

永赢沪深 300 指数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：中国工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。

基金托管人中国工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	10
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
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	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
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	18
§ 5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§ 6	审计报告	18
6.1	审计报告基本信息	18
6.2	审计报告的基本内容	18
§ 7	年度财务报表	20
7.1	资产负债表	20
7.2	利润表	21
7.3	净资产变动表	22
7.4	报表附注	23
§ 8	投资组合报告	66
8.1	期末基金资产组合情况	66
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	66
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	67
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	77

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	79
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	79
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	79
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	79
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	79
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	80
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12	投资组合报告附注	80
§ 9	基金份额持有人信息	81
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
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	82
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	82
§ 10	开放式基金份额变动	82
§ 11	重大事件揭示	82
11.1	基金份额持有人大会决议	82
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	83
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4	基金投资策略的改变	83
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	83
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	83
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8	其他重大事件	84
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	86
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	86
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	86
§ 13	备查文件目录	86
13.1	备查文件目录	86
13.2	存放地点	87
13.3	查阅方式	87

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金	
基金简称	永赢沪深 300	
基金主代码	007538	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2019 年 07 月 09 日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	444,033,298.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C
下属分级基金的交易代码	007538	007539
报告期末下属分级基金的份额总额	295,774,527.07 份	148,258,771.54 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35% 以内。具体主要使用股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、其他金融工具投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略和存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型证券投资基金、货币市场基金和混合型证券投资基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		永赢基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	郭明
	联系电话	021-20430340	(010) 66105799
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-805-8888	95588
传真		021-51690177	(010) 66105798
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号	北京市西城区复兴门内大街 55 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、	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	27 层	
邮政编码	200120	100140
法定代表人	马宇晖	陈四清

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管理人互联网网址	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	
	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C
本期已实现收益	-26,824,345.76	-9,935,885.68	-39,320,100.72	-10,377,791.42	83,235,632.14	11,513,602.11
本期利润	-35,080,321.73	-8,861,940.95	-97,895,108.10	-13,565,924.43	9,982,605.68	-1,610,025.46
加权平均基金份额本期利润	-0.1008	-0.0700	-0.2730	-0.2227	0.0287	-0.0340
本期加权平均净值利润率	-9.03%	-6.29%	-20.67%	-17.19%	1.87%	-2.21%
本期基金份额净值增长率	-7.53%	-7.63%	-18.65%	-18.73%	1.48%	1.37%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C
期末可供	6,709,740.	2,586,869.	33,348,473	17,067,148	160,366,83	23,645,900

分配利润	95	85	.78	.10	1.71	.56
期末可供分配基金份额利润	0.0227	0.0174	0.1060	0.1014	0.5085	0.5043
期末基金资产净值	302,484,268.02	150,845,641.39	348,037,741.33	185,326,517.58	487,398,495.80	72,271,008.92
期末基金份额净值	1.0227	1.0174	1.1060	1.1014	1.5454	1.5414
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C
基金份额累计净值增长率	16.25%	15.71%	25.72%	25.26%	54.54%	54.14%

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

永赢沪深 300A

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	-6.30%	0.74%	-6.65%	0.75%	0.35%	-0.01%
过去六个月	-8.32%	0.80%	-10.17%	0.81%	1.85%	-0.01%
过去一年	-7.53%	0.80%	-10.79%	0.80%	3.26%	0.00%
过去三年	-23.66%	1.05%	-32.59%	1.06%	8.93%	-0.01%
自基金合同生效起至今	16.25%	1.10%	-8.92%	1.11%	25.17%	-0.01%

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*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

永赢沪深 300C

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	-6.33%	0.74%	-6.65%	0.75%	0.32%	-0.01%
过去六个月	-8.37%	0.80%	-10.17%	0.81%	1.80%	-0.01%

过去一年	-7.63%	0.80%	-10.79%	0.80%	3.16%	0.00%
过去三年	-23.90%	1.05%	-32.59%	1.06%	8.69%	-0.01%
自基金合同生效起至今	15.71%	1.10%	-8.92%	1.11%	24.63%	-0.01%

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*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

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

永赢沪深300A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年07月09日-2023年12月31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。

永赢沪深300C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

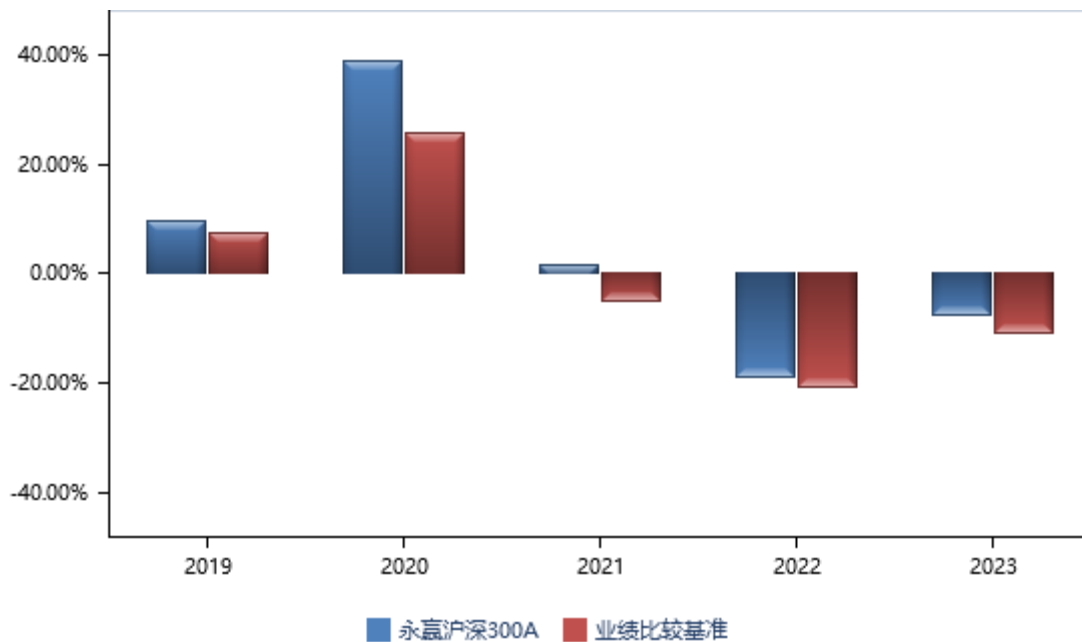
(2019年07月09日-2023年12月31日)



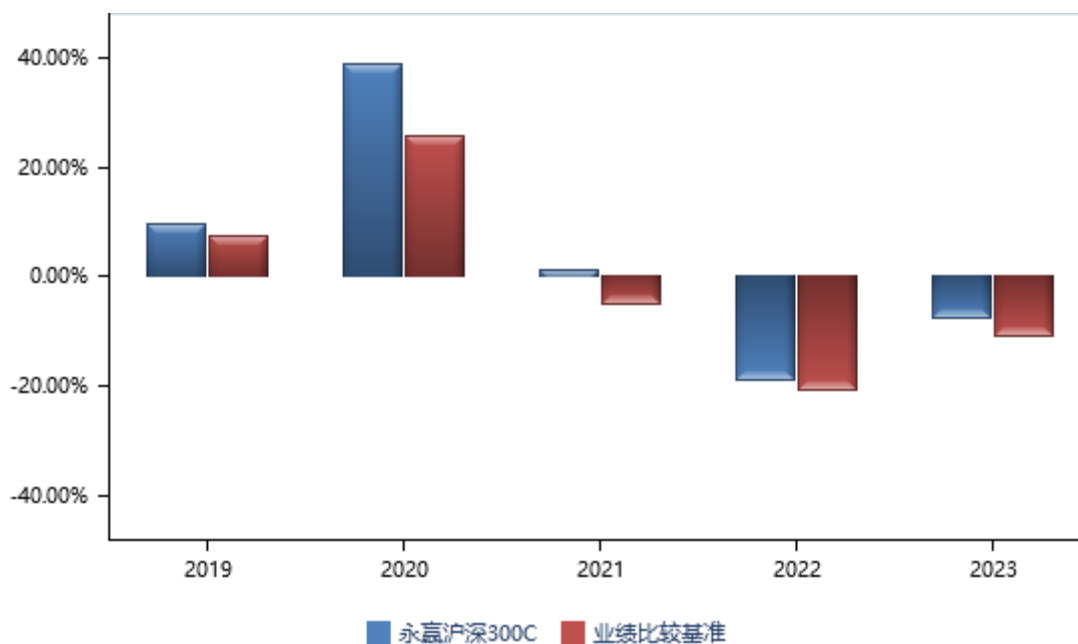
注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

永赢沪深 300A



永赢沪深 300C



注：本基金合同于 2019 年 07 月 09 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

永赢沪深 300A

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	1.500	22,725,496.16	21,508,511.90	44,234,008.06	-
合计	1.500	22,725,496.16	21,508,511.90	44,234,008.06	-

永赢沪深 300C

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	1.500	22,124,769.00	1,977,928.18	24,102,697.18	-
合计	1.500	22,124,769.00	1,977,928.18	24,102,697.18	-

