

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
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 03 月 27 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 25 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。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§ 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	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9	管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6	审计报告	16
6.1	审计报告基本信息	16
6.2	审计报告的基本内容	16
§ 7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	20
7.3	净资产变动表	21
7.4	报表附注	22
§ 8	投资组合报告	52
8.1	期末基金资产组合情况	52
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3	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	53
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	62

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6	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	64
8.7	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	64
8.8	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	64
8.9	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	64
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	65
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12	投资组合报告附注	65
§ 9	基金份额持有人信息	66
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.3	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	66
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	66
§ 10	开放式基金份额变动	66
§ 11	重大事件揭示	67
11.1	基金份额持有人大会决议	67
11.2	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	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4	基金投资策略的改变	67
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8	其他重大事件	69
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	70
12.1	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
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 13	备查文件目录	70
13.1	备查文件目录	70
13.2	存放地点	70
13.3	查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	永赢惠泽一年
基金主代码	006836
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 06 月 05 日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	142,035,881.40 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对宏观经济现状及趋势分析、相关政策研究的角度出发，自上而下地分析影响股票、债券、货币市场的各种关键因素，灵活配置大类资产，同时辅以自下而上地个股精选，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	目前国内宏观经济、产业政策、金融市场等多方面时刻面临着巨大且深刻的变化，本基金采用大类资产轮动配置模型驱动的投资策略进行基金资产灵活配置。本基金将资产配置与经济周期结合，形成大类资产配置策略。利用永赢基金自主研发的资产配置模型，结合经济周期表现，通过大类资产轮动切换配置、多风格的动态组合管理寻找具有投资价值的行业和个股，并对所挑选的投资标的进行资产配置和组合动态管理，实现长期稳定的投资收益。大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、开放期投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	张姗
	联系电话	021-20430340	400-61-95555
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-805-8888	400-61-95555
传真		021-51690177	0755-83195201
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路	深圳市深南大道 7088 号招商银

	466 号	行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	马宇晖	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-1,476,303.30	-10,498,442.67	89,775,525.14
本期利润	3,111,660.11	-65,659,134.61	24,349,349.01
加权平均基金份额本期利润	0.0146	-0.1438	0.0403
本期加权平均净值利润率	1.05%	-10.36%	2.75%
本期基金份额净值增长率	-1.13%	-8.91%	1.92%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	48,534,144.11	98,132,677.42	265,226,115.51
期末可供分配基金份额利润	0.3417	0.3570	0.4263
期末基金资产净值	190,570,025.51	373,013,211.17	926,923,342.11
期末基金份额净值	1.3417	1.3570	1.4897
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	34.17%	35.70%	48.97%

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

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
过去三个月	-2.44%	0.44%	-3.12%	0.40%	0.68%	0.04%
过去六个月	-3.94%	0.43%	-5.00%	0.42%	1.06%	0.01%
过去一年	-1.13%	0.40%	-4.68%	0.42%	3.55%	-0.02%
过去三年	-8.20%	0.58%	-16.00%	0.56%	7.80%	0.02%
自基金合同生效起至今	34.17%	0.63%	2.50%	0.58%	31.67%	0.05%

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：沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

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

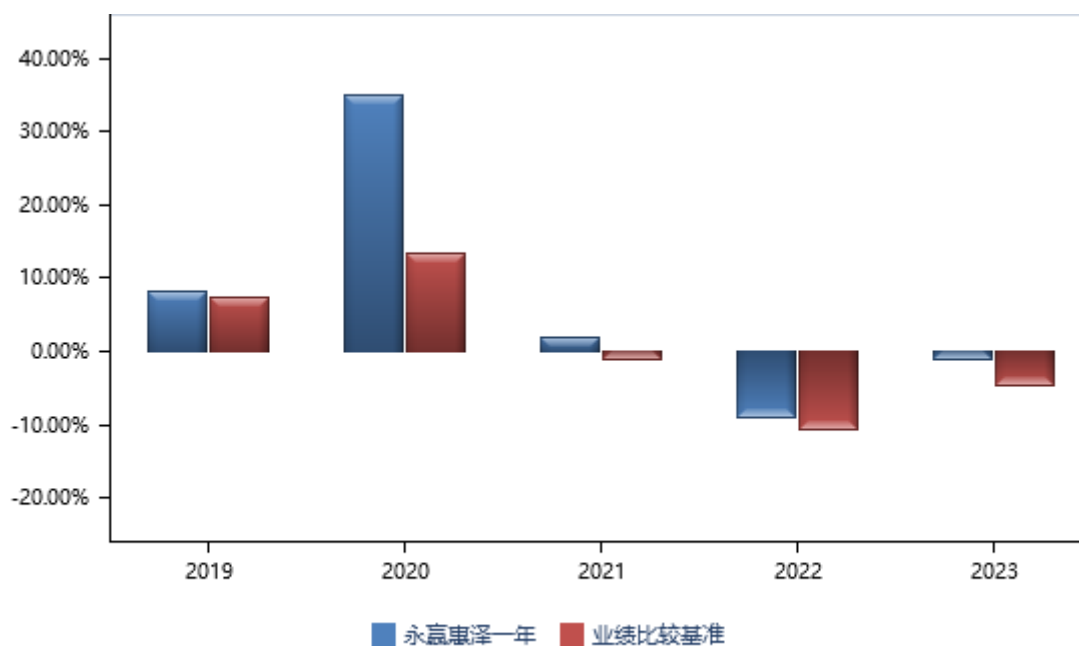
永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比



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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比

较



注：本基金合同于 2019 年 06 月 05 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年均未进行利润分配。

§ 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 12 月 31 日, 本基金管理人共管理 121 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、永赢通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、永赢中债-1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢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、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、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、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基金、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型基金中基金（FOF）、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、永赢匠心增利债券型证券投资基金、永赢启源混合型发起式证券投资基金、永赢中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、永赢睿信混合型证券投资基金。

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		
李永兴	副总经理兼基金经理	2019 年 06 月 05 日	-	17 年	李永兴先生，北京大学经济学硕士。17 年证券相关从业经验。曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理；九泰基金管理有

					限公司投资总监；永赢基金管理有限公司总经理助理。现任永赢基金管理有限公司副总经理，兼永赢国际资产管理有限公司董事。
牟琼屿	基金经理	2019年06月05日	-	14年	牟琼屿女士，中国人民大学经济学硕士，14年证券相关从业经验。曾任中融国际信托固定收益部交易员，国开证券固定收益部投资经理，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。
储可凡	基金经理助理	2022年11月07日	-	7年	储可凡女士，清华大学应用统计硕士，7年证券相关从业经验。曾任中银国际证券股份有限公司基金经理助理，永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理。

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、《永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式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 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限；投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预；基金经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同基金经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。另外，本基金管理人还建立机制要求公募基金经理与资产管理计划投资经理互相隔离，且原则上不能互相授权投资。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各基金经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后分析，确保交易得到公平和公允的执行；对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，基金经理须提出申请并阐明具体原因，交由投资决策委员会进行严格的公平性审核；（4）严格控制同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外），确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生同日反向交易的，相关基金经理须向风险控制

委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面，风险管理部开展定期分析工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了对非公开发行股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，以及对非连续竞价交易的价格公允性进行审查；事后分析评估上，风险管理部在每个季度的公平交易与异常交易稽核中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

4.3.2 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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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。

