

永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2023 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月28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2023年01月01日起至2023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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	23
§7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	63
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65

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	65
§9 开放式基金份额变动	66
§10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	69
§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	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	永赢消费主题	
基金主代码	006252	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年11月06日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	491,491,746.83份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢消费主题A	永赢消费主题C
下属分级基金的交易代码	006252	006253
报告期末下属分级基金的份额总额	317,145,291.67份	174,346,455.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于消费主题相关上市公司股票，在控制风险的前提下，力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基于对消费行业发展形势和未来趋势的深刻理解，本基金对于消费行业的界定按照申万行业分类标准，划分为三类：即主要消费、可选消费和其他消费。主要消费指主要与居民的基本生活需求高度相关的商品或服务；可选消费指非居民生活必需的，主要用于改善居民生活质量的商品和服务，居民可以自行选择是否进行消费。此外其他消费指居民日常生活中直接或间接使用的其他商品或服务，这类商品或服务拉动一系列与消费相关的产业发展、升级，对于拉动消费形成直接或间接作用。 根据前文定义，主要消费包括食品饮料、家用电器、农林牧渔、纺织服饰、医药生物、轻工制造、交通运输、公用事业、环保等；可选消费包括汽车、社会服务、商贸零售、金融、银行、电子、通信、传媒、

	房地产、建筑材料、建筑装饰、电力设备、机械设备、计算机、美容护理等；其他消费包括民用军工用品。 本基金主要投资策略包括资产配置策略（本基金的股票投资组合比例将按照上述消费行业的预测平均市盈率（PE）与预测平均市盈增长比率（PEG）来判断。当预测的平均PE与PEG在较低阈值区间时，本基金将按照规定保持较高仓位的股票类资产配置比例，从而争取为基金能够用较低成本抓住机遇获取潜在收益；当预测的平均PE与PEG在较高阈值区间时，本基金将按照规定保持较低仓位的股票类资产配置比例，从而为基金控制风险。当预测的平均PE与PEG在剩余其他阈值区间时，本基金将保持适中的股票类资产比例。） 、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略和资产支持证券投资策略、权证投资策略和股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率*60%+中国债券总指数收益率*40%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中风险和中等预期收益产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		永赢基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	朱萍
	联系电话	021-20430340	021-31888888
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-805-8888	95528
传真		021-51690177	021-63602540
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	上海市中山东一路12号

办公地址	上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码	200120	200126
法定代表人	马宇晖	郑杨

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号二十一世纪大厦21、22、23、27层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	永赢基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	永赢消费主题A	永赢消费主题C
本期已实现收益	-80,309,304.34	-45,478,015.30
本期利润	-119,645,553.89	-70,028,424.90
加权平均基金份额本期利润	-0.3305	-0.3426
本期加权平均净值利润率	-12.98%	-13.60%
本期基金份额净值增长率	-13.37%	-13.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末	

	(2023年06月30日)	
期末可供分配利润	88,604,950.62	45,365,465.76
期末可供分配基金份额利润	0.2794	0.2602
期末基金资产净值	715,885,642.04	389,436,298.79
期末基金份额净值	2.2573	2.2337
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	125.73%	123.37%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

永赢消费主题A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-1.09%	1.55%	2.63%	0.71%	-3.72%	0.84%
过去三个月	-13.95%	1.15%	-4.71%	0.61%	-9.24%	0.54%
过去六个月	-13.37%	1.13%	-3.09%	0.64%	-10.28%	0.49%
过去一年	-33.07%	1.24%	-10.48%	0.75%	-22.59%	0.49%
过去三年	13.91%	1.51%	7.12%	0.93%	6.79%	0.58%
自基金合同 生效起至今	125.73%	1.49%	54.06%	0.91%	71.67%	0.58%

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

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

永赢消费主题C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-1.11%	1.55%	2.63%	0.71%	-3.74%	0.84%
过去三个月	-13.99%	1.15%	-4.71%	0.61%	-9.28%	0.54%
过去六个月	-13.45%	1.13%	-3.09%	0.64%	-10.36%	0.49%
过去一年	-33.20%	1.24%	-10.48%	0.75%	-22.72%	0.49%
过去三年	13.23%	1.51%	7.12%	0.93%	6.11%	0.58%
自基金合同 生效起至今	123.37%	1.49%	54.06%	0.91%	69.31%	0.58%

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

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

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

永赢消费主题A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年11月06日-2023年06月30日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