§ 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		
万纯	指数与量化投资部主 管兼基金经理	2019 年 07 月 17 日	2023 年 08 月 29 日	9 年	万纯先生, 北京大学硕士, 9 年证券相关从业经验。曾任中国证券登记结算有限责任公司技术部基金业务组经理助理, 平安基金管理有限公司指数投资部基金经理助理, 永赢基金管理有限公司权益投资部指数与数量投资部副总监, 永赢基金管理有限公司指数与量化投资部主管。
刘庭宇	基金经理	2023 年 08 月 14 日	-	5 年	刘庭宇先生, 上海财经大学金融硕士, 5 年证券相关从业经验。曾任鹏扬基金管理有限公司量化分析师, 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。
刘庭宇	基金经理助理	2022 年 11 月 07 日	2023 年 07 月 25 日	5 年	刘庭宇先生, 上海财经大学金融硕士, 5 年证券相关从业经验。曾任鹏扬基金管理有限公司量化分析师, 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、《永赢沪深 300 指数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。

4.3.3 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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢沪深 300A 基金份额净值为 1.0227 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.53%，同期业绩比较基准收益率为-10.79%；截至报告期末永赢沪深 300C 基金份额净值为 1.0174 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.63%，同期业绩比较基准收益率为-10.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年，A 股市场在年初快速上涨后震荡回落，整体来看小盘股强于大盘股、价值风格相比成长风格占优。2023 年初随着疫情防控政策优化、新兴产业的规划出台及国内外人工智能应用爆火，TMT 和基建板块带领市场快速上行；进入二季度后，地产、消费需求偏弱导致相关板块回调较多；随着美元的强势上涨和美债利率持续上行，8 月份以来外资持续流出，叠加国内经济的内生性修复节奏偏缓、消费复苏动能仍弱于预期，市场整体继续震荡回调；全年整体呈现出以主题轮动为主的结构化行情。作为大盘价值风格的代表，沪深 300 指数兼具规模性和流动性，指数盈利能力相对稳健。报告期内，沪深 300 指数下跌 11.4%，中证 500 指数下跌 7.4%，创业板指下跌 19.4%。行业层面，TMT 板块（通信、传媒、计算机、电子）领涨，美容护理、商贸零售、房地产、电力设备行业领跌。

展望 2024 年，国内经济复苏斜率及结构、美联储货币政策变化将成为关键变量。随着美联储降息周期临近，美元和美债利率有望走弱并推动资金流入新兴市场；随着国内政策支持陆续推出和落地，经济复苏节奏加快、企业盈利有望回升，同时宏观流动性“宽货币稳信用”的可能性较高，目前主要宽基指数均处于历史估值中低位水平，因此对权益市场应保持积极乐观。预计 2024 年价值与成长风格仍以轮动状态为主，前期大盘价值风格有望延续相对优势，后期随着相关赛道景气度回升、看好成长风格的回归。

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。

4.8 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，本基金的管理人—永赢基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对永赢基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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_B53 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	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金的财务报

	<p>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。</p> <p>我们认为，后附的永赢沪深 300 指数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，公允反映了永赢沪深 300 指数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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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，我们独立于永赢沪深 300 指数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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>永赢沪深 300 指数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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估永赢沪深 300 指数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。</p> <p>治理层负责监督永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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，就可能对永赢沪深 300 指数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沪深 300 指数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：永赢沪深 300 指数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	22,942,402.78	32,176,641.42
结算备付金		230,446.11	1,917,214.20
存出保证金		96,352.54	768,524.63
交易性金融资产	7.4.7.2	435,129,506.17	505,761,091.79
其中：股票投资		422,896,357.68	499,719,954.80

基金投资		-	-
债券投资		12,233,148.49	6,041,136.99
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		27,632,603.28	8,818,793.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	15,577.15	505.14
资产总计		486,046,888.03	549,442,770.78
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		10,500,000.00	4,500,000.00
应付清算款		19,860,957.84	7,636,728.23
应付赎回款		1,796,629.91	3,231,164.28
应付管理人报酬		51,213.71	78,342.58
应付托管费		17,071.24	26,114.20
应付销售服务费		10,115.71	16,473.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,782.45	44.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	479,207.76	589,644.67
负债合计		32,716,978.62	16,078,511.87
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	444,033,298.61	482,948,637.03
未分配利润	7.4.7.8	9,296,610.80	50,415,621.88
净资产合计		453,329,909.41	533,364,258.91
负债和净资产总计		486,046,888.03	549,442,770.78

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0209 元，基金份额总额 444,033,298.61 份。

其中永赢沪深 300A 类基金份额净值 1.0227 元，份额总额 295,774,527.07 份；永赢沪深 300C 类基金份额净值 1.0174 元，份额总额 148,258,771.54 份。

7.2 利润表

会计主体：永赢沪深 300 指数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		-42,444,966.01	-109,953,225.19
1. 利息收入		569,544.02	224,185.90
其中：存款利息收入	7.4.7.9	98,234.33	164,386.81
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		-	-
其他利息收入		471,309.69	59,799.09
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-35,855,144.71	-48,435,120.76
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-47,685,472.43	-57,408,765.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	245,957.31	309.04
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	64,936.67	-1,729,814.01
股利收益	7.4.7.15	11,519,433.74	10,703,149.24
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	-7,182,031.24	-61,763,140.39
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	22,665.92	20,850.06
减：二、营业总支出		1,497,296.67	1,507,807.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	798,111.46	829,852.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	266,037.16	276,617.30
3. 销售服务费		142,015.53	77,925.75
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,722.49	-
其中：卖出回购金融资产支出		4,722.49	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		3,786.55	215.47
8. 其他费用	7.4.7.19	282,623.48	323,196.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-43,942,262.68	-111,461,032.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-43,942,262.68	-111,461,032.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-43,942,262.68	-111,461,032.53

7.3 净资产变动表

会计主体：永赢沪深 300 指数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	482,948,637.03	50,415,621.88	533,364,258.91
二、本期期初净资产	482,948,637.03	50,415,621.88	533,364,258.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-38,915,338.42	-41,119,011.08	-80,034,349.50
（一）、综合收益总额	-	-43,942,262.68	-43,942,262.68
（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）	-38,915,338.42	2,823,251.60	-36,092,086.82
其中：1. 基金申购款	820,046,408.41	88,657,582.95	908,703,991.36
2. 基金赎回款	-858,961,746.83	-85,834,331.35	-944,796,078.18
（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	444,033,298.61	9,296,610.80	453,329,909.41
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	362,263,377.16	197,406,127.56	559,669,504.72
二、本期期初净资产	362,263,377.16	197,406,127.56	559,669,504.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	120,685,259.87	-146,990,505.68	-26,305,245.81
（一）、综合收益总额	-	-111,461,032.53	-111,461,032.53
（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）	120,685,259.87	32,807,232.09	153,492,491.96
其中：1. 基金申购款	913,964,352.69	273,360,814.01	1,187,325,166.70
2. 基金赎回款	-793,279,092.82	-240,553,581.92	-1,033,832,674.74
（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）	-	-68,336,705.24	-68,336,705.24
四、本期期末净资产	482,948,637.03	50,415,621.88	533,364,258.91

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

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

永赢沪深 300 指数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[2019]853 号《关于准予永赢沪深 300 指数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 7 月 9 日生效，首次设立募集规模为 168,375,498.05 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，基金托管人为中国工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，以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，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）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可参与融资业务和融通证券出借交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率（税后） \times 5%。

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交易日确认，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) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入计入投资收益；

(8) 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，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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相应类别的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) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的每类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；

(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事业费附加的单位外）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	22,942,402.78	32,176,641.42
等于：本金	22,940,862.08	32,172,718.09
加：应计利息	1,540.70	3,923.33
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	22,942,402.78	32,176,641.42

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	480,787,847.87	-	422,896,357.68	-57,891,490.19	
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	12,018,570.00	231,948.49	12,233,148.49	-17,370.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,018,570.00	231,948.49	12,233,148.49	-17,370.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	492,806,417.87	231,948.49	435,129,506.17	-57,908,860.19	
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	550,698,183.75	-	499,719,954.80	-50,978,228.95	
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	5,989,200.00	52,536.99	6,041,136.99	-600.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,989,200.00	52,536.99	6,041,136.99	-600.00
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	556,687,383.75	52,536.99	505,761,091.79	-50,978,828.95

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-	-
权益衍生工具	5,604,300.00	-	-	-	-
其中：股指期货投资	5,604,300.00	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-	-
合计	5,604,300.00	-	-	-	-

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

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
应收利息	-	-
其他应收款	15,577.15	505.14

待摊费用	-	-
合计	15,577.15	505.14

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	258,969.56	371,177.83
其中：交易所市场	258,969.56	371,177.83
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付指数使用费	50,238.20	28,466.84
预提费用	170,000.00	190,000.00
合计	479,207.76	589,644.67

7.4.7.7 实收基金

永赢沪深 300A

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	314,689,267.55	314,689,267.55
本期申购	376,355,092.85	376,355,092.85
本期赎回（以“-”号填列）	-395,269,833.33	-395,269,833.33
本期末	295,774,527.07	295,774,527.07

永赢沪深 300C

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	168,259,369.48	168,259,369.48
本期申购	443,691,315.56	443,691,315.56
本期赎回（以“-”号填列）	-463,691,913.50	-463,691,913.50
本期末	148,258,771.54	148,258,771.54