4.3.3 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 年经济整体处于疫后修复期，一至四季度实际 GDP 增速依次录得 4.5%、6.3%、4.9%、5.2%，全年 GDP 增速 5.2%。从经济结构上看，地产投资偏弱，消费缓慢回补、制造业投资相对稳定，基建投资在稳增长政策支撑下维持高增速，出口年初脉冲后全年整体偏弱。实体以外，社融信贷年内投放节奏前置、增速前高后低，通胀中枢整体下移。

债市表现上，利率全年震荡下行，收益率曲线整体平坦化。节奏上，年初资金边际收敛，利率出现小幅调整。3 月央行降准后流动性合理充裕，在基本面和资金面驱动下，利率震荡下行，并于 8

月创下年内低点。9 月稳增长政策陆续落地，万亿国债增发、地方特殊再融资债发行带动资金面边际收敛，债券收益率震荡调整。年末在机构配置、宽松预期抢跑等因素带动下，收益率再度下行，十年国债活跃券全年下行近 28bp。信用债方面，无风险利率下行以及城投化债利好决定了全年牛市行情，信用利差、等级利差和期限利差悉数收窄。

报告期内，本基金一季度以票息策略为主，结合经济复苏节奏与市场供需变化等因素开展投资交易，整体保持偏防御久期。二、三季度根据市场行情积极进行了灵活的久期调节，在 4-5 月提高了组合久期。6 月降息后市场转入窄幅震荡走势，降低组合久期和杠杆。7 月增加商金债和中长期利率债配置，提高组合久期和杠杆，8 月下旬基于降息利好兑现以及政策预期升温的原因降低组合久期和杠杆。四季度，组合久期在 10-11 月中旬降低组合久期和杠杆，11 月下旬提高组合久期。

权益方面，2023 年市场缺乏增量资金，呈现存量博弈特征，结构性分化明显，AI 大模型的发布带动了 TMT 板块领涨，而与内需相关性较强的消费、以及依旧低迷的地产链跌幅较大；风格上，小盘风格占优，价值、成长均有所表现。操作上，权益部分保持较为均衡、分散的配置，适当进行市值的下沉，精选具备基本面与估值优势的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢惠泽一年基金份额净值为 1.3417 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 -1.13%，同期业绩比较基准收益率为 -4.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，经济基本面将延续修复态势，结构上，在信贷结构优化调整、盘活存量资金的导向下，制造业投资预计表现平稳；基建投资是财政发力核心抓手。2023 年消费数据亮眼，会给今年带来高基数效应，需求端可能弹性来源于出口，关注海外周期回升对外需的拉动作用。通胀方面，CPI、PPI 中枢将小幅抬升，整体仍处于偏低位置。在高质量发展基调下，政策提效是关键，货币政策在配合思路下将延续宽松基调，年内宽松操作仍可期待。对债券市场而言，广谱利率下移仍是长期趋势，由于金融机构负债端成本对下行幅度存在一定牵制，需在基本面和政策节奏中把握交易机会。信用方面，预计信用债收益率和利差中枢继续下降，但信用环境、政策变化和机构行为等因素或放大信用债的波动性，预计全年呈震荡下行趋势。

权益方面，2023 年末，上证指数的 PE 估值已处于低于历史 5% 低分位数，长期投资价值突出，我们对 24 年权益市场保持乐观。我们将密切跟踪宏观经济数据与行业个股基本面变化，对市场风格的演绎保持敏感度，并关注政策、新技术的催化。组合配置上，将从政策与技术催化、行业景气度、底部困境反转、公司商业模式等角度积极寻找投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障合规运作和投资者合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，持续健全、完善内控建设，提升风险管理水平，确保基金管理业务规范运作。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

1、持续加强制度建设。报告期内，公司根据法律法规、监管政策及业务开展实际情况，对公司制度进行了全面梳理、评估与更新，确保制度的合规性、有效性和可操作性，进一步完善公司制度体系。

2、新规解读及监管要求的落实。2023 年，公司持续密切关注各项最新法律法规、监管政策，及时开展新规新政的传达和解读、并拟定落实方案，由各相关部门进行具体落实，同时定期对落实情况跟踪检查。

3、强化合规培训。为进一步提升员工合规意识，强化员工执业行为的合规性，合规部组织多次面向不同对象，针对不同主题的合规培训，包括针对新员工的合规培训，面向全员的合规宣导以及邀请外部律师开展专项培训等，并通过多样化的方式提高员工在合规培训中的参与度以及积极性。

4、深入开展内部审计工作。公司建立了全面的内部审计体系和流程，并设置审计部作为公司风险防控机制中的一道重要防线独立履行内部审计检查职责。2023 年，公司有序开展各类专项审计、离任审查、年度/季度监察稽核项目、即时通讯工具例行检查、风险事件调查等内审工作，并聘请外部机构独立开展信息技术专项审计、年度内控评价等项目。针对上述审计检查发现的问题，审计部牵头推进整改，促进制度体系及业务流程不断完善，为公司防范风险、完善内控管理提供有力支持。

4.7 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/研究的分管领导、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。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，未发生会计师事务所出具非标准审计报告的情形。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70077306_B51 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了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的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的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的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于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，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	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管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估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的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督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的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊

	<p>或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对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持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致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不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	石静筠 沈熙苑
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
审计报告日期	2024年03月25日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	1,467,506.87	8,834,947.96
结算备付金		1,473,587.80	1,276,678.94
存出保证金		27,090.32	90,955.75
交易性金融资产	7.4.7.2	223,020,140.80	363,762,611.91
其中：股票投资		90,380,648.94	179,554,317.43
基金投资		-	-
债券投资		132,639,491.86	184,208,294.48
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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	7.4.7.5	-	-
资产总计		225,988,325.79	373,965,194.56
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		34,978,050.76	-
应付清算款		5,402.74	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		193,772.98	480,502.57
应付托管费		32,295.52	80,083.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,750.62	14,565.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	198,027.66	376,831.28
负债合计		35,418,300.28	951,983.39
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	142,035,881.40	274,880,533.75
未分配利润	7.4.7.8	48,534,144.11	98,132,677.42
净资产合计		190,570,025.51	373,013,211.17
负债和净资产总计		225,988,325.79	373,965,194.56

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3417 元，基金份额总额 142,035,881.40 份。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		9,479,258.86	-52,961,473.59
1. 利息收入		55,712.34	225,616.64
其中：存款利息收入	7.4.7.9	35,745.35	81,977.46
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		19,966.99	143,639.18
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,835,331.17	1,744,565.33
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,169,263.56	-16,964,575.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	6,438,187.79	12,904,022.96
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,566,406.94	5,805,118.33
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	4,587,963.41	-55,160,691.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	251.94	229,036.38
减：二、营业总支出		6,367,598.75	12,697,661.02
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,222,920.45	9,603,818.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	703,820.09	1,600,636.41
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,221,049.27	1,212,851.73
其中：卖出回购金融资产支出		1,221,049.27	1,212,851.73
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		15,555.26	37,055.75
8. 其他费用	7.4.7.19	204,253.68	243,298.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,111,660.11	-65,659,134.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,111,660.11	-65,659,134.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,111,660.11	-65,659,134.61