永赢消费主题C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年11月06日-2023年06月30日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2023年6月30日，本基金管理人共管理117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、永赢中债-1-5 年国开行债券指数证券投资基金、永赢医药健康股票型证券投资基金、永赢邦利债券型证券投资基金、永赢瑞宁87个月定期开放债券型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫享混合型证券投资基金、永赢鼎利债券型证券投资基金、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金、永赢成长领航混合型证券投资基金、永赢泰宁63个月定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫欣混合型证券投资基金、永赢稳健增利18个月持有期混合型证券投资基金、永赢鑫盛混合型证券投资基金、永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠添益混合型证券投资基金、永赢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、永赢新能源智选混合型发起式证券投资基金、永赢坤益债券型证券投资基金、永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金、永赢宏泰短债债券型证券投资基金、永赢添添悦6个月持有期混合型证券投资基金、永赢优质生活混合型证券投资基金、永赢安悦60天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢湖北国有企业债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、永赢半导体产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢低碳环保智选混合型发起式证券投资基金、永赢安泰中短债债券型证券投资基金、永赢医药创新智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费鑫选6个月持有期混合型证券投资基金、永赢消费龙头智选混合型发起式证券投资基金、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基金、永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金、永赢季季享90天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢昭利债券型证券投资基金、永赢恒欣稳健养老目标三年持有期混合基金中基金、永赢数字经济智选混合型发起式证券投资基金、永赢月月享30天持有期短债债券型证券投资基金、永赢先进制造智选混合型发起式证券投资基金、永赢浩益一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
常远	基金经理	2019-12-12	-	12	常远先生，同济大学理学博士，12年证券相关从业经验。曾任易方达基金管理有限公司权益投资部基金经理，现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。

注：

- 1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。
- 2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**4.3.1 公平交易制度的执行情况**

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

2023年上半年权益市场总体上经历一轮波动的慢复苏，期间上证指数上涨约3.65%，但是沪深300指数下跌0.75%，创业板指下跌5.61%；市场结构出现显著分化，“中特估”、AI相关股票涨幅明显，但是同期中证消费指数下跌约12.4%，永赢消费主题净值也出现了明显回撤。我们回顾了上半年的投资策略，首先产品主要配置在以白酒、家居为主的大消费领域，虽然在1季度初期获得了一定的正收益，但是伴随短期消费数据的回落和市场对于经济复苏的迟疑，总体上大消费和顺周期板块又出现明显的回调。其次部分仓位在年初还布局在新能源汽车领域，虽然最终新能源汽车销量和电池出货量符合我们之前的预期，但是市场对于汽车板块的总体悲观，以及对于新能源产业链的远期利润空间的质疑导致相关股票在估值较低的位置上，又出现了一轮下跌。从长期策略维度看，我们的权益投资重点坚持在大消费赛道中做布局，同时也关注优质科技成长类公司的机会，力图采取均衡配置的策略规避行业的波动风险，寻找具备成长优势的个股，但是这一长期策略与本轮持续较长的经济下行周期和存量市场博弈的环境并不匹配。均衡配置的结果可能导致行业分散后出现递次的下跌，组合弹性被显著对冲。而短期内缺乏明确经济动能和产业逻辑的大背景下，市场对于资金博弈、主题等更为敏感，这与我们追求企业长期成长定价的方式不一致。

经过一段时间的思考后，我们力求对投资策略和方法做出有效的改进。其一是相对过往，更为看中周期环境对于板块的影响；其二是坚持寻找长期核心竞争能力的公司，但是股票定价给与了更为苛刻的买入条件；其三是对于优秀商业模式和长期竞争力的公司给与更长的耐心，等待回报；其四是加强了对于我们能力圈范围内很多公司和行业的研究，但是较为谨慎的做出投资决定，更多是为未来储备可以长期跟踪的备选投资标的。相信我们的努力会在将来能够有所收获。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢消费主题A基金份额净值为2.2573元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.37%，同期业绩比较基准收益率为-3.09%；截至报告期末永赢消费主题C基金份额净值为2.2337元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.45%，同期业绩比较基准收益率为-3.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济和市场的发展阶段看，我们也发现了一些积极的变化。首先，3季度从库存周期角度看将进入本轮去库存的结尾，客观层面上为经济和权益市场给出了基本面的底部；其次，国内经济政策还在更为积极的出台，高质量发展的进程还在路上，这些将慢慢产生正向效果；另外，海外以大模型推动的人工智能的进步，及其对于硬件投入和软件应用的拉动作用逐步显现，预示着新一轮产业革命可能到来，这为从成长型产业逻辑出发寻找投资机会提供了便利。此外，汽车智能化、人形机器人、MR硬件领域的升级甚至高温超导和可控核聚变的科学突破等等，让我们对未来的技术与产业升级抱有了更强的信心，而新技术带来的经济发展也将会有助于市场去消弭存量博弈竞争所带来的不确定性和挑战。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本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本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	77,747,776.50	91,868,418.28
结算备付金		5,466,442.59	11,938,798.39
存出保证金		805,452.69	1,256,404.01