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

永赢沪深 300A

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	78,077,702.09	-44,729,228.31	33,348,473.78
本期期初	78,077,702.09	-44,729,228.31	33,348,473.78
本期利润	-26,824,345.76	-8,255,975.97	-35,080,321.73
本期基金份额交易产生的变动数	-3,489,503.95	11,931,092.85	8,441,588.90
其中：基金申购款	86,008,984.31	-44,986,464.18	41,022,520.13
基金赎回款	-89,498,488.26	56,917,557.03	-32,580,931.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,763,852.38	-41,054,111.43	6,709,740.95

永赢沪深 300C

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	40,879,575.36	-23,812,427.26	17,067,148.10
本期期初	40,879,575.36	-23,812,427.26	17,067,148.10
本期利润	-9,935,885.68	1,073,944.73	-8,861,940.95
本期基金份额交易产生的变动数	-7,871,248.84	2,252,911.54	-5,618,337.30
其中：基金申购款	99,355,060.98	-51,719,998.16	47,635,062.82
基金赎回款	-107,226,309.82	53,972,909.70	-53,253,400.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,072,440.84	-20,485,570.99	2,586,869.85

7.4.7.9 存款利息收入

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
活期存款利息收入	73,311.72	134,205.91
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	23,291.01	28,558.88
其他	1,631.60	1,622.02
合计	98,234.33	164,386.81

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	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
卖出股票成交总额	510,002,612.46	548,253,637.65
减：卖出股票成本总额	556,510,644.19	604,111,976.64
减：交易费用	1,177,440.70	1,550,426.04
买卖股票差价收入	-47,685,472.43	-57,408,765.03

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	228,602.31	309.04
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,355.00	-
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	245,957.31	309.04

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 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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,280,950.00	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,982,645.00	-
减：应计利息总额	280,950.00	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	17,355.00	-

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

7.4.7.14.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益--其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	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
股指期货投资收益	64,936.67	-1,729,814.01
合计	64,936.67	-1,729,814.01

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	11,519,433.74	10,703,149.24
其中：证券出借权益补偿收入	373,882.76	1,300.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,519,433.74	10,703,149.24

7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-6,930,031.24	-61,841,140.39
-- 股票投资	-6,913,261.24	-61,840,540.39
-- 债券投资	-16,770.00	-600.00
-- 资产支持证券投资	-	-
-- 贵金属投资	-	-
-- 其他	-	-
2. 衍生工具	-252,000.00	78,000.00
-- 权证投资	-	-
-- 股指期货	-252,000.00	78,000.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-7,182,031.24	-61,763,140.39

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	21,364.95	20,848.43
基金转换费收入	1,300.97	1.63
合计	22,665.92	20,850.06

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 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
审计费用	50,000.00	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	6,208.53	6,049.73
账户维护费	-	16,500.00
指数使用费	106,414.95	110,646.97
合计	282,623.48	323,196.70

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
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 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
当期发生的基金应支付的管理费	798,111.46	829,852.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	149,289.80	92,250.95
应支付基金管理人的净管理费	648,821.66	737,601.17

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

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

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 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
当期发生的基金应支付的托管费	266,037.16	276,617.30

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C	合计
永赢基金	0.00	42,234.13	42,234.13
宁波银行	0.00	7,136.43	7,136.43
合计	0.00	49,370.56	49,370.56
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C	合计
永赢基金	0.00	12,271.74	12,271.74
宁波银行	0.00	3,076.19	3,076.19
合计	0.00	15,347.93	15,347.93

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 0.10%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{C 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

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。

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

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。

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

永赢沪深 300A

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	10,000,000.00
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	10,000,000.00
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%

永赢沪深 300C

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	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。

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
工商银行	22,942,402.78	73,311.72	32,176,641.42	134,205.91

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

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金管理人股东发行的股票宁波银行（002142.SZ）、基金托管人发行的股票工商银行（601398.SH）。于报告期末，本基金持有的宁波银行（002142.SZ）的数量为 97,470，占基金净值比例为 0.43%，工商银行（601398.SH）的数量为 857,600，占基金净值比例为 0.90%。

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	-
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股限售	2.66	4.45	6,274	16,688.84	27,919.30	-
301348	蓝箭电子	2023 年 08 月 01 日	6 个月	新股限售	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
688549	中巨芯	2023 年 08 月 30 日	6 个月	新股限售	5.18	8.09	3,113	16,125.34	25,184.17	-

688582	芯动联科	2023年 06月21 日	6个月	新股限售	26.74	38.67	607	16,231.18	23,472.69	-
688548	广钢气体	2023年 08月08 日	6个月	新股限售	9.87	12.75	1,808	17,844.96	23,052.00	-
301291	明阳电气	2023年 06月21 日	6个月	新股限售	38.13	28.36	752	28,673.76	21,326.72	-
688563	航材股份	2023年 07月12 日	6个月	新股限售	78.99	60.49	346	27,330.54	20,929.54	-
301370	国科恒泰	2023年 07月03 日	6个月	新股限售	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301421	波长光电	2023年 08月16 日	6个月	新股限售	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301558	三态股份	2023年 09月21 日	6个月	新股限售	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
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	-
688591	泰凌微	2023年 08月18 日	6个月	新股限售	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
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	-
603296	华勤技术	2023年 08月01 日	6个月	新股限售	80.80	77.75	222	17,937.60	17,260.50	-
301486	致尚科技	2023年 06月30 日	6个月	新股限售	57.66	47.25	364	20,988.24	17,199.00	-
688702	盛科通信	2023年 09月06 日	6个月	新股限售	42.66	48.18	350	14,931.00	16,863.00	-
301511	德福科技	2023年 08月08 日	6个月	新股限售	28.00	22.67	734	20,552.00	16,639.78	-
301509	金凯	2023年	6个月	新股限售	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-

	生科	07月26日		售						
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股限售	31.95	52.25	311	9,936.45	16,249.75	-
301362	民爆光电	2023年07月27日	6个月	新股限售	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
301498	乖宝宠物	2023年08月09日	6个月	新股限售	39.99	38.81	406	16,235.94	15,756.86	-
301468	博盈特焊	2023年07月12日	6个月	新股限售	47.58	30.22	506	24,075.48	15,291.32	-
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	-
301510	固高科技	2023年08月04日	6个月	新股限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301507	民生健康	2023年08月24日	6个月	新股限售	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301393	昊帆生物	2023年07月05日	6个月	新股限售	67.68	59.37	227	15,363.36	13,476.99	-
301210	金杨股份	2023年06月21日	6个月	新股限售	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股限售	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古智能	2023年07月06日	6个月	新股限售	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688719	爱科赛博	2023年09月20日	6个月	新股限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688602	康鹏科技	2023年07月13日	6个月	新股限售	8.66	11.06	1,042	9,023.72	11,524.52	-
301550	斯菱股份	2023年09月06日	6个月	新股限售	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-

		日								
301559	中集环科	2023年09月26日	6个月	新股限售	24.22	18.24	620	15,016.40	11,308.80	-
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	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301251	威尔高	2023年08月30日	6个月	新股限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
688592	司南导航	2023年08月07日	6个月	新股限售	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
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	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股限售	1.70	4.06	2,635	4,479.50	10,698.10	-
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	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
301528	多浦乐	2023年08月17日	6个月	新股限售	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
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	-
301372	科净源	2023年08月03日	6个月	新股限售	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
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	-
688612	威迈斯	2023年07月19日	6个月	新股限售	47.29	37.97	257	12,153.53	9,758.29	-

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	-
688716	中研股份	2023年09月13日	6个月	新股限售	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301500	飞南资源	2023年09月13日	6个月	新股限售	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301418	协昌科技	2023年08月10日	6个月	新股限售	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301516	中远通	2023年12月01日	6个月	新股限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
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	-
301371	敷尔佳	2023年07月24日	6个月	新股限售	55.68	37.58	245	13,641.60	9,207.10	-
301469	恒达新材	2023年08月10日	6个月	新股限售	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
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	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股限售	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦医药	2023年09月18日	6个月	新股限售	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
688638	誉辰	2023年	6个月	新股限售	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-

	智能	07月04日		售						
301459	丰茂股份	2023年12月06日	6个月	新股限售	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
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	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股限售	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
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	-
301517	陕西华达	2023年10月09日	6个月	新股限售	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股限售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德科技	2023年09月11日	6个月	新股限售	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
688657	浩辰软件	2023年09月25日	6个月	新股限售	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
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	-
688671	碧兴物联	2023年08月02日	6个月	新股限售	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023年08月10日	6个月	新股限售	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股限售	11.25	11.07	695	7,818.75	7,693.65	-
301533	威马农机	2023年08月07日	6个月	新股限售	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-

		日								
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股限 售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
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	-
301529	福赛科技	2023 年 08 月 31 日	6 个月	新股限 售	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
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	-
688648	中邮科技	2023 年 11 月 06 日	6 个月	新股限 售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	6 个月	新股限 售	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
603275	众辰科技	2023 年 08 月 16 日	6 个月	新股限 售	49.97	39.70	157	7,845.29	6,232.90	-
688450	光格科技	2023 年 07 月 17 日	6 个月	新股限 售	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股限 售	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603270	金帝股份	2023 年 08 月 25 日	6 个月	新股限 售	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603119	浙江荣泰	2023 年 07 月 21 日	6 个月	新股限 售	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603062	麦加芯彩	2023 年 10 月 31 日	6 个月	新股限 售	58.08	57.81	93	5,401.44	5,376.33	-
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新股限 售	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603193	润本股份	2023 年 10 月 09 日	6 个月	新股限 售	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-