7.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	274,880,533.75	98,132,677.42	373,013,211.17
二、本期期初净资产	274,880,533.75	98,132,677.42	373,013,211.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-132,844,652.35	-49,598,533.31	-182,443,185.66
（一）、综合收益总额	-	3,111,660.11	3,111,660.11
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-132,844,652.35	-52,710,193.42	-185,554,845.77
其中：1. 基金申购款	276,037.42	108,553.09	384,590.51
2. 基金赎回款	-133,120,689.77	-52,818,746.51	-185,939,436.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	142,035,881.40	48,534,144.11	190,570,025.51
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	622,208,425.39	304,714,916.72	926,923,342.11
二、本期期初净资产	622,208,425.39	304,714,916.72	926,923,342.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-347,327,891.64	-206,582,239.30	-553,910,130.94
（一）、综合收益总额	-	-65,659,134.61	-65,659,134.61
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-347,327,891.64	-140,923,104.69	-488,250,996.33
其中：1. 基金申购款	454,978.32	185,535.15	640,513.47
2. 基金赎回款	-347,782,869.96	-141,108,639.84	-488,891,509.80
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	274,880,533.75	98,132,677.42	373,013,211.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

芦特尔

基金管理人负责人

汪成杰

主管会计工作负责人

虞俏依

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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（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]2090号《关于准予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2019年6月5日生效，首次设立募集规模为338,868,389.00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及注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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、地方政府债、政策性金融债、商业银行金融债与次级债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债、可转换债券（含分离交易可转债纯债部分）、可交换债券、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、货币市场工具、股指期货、国债期货、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：封闭期内，本基金投资于股票的比例为0-100%；开放期内，本基金投资于股票的比例为0-95%。在开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金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%；在封闭期内，本基金不受前述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证投资比例为基金资产净值的0-3%。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

7.4.2 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2号《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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的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按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无

法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 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) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本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；

(5) 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；

(6) 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；

(7) 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告，且不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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%；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	1,467,506.87	8,834,947.96
等于：本金	1,467,356.89	8,833,596.32

加：应计利息	149.98	1,351.64
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	1,467,506.87	8,834,947.96

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	98,880,734.82	-	90,380,648.94	-8,500,085.88	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	30,274,921.92	169,111.24	30,299,111.24	-144,921.92
	银行间市场	100,463,176.42	1,494,380.62	102,340,380.62	382,823.58
	合计	130,738,098.34	1,663,491.86	132,639,491.86	237,901.66
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	229,618,833.16	1,663,491.86	223,020,140.80	-8,262,184.22	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	190,840,426.79	-	179,554,317.43	-11,286,109.36	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	30,536,597.53	397,865.21	30,526,865.21	-407,597.53
	银行间市场	153,178,440.74	1,659,429.27	153,681,429.27	-1,156,440.74
	合计	183,715,038.27	2,057,294.48	184,208,294.48	-1,564,038.27
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	374,555,465.06	2,057,294.48	363,762,611.91	-12,850,147.63	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 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	43,027.66	186,831.28
其中：交易所市场	30,015.00	172,227.78
银行间市场	13,012.66	14,603.50
应付利息	-	-
预提费用	155,000.00	190,000.00
合计	198,027.66	376,831.28

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	274,880,533.75	274,880,533.75
本期申购	276,037.42	276,037.42
本期赎回（以“-”号填列）	-133,120,689.77	-133,120,689.77
本期末	142,035,881.40	142,035,881.40

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 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
上年度末	102,061,811.59	-3,929,134.17	98,132,677.42
本期期初	102,061,811.59	-3,929,134.17	98,132,677.42
本期利润	-1,476,303.30	4,587,963.41	3,111,660.11
本期基金份额交易产生的变动数	-49,024,190.22	-3,686,003.20	-52,710,193.42
其中：基金申购款	101,733.66	6,819.43	108,553.09
基金赎回款	-49,125,923.88	-3,692,822.63	-52,818,746.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,561,318.07	-3,027,173.96	48,534,144.11

7.4.7.9 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12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
活期存款利息收入	16,892.37	33,059.18
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	18,401.76	47,511.36
其他	451.22	1,406.92
合计	35,745.35	81,977.46

7.4.7.10 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12月31 日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	232,419,278.25	836,919,655.98
减：卖出股票成本总额	236,092,051.27	851,826,827.79
减：交易费用	496,490.54	2,057,404.15
买卖股票差价收入	-4,169,263.56	-16,964,575.96

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
债券投资收益—利息收入	6,060,685.55	12,464,174.70
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	377,502.24	439,848.26

债券投资收益--赎回差价收入	-	-
债券投资收益--申购差价收入	-	-
合计	6,438,187.79	12,904,022.96

7.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	577,255,930.76	2,022,979,741.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	569,934,830.76	1,996,926,539.58
减：应计利息总额	6,931,072.76	25,579,673.19
减：交易费用	12,525.00	33,680.46
买卖债券差价收入	377,502.24	439,848.26

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,566,406.94	5,805,118.33
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,566,406.94	5,805,118.33

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日

1. 交易性金融资产	4,587,963.41	-55,160,691.94
--股票投资	2,786,023.48	-52,301,059.10
--债券投资	1,801,939.93	-2,859,632.84
--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	4,587,963.41	-55,160,691.94

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
基金赎回费收入	251.94	182,754.85
基金转换费收入	-	46,281.53
合计	251.94	229,036.38

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
审计费用	35,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	12,053.68	16,098.98
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	204,253.68	243,298.98

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
Oversea-Chinese Banking Corporation Limited（“Oversea-Chinese Banking”）	基金管理人的股东
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司
永赢国际资产管理有限公司（“永赢国际”）	基金管理人的子公司

注：（1）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）根据中国证券监督管理委员会的相关批复，永赢基金管理有限公司已在香港特别行政区政府的公司注册处办理完成香港子公司——永赢国际资产管理有限公司的注册登记手续，并于 2022 年 11 月 14 日获得香港证券及期货事务监察委员会颁发的第四号（就证券提供意见）及第九号（提供资产管理）牌照。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,222,920.45	9,603,818.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,758,218.59	3,947,457.89
应支付基金管理人的净管理费	2,464,701.86	5,656,360.26

注：2023年07月24日前，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。自2023年07月24日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	703,820.09	1,600,636.41

注：2023年07月24日前，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。自2023年07月24日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2023年01月01日至2023年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买	基金卖	交易金	利息收	交易金额	利息支出

	入	出	额	入		
招商银行	-	-	-	-	74,705,000.00	30,794.04
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

注：本基金上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
报告期初持有的基金份额	0.00	10,000,900.00
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	10,000,900.00
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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,467,506.87	16,892.37	8,834,947.96	33,059.18

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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。

7.4.12 期末 2023 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301487	盟固利	2023年08月01日	6个月	新股限售	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
688627	精智达	2023年07月11日	6个月	新股限售	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
301348	蓝箭电子	2023年08月01日	6个月	新股限售	18.08	44.57	417	7,539.36	18,585.69	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股限售	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
688582	芯动	2023年	6个月	新股限售	26.74	38.67	416	11,123.84	16,086.72	-