交易性金融资产	6.4.7.2	1,026,552,530.28	1,453,794,204.24
其中：股票投资		1,026,552,530.28	1,453,794,204.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	21,119,419.42
应收股利		-	-
应收申购款		1,208,099.27	1,404,025.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,111,780,301.33	1,581,381,270.17
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022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		-	-
应付赎回款		748,947.87	22,927,763.83

应付管理人报酬		1,481,674.36	2,017,990.48
应付托管费		246,945.72	336,331.76
应付销售服务费		70,443.72	97,374.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,910,348.83	4,694,550.92
负债合计		6,458,360.50	30,074,011.98
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	491,491,746.83	597,385,559.86
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	613,830,194.00	953,921,698.33
净资产合计		1,105,321,940.83	1,551,307,258.19
负债和净资产总计		1,111,780,301.33	1,581,381,270.17

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值2.2489元，基金份额总额491,491,746.83份。其中A类基金份额净值2.2573元，份额总额317,145,291.67份；C类基金份额净值2.2337元，份额总额174,346,455.16份。

6.2 利润表

会计主体：永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		-176,518,530.89	-312,946,781.90
1.利息收入		226,704.75	381,014.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	226,704.75	381,014.24
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）		-113,056,460.75	-271,851,519.62
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-121,464,371.97	-284,493,934.60
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	-	-
股利收益	6.4.7.15	8,407,911.22	12,642,414.98
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	-63,886,659.15	-42,095,289.41
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	197,884.26	619,012.89
减：二、营业总支出		13,155,447.90	23,369,198.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,734,479.59	19,256,132.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,789,079.97	3,209,355.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	512,966.08	774,845.81
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	118,922.26	128,864.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-189,673,978.79	-336,315,980.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-189,673,978.79	-336,315,980.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-189,673,978.79	-336,315,980.23

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2023年01月01日至2023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）	597,385,559.86	-	953,921,698.33	1,551,307,258.19
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）	597,385,559.86	-	953,921,698.33	1,551,307,258.19
三、本期增减变动额（减少以	-105,893,813.03	-	-340,091,504.33	-445,985,317.36

“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-189,673,978.79	-189,673,978.79
(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)	-105,893,813.03	-	-150,417,525.54	-256,311,338.57
其中: 1.基金申购款	92,073,354.31	-	146,735,856.65	238,809,210.96
2.基金赎回款	-197,967,167.34	-	-297,153,382.19	-495,120,549.53
(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)	491,491,746.83	-	613,830,194.00	1,105,321,940.83
项 目	上年度可比期间 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)	1,063,737,533.22	-	2,763,407,872.44	3,827,145,405.66
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）	1,063,737,533.2 2	-	2,763,407,872.4 4	3,827,145,405.6 6
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-394,480,235.92	-	-1,182,027,106. 47	-1,576,507,342. 39
（一）、综合收益总额	-	-	-336,315,980.23	-336,315,980.23
（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）	-394,480,235.92	-	-845,711,126.24	-1,240,191,362. 16
其中：1.基金申购款	166,273,285.00	-	343,642,619.51	509,915,904.51
2.基金赎回款	-560,753,520.92	-	-1,189,353,745. 75	-1,750,107,266. 67
（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）	669,257,297.30	-	1,581,380,765.9 7	2,250,638,063.2 7

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

永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1121号文《关于准予永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由永赢基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于2018年11月6日正式生效，首次设立募集规模为271,545,781.66份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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

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

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

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公

开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第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2023年6月30日的财务状况以及自2023年1月1日至2023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

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

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 2023年06月30日
活期存款	77,747,776.50
等于：本金	77,738,524.13
加：应计利息	9,252.37
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	77,747,776.50

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,048,310,609.59	-	1,026,552,530.28	-21,758,079.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,048,310,609.59	-	1,026,552,530.28	-21,758,079.31

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 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 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	48.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,794,162.01
其中：交易所市场	3,794,162.01
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	116,138.35
合计	3,910,348.83

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 永赢消费主题A

金额单位：人民币元

项目 (永赢消费主题A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	386,183,624.62	386,183,624.62
本期申购	23,620,860.34	23,620,860.34
本期赎回（以“-”号填列）	-92,659,193.29	-92,659,193.29
本期末	317,145,291.67	317,145,291.67

6.4.7.7.2 永赢消费主题C

金额单位：人民币元

项目 (永赢消费主题C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	211,201,935.24	211,201,935.24
本期申购	68,452,493.97	68,452,493.97
本期赎回（以“-”号填列）	-105,307,974.05	-105,307,974.05
本期末	174,346,455.16	174,346,455.16

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润**6.4.7.8.1 永赢消费主题A**

单位：人民币元

项目 (永赢消费主题A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	197,042,843.46	422,998,393.56	620,041,237.02
本期利润	-80,309,304.34	-39,336,249.55	-119,645,553.89
本期基金份额交易产生的变动数	-28,128,588.50	-73,526,744.26	-101,655,332.76
其中：基金申购款	10,859,441.94	26,242,416.06	37,101,858.00
基金赎回款	-38,988,030.44	-99,769,160.32	-138,757,190.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,604,950.62	310,135,399.75	398,740,350.37