001306	夏厦精密	2023 年 11 月 09 日	6 个月	新股限售	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 01 日	6 个月	新股限售	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
603075	热威股份	2023 年 09 月 01 日	6 个月	新股限售	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股限售	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023 年 12 月 04 日	6 个月	新股限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 06 日	6 个月	新股限售	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股限售	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023 年 09 月 18 日	6 个月	新股限售	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股限售	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

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。

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 10,500,000.00 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000001	平安银行	2024 年 01 月 05 日	9.39	56,100	526,779.00
2	000002	万科 A	2024 年 01 月 02 日	10.46	37,600	393,296.00
3	000063	中兴通讯	2024 年 01 月 02 日	26.48	25,200	667,296.00
4	000069	华侨城 A	2024 年 01 月 03 日	3.11	5,700	17,727.00
5	000408	藏格矿业	2024 年 01 月 02 日	25.34	5,800	146,972.00
6	000538	云南白药	2024 年 01 月 04 日	49.15	4,700	231,005.00
7	000625	长安汽车	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 04 日	16.83	38,600	649,638.00
8	000725	京东方 A	2024 年 01 月 02 日	3.90	52,300	203,970.00
9	000786	北新建材	2024 年 01 月 03 日-2024 年 01 月 12 日	23.36	5,600	130,816.00
10	000792	盐湖股份	2024 年 01 月 10 日-2024 年 01 月 11 日	15.95	28,000	446,600.00
11	000800	一汽解放	2024 年 01 月 11 日	8.50	5,500	46,750.00
12	000876	新希望	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 11 日	9.32	12,600	117,432.00
13	000895	双汇发展	2024 年 01 月 11 日	26.71	6,000	160,260.00
14	000938	紫光股份	2024 年 01 月 09 日	19.35	5,000	96,750.00
15	000977	浪潮信息	2024 年 01 月 02 日	33.20	5,600	185,920.00
16	000983	山西焦煤	2024 年 01 月 02 日	9.88	17,500	172,900.00
17	001979	招商蛇口	2024 年 01 月	9.53	19,400	184,882.00

			02 日-2024 年 01 月 04 日			
18	002050	三花智控	2024 年 01 月 11 日	29.40	12,800	376,320.00
19	002142	宁波银行	2024 年 01 月 10 日	20.11	1,000	20,110.00
20	002202	金风科技	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 11 日	8.00	15,300	122,400.00
21	002230	科大讯飞	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 10 日	46.38	10,300	477,714.00
22	002236	大华股份	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 08 日	18.45	11,000	202,950.00
23	002241	歌尔股份	2024 年 01 月 04 日	21.01	18,600	390,786.00
24	002271	东方雨虹	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 03 日	19.20	11,500	220,800.00
25	002459	晶澳科技	2024 年 01 月 09 日	20.72	9,700	200,984.00
26	002460	赣锋锂业	2024 年 01 月 11 日	42.80	6,700	286,760.00
27	002466	天齐锂业	2024 年 01 月 05 日-2024 年 01 月 08 日	55.79	5,700	318,003.00
28	002493	荣盛石化	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日	10.35	17,800	184,230.00
29	002555	三七互娱	2024 年 01 月 08 日	18.81	8,900	167,409.00
30	002709	天赐材料	2024 年 01 月 02 日	25.08	8,600	215,688.00
31	002736	国信证券	2024 年 01 月 02 日	8.54	21,600	184,464.00
32	002812	恩捷股份	2024 年 01 月 02 日	56.82	3,900	221,598.00
33	002916	深南电路	2024 年 01 月 02 日	70.99	1,400	99,386.00
34	002920	德赛西威	2024 年 01 月 11 日	129.51	1,600	207,216.00
35	003816	中国广核	2024 年 01 月 02 日	3.11	10,900	33,899.00

36	300124	汇川技术	2024 年 01 月 02 日	63.14	11,500	726,110.00
37	300142	沃森生物	2024 年 01 月 10 日	23.51	3,400	79,934.00
38	300223	北京君正	2024 年 01 月 02 日	64.65	1,500	96,975.00
39	300274	阳光电源	2024 年 01 月 12 日	87.59	1,400	122,626.00
40	300413	芒果超媒	2024 年 01 月 09 日	25.20	4,100	103,320.00
41	300433	蓝思科技	2024 年 01 月 02 日	13.20	11,900	157,080.00
42	300628	亿联网络	2024 年 01 月 02 日	29.55	1,200	35,460.00
43	300661	圣邦股份	2024 年 01 月 02 日	89.01	2,100	186,921.00
44	300760	迈瑞医疗	2024 年 01 月 12 日	290.60	1,000	290,600.00
45	300763	锦浪科技	2024 年 01 月 02 日	69.90	1,300	90,870.00
46	300999	金龙鱼	2024 年 01 月 02 日	33.38	4,000	133,520.00
47	600009	上海机场	2024 年 01 月 02 日	32.78	9,600	314,688.00
48	600010	包钢股份	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日	1.46	126,000	183,960.00
49	600015	华夏银行	2024 年 01 月 02 日	5.62	42,100	236,602.00
50	600025	华能水电	2024 年 01 月 02 日	8.63	11,900	102,697.00
51	600029	南方航空	2024 年 01 月 02 日	5.76	35,700	205,632.00
52	600031	三一重工	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 09 日	13.77	33,900	466,803.00
53	600039	四川路桥	2024 年 01 月 11 日	7.49	10,100	75,649.00
54	600048	保利发展	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 04 日	9.90	9,500	94,050.00
55	600104	上汽集团	2024 年 01 月 10 日	13.53	13,500	182,655.00
56	600111	北方稀土	2024 年 01 月	19.34	3,500	67,690.00

			03 日			
57	600176	中国巨石	2024 年 01 月 02 日	9.83	16,400	161,212.00
58	600183	生益科技	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 04 日	18.31	8,900	162,959.00
59	600188	兖矿能源	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 05 日	19.81	8,200	162,442.00
60	600346	恒力石化	2024 年 01 月 05 日	13.17	12,100	159,357.00
61	600362	江西铜业	2024 年 01 月 11 日	17.86	1,300	23,218.00
62	600438	通威股份	2024 年 01 月 11 日	25.03	3,500	87,605.00
63	600460	士兰微	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 04 日	22.83	6,600	150,678.00
64	600489	中金黄金	2024 年 01 月 12 日	9.96	16,100	160,356.00
65	600515	海南机场	2024 年 01 月 08 日	3.70	37,200	137,640.00
66	600690	海尔智家	2024 年 01 月 10 日	21.00	1,000	21,000.00
67	600732	爱旭股份	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 11 日	17.64	6,100	107,604.00
68	600741	华域汽车	2024 年 01 月 09 日	16.28	2,000	32,560.00
69	600745	闻泰科技	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日	42.31	5,000	211,550.00
70	600754	锦江酒店	2024 年 01 月 09 日	29.90	2,500	74,750.00
71	600760	中航沈飞	2024 年 01 月 09 日	42.18	6,400	269,952.00
72	600803	新奥股份	2024 年 01 月 02 日	16.82	1,000	16,820.00
73	600809	山西汾酒	2024 年 01 月 10 日	230.73	1,000	230,730.00
74	600905	三峡能源	2024 年 01 月 02 日	4.37	107,900	471,523.00
75	601006	大秦铁路	2024 年 01 月 08 日-2024 年	7.21	36,000	259,560.00

			01 月 12 日			
76	601012	隆基绿能	2024 年 01 月 10 日	22.90	35,800	819,820.00
77	601059	信达证券	2024 年 01 月 02 日	17.99	1,700	30,583.00
78	601100	恒立液压	2024 年 01 月 10 日	54.68	1,000	54,680.00
79	601138	工业富联	2024 年 01 月 04 日-2024 年 01 月 08 日	15.12	8,100	122,472.00
80	601155	新城控股	2024 年 01 月 02 日	11.41	7,100	81,011.00
81	601211	国泰君安	2024 年 01 月 10 日	14.88	1,000	14,880.00
82	601236	红塔证券	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 11 日	7.59	8,100	61,479.00
83	601238	广汽集团	2024 年 01 月 08 日	8.75	12,300	107,625.00
84	601360	三六零	2024 年 01 月 02 日	9.01	28,200	254,082.00
85	601600	中国铝业	2024 年 01 月 03 日	5.64	16,800	94,752.00
86	601607	上海医药	2024 年 01 月 10 日	16.73	1,000	16,730.00
87	601615	明阳智能	2024 年 01 月 03 日-2024 年 01 月 09 日	12.54	10,000	125,400.00
88	601628	中国人寿	2024 年 01 月 04 日	28.35	1,000	28,350.00
89	601633	长城汽车	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 05 日	25.22	7,400	186,628.00
90	601658	邮储银行	2024 年 01 月 10 日	4.35	11,700	50,895.00
91	601689	拓普集团	2024 年 01 月 09 日	73.50	2,400	176,400.00
92	601698	中国卫通	2024 年 01 月 08 日	17.31	3,500	60,585.00
93	601699	潞安环能	2024 年 01 月 02 日	21.91	8,900	194,999.00
94	601728	中国电信	2024 年 01 月 10 日	5.41	2,200	11,902.00
95	601800	中国交建	2024 年 01 月	7.60	26,100	198,360.00

