

永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金(原永赢深证创新
100 交易型开放式指数证券投资基金转型)

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

自 2025 年 05 月 09 日起，永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型为永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金。本报告中，永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 05 月 08 日止，永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的报告期自 2025 年 05 月 09 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	6
2.1	基金基本情况（转型后）	6
2.1	基金基本情况（转型前）	6
2.2	基金产品说明（转型后）	6
2.2	基金产品说明（转型前）	7
2.3	基金管理人和基金托管人	7
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标（转型后）	8
3.1	主要会计数据和财务指标（转型前）	8
3.2	基金净值表现（转型后）	9
3.2	基金净值表现（转型前）	9
§ 4	管理人报告	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5	托管人报告	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	19
6.3	净资产变动表	19
6.4	报表附注	20
§ 6	半年度财务会计报表（未经审计）（转型前）	43
6.1	资产负债表	43
6.2	利润表	45
6.3	净资产变动表	46
6.4	报表附注	47
§ 7	投资组合报告（转型后）	67
7.1	期末基金资产组合情况	67
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	67

7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	68
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	73
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	73
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	73
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	73
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
7.12	投资组合报告附注	73
§ 7	投资组合报告（转型前）	74
7.1	期末基金资产组合情况	74
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	75
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	76
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	79
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	81
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	81
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	81
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	81
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	81
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	81
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	81
7.12	投资组合报告附注	81
§ 8	基金份额持有人信息（转型后）	82
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
8.2	期末上市基金前十名持有人	82
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	83
§ 8	基金份额持有人信息（转型前）	83
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
8.2	期末上市基金前十名持有人	83
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	84
§ 9	开放式基金份额变动（转型后）	84
§ 9	开放式基金份额变动（转型前）	84
§ 10	重大事件揭示	84
10.1	基金份额持有人大会决议	84
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	85
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
10.4	基金投资策略的改变	85
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	85
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	85
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	86
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	87

10.9	其他重大事件（转型后）	88
10.10	其他重大事件（转型前）	89
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	90
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	90
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	90
§ 12	备查文件目录	91
12.1	备查文件目录	91
12.2	存放地点	91
12.3	查阅方式	91

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	深证 100ETF 永赢
场内简称	深证 100ETF 永赢
基金主代码	159721
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 05 月 09 日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	105,431,696.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 06 月 25 日

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	深创龙头 ETF
场内简称	深创 ETF
基金主代码	159721
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 06 月 17 日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	111,431,696.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 06 月 25 日

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在 2%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内。主要投资策略有：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、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	深证 100 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，理论上具有与标的指数、以及标

	的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	-----------------------

2.2 基金产品说明（转型前）

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。
投资策略	本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。主要投资策略有：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、股指期货投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略和存托凭证投资策略。
业绩比较基准	深证创新 100 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		永赢基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	许俊
	联系电话	021-20430340	010-66596688
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-805-8888	95566
传真		021-51690177	010-66594942
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		马宇晖	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	659,306.40
本期利润	2,107,918.35
加权平均基金份额本期利润	0.0194
本期加权平均净值利润率	2.54%
本期基金份额净值增长率	2.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	-24,435,411.36
期末可供分配基金份额利润	-0.2318
期末基金资产净值	82,423,079.85
期末基金份额净值	0.7818
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	2.57%

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。

4、本基金于 2025 年 05 月 09 日由永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型而成，截至本报告期末，本基金转型未滿半年。

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日）
本期已实现收益	953,222.98
本期利润	-2,045,030.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0247
本期加权平均净值利润率	-3.23%
本期基金份额净值增长率	-0.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 05 月 08 日）
期末可供分配利润	-26,501,912.87
期末可供分配基金份额利润	-0.2378
期末基金资产净值	84,937,077.18
期末基金份额净值	0.7622
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 05 月 08 日）
基金份额累计净值增长率	-23.78%