6.4.7.8.2 永赢消费主题C

单位：人民币元

项目 (永赢消费主题C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	103,735,861.42	230,144,599.89	333,880,461.31
本期利润	-45,478,015.30	-24,550,409.60	-70,028,424.90
本期基金份额交易产	-12,892,380.36	-35,869,812.42	-48,762,192.78

生的变动数			
其中：基金申购款	31,606,912.79	78,027,085.86	109,633,998.65
基金赎回款	-44,499,293.15	-113,896,898.28	-158,396,191.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,365,465.76	169,724,377.87	215,089,843.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	177,302.39
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	41,263.39
其他	8,138.97
合计	226,704.75

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	4,056,307,571.93
减：卖出股票成本总额	4,167,429,187.95
减：交易费用	10,342,755.95
买卖股票差价收入	-121,464,371.97

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	8,407,911.22
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	8,407,911.22

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-63,886,659.15
——股票投资	-63,886,659.15
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允	-

价值变动产生的预估增值税	
合计	-63,886,659.15

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	195,763.79
基金转换费收入	2,120.47
合计	197,884.26

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	5,783.91
账户维护费	9,000.00
合计	118,922.26

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
上海浦东发展银行股份有限公司（"浦发银行"）	基金托管人、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（"宁波银行"）	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,734,479.59	19,256,132.84
其中：支付销售机构的客户维护费	3,982,983.85	4,892,815.81

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,789,079.97	3,209,355.43

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 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢消费主题A	永赢消费主题C	合计
宁波银行	0.00	17,959.91	17,959.91
浦发银行	0.00	3,119.18	3,119.18
永赢基金	0.00	27,231.06	27,231.06
合计	0.00	48,310.15	48,310.15

获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢消费主题A	永赢消费主题C	合计
宁波银行	0.00	19,511.66	19,511.66
浦发银行	0.00	4,154.58	4,154.58
永赢基金	0.00	173,237.29	173,237.29
合计	0.00	196,903.53	196,903.53

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

永赢消费主题A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	20,029,020.95
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	20,029,020.95
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

永赢消费主题C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022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	0.0000%	0.0000%

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

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022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
浦发银行	77,747,776.50	177,302.39	185,492,636.77	335,245.46

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（2023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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	105.00	2,932.65	3,468.15	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股限售	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股限售	20.68	25.49	145.00	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	177.00	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股限售	44.48	39.48	55.00	2,446.40	2,171.40	-
0013	华纬	2023	6个月	新股	28.84	30.78	170.00	4,90	5,23	-

80	科技	-05-09		限售				2.80	2.60	
300804	广康生化	2023-06-15	6个月	新股限售	42.45	32.97	226.00	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新股限售	41.20	42.69	262.00	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6个月	新股限售	56.50	52.93	150.00	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股限售	34.00	34.93	250.00	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内(含)	认购新发证券	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	306.00	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	新股限售	46.13	34.40	225.00	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股限售	57.88	49.17	281.00	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	新股限售	35.66	33.26	333.00	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月	新股限售	72.50	58.42	165.00	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	新股限售	50.00	30.71	931.00	46,550.00	28,591.01	-
301260	格力博	2023-01-2	6个月	新股限售	30.85	23.63	3,021	93,197.85	71,386.23	-

		0								
3012 61	恒工 精密	2023 -06-2 9	1个月内 (含)	认购 新发 证券	36.90	36.90	1,775	65,49 7.50	65,49 7.50	-
3012 61	恒工 精密	2023 -06-2 9	6个月	新股 限售	36.90	36.90	198.00	7,30 6.20	7,30 6.20	-
3012 62	海看 股份	2023 -06-1 3	6个月	新股 限售	30.22	25.50	692.00	20,91 2.24	17,64 6.00	-
3012 81	科源 制药	2023 -03-2 8	6个月	新股 限售	44.18	25.10	241.00	10,64 7.38	6,04 9.10	-
3012 81	科源 制药	2023 -05-2 6	5个月	新股 限售 -送 股	-	25.10	96.00	-	2,40 9.60	-
3012 91	明阳 电气	2023 -06-2 1	6个月	新股 限售	38.13	31.03	1,206	45,98 4.78	37,42 2.18	-
3012 92	海科 新源	2023 -06-2 9	1个月内 (含)	认购 新发 证券	19.99	19.99	5,241	104,7 67.59	104,7 67.59	-
3012 92	海科 新源	2023 -06-2 9	6个月	新股 限售	19.99	19.99	583.00	11,65 4.17	11,65 4.17	-
3012 93	三博 脑科	2023 -04-2 5	6个月	新股 限售	29.60	71.42	333.00	9,85 6.80	23,78 2.86	-
3012 95	美硕 科技	2023 -06-1 9	6个月	新股 限售	37.40	36.07	215.00	8,04 1.00	7,75 5.05	-
3013 01	川宁 生物	2022 -12-2 0	6个月	新股 限售	5.00	8.96	3,574	17,87 0.00	32,02 3.04	-
3013	真兰	2023	6个月	新股	26.80	22.32	1,058	28,35	23,61	-