	联科	06月21日		售						
688563	航材股份	2023年07月12日	6个月	新股限售	78.99	60.49	261	20,616.39	15,787.89	-
301291	明阳电气	2023年06月21日	6个月	新股限售	38.13	28.36	515	19,636.95	14,605.40	-
688610	埃科光电	2023年07月10日	6个月	新股限售	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
301509	金凯生科	2023年07月26日	6个月	新股限售	56.56	62.23	221	12,499.76	13,752.83	-
301510	固高科技	2023年08月04日	6个月	新股限售	12.00	35.01	387	4,644.00	13,548.87	-
301210	金杨股份	2023年06月21日	6个月	新股限售	57.88	45.48	267	15,453.96	12,143.16	-
301486	致尚科技	2023年06月30日	6个月	新股限售	57.66	47.25	250	14,415.00	11,812.50	-
301421	波长光电	2023年08月16日	6个月	新股限售	29.38	59.37	195	5,729.10	11,577.15	-
301468	博盈特焊	2023年07月12日	6个月	新股限售	47.58	30.22	381	18,127.98	11,513.82	-
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股限售	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301362	民爆光电	2023年07月27日	6个月	新股限售	51.05	38.52	283	14,447.15	10,901.16	-
301499	维科精密	2023年07月13日	6个月	新股限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	新股限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
301329	信音电子	2023年07月05日	6个月	新股限售	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-

		日								
301393	昊帆生物	2023年 07月05日	6个月	新股限售	67.68	59.37	171	11,573.28	10,152.27	-
301261	恒工精密	2023年 06月29日	6个月	新股限售	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
688548	广钢气体	2023年 08月08日	6个月	新股限售	9.87	12.75	774	7,639.38	9,868.50	-
301202	朗威股份	2023年 06月28日	6个月	新股限售	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301395	仁信新材	2023年 06月21日	6个月	新股限售	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301456	盘古智能	2023年 07月06日	6个月	新股限售	37.96	30.39	314	11,919.44	9,542.46	-
301272	英华特	2023年 07月06日	6个月	新股限售	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301519	舜禹股份	2023年 07月19日	6个月	新股限售	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301518	长华化学	2023年 07月26日	6个月	新股限售	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
688602	康鹏科技	2023年 07月13日	6个月	新股限售	8.66	11.06	799	6,919.34	8,836.94	-
688592	司南导航	2023年 08月07日	6个月	新股限售	50.50	50.53	167	8,433.50	8,438.51	-
688638	誉辰智能	2023年 07月04日	6个月	新股限售	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688573	信宇人	2023年 08月09日	6个月	新股限售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688651	盛邦安全	2023年 07月19日	6个月	新股限售	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-

688646	逸飞激光	2023年07月21日	6个月	新股限售	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688612	威迈斯	2023年07月19日	6个月	新股限售	47.29	37.97	194	9,174.26	7,366.18	-
301372	科净源	2023年08月03日	6个月	新股限售	45.00	43.59	162	7,290.00	7,061.58	-
301371	敷尔佳	2023年07月24日	6个月	新股限售	55.68	37.58	185	10,300.80	6,952.30	-
301505	苏州规划	2023年07月12日	6个月	新股限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301498	乖宝宠物	2023年08月09日	6个月	新股限售	39.99	38.81	174	6,958.26	6,752.94	-
688671	碧兴物联	2023年08月02日	6个月	新股限售	36.12	34.30	193	6,971.16	6,619.90	-
301515	港通医疗	2023年07月13日	6个月	新股限售	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
603296	华勤技术	2023年08月01日	6个月	新股限售	80.80	77.75	83	6,706.40	6,453.25	-
301533	威马农机	2023年08月07日	6个月	新股限售	29.50	33.16	193	5,693.50	6,399.88	-
301511	德福科技	2023年08月08日	6个月	新股限售	28.00	22.67	276	7,728.00	6,256.92	-
688450	光格科技	2023年07月17日	6个月	新股限售	53.09	36.42	164	8,706.76	5,972.88	-
301469	恒达新材	2023年08月10日	6个月	新股限售	36.58	33.09	177	6,474.66	5,856.93	-
301528	多浦乐	2023年08月17日	6个月	新股限售	71.80	68.91	79	5,672.20	5,443.89	-
301418	协昌	2023年	6个月	新股限	51.88	50.20	101	5,239.88	5,070.20	-

	科技	08月10日		售						
688693	锆威特	2023年08月10日	6个月	新股限售	40.83	43.41	113	4,613.79	4,905.33	-
603119	浙江荣泰	2023年07月21日	6个月	新股限售	15.32	23.87	201	3,079.32	4,797.87	-
603275	众辰科技	2023年08月16日	6个月	新股限售	49.97	39.70	57	2,848.29	2,262.90	-

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金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 17,979,401.43 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
230015	23 付息国债 15	2024 年 01 月 02 日	101.14	86,000	8,698,448.85
230202	23 国开 02	2024 年 01 月 02 日	103.07	100,000	10,306,904.11
合计				186,000	19,005,352.96

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 16,998,649.33 元，于 2024 年 01 月 02 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,383,232.79	60,064,756.72
合计	20,383,232.79	60,064,756.72

注：国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	61,030,855.50	71,276,756.71
AAA 以下	30,804,024.05	52,866,781.05
未评级	20,421,379.52	-
合计	112,256,259.07	124,143,537.76

注：国债或政策性金融债列示为未评级。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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开放期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。

7.4.13.3.1 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在每个开放期对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，

约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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							
货币资金	1,467,506.87	-	-	-	-	-	1,467,506.87
结算备付金	1,473,587.80	-	-	-	-	-	1,473,587.80
存出保证金	27,090.32	-	-	-	-	-	27,090.32
交易性金融资产	10,257,445.90	-	30,257,103.61	81,636,584.97	10,488,357.38	90,380,648.94	223,020,140.80

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	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,225,630.89	-	30,257,103.61	81,636,584.97	10,488,357.38	90,380,648.94	225,988,325.79
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	34,978,050.76	-	-	-	-	-	34,978,050.76
应付清算款	-	-	-	-	-	5,402.74	5,402.74
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	193,772.98	193,772.98
应付托管费	-	-	-	-	-	32,295.52	32,295.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	10,750.62	10,750.62
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	198,027.66	198,027.66
负债总计	34,978,050.76	-	-	-	-	440,249.52	35,418,300.28
利率敏感度缺口	-21,752,419.87	-	30,257,103.61	81,636,584.97	10,488,357.38	89,940,399.42	190,570,025.51
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							
货币资金	8,834,947.9	-	-	-	-	-	8,834,947.9

	6						6
结算备付金	1,276,678.94	-	-	-	-	-	1,276,678.94
存出保证金	90,955.75	-	-	-	-	-	90,955.75
交易性金融资产	10,014,997.81	92,470,386.54	81,722,910.13	-	179,554,317.43	363,762,611.91	
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	10,202,582.65	10,014,997.81	92,470,386.54	81,722,910.13	-	179,554,317.43	373,965,194.56
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	-	-	-	-	-	480,502.57	480,502.57
应付托管费	-	-	-	-	-	80,083.74	80,083.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	14,565.80	14,565.80
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	376,831.28	376,831.28
负债总计	-	-	-	-	-	951,983.39	951,983.39
利率敏感度缺口	10,202,582.65	10,014,997.81	92,470,386.54	81,722,910.13	-	178,602,334.04	373,013,211.17

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率曲线向上、向下平行移动 50 个基点 2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2023 年 12 月 31 日)	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率平行上升 50 个基点	-1,112,038.93	-840,645.66
	市场利率平行下降 50 个基点	1,112,038.93	840,645.66

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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币汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	90,380,648.94	47.43	179,554,317.43	48.14
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	90,380,648.94	47.43	179,554,317.43	48.14