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。

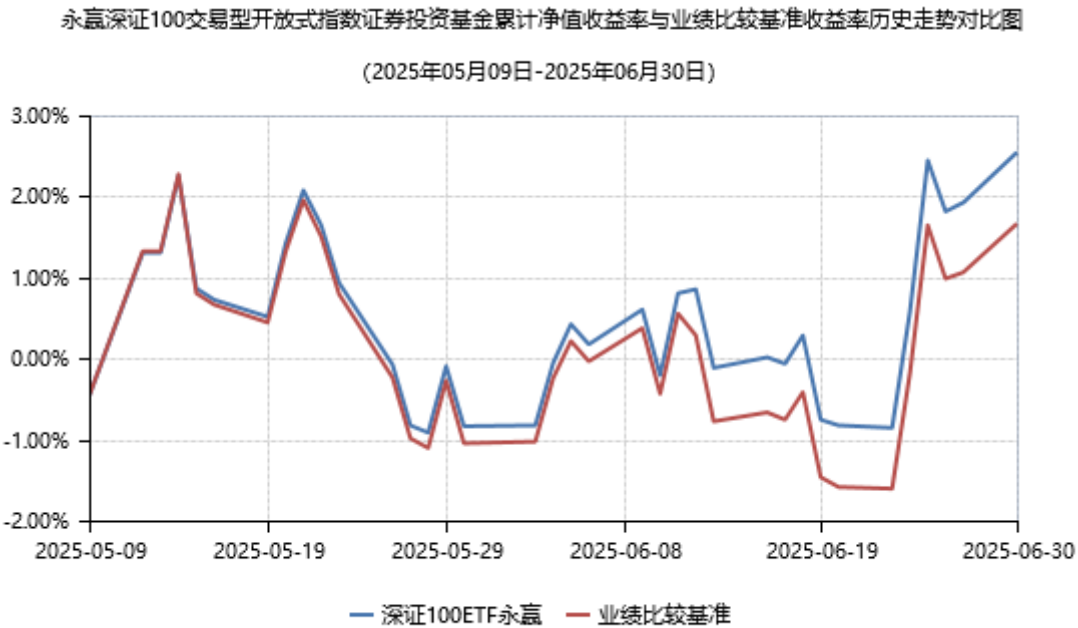
3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去一个月	3.41%	0.75%	2.74%	0.76%	0.67%	-0.01%
自基金合同生 效起至今	2.57%	0.79%	1.69%	0.80%	0.88%	-0.01%

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



注：本基金于 2025 年 05 月 09 日由永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型而成，截至本报告期末，本基金转型未满一年。

3.2 基金净值表现（转型前）

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
2025年05月01 日-2025年05 月08日	3.07%	0.79%	3.31%	0.82%	-0.24%	-0.03%
2025年03月01 日-2025年05 月08日	-4.68%	1.82%	-4.89%	1.84%	0.21%	-0.02%
2024年12月01 日-2025年05 月08日	1.33%	1.62%	0.91%	1.63%	0.42%	-0.01%
2024年06月01 日-2025年05 月08日	20.49%	2.03%	19.35%	2.05%	1.14%	-0.02%
2022年06月01 日-2025年05 月08日	3.24%	1.51%	-0.94%	1.53%	4.18%	-0.02%
2021年06月17 日-2025年05 月08日	-23.78%	1.51%	-24.00%	1.53%	0.22%	-0.02%

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

永赢深证创新100交易型开放式指数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图

(2021年06月17日-2025年05月08日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2025 年 06 月 30 日，本基金管理人共管理 155 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 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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 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、永赢添添欣 12 个月持有期混合型证券投资基金、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、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、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发起式联接基金、永赢腾利债券型证券投资基金、永赢红利慧选混合型发起式证券投资基金、永赢瑞弘 12 个月持有期债券型证券投资基金、永赢璟利债券型证券投资基金、永赢安裕 120 天滚动持有债券型证券投资基金、永赢悦享债券型证券投资基金、永赢上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、永赢启鑫混合型证券投资基金、永赢安怡 30 天持有期债券型证券投资基金、永赢安源 60 天滚动持有债券型证券投资基金、永赢逸享债券型证券投资基金、永赢融安混合型证券投资基金、永赢汇享债券型证券投资基金、永赢科技智选混合型发起式证券投资基金、永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、永赢安泽 6 个月持有期债券型证券投资基金、永赢睿恒混合型证券投资基金、永赢中证 A50 指数增强型发起式证券投资基金、永赢安和 30 天持有期债券型证券投资基金、永赢国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金、永赢锐见进取混合型证券投资基金、永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、永赢国证商用卫星通信产业交易型开放式指数证券投资基金、永赢国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、永赢多元增利债券型证券投资基金、永赢信息产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金、永赢北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、永赢价值发现慧选混合型发起式证券投资基金、永赢中证 A500 指数增强型证券投资基金、永赢上证科创板综合价格指数型证券投资基金、永赢制造升级智选混合型发起式证券投资基金、永赢上证科创板 50 成份指数型证券投资基金、永赢国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢上证科创板综合价格增强策略交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
刘庭宇	基金经理	2025 年 05 月 09 日	-	7 年	刘庭宇先生，上海财经大学金融硕士，7 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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
刘庭宇	基金经理	2023 年 08 月 14 日	2025 年 05 月 08 日	7 年	刘庭宇先生，上海财经大学金融硕士，7 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、《永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，分别于每季度和每年度对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，每季度对连续四个季度期间内、不同时间窗下不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