03	仪表	-02-13		限售				4.40	4.56	
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	新股限售	25.25	19.69	753.00	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	新股限售	32.34	31.86	687.00	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023-05-26	6个月	新股限售	67.28	65.43	409.00	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	226.00	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	新股限售	20.67	26.17	694.00	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023-06-01	6个月	新股限售	13.06	20.62	642.00	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	228.00	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	新股限售	76.80	107.95	364.00	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股限售	32.60	30.37	232.00	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股限售	73.45	46.64	266.00	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023-06-0	6个月	新股限售	17.55	16.75	563.00	9,880.65	9,430.25	-

		2								
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新股限售	50.00	48.39	190.00	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股限售	23.77	42.89	1,951	46,375.27	83,678.39	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	新股限售	71.88	92.60	134.00	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股限售	33.73	31.85	277.00	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	420.00	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	新股限售	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023-05-31	6个月	新股限售	46.16	35.72	493.00	22,756.88	17,609.96	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股限售	29.99	23.79	378.00	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股限售	58.32	45.36	307.00	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内(含)	认购新发证券	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	520.00	13,873.60	13,873.60	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股限售	53.27	40.20	362.00	19,283.74	14,552.40	-

301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股限售	43.99	51.57	293.00	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股限售	16.24	16.95	879.00	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	新股限售	24.80	43.85	330.00	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	新股限售	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	新股限售	28.75	21.02	499.00	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新股限售	19.99	16.90	949.00	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内(含)	认购新发证券	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股限售	57.66	57.66	482.00	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内(含)	认购新发证券	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	262.00	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股限售	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	875.00	9,065.00	10,360.00	-

601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股限售	11.66	12.26	664.00	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	160.00	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股限售	17.80	17.89	628.00	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股限售	15.90	17.09	139.00	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股限售	14.58	16.13	122.00	1,778.76	1,967.86	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	新股限售	14.16	16.21	888.00	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	新股限售	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	831.00	19,611.60	53,740.77	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	新股限售	26.66	31.50	418.00	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	新股限售	75.00	90.76	221.00	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	新股限售	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
6884	阿特	2023	6个月	新股	11.10	17.04	4,237	47,03	72,19	-

72	斯	-06-02		限售				0.70	8.48	
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	新股限售	32.52	42.37	402.00	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	332.00	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	新股限售	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6个月	新股限售	245.56	122.11	140.00	34,378.40	17,095.40	-
688507	索辰科技	2023-06-20	4个月	新股限售-送股	-	122.11	67.00	-	8,181.37	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	新股限售	20.92	19.16	721.00	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	472.00	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股限售	152.38	135.97	346.00	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	新股限售	43.67	53.05	410.00	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	新股限售	21.17	23.50	956.00	20,238.52	22,466.00	-
6885	航天	2023	6个月	新股	12.68	22.31	726.00	9,20	16,19	-

62	软件	-05-15		限售				5.68	7.06	
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	新股限售	30.26	25.33	884.00	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	163.00	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	新股限售	26.74	40.68	648.00	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	959.00	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内(含)	认购新发证券	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	140.00	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023-06-15	6个月	新股限售	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023-05-31	6个月	新股限售	125.88	86.79	178.00	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6个月	新股限售	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	336.00	8,494.08	10,036.32	-

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2023年06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2023年06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及业务部门的自控和互控的第一道防线，合规风控部门监督管理的第二道防线，审计部事后检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险控制监督管理的第五道防线。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款

项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	77,747,776.50	-	-	-	-	-	77,747,776.50

结算备付金	5,466,442.59	-	-	-	-	-	5,466,442.59
存出保证金	805,452.69	-	-	-	-	-	805,452.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,026,552,530.28	1,026,552,530.28
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	-	-	-	-	-	1,208,099.27	1,208,099.27
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	84,019,671.78	-	-	-	-	1,027,760,629.55	1,111,780,301.33
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	-	-	-	-	-	748,947.87	748,947.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,481,674.36	1,481,674.36
应付托管费	-	-	-	-	-	246,945.72	246,945.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	70,443.72	70,443.72
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	3,910,348.83	3,910,348.83