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日)	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 1%	1,536,085.09	3,516,957.01

业绩比较基准减少 1%	-1,536,085.09	-3,516,957.01
-------------	---------------	---------------

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	89,862,921.70	178,256,040.10
第二层次	132,682,327.14	184,208,294.48
第三层次	474,891.96	1,298,277.33
合计	223,020,140.80	363,762,611.91

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	1,298,277.33	1,298,277.33
当期购买	-	1,536,705.51	1,536,705.51
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,850,737.22	2,850,737.22
当期利得或损失总额	-	490,646.34	490,646.34
其中：计入损益的利得或损失	-	490,646.34	490,646.34
期末余额	-	474,891.96	474,891.96
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	45,796.04	45,796.04
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	4,210,598.95	4,210,598.95
当期购买	-	1,111,082.10	1,111,082.10
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,417,097.52	3,417,097.52
当期利得或损失总额	-	-606,306.20	-606,306.20
其中：计入损益的利得或损失	-	-606,306.20	-606,306.20
期末余额	-	1,298,277.33	1,298,277.33
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	187,195.23	187,195.23

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	474,891.96	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1462-0.6725	负相关
项目	上年度末公允	采用的估值	不可观察输入值		

	价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,298,277.33	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2063-2.4756	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 03 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	90,380,648.94	39.99
	其中：股票	90,380,648.94	39.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	132,639,491.86	58.69
	其中：债券	132,639,491.86	58.69
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,941,094.67	1.30

8	其他各项资产	27,090.32	0.01
9	合计	225,988,325.79	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	989,282.00	0.52
B	采矿业	2,431,853.00	1.28
C	制造业	62,103,116.89	32.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,529,350.00	0.80
E	建筑业	309,283.00	0.16
F	批发和零售业	1,077,400.40	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	2,435,258.00	1.28
H	住宿和餐饮业	355,810.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,604,719.13	2.94
J	金融业	5,920,119.38	3.11
K	房地产业	655,702.00	0.34
L	租赁和商务服务业	1,543,183.60	0.81
M	科学研究和技术服务业	1,167,583.14	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	1,414,674.40	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,843,314.00	1.49
S	综合	-	-
	合计	90,380,648.94	47.43

8.2.2 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。

8.3 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	600519	贵州茅台	902	1,556,852.00	0.82

2	300750	宁德时代	8,300	1,355,058.00	0.71
3	601900	南方传媒	79,800	1,036,602.00	0.54
4	601318	中国平安	25,400	1,023,620.00	0.54
5	600757	长江传媒	121,800	907,410.00	0.48
6	000513	丽珠集团	24,500	857,745.00	0.45
7	605305	中际联合	26,100	843,291.00	0.44
8	300129	泰胜风能	72,200	777,594.00	0.41
9	000989	九芝堂	74,800	756,976.00	0.40
10	002275	桂林三金	50,100	725,949.00	0.38
11	000786	北新建材	31,000	724,160.00	0.38
12	600875	东方电气	48,900	714,918.00	0.38
13	002271	东方雨虹	36,300	696,960.00	0.37
14	002475	立讯精密	20,000	689,000.00	0.36
15	601012	隆基绿能	29,984	686,633.60	0.36
16	301548	崇德科技	11,200	684,208.00	0.36
17	601877	正泰电器	31,300	673,263.00	0.35
18	600522	中天科技	52,300	653,227.00	0.34
19	601166	兴业银行	40,200	651,642.00	0.34
20	601827	三峰环境	86,300	648,113.00	0.34
21	600271	航天信息	59,100	628,824.00	0.33
22	000333	美的集团	11,400	622,782.00	0.33
23	000858	五粮液	4,400	617,364.00	0.32
24	300168	万达信息	72,000	610,560.00	0.32
25	002391	长青股份	91,800	578,340.00	0.30
26	600900	长江电力	24,600	574,164.00	0.30
27	300078	思创医惠	129,700	568,086.00	0.30
28	601888	中国中免	6,500	543,985.00	0.29
29	600276	恒瑞医药	11,800	533,714.00	0.28
30	601288	农业银行	141,700	515,788.00	0.27
31	603177	德创环保	43,100	509,442.00	0.27
32	000568	泸州老窖	2,800	502,376.00	0.26
33	688653	康希通信	24,400	488,488.00	0.26
34	600030	中信证券	23,400	476,658.00	0.25
35	002352	顺丰控股	11,700	472,680.00	0.25
36	002415	海康威视	13,600	472,192.00	0.25
37	300760	迈瑞医疗	1,600	464,960.00	0.24
38	601899	紫金矿业	37,000	461,020.00	0.24
39	603933	睿能科技	29,500	458,725.00	0.24
40	603259	药明康德	6,300	458,388.00	0.24
41	300059	东方财富	32,547	456,959.88	0.24
42	601398	工商银行	95,000	454,100.00	0.24

43	300408	三环集团	15,100	444,695.00	0.23
44	000651	格力电器	13,700	440,729.00	0.23
45	601328	交通银行	76,200	437,388.00	0.23
46	002859	洁美科技	17,400	434,130.00	0.23
47	688012	中微公司	2,811	431,769.60	0.23
48	002463	沪电股份	19,200	424,704.00	0.22
49	002429	兆驰股份	76,100	424,638.00	0.22
50	601816	京沪高铁	83,100	408,852.00	0.21
51	000725	京东方 A	103,000	401,700.00	0.21
52	002857	三晖电气	23,800	392,700.00	0.21
53	603496	恒为科技	12,500	389,500.00	0.20
54	000063	中兴通讯	14,032	371,567.36	0.19
55	688072	拓荆科技	1,600	370,080.00	0.19
56	600309	万华化学	4,800	368,736.00	0.19
57	002714	牧原股份	8,900	366,502.00	0.19
58	688052	纳芯微	2,189	365,234.65	0.19
59	600825	新华传媒	81,400	363,858.00	0.19
60	300049	福瑞股份	8,300	361,797.00	0.19
61	300498	温氏股份	18,000	361,080.00	0.19
62	300124	汇川技术	5,700	359,898.00	0.19
63	600152	维科技术	49,100	357,448.00	0.19
64	688120	华海清科	1,900	356,630.00	0.19
65	002594	比亚迪	1,800	356,400.00	0.19
66	600754	锦江酒店	11,900	355,810.00	0.19
67	002230	科大讯飞	7,600	352,488.00	0.18
68	000100	TCL 科技	81,300	349,590.00	0.18
69	300144	宋城演艺	35,200	347,424.00	0.18
70	600531	豫光金铅	56,900	344,245.00	0.18
71	300274	阳光电源	3,900	341,601.00	0.18
72	300280	紫天科技	7,800	333,294.00	0.17
73	600702	舍得酒业	3,400	328,780.00	0.17
74	600114	东睦股份	21,200	328,388.00	0.17
75	300820	英杰电气	5,700	326,496.00	0.17
76	688091	上海谊众	5,100	326,400.00	0.17
77	688369	致远互联	9,400	325,334.00	0.17
78	600809	山西汾酒	1,400	323,022.00	0.17
79	300174	元力股份	20,100	321,801.00	0.17
80	603027	千禾味业	19,500	315,315.00	0.17
81	603501	韦尔股份	2,945	314,260.95	0.16
82	603345	安井食品	3,000	313,830.00	0.16
83	688382	益方生物	20,600	311,884.00	0.16

