09
429	600906	财达证券	4,600	41,354.00	0.09
430	000718	苏宁环球	10,900	40,112.00	0.09
431	601928	凤凰传媒	5,600	40,040.00	0.09
432	002387	维信诺	5,900	39,648.00	0.08
433	000671	阳光城	18,000	39,420.00	0.08
434	603650	彤程新材	1,200	39,096.00	0.08
435	000553	安道麦A	3,200	38,752.00	0.08
436	000959	首钢股份	8,100	38,556.00	0.08
437	000031	大悦城	9,500	38,000.00	0.08
438	000415	渤海租赁	17,500	37,975.00	0.08
439	600968	海油发展	14,400	37,152.00	0.08
440	603786	科博达	600	36,942.00	0.08
441	600648	外高桥	2,700	36,720.00	0.08
442	688029	南微医学	420	36,624.00	0.08
443	600787	中储股份	6,400	36,416.00	0.08
444	601860	紫金银行	12,400	35,588.00	0.08
445	600928	西安银行	9,600	35,232.00	0.08
446	600339	中油工程	11,900	34,391.00	0.07
447	002563	森马服饰	5,800	34,336.00	0.07
448	000967	盈峰环境	6,700	33,902.00	0.07
449	002815	崇达技术	2,600	33,306.00	0.07
450	300888	稳健医疗	500	33,250.00	0.07
451	600623	华谊集团	4,000	33,200.00	0.07
452	601228	广州港	9,000	33,030.00	0.07
453	600835	上海机电	2,400	32,952.00	0.07
454	003035	南网能源	5,100	32,385.00	0.07
455	002423	中粮资本	4,800	32,208.00	0.07
456	000717	韶钢松山	8,600	30,100.00	0.06
457	000028	国药一致	1,000	29,790.00	0.06

458	600556	天下秀	3,600	29,628.00	0.06
459	603056	德邦股份	2,200	29,546.00	0.06
460	000156	华数传媒	3,700	29,489.00	0.06
461	600095	湘财股份	3,800	29,222.00	0.06
462	000062	深圳华强	2,300	29,210.00	0.06
463	600377	宁沪高速	3,400	29,138.00	0.06
464	002945	华林证券	1,900	28,975.00	0.06
465	600299	安迪苏	3,000	28,740.00	0.06
466	601298	青岛港	5,100	27,897.00	0.06
467	601139	深圳燃气	4,000	27,760.00	0.06
468	688819	天能股份	800	27,664.00	0.06
469	000869	张裕 A	900	26,766.00	0.06
470	603379	三美股份	1,200	26,700.00	0.06
471	002948	青岛银行	7,180	25,991.60	0.06
472	001872	招商港口	1,600	24,960.00	0.05
473	600871	石化油服	13,100	24,759.00	0.05
474	601869	长飞光纤	800	24,736.00	0.05
475	002653	海思科	1,500	24,165.00	0.05
476	600823	世茂股份	8,100	24,138.00	0.05
477	601969	海南矿业	2,800	24,052.00	0.05
478	601156	东航物流	1,200	23,760.00	0.05
479	600350	山东高速	4,500	23,625.00	0.05
480	002901	大博医疗	600	23,484.00	0.05
481	300741	华宝股份	800	22,256.00	0.05
482	689009	九号公司	500	22,250.00	0.05
483	001227	兰州银行	4,500	22,140.00	0.05
484	688777	中控技术	300	21,828.00	0.05
485	000785	居然之家	4,900	21,805.00	0.05
486	600927	永安期货	1,000	20,170.00	0.04
487	601828	美凯龙	3,300	19,998.00	0.04
488	300869	康泰医学	700	19,782.00	0.04