负债总计	-	-	-	-	-	6,458,360.50	6,458,360.50
利率敏感度缺口	84,019,671.78	-	-	-	-	1,021,302,269.05	1,105,321,940.83
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	91,868,418.28	-	-	-	-	-	91,868,418.28
结算备付金	11,938,798.39	-	-	-	-	-	11,938,798.39
存出保证金	1,256,404.01	-	-	-	-	-	1,256,404.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,453,794,204.24	1,453,794,204.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	21,119,419.42	21,119,419.42
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,404,025.83	1,404,025.83
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	105,063,620.68	-	-	-	-	1,476,317,649.49	1,581,381,270.17
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	22,927,763.83	22,927,763.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,017,990.48	2,017,990.48

应付托管费	-	-	-	-	-	336,331.76	336,331.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	97,374.99	97,374.99
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	4,694,550.92	4,694,550.92
负债总计	-	-	-	-	-	30,074,011.98	30,074,011.98
利率敏感度缺口	105,063,620.68	-	-	-	-	1,446,243,637.51	1,551,307,258.19

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

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 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	1,026,552,530.28	92.87	1,453,794,204.24	93.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,026,552,530.28	92.87	1,453,794,204.24	93.71

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准增加1%	14,688,293.94	21,660,179.22
	业绩比较基准减少1%	-14,688,293.94	-21,660,179.22

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

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	1,024,028,424.69	1,452,228,307.53
第二层次	897,457.22	-
第三层次	1,626,648.37	1,565,896.71
合计	1,026,552,530.28	1,453,794,204.24

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2023年8月28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	1,026,552,530.28	92.33
	其中：股票	1,026,552,530.28	92.33
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	83,214,219.09	7.48
8	其他各项资产	2,013,551.96	0.18
9	合计	1,111,780,301.33	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	750,426,427.56	67.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,220,822.00	1.56
E	建筑业	99,499.03	0.01
F	批发和零售业	598,713.37	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	13,469,201.89	1.22

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	217,724,976.61	19.70
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26,184,800.78	2.37
M	科学研究和技术服务业	386,321.81	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	163,450.27	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	278,316.96	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,026,552,530.28	92.87

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	002555	三七互娱	2,345,400	81,807,552.00	7.40
2	000568	泸州老窖	340,704	71,401,337.28	6.46
3	002594	比亚迪	262,300	67,744,221.00	6.13
4	000858	五粮液	397,000	64,937,290.00	5.87
5	000063	中兴通讯	1,396,700	63,605,718.00	5.75
6	600809	山西汾酒	292,454	54,124,461.78	4.90
7	603345	安井食品	345,300	50,690,040.00	4.59
8	688111	金山办公	103,063	48,668,409.86	4.40
9	600519	贵州茅台	25,800	43,627,800.00	3.95

10	000938	紫光股份	1,326,700	42,255,395.00	3.82
11	002517	恺英网络	2,365,800	37,237,692.00	3.37
12	600702	舍得酒业	214,500	26,587,275.00	2.41
13	605168	三人行	304,687	26,184,800.78	2.37
14	002475	立讯精密	766,100	24,859,945.00	2.25
15	300908	仲景食品	520,597	23,609,073.95	2.14
16	603197	保隆科技	421,500	22,866,375.00	2.07
17	002429	兆驰股份	4,058,400	22,321,200.00	2.02
18	688981	中芯国际	420,124	21,224,664.48	1.92
19	300002	神州泰岳	1,352,100	18,929,400.00	1.71
20	688234	天岳先进	255,117	18,863,350.98	1.71
21	600600	青岛啤酒	178,600	18,508,318.00	1.67
22	300418	昆仑万维	455,900	18,363,652.00	1.66
23	600011	华能国际	1,859,700	17,220,822.00	1.56
24	601689	拓普集团	206,700	16,680,690.00	1.51
25	300679	电连技术	477,200	15,771,460.00	1.43
26	000988	华工科技	385,900	14,668,059.00	1.33
27	603885	吉祥航空	872,923	13,469,201.89	1.22
28	300750	宁德时代	54,960	12,574,298.40	1.14
29	600419	天润乳业	749,300	12,153,646.00	1.10
30	688262	国芯科技	296,536	12,066,049.84	1.09
31	688048	长光华芯	108,461	10,251,733.72	0.93
32	300604	长川科技	203,600	9,668,964.00	0.87
33	300308	中际旭创	40,000	5,898,000.00	0.53
34	300751	迈为股份	33,700	5,708,106.00	0.52
35	688249	晶合集成	74,041	1,391,155.62	0.13
36	301358	湖南裕能	19,501	856,053.89	0.08
37	301325	曼恩斯特	3,636	413,937.80	0.04
38	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.04
39	601061	中信金属	40,154	347,732.92	0.03
40	301301	川宁生物	35,740	320,230.40	0.03