报告期内，本基金于 2025 年 05 月 09 日转型。转型后截至 2025 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 0.7818 元，本报告期份额净值增长率为 2.57%，同期业绩比较基准增长率为 1.69%。转型前截至 2025 年 05 月 08 日，本基金份额净值为 0.7622 元，本报告期份额净值增长率为-0.04%，同期业绩比较基准增长率为-0.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年，A 股整体呈震荡走势，期间，沪深 300 指数上涨 0.03%，中证 1000 上涨 6.69%，

深证 100 指数下跌 2.58%，整体来看小盘股强于大盘股、成长风格相比价值风格占优。一季度国内经济基本面呈现出企稳回升态势，市场风险偏好春节前后快速提升，市场呈现出典型的春季躁动行情，成交量能放大、交投活跃，四月初，A 股市场受新一轮美国关税政策冲击，避险情绪导致指数出现一定调整；随后，伴随着稳定市场、扩内需等一系列举措出台，央行降准降息，叠加中美关税问题缓和、长期资金入市步伐加快，市场流动性显著改善，投资者信心逐步恢复，推动市场触底回升，进入震荡上行阶段。深证 100 指数以“新质蓝筹，大盘成长”为特色，囊括深市最具代表性、市值大、流动性好的核心企业。行业层面，有色金属、银行、军工、传媒涨幅靠前，煤炭、食品饮料、房地产回调幅度靠前。

展望 2025 年下半年，市场交易主线将从预期过渡到基本面，市场对关税扰动逐渐脱敏，美国与各国逐渐达成贸易协定后全球市场风险偏好有望回升，随着美联储年内首次降息临近，美元和美债利率或将走弱并推动资金流入新兴市场，中国资产对全球投资者的配置吸引力仍然较强。下半年国内经济增长动能有望继续温和改善，产能周期、地产周期逐步企稳，新质生产力方向市场前景广阔、企业技术创新和场景应用加速落地，下半年市场驱动因素或主要来自企业盈利增长，同时上市公司对股东回报的重视度持续提升，因此对权益市场应保持积极乐观。现阶段小盘、成长风格可能仍占优，若经济复苏加速，则风格或切换到大盘、价值方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	483,113.68
结算备付金		372,773.27
存出保证金		326.61
交易性金融资产	6.4.7.2	81,570,237.49

其中：股票投资		81,570,237.49
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收清算款		2,323.59
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	75,616.38
资产总计		82,504,391.02
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		—
应付赎回款		—
应付管理人报酬		10,079.95
应付托管费		3,359.98
应付销售服务费		—
应付投资顾问费		—
应交税费		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.6	67,871.24
负债合计		81,311.17
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	105,431,696.00
未分配利润	6.4.7.8	-23,008,616.15
净资产合计		82,423,079.85
负债和净资产总计		82,504,391.02

注：1、报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7818 元，基金份额总额 105,431,696.00 份。

2、本基金由永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型而成，转型日为 2025 年 05 月 09 日。

6.2 利润表

会计主体：永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日） 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		2,168,430.41
1. 利息收入		359.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	359.15
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		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		719,459.31
其中：股票投资收益	6.4.7.10	18,090.16
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	701,369.15
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,448,611.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、营业总支出		60,512.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,083.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,027.69
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.19	36,401.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,107,918.35
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,107,918.35
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2,107,918.35