84	001215	千味央厨	5,900	311,579.00	0.16
85	600837	海通证券	33,200	311,084.00	0.16
86	605499	东鹏饮料	1,700	310,267.00	0.16
87	002335	科华数据	11,200	310,016.00	0.16
88	600761	安徽合力	17,000	309,570.00	0.16
89	601668	中国建筑	64,300	309,283.00	0.16
90	601233	桐昆股份	20,400	308,652.00	0.16
91	002304	洋河股份	2,800	307,720.00	0.16
92	601107	四川成渝	70,000	307,300.00	0.16
93	600233	圆通速递	25,000	307,250.00	0.16
94	300661	圣邦股份	3,420	304,414.20	0.16
95	000596	古井贡酒	1,300	302,640.00	0.16
96	300595	欧普康视	13,400	302,572.00	0.16
97	300705	九典制药	9,100	302,393.00	0.16
98	601021	春秋航空	6,000	301,200.00	0.16
99	603871	嘉友国际	18,900	299,754.00	0.16
100	600199	金种子酒	16,100	298,172.00	0.16
101	600938	中国海油	14,200	297,774.00	0.16
102	002045	国光电器	17,800	296,370.00	0.16
103	603939	益丰药房	7,400	296,296.00	0.16
104	605337	李子园	21,000	295,890.00	0.16
105	300896	爱美客	1,000	294,330.00	0.15
106	300354	东华测试	5,900	293,053.00	0.15
107	300007	汉威科技	14,100	292,998.00	0.15
108	301077	星华新材	14,400	292,752.00	0.15
109	601688	华泰证券	20,900	291,555.00	0.15
110	601857	中国石油	41,200	290,872.00	0.15
111	600031	三一重工	21,100	290,547.00	0.15
112	600150	中国船舶	9,700	285,568.00	0.15
113	600968	海油发展	100,000	285,000.00	0.15
114	601225	陕西煤业	13,600	284,104.00	0.15
115	002493	荣盛石化	27,400	283,590.00	0.15
116	688351	微电生理	11,054	283,535.10	0.15
117	600583	海油工程	47,600	282,744.00	0.15
118	601187	厦门银行	55,500	281,385.00	0.15
119	300604	长川科技	7,400	281,126.00	0.15
120	002698	博实股份	18,500	281,015.00	0.15
121	601665	齐鲁银行	71,800	280,738.00	0.15
122	601882	海天精工	10,700	279,805.00	0.15
123	002444	巨星科技	12,400	279,248.00	0.15
124	605266	健之佳	4,700	279,180.00	0.15

125	002120	韵达股份	37,300	278,258.00	0.15
126	688017	绿的谐波	1,800	276,300.00	0.14
127	002876	三利谱	7,500	275,775.00	0.14
128	002109	兴化股份	57,800	273,972.00	0.14
129	002866	传艺科技	12,900	273,738.00	0.14
130	601100	恒立液压	5,000	273,400.00	0.14
131	603233	大参林	10,940	272,406.00	0.14
132	688617	惠泰医疗	700	271,950.00	0.14
133	300494	盛天网络	17,100	270,351.00	0.14
134	300633	开立医疗	5,700	269,610.00	0.14
134	601088	中国神华	8,600	269,610.00	0.14
136	600050	中国联通	61,500	269,370.00	0.14
137	000002	万科 A	25,700	268,822.00	0.14
138	601528	瑞丰银行	54,210	268,339.50	0.14
139	603277	银都股份	10,000	268,200.00	0.14
140	600200	江苏吴中	32,400	266,328.00	0.14
141	688377	迪威尔	9,900	265,518.00	0.14
142	300803	指南针	4,400	265,144.00	0.14
143	300303	聚飞光电	44,700	265,071.00	0.14
144	002446	盛路通信	31,900	264,770.00	0.14
145	000409	云鼎科技	28,500	263,910.00	0.14
146	300415	伊之密	14,900	262,687.00	0.14
147	603486	科沃斯	6,300	261,072.00	0.14
148	601699	潞安环能	11,900	260,729.00	0.14
149	002959	小熊电器	5,000	259,650.00	0.14
150	003000	劲仔食品	21,200	259,064.00	0.14
151	002115	三维通信	35,700	257,754.00	0.14
152	688733	壹石通	8,800	257,576.00	0.14
153	600584	长电科技	8,600	256,796.00	0.13
154	002236	大华股份	13,900	256,455.00	0.13
155	002185	华天科技	30,100	256,452.00	0.13
156	603927	中科软	8,500	254,830.00	0.13
157	002867	周大生	16,700	253,506.00	0.13
158	000938	紫光股份	13,100	253,485.00	0.13
159	600048	保利发展	25,600	253,440.00	0.13
160	600690	海尔智家	12,065	253,365.00	0.13
161	688111	金山办公	800	252,960.00	0.13
162	600796	钱江生化	43,100	252,135.00	0.13
163	300181	佐力药业	23,600	251,576.00	0.13
164	300638	广和通	13,200	251,196.00	0.13
165	300396	迪瑞医疗	8,500	250,325.00	0.13

166	300123	亚光科技	34,100	249,953.00	0.13
167	688789	宏华数科	2,500	249,775.00	0.13
168	300308	中际旭创	2,200	248,402.00	0.13
169	002508	老板电器	11,400	248,292.00	0.13
170	300451	创业慧康	37,400	244,970.00	0.13
171	002035	华帝股份	39,300	244,053.00	0.13
172	600703	三安光电	17,500	242,375.00	0.13
173	300355	蒙草生态	64,300	241,125.00	0.13
174	300035	中科电气	22,800	240,312.00	0.13
175	688677	海泰新光	4,500	239,535.00	0.13
176	300580	贝斯特	7,900	239,212.00	0.13
177	603605	珀莱雅	2,404	238,957.60	0.13
178	300454	深信服	3,300	238,557.00	0.13
179	688793	倍轻松	7,072	237,972.80	0.12
180	300394	天孚通信	2,600	237,952.00	0.12
181	300502	新易盛	4,800	236,736.00	0.12
182	688099	晶晨股份	3,758	235,363.54	0.12
183	600609	金杯汽车	48,400	235,224.00	0.12
184	603035	常熟汽饰	12,400	233,988.00	0.12
185	301185	鸥玛软件	11,400	232,104.00	0.12
186	000735	罗牛山	40,200	231,954.00	0.12
187	600797	浙大网新	35,200	230,912.00	0.12
188	603867	新化股份	7,000	229,880.00	0.12
189	300048	合康新能	45,400	229,724.00	0.12
190	002649	博彦科技	18,700	229,449.00	0.12
191	000819	岳阳兴长	12,400	224,192.00	0.12
192	688498	源杰科技	1,500	223,470.00	0.12
193	000915	华特达因	7,700	222,992.00	0.12
194	300766	每日互动	14,400	222,192.00	0.12
195	000862	银星能源	36,300	221,067.00	0.12
196	300170	汉得信息	26,500	220,215.00	0.12
197	603368	柳药集团	11,600	219,472.00	0.12
198	603859	能科科技	5,800	218,834.00	0.11
199	300041	回天新材	21,800	218,436.00	0.11
200	603018	华设集团	28,600	217,360.00	0.11
201	300203	聚光科技	13,700	217,145.00	0.11
202	600537	亿晶光电	39,400	217,094.00	0.11
203	002334	英威腾	24,400	213,012.00	0.11
204	300057	万顺新材	34,500	212,865.00	0.11
205	688501	青达环保	12,700	212,471.00	0.11
206	300109	新开源	11,700	211,068.00	0.11