41	688352	颀中科技	23,609	314,070.39	0.03
42	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.03
43	301246	宏源药业	9,303	290,969.49	0.03
44	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.03
45	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.03
46	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
47	301303	真兰仪表	10,574	241,150.32	0.02
48	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.02
49	301297	富乐德	10,147	228,408.97	0.02
50	301262	海看股份	6,917	190,389.75	0.02
51	301317	鑫磊股份	6,936	186,571.14	0.02
52	301383	天键股份	4,925	183,366.76	0.02
53	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.02
54	301439	泓淋电力	9,486	168,338.18	0.02
55	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
56	301332	德尔玛	11,211	159,576.87	0.01
57	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.01
58	301305	朗坤环境	7,523	155,710.27	0.01
59	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.01
60	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.01
61	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.01
62	301408	华人健康	8,784	152,129.85	0.01
63	301419	阿莱德	3,292	150,811.36	0.01
64	301387	光大同创	3,070	150,224.31	0.01
65	301280	珠城科技	4,175	149,298.00	0.01
66	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.01
67	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
68	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.01
69	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.01
70	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.01
71	603135	中重科技	6,273	126,392.92	0.01

72	301345	涛涛车业	2,652	126,242.30	0.01
73	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.01
74	301292	N海科	5,824	116,421.76	0.01
75	601065	江盐集团	8,748	116,094.39	0.01
76	301429	森泰股份	4,989	112,367.08	0.01
77	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
78	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
79	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.01
80	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.01
81	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.01
82	601133	柏诚股份	6,632	97,123.52	0.01
83	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
84	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.01
85	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
86	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.01
87	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
88	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.01
89	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
90	688472	阿特斯	4,237	72,198.48	0.01
91	301260	格力博	3,021	71,386.23	0.01
92	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
93	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
94	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
95	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
96	688507	索辰科技	207	25,276.77	0.00
97	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
98	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
99	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
100	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
101	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
102	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00

103	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
104	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
105	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
106	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
107	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
108	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
109	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
110	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
111	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
112	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
113	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
114	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
115	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
116	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
117	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
118	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
119	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
120	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
121	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
122	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
123	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
124	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
125	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
126	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
127	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
128	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	002555	三七互娱	106,341,132.00	6.85
2	002594	比亚迪	96,958,089.64	6.25
3	600633	浙数文化	80,432,351.05	5.18
4	600325	华发股份	77,316,705.36	4.98
5	002304	洋河股份	75,468,251.00	4.86
6	300418	昆仑万维	71,120,604.35	4.58
7	000938	紫光股份	68,477,723.80	4.41
8	300604	长川科技	68,251,999.85	4.40
9	601186	中国铁建	66,457,789.50	4.28
10	600011	华能国际	65,953,526.00	4.25
11	600702	舍得酒业	65,005,295.03	4.19
12	600373	中文传媒	64,241,471.66	4.14
13	600809	山西汾酒	64,020,661.36	4.13
14	300144	宋城演艺	60,360,478.10	3.89
15	000063	中兴通讯	55,602,946.00	3.58
16	002517	恺英网络	54,997,940.90	3.55
17	300364	中文在线	53,618,306.68	3.46
18	601398	工商银行	53,058,962.57	3.42
19	600519	贵州茅台	52,891,848.39	3.41
20	603345	安井食品	47,420,834.80	3.06
21	688111	金山办公	46,644,711.85	3.01
22	601888	中国中免	46,387,681.00	2.99
23	605168	三人行	46,160,161.58	2.98
24	300168	万达信息	43,756,604.81	2.82
25	603885	吉祥航空	43,733,546.50	2.82
26	002352	顺丰控股	43,657,327.46	2.81
27	688262	国芯科技	43,511,619.06	2.80
28	002230	科大讯飞	42,147,325.44	2.72
29	002812	恩捷股份	40,020,018.00	2.58
30	603899	晨光股份	37,748,251.78	2.43

31	601098	中南传媒	36,293,954.80	2.34
32	002475	立讯精密	35,482,953.00	2.29
33	002121	科陆电子	35,132,078.00	2.26
34	000651	格力电器	34,656,352.00	2.23
35	688234	天岳先进	34,644,011.04	2.23
36	300820	英杰电气	34,642,246.44	2.23
37	000858	五 粮 液	34,059,517.44	2.20
38	300751	迈为股份	33,207,261.63	2.14
39	300679	电连技术	32,862,835.19	2.12
40	000933	神火股份	32,694,017.00	2.11
41	603369	今世缘	31,564,651.16	2.03