489	001203	大中矿业	1,600	18,080.00	0.04
490	603355	莱克电气	700	17,661.00	0.04
491	603515	欧普照明	1,000	17,450.00	0.04
492	603719	良品铺子	600	17,178.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	3,500	17,080.00	0.04
494	603983	丸美股份	600	16,080.00	0.03
495	601568	北元集团	2,410	15,279.40	0.03
496	600917	重庆燃气	2,100	15,162.00	0.03
497	601003	柳钢股份	3,600	14,580.00	0.03
498	002946	新乳业	1,100	14,289.00	0.03
499	600956	新天绿能	900	11,088.00	0.02
500	601187	厦门银行	1,700	10,132.00	0.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票组合。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002497	雅化集团	281,589.00	0.49
2	002240	盛新锂能	273,102.00	0.48
3	300769	德方纳米	271,624.00	0.47
4	600096	云天化	243,729.00	0.42
5	688180	君实生物	225,126.00	0.39
6	300073	当升科技	215,285.00	0.37
7	603444	吉比特	206,279.00	0.36
8	002756	永兴材料	201,570.00	0.35
9	688122	西部超导	194,062.00	0.34
10	300012	华测检测	192,520.00	0.34
11	300390	天华超净	191,776.00	0.33

12	002407	多氟多	188,640.00	0.33
13	601108	财通证券	187,748.00	0.33
14	601058	赛轮轮胎	184,702.00	0.32
15	000783	长江证券	173,436.00	0.30
16	600499	科达制造	168,100.00	0.29
17	002625	光启技术	160,800.00	0.28
18	603290	斯达半导	157,873.00	0.27
19	601607	上海医药	157,080.00	0.27
20	603026	石大胜华	150,527.00	0.26

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	000733	振华科技	351,693.00	0.61
2	002340	格林美	303,681.00	0.53
3	600188	兖矿能源	299,788.00	0.52
4	603290	斯达半导	278,656.00	0.48
5	300751	迈为股份	248,934.00	0.43
6	601117	中国化学	244,089.00	0.42
7	000723	美锦能源	242,149.00	0.42
8	600884	杉杉股份	216,627.00	0.38
9	603444	吉比特	216,238.00	0.38
10	688005	容百科技	212,856.00	0.37
11	605358	立昂微	205,124.08	0.36
12	300763	锦浪科技	195,180.00	0.34
13	601689	拓普集团	189,028.00	0.33
14	600754	锦江酒店	187,017.00	0.33
15	002013	中航机电	186,752.00	0.32
16	688536	思瑞浦	165,597.00	0.29

17	600256	广汇能源	136,150.00	0.24
18	300223	北京君正	135,045.00	0.24
19	600733	北汽蓝谷	134,533.00	0.23
20	600803	新奥股份	125,732.00	0.22

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	9,310,799.00
卖出股票收入（成交）总额	11,274,223.72

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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	204,645.26
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	204,645.26

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
372	119,205.04	35,057,465.00	79.057 5%	9,286,810.00	20.942 5%

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	32,077,908.00	72.34%
2	中信建投证券股份有限公司	2,979,557.00	6.72%
3	李翠英	995,019.00	2.24%
4	杨清萍	560,105.00	1.26%
5	张丽怡	399,011.00	0.90%
6	程晓东	369,138.00	0.83%
7	张红	300,020.00	0.68%
8	靳玮	300,008.00	0.68%
9	陈赛月	300,000.00	0.68%
10	郑慧英	200,085.00	0.45%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研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(2020年07月14日)基金份额总额	342,344,275.00
本报告期期初基金份额总额	48,344,275.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	44,344,275.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、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	
中信建投	1	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	新增
广发证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	186,752.00	0.91%	134.71	0.90%	—
申万宏源证券	2	6,166,883.00	29.97%	4,509.97	30.11%	—
五矿证券	2	—	—	—	—	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中信证券	2	741,316.00	3.60%	537.30	3.59%	—
海通证券	3	13,479,145.72	65.52%	9,797.37	65.40%	—

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
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-01
2	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-22
3	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	2022-03-18
4	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-26
5	永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22

§ 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	20220101 - 20220630	32,077,908.00	0.00	0.00	32,077,908.00 72.34%
	2	20220609 - 20220609	5,831,610.00	9,178,036.00	12,030,089.00	2,979,557.00 6.72%
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. 中国证监会准予永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
2. 《永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新(如有)；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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
二〇二二年八月三十日