6.3 净资产变动表

会计主体：永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金
本报告期：2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	111,431,696.00	-26,494,618.82	84,937,077.18
二、本期期初净资产	111,431,696.00	-26,494,618.82	84,937,077.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,000,000.00	3,486,002.67	-2,513,997.33
（一）、综合收益总额	-	2,107,918.35	2,107,918.35
（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）	-6,000,000.00	1,378,084.32	-4,621,915.68
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	1,378,084.32	-4,621,915.68
（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	105,431,696.00	-23,008,616.15	82,423,079.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

芦特尔 虞俏依 曹婷
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）由永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型而来，永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资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[2021]1087 号《关于准予永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人永赢基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2021 年 6 月 17 日生效。首次设立募集规模为 387,431,696.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为永赢基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2025 年 5 月 9 日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效暨基金更名、复牌及恢复办理申购赎回业务的公告》，自 2025 年 5 月 9 日起，永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型并更名为永赢深证 100 交易

型开放式指数证券投资基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、企业债、公司债、次级债、地方政府债、金融债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。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：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除衍生品投资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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以对该比例做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：深证 100 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 5 月 9 日（基金合同转型日）起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 5 月 9 日（基金合同转型日）起至 2025 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）占基金净资产比例计算的金额。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）占基金净资产比例计算的金额。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）”。

6.4.4.9 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) 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金的收益分配方式为现金分红；

2、基金管理人可每月对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，收益评价日核定的基金份额净值增长率超过业绩比较基准同期增长率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配；

3、当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本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、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每月进行收益分配。评价时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，

经履行适当程序，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，但应于变更实施日前在规定媒介上公告。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；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。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,

自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自 2008 年 10 月 9 日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自 2013 年 1 月 1 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自 2015 年 9 月 8 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	483,113.68
等于: 本金	483,073.08
加: 应计利息	40.60
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	483,113.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		80,422,347.93	-	81,570,237.49	1,147,889.56
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		80,422,347.93	-	81,570,237.49	1,147,889.56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.38
合计	75,616.38

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	18,282.67
其中：交易所市场	18,282.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,588.57
合计	67,871.24

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 05 月 09 日(基金合同生效日) 至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	111,431,696.00	111,431,696.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-6,000,000.00	-6,000,000.00
本期末	105,431,696.00	105,431,696.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-26,501,912.87	7,294.05	-26,494,618.82
本期利润	659,306.40	1,448,611.95	2,107,918.35
本期基金份额交易产生的变动数	1,407,195.11	-29,110.79	1,378,084.32
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	1,407,195.11	-29,110.79	1,378,084.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,435,411.36	1,426,795.21	-23,008,616.15

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 05 月 09 日(基金合同生效日)至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	281.99
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	77.21
其他	-0.05
合计	359.15

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
股票投资收益--买卖股票差价收入	1,744.76
股票投资收益--赎回差价收入	16,345.40
股票投资收益--申购差价收入	-
股票投资收益--证券出借差价收入	-
合计	18,090.16

6.4.7.10.2 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,520,165.96
减：卖出股票成本总额	1,516,825.78
减：交易费用	1,595.42
买卖股票差价收入	1,744.76

6.4.7.10.3 股票投资收益--赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	4,621,915.68
减：现金支付赎回款总额	-30,656.32
减：赎回股票成本总额	4,636,226.60
减：交易费用	-
赎回差价收入	16,345.40

6.4.7.10.4 股票投资收益--证券出借差价收入

本基金本报告期无股票投资收益--证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 05 月 09 日(基金合同生效日)至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	701,369.15
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	701,369.15

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 05 月 09 日(基金合同生效日)至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,448,611.95
--股票投资	1,448,611.95
--债券投资	—
--资产支持证券投资	—
--贵金属投资	—
--其他	—
2. 衍生工具	—
--权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	1,448,611.95

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 05 月 09 日(基金合同生效日)至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	2,903.87
信息披露费	11,616.54
证券出借违约金	-
汇划手续费	100.00
其他	21,780.88
合计	36,401.29