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	002304	洋河股份	168,075,436.16	10.83
2	600519	贵州茅台	102,081,080.18	6.58
3	603833	欧派家居	101,856,850.00	6.57
4	600633	浙数文化	95,983,929.64	6.19
5	000333	美的集团	95,435,698.70	6.15
6	600809	山西汾酒	94,920,922.75	6.12
7	002352	顺丰控股	90,388,132.16	5.83
8	000858	五 粮 液	81,288,486.00	5.24
9	000596	古井贡酒	79,485,643.50	5.12
10	600325	华发股份	76,807,209.20	4.95
11	300037	新宙邦	69,458,376.62	4.48
12	603345	安井食品	60,120,418.84	3.88
13	600199	金种子酒	59,341,840.96	3.83
14	300604	长川科技	57,703,738.00	3.72

15	603486	科沃斯	57,457,999.00	3.70
16	601186	中国铁建	53,345,231.00	3.44
17	300364	中文在线	53,108,137.09	3.42
18	600373	中文传媒	53,060,976.22	3.42
19	300012	华测检测	50,480,120.96	3.25
20	601398	工商银行	50,006,837.00	3.22
21	600011	华能国际	49,977,173.00	3.22
22	300144	宋城演艺	49,035,147.16	3.16
23	603899	晨光股份	47,828,240.00	3.08
24	000568	泸州老窖	46,646,035.00	3.01
25	002727	一心堂	45,542,503.00	2.94
26	300168	万达信息	40,609,654.91	2.62
27	002230	科大讯飞	40,471,491.00	2.61
28	603596	伯特利	39,616,584.20	2.55
29	300418	昆仑万维	39,465,139.00	2.54
30	601888	中国中免	38,839,904.12	2.50
31	600872	中炬高新	38,693,577.29	2.49
32	600859	王府井	37,468,490.00	2.42
33	601098	中南传媒	36,645,732.00	2.36
34	300820	英杰电气	36,017,898.72	2.32
35	000786	北新建材	35,940,970.00	2.32
36	000537	广宇发展	34,016,505.00	2.19
37	300174	元力股份	33,608,338.00	2.17
38	000933	神火股份	33,433,900.27	2.16
39	002812	恩捷股份	33,152,238.00	2.14
40	603369	今世缘	32,239,994.00	2.08
41	300308	中际旭创	31,411,451.00	2.02
42	000651	格力电器	31,252,160.11	2.01
43	600702	舍得酒业	31,034,967.00	2.00

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	3,804,074,173.14
卖出股票收入（成交）总额	4,056,307,571.93

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三七互娱网络科技集团股份有限公司因涉及信息披露违法违规被监管部门立案调查,公司公告各项经营活动正常有序开展。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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	805,452.69
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,208,099.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,013,551.96

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
永赢消费主题A	61,536	5,153.82	24,547,307.53	7.7401%	292,597,984.14	92.2599%
永赢消费主题C	13,815	1,261.93	3,205,267.74	1.8384%	171,141,187.42	98.1616%
合计	19,965	2,461.21	27,752,575.27	5.6466%	463,739,171.56	94.3534%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	永赢消费主题A	885,315.73	0.28%
	永赢消费主题C	404,251.39	0.23%
	合计	1,289,567.12	0.26%

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	永赢消费主题A	10~50
	永赢消费主题C	0~10

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢消费主题A	永赢消费主题C
基金合同生效日(2018年11月06日)基金份额总额	216,648,074.95	54,897,706.71
本报告期期初基金份额总额	386,183,624.62	211,201,935.24
本报告期基金总申购份额	23,620,860.34	68,452,493.97
减：本报告期基金总赎回份额	92,659,193.29	105,307,974.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	317,145,291.67	174,346,455.16

§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无重大人事变动。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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	
安信证券	2	140,313,427.68	1.79%	101,206.44	1.79%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	1,353,890,261.31	17.27%	976,554.69	17.24%	-
方正证券	2	557,041,869.87	7.10%	401,792.67	7.09%	-
广发证券	2	1,857,258,182.28	23.68%	1,339,637.38	23.64%	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	608,809,995.08	7.76%	441,580.06	7.79%	-
国信证券	2	259,745,985.20	3.31%	189,798.21	3.35%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-

华安证券	2	46,120,070.40	0.59%	33,727.95	0.60%	-
华泰证券	2	1,433,582,446.14	18.28%	1,034,039.73	18.25%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	52,999,866.35	0.68%	38,229.05	0.67%	-
兴业证券	2	777,240,754.13	9.91%	560,623.74	9.89%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	754,735,522.46	9.62%	548,769.20	9.69%	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-

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

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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新增兴业证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-01-05
2	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
3	永赢基金管理有限公司关于新增江苏江南农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-02-17
4	永赢基金管理有限公司关于新增杭州银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-29
5	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-30
6	永赢基金管理有限公司关于广州分公司办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
7	永赢基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-08
8	永赢基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2023-04-19

	新增长城证券股份有限公司为公司旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告		
9	永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
10	永赢基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为永赢基金旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-26

§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.中国证监会准予永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新(如有)；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

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

二〇二三年八月三十日