			02 日			
96	601808	中海油服	2024 年 01 月 11 日	14.62	3,300	48,246.00
97	601818	光大银行	2024 年 01 月 10 日	2.90	8,100	23,490.00
98	601868	中国能建	2024 年 01 月 02 日-2024 年 01 月 12 日	2.10	77,400	162,540.00
99	601872	招商轮船	2024 年 01 月 05 日	5.88	19,500	114,660.00
100	601877	正泰电器	2024 年 01 月 10 日	21.51	1,300	27,963.00
101	601878	浙商证券	2024 年 01 月 03 日	10.43	11,100	115,773.00
102	601881	中国银河	2024 年 01 月 10 日-2024 年 01 月 11 日	12.05	9,100	109,655.00
103	601888	中国中免	2024 年 01 月 11 日	83.69	5,400	451,926.00
104	601901	方正证券	2024 年 01 月 02 日	8.06	30,900	249,054.00
105	601919	中远海控	2024 年 01 月 03 日-2024 年 01 月 04 日	9.58	35,600	341,048.00
106	601989	中国重工	2024 年 01 月 04 日	4.13	15,000	61,950.00
107	601995	中金公司	2024 年 01 月 08 日	38.05	5,200	197,860.00
108	603260	合盛硅业	2024 年 01 月 12 日	51.00	2,000	102,000.00
109	603369	今世缘	2024 年 01 月 02 日	48.75	4,500	219,375.00
110	603392	万泰生物	2024 年 01 月 02 日	75.13	2,600	195,338.00
111	603486	科沃斯	2024 年 01 月 02 日	41.44	1,100	45,584.00
112	603501	韦尔股份	2024 年 01 月 05 日	106.71	4,700	501,537.00
113	603659	璞泰来	2024 年 01 月 04 日-2024 年 01 月 09 日	20.93	4,800	100,464.00
114	603799	华友钴业	2024 年 01 月 04 日	32.93	1,700	55,981.00
115	603806	福斯特	2024 年 01 月	24.27	4,900	118,923.00

			02 日			
116	603833	欧派家居	2024 年 01 月 02 日	69.61	1,200	83,532.00
117	603899	晨光股份	2024 年 01 月 11 日	37.55	2,200	82,610.00
118	603993	洛阳钼业	2024 年 01 月 03 日	5.20	40,300	209,560.00
119	605117	德业股份	2024 年 01 月 02 日	83.90	1,300	109,070.00
120	688012	中微公司	2024 年 01 月 02 日	153.60	2,500	384,000.00
121	688036	传音控股	2024 年 01 月 02 日	138.40	1,900	262,960.00
122	688041	海光信息	2024 年 01 月 08 日	70.98	5,000	354,900.00
123	688065	凯赛生物	2024 年 01 月 02 日	54.98	1,300	71,474.00
124	688223	晶科能源	2024 年 01 月 02 日	8.86	12,000	106,320.00
125	688256	寒武纪	2024 年 01 月 08 日	134.96	1,100	148,456.00
126	688271	联影医疗	2024 年 01 月 08 日	137.01	2,200	301,422.00
127	688303	大全能源	2024 年 01 月 04 日	29.57	3,700	109,409.00
128	688363	华熙生物	2024 年 01 月 08 日	66.93	1,100	73,623.00
129	688396	华润微	2024 年 01 月 02 日	44.69	3,000	134,070.00
130	688599	天合光能	2024 年 01 月 04 日-2024 年 01 月 08 日	28.53	6,200	176,886.00
合计					1,654,400	23,708,360.00

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，使本基金紧密跟踪标的指数。

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体

系。五道防线分别为员工自律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	12,233,148.49	6,041,136.99
合计	12,233,148.49	6,041,136.99

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

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 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	22,942,402.78	-	-	-	-	-	22,942,402.78
结算备付金	230,446.11	-	-	-	-	-	230,446.11
存出保证金	96,352.54	-	-	-	-	-	96,352.54
交易性金融资产	12,233,148.49	-	-	-	-	422,896,357.68	435,129,506.17
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	-	-	-	-	-	27,632,603.28	27,632,603.28
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	15,577.15	15,577.15
资产总计	35,502,349.92	-	-	-	-	450,544,538.11	486,046,888.03
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	10,500,000.00	-	-	-	-	-	10,500,000.00

资产款	0						
应付清算款	-	-	-	-	-	19,860,957.84	19,860,957.84
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,796,629.91	1,796,629.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,213.71	51,213.71
应付托管费	-	-	-	-	-	17,071.24	17,071.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,115.71	10,115.71
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1,782.45	1,782.45
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	479,207.76	479,207.76
负债总计	10,500,000.00	-	-	-	-	22,216,978.62	32,716,978.62
利率敏感度缺口	25,002,349.92	-	-	-	-	428,327,559.49	453,329,909.41
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	32,176,641.42	-	-	-	-	-	32,176,641.42
结算备付金	1,917,214.20	-	-	-	-	-	1,917,214.20
存出保证金	65,768.63	-	-	-	-	702,756.00	768,524.63
交易性金融资产	-	-	6,041,136.99	-	-	499,719,954.80	505,761,091.79
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	-	-	-	-	-	8,818,793.60	8,818,793.60
其他资产	-	-	-	-	-	505.14	505.14
资产总计	34,159,624.25	-	6,041,136.99	-	-	509,242,009.54	549,442,770.78
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	4,500,000.00	-	-	-	-	4,500,000.00
应付清算款	-	-	-	-	7,636,728.23	7,636,728.23
应付赎回款	-	-	-	-	3,231,164.28	3,231,164.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	78,342.58	78,342.58
应付托管费	-	-	-	-	26,114.20	26,114.20
应付销售服务费	-	-	-	-	16,473.47	16,473.47
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	44.44	44.44
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	589,644.67	589,644.67
负债总计	4,500,000.00	-	-	-	11,578,511.87	16,078,511.87
利率敏感度缺口	29,659,624.25	6,041,136.99	-	-	497,663,497.67	533,364,258.91

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		
	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）	
分析		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		-2,801.39	-15,951.62
市场利率平行下降 50 个基点		2,801.39	15,951.62

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汇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	422,896,357.68	93.29	499,719,954.80	93.69
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	422,896,357.68	93.29	499,719,954.80	93.69

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%	4,492,743.16	5,292,734.10
业绩比较基准减少 1%	-4,492,743.16	-5,292,734.10	

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	421,782,124.83	497,762,537.70
第二层次	12,290,727.78	6,041,136.99
第三层次	1,056,653.56	1,957,417.10
合计	435,129,506.17	505,761,091.79

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		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,957,417.10	1,957,417.10
当期购买	-	2,072,516.64	2,072,516.64
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,712,014.76	3,712,014.76
当期利得或损失总额	-	738,734.58	738,734.58
其中：计入损益的利得或损失	-	738,734.58	738,734.58
期末余额	-	1,056,653.56	1,056,653.56
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	-	148,512.57	148,512.57
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	-	3,355,860.92	3,355,860.92
当期购买	-	1,918,571.72	1,918,571.72
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,162,172.51	3,162,172.51
当期利得或损失总额	-	-154,843.03	-154,843.03
其中：计入损益的利得或损失	-	-154,843.03	-154,843.03
期末余额	-	1,957,417.10	1,957,417.10
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	-	38,845.38	38,845.38

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	1,056,653.56	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	0.1462-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	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	1,957,417.10	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	422,896,357.68	87.01
	其中：股票	422,896,357.68	87.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,233,148.49	2.52
	其中：债券	12,233,148.49	2.52
	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	23,172,848.89	4.77
8	其他各项资产	27,744,532.97	5.71
9	合计	486,046,888.03	100.00

注：本基金通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为人民币 23,708,360.00 元，占期末基金资产净值比例 5.23%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,406,443.08	1.19
B	采矿业	20,167,938.06	4.45
C	制造业	230,639,917.78	50.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,195,271.90	3.13
E	建筑业	8,714,394.80	1.92
F	批发和零售业	1,341,427.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	13,152,768.50	2.90
H	住宿和餐饮业	322,920.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,849,082.80	4.38
J	金融业	91,724,083.82	20.23
K	房地产业	5,492,405.00	1.21

L	租赁和商务服务业	3,518,251.75	0.78
M	科学研究和技术服务业	4,985,157.82	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,822,242.52	0.40
R	文化、体育和娱乐业	449,820.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	421,782,124.83	93.04

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	985,563.90	0.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	39,389.60	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	7,693.65	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,961.13	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	19,002.11	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,114,232.85	0.25