207	603187	海容冷链	13,900	210,724.00	0.11
208	300094	国联水产	44,600	209,620.00	0.11
209	600195	中牧股份	17,500	207,550.00	0.11
210	002311	海大集团	4,600	206,586.00	0.11
211	688518	联赢激光	9,900	202,752.00	0.11
212	603789	星光农机	18,800	201,724.00	0.11
213	002478	常宝股份	36,800	200,560.00	0.11
214	300662	科锐国际	7,200	198,864.00	0.10
215	600496	精工钢构	64,900	197,945.00	0.10
216	002250	联化科技	27,700	197,501.00	0.10
217	603566	普莱柯	8,700	197,055.00	0.10
218	002840	华统股份	9,400	195,426.00	0.10
219	002891	中宠股份	7,400	194,990.00	0.10
220	003033	征和工业	5,400	193,374.00	0.10
221	688121	卓然股份	9,500	192,185.00	0.10
222	605016	百龙创园	6,700	190,213.00	0.10
223	300979	华利集团	3,600	189,504.00	0.10
224	603518	锦泓集团	18,200	182,364.00	0.10
225	002003	伟星股份	16,400	177,940.00	0.09
226	002149	西部材料	11,100	174,492.00	0.09
227	603889	新澳股份	24,500	174,440.00	0.09
228	603712	七一二	5,500	173,305.00	0.09
229	002179	中航光电	4,400	171,600.00	0.09
230	002895	川恒股份	9,000	171,000.00	0.09
231	300025	华星创业	17,800	170,702.00	0.09
232	000768	中航西飞	7,600	170,012.00	0.09
233	600989	宝丰能源	11,500	169,855.00	0.09
234	688122	西部超导	3,180	169,271.40	0.09
235	300575	中旗股份	22,000	168,080.00	0.09
236	601058	赛轮轮胎	14,300	168,025.00	0.09
237	300855	图南股份	5,560	167,912.00	0.09
238	601208	东材科技	13,500	167,130.00	0.09
239	002601	龙佰集团	9,700	166,161.00	0.09
240	002643	万润股份	10,000	165,900.00	0.09
241	600409	三友化工	30,200	165,798.00	0.09
242	300037	新宙邦	3,500	165,550.00	0.09
243	688523	航天环宇	6,172	165,533.04	0.09
244	002154	报喜鸟	28,900	164,152.00	0.09
245	605020	永和股份	6,500	162,565.00	0.09
246	688333	铂力特	1,400	162,260.00	0.09
247	000589	贵州轮胎	26,500	162,180.00	0.09

248	603558	健盛集团	16,600	160,854.00	0.08
249	300639	凯普生物	17,100	159,714.00	0.08
250	002832	比音勒芬	5,000	158,500.00	0.08
251	600426	华鲁恒升	5,700	157,263.00	0.08
252	605589	圣泉集团	7,000	156,660.00	0.08
253	688053	思科瑞	3,100	154,814.00	0.08
254	000893	亚钾国际	5,800	152,192.00	0.08
255	688439	振华风光	1,700	151,487.00	0.08
256	603611	诺力股份	7,800	147,654.00	0.08
257	301117	佳缘科技	2,700	147,177.00	0.08
258	002345	潮宏基	21,500	146,415.00	0.08
259	300395	菲利华	3,900	142,584.00	0.07
260	300910	瑞丰新材	3,100	142,414.00	0.07
261	603000	人民网	5,000	139,900.00	0.07
262	601601	中国太保	5,700	135,546.00	0.07
263	300474	景嘉微	1,900	134,349.00	0.07
264	000926	福星股份	32,000	133,440.00	0.07
265	688066	航天宏图	3,146	132,887.04	0.07
266	002078	太阳纸业	10,400	126,568.00	0.07
267	300969	恒帅股份	1,400	125,818.00	0.07
268	301356	天振股份	6,900	125,511.00	0.07
269	603833	欧派家居	1,800	125,298.00	0.07
270	002572	索菲亚	7,800	124,410.00	0.07
271	603109	神驰机电	7,500	123,150.00	0.06
272	600933	爱柯迪	5,600	122,864.00	0.06
273	003006	百亚股份	8,100	122,796.00	0.06
274	603816	顾家家居	3,500	122,500.00	0.06
275	001323	慕思股份	4,000	122,000.00	0.06
276	000338	潍柴动力	8,700	118,755.00	0.06
277	603197	保隆科技	2,100	118,440.00	0.06
278	000700	模塑科技	16,900	118,300.00	0.06
279	301039	中集车辆	12,600	118,188.00	0.06
280	000550	江铃汽车	6,200	117,986.00	0.06
281	301011	华立科技	5,010	117,234.00	0.06
282	000951	中国重汽	8,700	116,232.00	0.06
283	000521	长虹美菱	19,900	112,037.00	0.06
284	002027	分众传媒	17,700	111,864.00	0.06
285	688133	泰坦科技	2,400	111,240.00	0.06
286	000625	长安汽车	6,600	111,078.00	0.06
287	002517	恺英网络	9,000	100,530.00	0.05
288	600642	申能股份	15,300	98,226.00	0.05

289	301102	兆讯传媒	5,090	97,422.60	0.05
290	000719	中原传媒	10,000	97,300.00	0.05
291	600027	华电国际	18,300	94,062.00	0.05
292	600011	华能国际	12,200	93,940.00	0.05
293	688116	天奈科技	3,228	93,741.12	0.05
294	600023	浙能电力	19,800	91,278.00	0.05
295	300413	芒果超媒	3,600	90,720.00	0.05
296	000539	粤电力 A	18,500	90,465.00	0.05
297	601991	大唐发电	37,100	89,782.00	0.05
298	002608	江苏国信	13,600	89,352.00	0.05
299	000543	皖能电力	13,900	87,014.00	0.05
300	002555	三七互娱	4,600	86,526.00	0.05
301	002812	恩捷股份	1,400	79,548.00	0.04
302	002709	天赐材料	2,900	72,732.00	0.04
303	600000	浦发银行	10,600	70,172.00	0.04
304	603296	华勤技术	829	66,051.19	0.03
305	300586	美联新材	7,540	60,998.60	0.03
306	000507	珠海港	11,400	59,964.00	0.03
307	002438	江苏神通	4,500	53,775.00	0.03
308	688582	芯动联科	930	35,963.10	0.02
309	301487	盟固利	867	35,512.32	0.02
310	600108	亚盛集团	10,700	29,746.00	0.02
311	688627	精智达	222	19,473.84	0.01
312	301348	蓝箭电子	417	18,585.69	0.01
313	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.01
314	301210	金杨股份	361	16,418.28	0.01
315	688563	航材股份	261	15,787.89	0.01
316	301291	明阳电气	542	15,371.12	0.01
317	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.01
318	301509	金凯生科	221	13,752.83	0.01
319	301510	固高科技	387	13,548.87	0.01
320	301486	致尚科技	250	11,812.50	0.01
321	301421	波长光电	195	11,577.15	0.01
322	301468	博盈特焊	381	11,513.82	0.01
323	301292	海科新源	583	11,281.05	0.01
324	301395	仁信新材	596	11,148.36	0.01
325	301362	民爆光电	283	10,901.16	0.01
326	301499	维科精密	371	10,733.03	0.01
327	688603	天承科技	140	10,379.60	0.01
328	301329	信音电子	458	10,181.34	0.01
329	301393	昊帆生物	171	10,152.27	0.01