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	15,200	26,235,200.00	5.79
2	601318	中国平安	263,294	10,610,748.20	2.34
3	300750	宁德时代	64,980	10,608,634.80	2.34
4	600036	招商银行	302,800	8,423,896.00	1.86
5	000858	五粮液	47,886	6,718,884.66	1.48
6	000333	美的集团	121,300	6,626,619.00	1.46
7	601166	兴业银行	356,000	5,770,760.00	1.27
8	600900	长江电力	239,500	5,589,930.00	1.23
9	601899	紫金矿业	403,300	5,025,118.00	1.11
10	600276	恒瑞医药	109,078	4,933,597.94	1.09
11	600030	中信证券	238,870	4,865,781.90	1.07
12	002594	比亚迪	22,300	4,415,400.00	0.97
13	300059	东方财富	313,263	4,398,212.52	0.97
14	300760	迈瑞医疗	14,700	4,271,820.00	0.94
15	002475	立讯精密	123,368	4,250,027.60	0.94
16	600887	伊利股份	155,733	4,165,857.75	0.92
17	601398	工商银行	857,600	4,099,328.00	0.90
18	601328	交通银行	672,300	3,859,002.00	0.85
19	603259	药明康德	50,132	3,647,604.32	0.80
20	000725	京东方 A	919,300	3,585,270.00	0.79
21	000651	格力电器	111,200	3,577,304.00	0.79
22	600309	万华化学	46,000	3,533,720.00	0.78
23	601012	隆基绿能	144,394	3,306,622.60	0.73
24	300124	汇川技术	51,242	3,235,419.88	0.71
25	000568	泸州老窖	18,000	3,229,560.00	0.71
26	002415	海康威视	92,100	3,197,712.00	0.71
27	600919	江苏银行	448,970	3,003,609.30	0.66
28	601816	京沪高铁	600,500	2,954,460.00	0.65
29	601288	农业银行	781,500	2,844,660.00	0.63
30	002714	牧原股份	67,364	2,774,049.52	0.61
31	600809	山西汾酒	11,673	2,693,311.29	0.59
32	300498	温氏股份	131,226	2,632,393.56	0.58
33	600028	中国石化	465,400	2,596,932.00	0.57
34	688981	中芯国际	47,931	2,541,301.62	0.56
35	601088	中国神华	80,600	2,526,810.00	0.56
36	601668	中国建筑	512,600	2,465,606.00	0.54
37	002352	顺丰控股	60,446	2,442,018.40	0.54
38	600016	民生银行	607,300	2,271,302.00	0.50
39	300274	阳光电源	25,300	2,216,027.00	0.49
40	600837	海通证券	236,200	2,213,194.00	0.49
41	600406	国电南瑞	98,212	2,192,091.84	0.48

42	000001	平安银行	232,900	2,186,931.00	0.48
43	600941	中国移动	21,900	2,178,612.00	0.48
44	000792	盐湖股份	130,914	2,088,078.30	0.46
45	002230	科大讯飞	44,435	2,060,895.30	0.45
46	601988	中国银行	515,100	2,055,249.00	0.45
47	601728	中国电信	379,200	2,051,472.00	0.45
48	600050	中国联通	466,600	2,043,708.00	0.45
49	000063	中兴通讯	75,600	2,001,888.00	0.44
50	000100	TCL 科技	463,490	1,993,007.00	0.44
51	601601	中国太保	83,700	1,990,386.00	0.44
52	000625	长安汽车	118,062	1,986,983.46	0.44
53	601225	陕西煤业	94,800	1,980,372.00	0.44
54	601857	中国石油	277,700	1,960,562.00	0.43
55	002142	宁波银行	97,470	1,960,121.70	0.43
56	600031	三一重工	141,600	1,949,832.00	0.43
57	600690	海尔智家	92,500	1,942,500.00	0.43
58	601888	中国中免	23,175	1,939,515.75	0.43
59	600000	浦发银行	286,900	1,899,278.00	0.42
60	603501	韦尔股份	17,207	1,836,158.97	0.41
61	000338	潍柴动力	134,100	1,830,465.00	0.40
62	300015	爱尔眼科	115,186	1,822,242.52	0.40
63	300122	智飞生物	29,500	1,802,745.00	0.40
64	300308	中际旭创	15,800	1,783,978.00	0.39
65	600436	片仔癀	7,300	1,766,527.00	0.39
66	601688	华泰证券	125,961	1,757,155.95	0.39
67	601985	中国核电	231,100	1,733,250.00	0.38
68	600048	保利发展	174,600	1,728,540.00	0.38
69	000002	万科 A	163,500	1,710,210.00	0.38
70	600089	特变电工	123,570	1,705,266.00	0.38
71	688111	金山办公	5,286	1,671,433.20	0.37
72	600438	通威股份	65,700	1,644,471.00	0.36
73	601169	北京银行	361,800	1,638,954.00	0.36
74	601211	国泰君安	110,100	1,638,288.00	0.36
75	600150	中国船舶	54,600	1,607,424.00	0.35
76	002304	洋河股份	14,600	1,604,540.00	0.35
77	002371	北方华创	6,500	1,597,115.00	0.35
78	002050	三花智控	53,702	1,578,838.80	0.35
79	002027	分众传媒	249,800	1,578,736.00	0.35
80	688041	海光信息	22,066	1,566,244.68	0.35
81	601766	中国中车	297,600	1,565,376.00	0.35
82	603288	海天味业	40,682	1,543,881.90	0.34

83	688012	中微公司	9,995	1,535,232.00	0.34
84	600104	上汽集团	112,800	1,526,184.00	0.34
85	603986	兆易创新	16,084	1,486,000.76	0.33
86	600905	三峡能源	338,600	1,479,682.00	0.33
87	600660	福耀玻璃	39,200	1,465,688.00	0.32
88	601138	工业富联	96,300	1,456,056.00	0.32
89	601919	中远海控	151,890	1,455,106.20	0.32
90	601229	上海银行	243,300	1,452,501.00	0.32
91	601390	中国中铁	251,100	1,426,248.00	0.31
92	002466	天齐锂业	24,800	1,383,592.00	0.31
93	600585	海螺水泥	58,700	1,324,272.00	0.29
94	601818	光大银行	452,900	1,313,410.00	0.29
95	688008	澜起科技	22,159	1,302,062.84	0.29
96	600019	宝钢股份	216,100	1,281,473.00	0.28
97	688271	联影医疗	9,328	1,278,029.28	0.28
98	300014	亿纬锂能	30,200	1,274,440.00	0.28
99	300782	卓胜微	9,020	1,271,820.00	0.28
100	002129	TCL 中环	79,675	1,246,117.00	0.27
101	600999	招商证券	90,800	1,238,512.00	0.27
102	600893	航发动力	32,400	1,211,112.00	0.27
103	601658	邮储银行	270,678	1,177,449.30	0.26
104	002241	歌尔股份	55,676	1,169,752.76	0.26
105	600111	北方稀土	60,300	1,166,202.00	0.26
106	002460	赣锋锂业	27,020	1,156,456.00	0.26
107	000661	长春高新	7,905	1,152,549.00	0.25
108	601628	中国人寿	40,600	1,151,010.00	0.25
109	601989	中国重工	277,200	1,144,836.00	0.25
110	603019	中科曙光	28,460	1,123,885.40	0.25
111	002049	紫光国微	16,620	1,121,019.00	0.25
112	600958	东方证券	127,944	1,113,112.80	0.25
113	600760	中航沈飞	26,076	1,099,885.68	0.24
114	603799	华友钴业	33,210	1,093,605.30	0.24
115	601600	中国铝业	192,300	1,084,572.00	0.24
116	000938	紫光股份	55,739	1,078,549.65	0.24
117	600938	中国海油	51,000	1,069,470.00	0.24
118	601939	建设银行	164,100	1,068,291.00	0.24
119	600570	恒生电子	37,088	1,066,650.88	0.24
120	601006	大秦铁路	146,900	1,059,149.00	0.23
121	000538	云南白药	21,480	1,055,742.00	0.23
122	002252	上海莱士	131,200	1,049,600.00	0.23
123	000776	广发证券	73,100	1,044,599.00	0.23

124	600584	长电科技	34,800	1,039,128.00	0.23
125	601669	中国电建	210,700	1,030,323.00	0.23
126	002179	中航光电	26,048	1,015,872.00	0.22
127	688036	传音控股	7,313	1,012,119.20	0.22
128	600547	山东黄金	44,088	1,008,292.56	0.22
129	600426	华鲁恒升	36,190	998,482.10	0.22
130	601377	兴业证券	169,220	993,321.40	0.22
131	000166	申万宏源	222,100	986,124.00	0.22
132	300408	三环集团	33,000	971,850.00	0.21
133	600886	国投电力	72,855	960,228.90	0.21
134	600009	上海机场	29,200	957,176.00	0.21
135	000425	徐工机械	174,800	954,408.00	0.21
136	601009	南京银行	126,140	930,913.20	0.21
137	601916	浙商银行	369,100	930,132.00	0.21
138	002271	东方雨虹	48,350	928,320.00	0.20
139	300142	沃森生物	39,300	923,943.00	0.20
140	002311	海大集团	20,435	917,735.85	0.20
141	600795	国电电力	218,300	908,128.00	0.20
142	000596	古井贡酒	3,900	907,920.00	0.20
143	600085	同仁堂	16,600	891,420.00	0.20
144	000963	华东医药	21,500	891,390.00	0.20
145	600588	用友网络	49,970	888,966.30	0.20
146	600745	闻泰科技	20,900	884,279.00	0.20
147	603993	洛阳钼业	168,200	874,640.00	0.19
148	002236	大华股份	47,400	874,530.00	0.19
149	600926	杭州银行	87,095	871,820.95	0.19
150	600845	宝信软件	17,550	856,440.00	0.19
151	601186	中国铁建	112,300	854,603.00	0.19
152	600015	华夏银行	150,800	847,496.00	0.19
153	601111	中国国航	113,600	833,824.00	0.18
154	600011	华能国际	107,700	829,290.00	0.18
155	001979	招商蛇口	87,000	829,110.00	0.18
156	002920	德赛西威	6,400	828,864.00	0.18
157	600674	川投能源	54,400	822,528.00	0.18
158	002459	晶澳科技	39,628	821,092.16	0.18
159	000977	浪潮信息	24,700	820,040.00	0.18
160	300033	同花顺	5,200	815,724.00	0.18
161	600115	中国东航	209,100	811,308.00	0.18
162	000157	中联重科	123,000	803,190.00	0.18
163	600989	宝丰能源	53,600	791,672.00	0.17
164	601995	中金公司	20,800	791,440.00	0.17

165	600010	包钢股份	541,600	790,736.00	0.17
166	002812	恩捷股份	13,900	789,798.00	0.17
167	601901	方正证券	97,600	786,656.00	0.17
168	600196	复星医药	31,000	775,930.00	0.17
169	000768	中航西飞	34,300	767,291.00	0.17
170	601689	拓普集团	10,400	764,400.00	0.17
171	601360	三六零	84,200	758,642.00	0.17
172	002493	荣盛石化	73,208	757,702.80	0.17
173	601066	中信建投	31,700	750,022.00	0.17
174	601633	长城汽车	29,300	738,946.00	0.16
175	600029	南方航空	128,000	737,280.00	0.16
176	300896	爱美客	2,500	735,825.00	0.16
177	601788	光大证券	47,700	735,534.00	0.16
178	688599	天合光能	25,644	731,623.32	0.16
179	603369	今世缘	14,800	721,500.00	0.16
180	300316	晶盛机电	16,100	709,849.00	0.16
181	300496	中科创达	8,800	704,528.00	0.16
182	002601	龙佰集团	41,100	704,043.00	0.16
183	300347	泰格医药	12,800	703,616.00	0.16
184	601100	恒立液压	12,840	702,091.20	0.15
185	002555	三七互娱	37,100	697,851.00	0.15
186	688126	沪硅产业	40,012	693,007.84	0.15
187	300450	先导智能	27,000	691,200.00	0.15
188	600489	中金黄金	69,300	690,228.00	0.15
189	002709	天赐材料	27,500	689,700.00	0.15
190	300661	圣邦股份	7,705	685,822.05	0.15
191	002821	凯莱英	5,840	678,024.00	0.15
192	000895	双汇发展	25,100	670,421.00	0.15
193	603392	万泰生物	8,875	666,778.75	0.15
194	600346	恒力石化	50,400	663,768.00	0.15
195	600188	兖矿能源	32,750	648,777.50	0.14
196	601868	中国能建	308,200	647,220.00	0.14
197	002001	新和成	38,113	646,396.48	0.14
198	601800	中国交建	84,000	638,400.00	0.14
199	600600	青岛啤酒	8,500	635,375.00	0.14
200	300759	康龙化成	21,875	633,937.50	0.14
201	300433	蓝思科技	47,700	629,640.00	0.14
202	601881	中国银河	52,000	626,600.00	0.14
203	601336	新华保险	20,100	625,713.00	0.14
204	000301	东方盛虹	65,100	624,960.00	0.14
205	600372	中航机载	47,300	623,414.00	0.14

206	688256	寒武纪	4,600	620,816.00	0.14
207	600741	华域汽车	38,100	620,268.00	0.14
208	601699	潞安环能	28,200	617,862.00	0.14
209	002648	卫星化学	41,520	612,420.00	0.14
210	600515	海南机场	163,400	604,580.00	0.13
211	003816	中国广核	193,300	601,163.00	0.13
212	002007	华兰生物	27,050	598,616.50	0.13
213	601021	春秋航空	11,800	592,360.00	0.13
214	002736	国信证券	68,700	586,698.00	0.13
215	601117	中国化学	89,800	571,128.00	0.13
216	002074	国轩高科	26,400	567,600.00	0.13
217	000786	北新建材	24,100	562,976.00	0.12
218	002410	广联达	32,780	561,849.20	0.12
219	601877	正泰电器	26,100	561,411.00	0.12
220	000733	振华科技	9,500	558,980.00	0.12
221	600176	中国巨石	56,809	558,432.47	0.12
222	688396	华润微	12,380	553,262.20	0.12
223	301269	华大九天	5,200	550,420.00	0.12
224	002180	纳思达	24,205	547,759.15	0.12
225	601615	明阳智能	43,200	541,728.00	0.12
226	601618	中国中冶	174,100	532,746.00	0.12
227	000983	山西焦煤	53,800	531,544.00	0.12
228	002202	金风科技	66,430	531,440.00	0.12
229	601838	成都银行	46,600	524,716.00	0.12
230	600233	圆通速递	42,100	517,409.00	0.11
231	000876	新希望	54,500	507,940.00	0.11
232	600183	生益科技	27,700	507,187.00	0.11
233	600219	南山铝业	172,000	505,680.00	0.11
234	600332	白云山	17,100	489,060.00	0.11
235	000999	华润三九	9,700	482,381.00	0.11
236	601878	浙商证券	46,200	481,866.00	0.11
237	300999	金龙鱼	14,200	473,996.00	0.10
238	000408	藏格矿业	18,700	473,858.00	0.10
239	002603	以岭药业	20,500	472,935.00	0.10
240	002841	视源股份	10,300	471,328.00	0.10
241	600918	中泰证券	68,300	468,538.00	0.10
242	600732	爱旭股份	26,320	464,284.80	0.10
243	601238	广汽集团	52,700	461,125.00	0.10
244	601872	招商轮船	77,900	458,052.00	0.10
245	600023	浙能电力	98,400	453,624.00	0.10
246	601607	上海医药	26,900	450,037.00	0.10

247	300413	芒果超媒	17,850	449,820.00	0.10
248	600362	江西铜业	25,100	448,286.00	0.10
249	688303	大全能源	15,049	444,998.93	0.10
250	600460	士兰微	19,400	442,902.00	0.10
251	300223	北京君正	6,800	439,620.00	0.10
252	601898	中煤能源	44,800	434,112.00	0.10
253	300454	深信服	6,000	433,740.00	0.10
254	603260	合盛硅业	8,500	433,500.00	0.10
255	601799	星宇股份	3,300	432,663.00	0.10
256	603806	福斯特	17,672	428,899.44	0.09
257	600061	国投资本	63,060	425,024.40	0.09
258	300751	迈为股份	3,260	422,202.60	0.09
259	603659	璞泰来	20,145	421,634.85	0.09
260	688223	晶科能源	47,023	416,623.78	0.09
261	300919	中伟股份	8,100	397,953.00	0.09
262	601998	中信银行	74,600	394,634.00	0.09
263	600875	东方电气	26,900	393,278.00	0.09
264	300763	锦浪科技	5,600	391,440.00	0.09
265	600132	重庆啤酒	5,800	385,410.00	0.09
266	002938	鹏鼎控股	17,000	379,440.00	0.08
267	601319	中国人保	78,300	378,972.00	0.08
268	000069	华侨城 A	121,200	376,932.00	0.08
269	600803	新奥股份	22,400	376,768.00	0.08
270	600025	华能水电	42,800	369,364.00	0.08
271	603290	斯达半导	2,000	362,000.00	0.08
272	300628	亿联网络	12,240	361,692.00	0.08
273	601865	福莱特	13,400	357,780.00	0.08
274	000708	中信特钢	24,700	346,788.00	0.08
275	002916	深南电路	4,720	335,072.80	0.07
276	000617	中油资本	62,000	334,800.00	0.07
277	600018	上港集团	68,291	334,625.90	0.07
278	605117	德业股份	3,920	328,888.00	0.07
279	605499	东鹏饮料	1,800	328,518.00	0.07
280	603899	晨光股份	8,700	326,685.00	0.07
281	600754	锦江酒店	10,800	322,920.00	0.07
282	600039	四川路桥	41,920	313,980.80	0.07
283	603833	欧派家居	4,200	292,362.00	0.06
284	603195	公牛集团	3,056	292,306.40	0.06
285	688363	华熙生物	4,299	287,732.07	0.06
286	000877	天山股份	42,900	286,572.00	0.06
287	688065	凯赛生物	5,110	280,947.80	0.06