330	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.01
331	301376	致欧科技	420	10,046.40	0.01
332	688548	广钢气体	774	9,868.50	0.01
333	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.01
334	301456	盘古智能	314	9,542.46	0.01
335	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
336	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
337	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
338	688602	康鹏科技	799	8,836.94	0.00
339	688592	司南导航	167	8,438.51	0.00
340	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
341	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
342	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
343	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
344	688612	威迈斯	194	7,366.18	0.00
345	301372	科净源	162	7,061.58	0.00
346	301371	敷尔佳	185	6,952.30	0.00
347	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
348	301498	乖宝宠物	174	6,752.94	0.00
349	688671	碧兴物联	193	6,619.90	0.00
350	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
351	301533	威马农机	193	6,399.88	0.00
352	301511	德福科技	276	6,256.92	0.00
353	688450	光格科技	164	5,972.88	0.00
354	301469	恒达新材	177	5,856.93	0.00
355	301528	多浦乐	79	5,443.89	0.00
356	301418	协昌科技	101	5,070.20	0.00
357	688693	锆威特	113	4,905.33	0.00
358	603119	浙江荣泰	201	4,797.87	0.00
359	603275	众辰科技	57	2,262.90	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000063	中兴通讯	4,100,953.02	1.10
2	600519	贵州茅台	3,067,549.00	0.82
3	600875	东方电气	1,310,254.00	0.35
4	603259	药明康德	1,280,591.00	0.34
5	601318	中国平安	1,260,057.00	0.34

6	600761	安徽合力	1,182,749.20	0.32
7	002594	比亚迪	1,162,245.00	0.31
8	301191	菲菱科思	1,146,589.00	0.31
9	002665	首航高科	1,098,504.00	0.29
10	002230	科大讯飞	1,078,399.00	0.29
11	300633	开立医疗	1,024,796.00	0.27
12	301011	华立科技	951,501.00	0.26
13	002475	立讯精密	944,830.00	0.25
14	002444	巨星科技	941,269.00	0.25
15	002271	东方雨虹	936,057.00	0.25
16	603027	千禾味业	902,672.76	0.24
17	002463	沪电股份	877,477.00	0.24
18	000786	北新建材	875,632.00	0.23
19	300415	伊之密	873,595.00	0.23
20	300803	指南针	872,257.00	0.23

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。

8.4.2 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	000063	中兴通讯	3,153,949.00	0.85
2	600580	卧龙电驱	2,244,498.00	0.60
3	603699	纽威股份	2,146,975.00	0.58
4	300124	汇川技术	2,139,307.00	0.57
5	301155	海力风电	2,124,251.00	0.57
6	603042	华脉科技	1,953,742.00	0.52
7	600519	贵州茅台	1,878,236.00	0.50
8	600449	宁夏建材	1,733,662.00	0.46
9	002594	比亚迪	1,713,624.00	0.46
10	300484	蓝海华腾	1,676,236.00	0.45
11	603606	东方电缆	1,673,167.00	0.45
12	000625	长安汽车	1,596,839.00	0.43
13	603180	金牌厨柜	1,587,420.00	0.43
14	600475	华光环能	1,547,982.00	0.41
15	002757	南兴股份	1,528,765.88	0.41
16	000729	燕京啤酒	1,510,316.00	0.40
17	601900	南方传媒	1,479,956.00	0.40
18	300750	宁德时代	1,448,641.30	0.39
19	601985	中国核电	1,446,829.00	0.39
20	600356	恒丰纸业	1,428,452.00	0.38

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。

8.4.3 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	144,132,359.30
卖出股票收入（成交）总额	232,419,278.25

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,114,475.41	5.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,889,507.39	16.21
	其中：政策性金融债	10,306,904.11	5.41
4	企业债券	30,299,111.24	15.90
5	企业短期融资券	20,383,232.79	10.70
6	中期票据	40,953,165.03	21.49
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	132,639,491.86	69.60

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	2228017	22 邮储银行二级 01	100,000	10,488,357.38	5.50
2	102280534	22 宜春交通 MTN001	100,000	10,356,983.61	5.43
3	230202	23 国开 02	100,000	10,306,904.11	5.41
4	012381484	23 泰山财金 SCP001	100,000	10,257,445.90	5.38
5	102002108	20 成华国资 MTN001	100,000	10,226,338.80	5.37

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本报告期内,基金投资的前十名证券的发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年受到行政处罚,处罚金额合计为 3186 万元。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.12.3 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	27,090.32
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	27,090.32

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
5,199	27,319.85	0.00	0.0000%	142,035,881.40	100.0000%

9.2 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	31,404.74	0.02%

9.3 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占基 金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基 金总份额比例	发起份额承诺持 有期限
基金管理人固有资金	0.00	0.00%	10,000,900.00	7.04%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	9,989.81	0.01%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	9,989.81	0.01%	10,000,900.00	7.04%	不少于3年

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满3年，发起份额全部赎回。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 06 月 05 日）基金份额总额	338,868,389.00
本报告期期初基金份额总额	274,880,533.75
本报告期基金总申购份额	276,037.42
减：本报告期基金总赎回份额	133,120,689.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	142,035,881.40

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为 35,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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，未发生托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	87,909,825.77	24.30%	63,409.69	24.02%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	28,017,571.49	7.75%	20,357.18	7.71%	-
民生证券	2	188,389,907.24	52.08%	138,184.33	52.34%	-
兴业证券	2	35,612,522.24	9.84%	26,316.13	9.97%	-
招商证券	2	189,798.33	0.05%	140.68	0.05%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	1	21,612,789.20	5.97%	15,589.00	5.90%	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	400,000.00	14.07%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	30,313,223.01	21.49%	198,000.00	6.97%	-	-	-	-
民生证券	100,819,542.46	71.46%	741,000.00	26.07%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	535,000.00	18.82%	-	-	-	-
招商证券	9,946,127.40	7.05%	195,000.00	6.86%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	773,000,000.00	27.20%	-	-	-

11.8 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年01月05日
2	永赢基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的声明	中国证监会规定媒介	2023年01月12日
3	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 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年01月20日
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年03月29日
5	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 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023年03月30日
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年03月31日
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信息的公告	中国证监会规定媒介	2023年04月08日
8	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 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年04月21日
9	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招募说明书更新(2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2023年05月31日
10	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基金产品资料概要更新(2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2023年05月31日
11	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开放日常申购、赎回及转换业务公告	中国证监会规定媒介	2023年07月10日
12	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 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年07月20日
13	永赢基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2023年07月22日
14	永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型	中国证监会规定媒介	2023年07月22日

	发起式证券投资基金基金产品资料概要更新(2023年第2号)		日
15	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基金合同	中国证监会规定媒介	2023年07月22日
16	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招募说明书更新(2023年第2号)	中国证监会规定媒介	2023年07月22日
17	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2023年中期报告	中国证监会规定媒介	2023年08月30日
18	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2023年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2023年10月25日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予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注册的文件；
2. 《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基金合同》；
3. 《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托管协议》；
4. 《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。

13.2 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

13.3 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
2024 年 03 月 27 日