288	300957	贝泰妮	4,100	279,497.00	0.06
289	601698	中国卫通	14,900	257,919.00	0.06
290	601236	红塔证券	33,580	254,872.20	0.06
291	688561	奇安信	6,312	253,048.08	0.06
292	601155	新城控股	21,300	243,033.00	0.05
293	600606	绿地控股	101,800	234,140.00	0.05
294	603486	科沃斯	5,400	223,776.00	0.05
295	688187	时代电气	6,004	218,125.32	0.05
296	601808	中海油服	13,900	203,218.00	0.04
297	300979	华利集团	3,600	189,504.00	0.04
298	000800	一汽解放	22,200	188,700.00	0.04
299	601059	信达证券	7,600	136,724.00	0.03
300	001289	龙源电力	3,600	71,316.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
2	301526	国际复材	6,274	27,919.30	0.01
3	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.01
4	688549	中巨芯	3,113	25,184.17	0.01
5	688582	芯动联科	607	23,472.69	0.01
6	688548	广钢气体	1,808	23,052.00	0.01
7	301291	明阳电气	752	21,326.72	0.00
8	688563	航材股份	346	20,929.54	0.00
9	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
10	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
11	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
12	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
13	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
14	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
15	603296	华勤技术	222	17,260.50	0.00
16	301486	致尚科技	364	17,199.00	0.00
17	688702	盛科通信	350	16,863.00	0.00
18	301511	德福科技	734	16,639.78	0.00
19	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
20	688652	京仪装备	311	16,249.75	0.00
21	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
22	301498	乖宝宠物	406	15,756.86	0.00
23	301468	博盈特焊	506	15,291.32	0.00
24	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00

25	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
26	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
27	301393	昊帆生物	227	13,476.99	0.00
28	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
29	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
30	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
31	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
32	688602	康鹏科技	1,042	11,524.52	0.00
33	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
34	301559	中集环科	620	11,308.80	0.00
35	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
36	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
37	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
38	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
39	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
40	601096	宏盛华源	2,635	10,698.10	0.00
41	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
42	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
43	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
44	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
45	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
46	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
47	688612	威迈斯	257	9,758.29	0.00
48	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
49	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
50	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
51	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
52	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
53	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
54	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
55	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
56	301371	敷尔佳	245	9,207.10	0.00
57	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
58	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
59	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
60	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
61	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
62	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
63	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
64	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
65	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00

66	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
67	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
68	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
69	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
70	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
71	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
72	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
73	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
74	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
75	601083	锦江航运	695	7,693.65	0.00
76	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
77	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
78	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
79	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
80	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
81	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
82	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
83	603275	众辰科技	157	6,232.90	0.00
84	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
85	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
86	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
87	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
88	603062	麦加芯彩	93	5,376.33	0.00
89	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
90	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
91	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
92	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
93	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
94	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
95	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
96	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
97	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
98	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
99	603373	安邦护卫	88	3,058.00	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	600519	贵州茅台	23,613,539.88	4.43

2	300750	宁德时代	13,274,358.00	2.49
3	601318	中国平安	12,844,962.00	2.41
4	600036	招商银行	10,318,904.00	1.93
5	000858	五粮液	7,668,412.05	1.44
6	000333	美的集团	6,649,255.00	1.25
7	601166	兴业银行	6,037,730.00	1.13
8	600900	长江电力	5,747,898.60	1.08
9	601899	紫金矿业	5,586,865.00	1.05
10	600030	中信证券	5,374,035.00	1.01
11	600276	恒瑞医药	5,097,382.18	0.96
12	002594	比亚迪	4,860,061.00	0.91
13	300059	东方财富	4,771,009.69	0.89
14	600887	伊利股份	4,528,110.00	0.85
15	601012	隆基绿能	4,367,626.48	0.82
16	601398	工商银行	4,286,883.00	0.80
17	600309	万华化学	4,113,616.00	0.77
18	002415	海康威视	4,058,285.00	0.76
19	601328	交通银行	4,002,499.00	0.75
20	000651	格力电器	3,949,793.00	0.74

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	600519	贵州茅台	25,464,931.40	4.77
2	601318	中国平安	14,065,976.00	2.64
3	300750	宁德时代	13,695,319.80	2.57
4	600036	招商银行	11,286,446.82	2.12
5	000858	五粮液	8,120,026.00	1.52
6	600900	长江电力	7,180,750.50	1.35
7	000333	美的集团	7,113,235.00	1.33
8	601166	兴业银行	6,544,828.00	1.23
9	600030	中信证券	5,748,113.97	1.08
10	600276	恒瑞医药	5,507,473.97	1.03
11	002594	比亚迪	5,443,404.00	1.02
12	601899	紫金矿业	5,260,314.00	0.99
13	002415	海康威视	5,120,701.39	0.96
14	300059	东方财富	5,021,534.80	0.94
15	600887	伊利股份	4,935,501.00	0.93
16	601398	工商银行	4,723,784.00	0.89
17	601012	隆基绿能	4,571,383.00	0.86

18	601328	交通银行	4,412,291.00	0.83
19	600309	万华化学	4,404,987.00	0.83
20	603259	药明康德	4,204,510.75	0.79

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	486,600,308.31
卖出股票收入（成交）总额	510,002,612.46

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	12,233,148.49	2.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,233,148.49	2.70

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	019694	23 国债 01	120,000	12,233,148.49	2.70

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

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。根据基金合同规定，本基金可投资于以标的指数为基础资产的股指期货，并在相关法律法规的限制下，起到配合基金日常投资管理需要、降低交易成本和跟踪误差的作用。报告期内，本基金严格遵守既定投资政策和投资目的，进行股指期货投资。

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招商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 635 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	96,352.54
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,632,603.28
6	其他应收款	15,577.15

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,744,532.97

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301487	盟固利	35,512.32	0.01	新股限售
2	301526	国际复材	27,919.30	0.01	新股限售
3	301348	蓝箭电子	27,321.41	0.01	新股限售
4	688549	中巨芯	25,184.17	0.01	新股限售
5	688582	芯动联科	23,472.69	0.01	新股限售

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

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
永赢沪深 300A	16,653	17,761.04	140,045,749.78	47.3488%	155,728,777.29	52.6512%
永赢沪深 300C	16,613	8,924.26	30,114,524.81	20.3121%	118,144,246.73	79.6879%
合计	33,266	13,347.96	170,160,274.59	38.3215%	273,873,024.02	61.6785%

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）。

9.2 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	永赢沪深 300A	394,858.75	0.13%
	永赢沪深 300C	393,958.94	0.27%
	合计	788,817.69	0.18%

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	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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	永赢沪深 300A	0~10
	永赢沪深 300C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢沪深 300A	0
	永赢沪深 300C	0
	合计	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%	10,000,000.00	2.25%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	382,277.81	0.09%	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	382,277.81	0.09%	10,000,000.00	2.25%	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

项目	永赢沪深 300A	永赢沪深 300C
基金合同生效日（2019 年 07 月 09 日）基金份额总额	167,410,623.76	964,874.29
本报告期期初基金份额总额	314,689,267.55	168,259,369.48
本报告期基金总申购份额	376,355,092.85	443,691,315.56
减：本报告期基金总赎回份额	395,269,833.33	463,691,913.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	295,774,527.07	148,258,771.54

§ 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 50,000.00 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	
国投证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	92,316,577.55	9.47%	67,896.10	9.56%	-
广发证券	2	41,183,480.77	4.23%	30,496.15	4.29%	-
国海证券	2	273,567,028.63	28.07%	197,825.24	27.85%	-
华创证券	2	267,559,859.99	27.46%	195,014.18	27.45%	-

上海证券	2	148,919,895.03	15.28%	108,489.24	15.27%	-
野村东方 国际证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	150,957,089.79	15.49%	110,659.49	15.58%	-

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
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	10,500,000.00	24.76%	-	-	-	-
国海证券	499,390.00	2.38%	8,300,000.00	19.58%	-	-	-	-
华创证券	7,994,540.00	38.05%	7,100,000.00	16.75%	-	-	-	-
上海证券	12,018,570.00	57.20%	11,800,000.00	27.83%	-	-	-	-
野村东方 国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	499,515.00	2.38%	4,700,000.00	11.08%	-	-	-	-

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	永赢沪深 300 指数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 年 02 月 17 日
5	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
6	永赢沪深 300 指数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
7	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
8	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
9	永赢沪深 300 指数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
10	永赢基金管理有限公司关于新增中国邮政储蓄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 05 月 17 日
11	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 年 05 月 26 日
12	永赢沪深 300 指数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	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金(C 份额)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 08 月 15 日
14	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金增聘基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 15 日
15	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金更新招募说明书(2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 15 日
16	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金(A 份额)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 08 月 15 日
17	永赢沪深 300 指数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	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金(A 份额)基金产品资料概要更新(2023 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 30 日
19	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金的基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 30 日
20	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金(C 份额)基金产品资料概要更新(2023	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 30 日

	年第 2 号)		
21	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金更新招募说明书(2023 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 30 日
22	永赢沪深 300 指数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
23	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金更新招募说明书(2023 年第 3 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 11 月 30 日
24	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金(A 份额)基金产品资料概要更新(2023 年第 3 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 11 月 30 日
25	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金(C 份额)基金产品资料概要更新(2023 年第 3 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 11 月 30 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230607 - 20230608, 20230616 - 20230919	59,927,916.73	49,025,387.90	108,650,549.56	302,755.07	0.07%
产品特有风险							
<p>本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况,存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。</p>							

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沪深 300 指数型发起式证券投资基金注册的文件;
2. 《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金合同》;
3. 《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金托管协议》;

4. 《永赢沪深 300 指数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