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,083.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	770.65
应支付基金管理人的净管理费	17,312.43

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,027.69

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 06 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
永赢资产	50,773,000.00	48.1572%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2025 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	483,113.68	281.99

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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宁波银行发行的股票。于本报告期末，本基金持有的基金管理人股东发行的股票宁波银行（002142.SZ）43,300.00 股，期末公允价值为人民币 1,184,688.00 元，占基金净值比例为 1.44%。本基金合同转型日为 2025 年 05 月 09 日，无上年度末可比数据。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 2025 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	1 个月内(含)	认购新发证券	16.42	16.42	383	6,288.86	6,288.86	—
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	6 个月	新股限售	16.42	16.42	43	706.06	706.06	—
301678	新恒汇	2025 年 06 月 13 日	6 个月	新股限售	12.80	44.54	119	1,523.20	5,300.26	—
301662	宏工科技	2025 年 04 月 10 日	6 个月	新股限售	26.60	82.50	39	1,037.40	3,217.50	—
301665	泰禾股份	2025 年 04 月 02 日	6 个月	新股限售	10.27	22.39	112	1,150.24	2,507.68	—
301560	众捷汽车	2025 年 04 月 17 日	6 个月	新股限售	16.50	27.45	85	1,402.50	2,333.25	—
001335	信凯科技	2025 年 04 月 02 日	6 个月	新股限售	12.80	28.05	35	448.00	981.75	—

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出

现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末，本基金未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末，本基金未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末，本基金未持有长期债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末，本基金未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末，本基金未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

性风险进行管理。

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	483,113.68	-	-	-	-	-	483,113.68
结算备付金	372,773.27	-	-	-	-	-	372,773.27

存出保证金	326.61	-	-	-	-	-	326.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-	81,570,237.49	81,570,237.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,323.59	2,323.59
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	75,616.38	75,616.38
资产总计	856,213.56	-	-	-	-	81,648,177.46	82,504,391.02
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	-	-	-	-	-	10,079.95	10,079.95
应付托管费	-	-	-	-	-	3,359.98	3,359.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	67,871.24	67,871.24
负债总计	-	-	-	-	-	81,311.17	81,311.17
利率敏感度缺口	856,213.56	-	-	-	-	81,566,866.29	82,423,079.85

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有债券，无重大利率风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	81,570,237.49	98.97
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	81,570,237.49	98.97

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险 2. 以下分析,除业绩比较基准发生变动,其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） 本期末（2025 年 06 月 30 日）
	业绩比较基准增加 1%	940,146.78
	业绩比较基准减少 1%	-940,146.78

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 06 月 30 日
---------------	-------------------------

第一层次	81,548,902.13
第二层次	6,994.92
第三层次	14,340.44
合计	81,570,237.49

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 08 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 6 半年度财务会计报表（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日：2025 年 05 月 08 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 05 月 08 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	448,330.52	567,724.23
结算备付金		10,191.12	7,544.26
存出保证金		471.65	1,052.81
交易性金融资产	6.4.7.2	84,431,925.00	47,899,652.37
其中：股票投资		84,431,925.00	47,899,652.37
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收清算款		102,517.07	—
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		84,993,435.36	48,475,973.67
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 05 月 08 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		—	9.83
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		2,721.36	7,127.15
应付托管费		907.11	2,375.71
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.6	52,729.71	102,103.13
负债合计		56,358.18	111,615.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	111,431,696.00	63,431,696.00
未分配利润	6.4.7.8	-26,494,618.82	-15,067,338.15
净资产合计		84,937,077.18	48,364,357.85
负债和净资产总计		84,993,435.36	48,475,973.67

注：1、报告截止日 2025 年 05 月 08 日，基金份额净值 0.7622 元，基金份额总额 111,431,696.00

份。

2、本期财务报表的实际编制区间系 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日止。

6.2 利润表

会计主体：永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-1,965,373.51	-518,020.33
1. 利息收入		710.42	1,136.61
其中：存款利息收入	6.4.7.9	710.42	1,136.61
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		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,026,539.37	-3,705,131.17
其中：股票投资收益	6.4.7.10	696,198.23	-4,606,936.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	330,341.14	901,805.45
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,998,253.00	3,181,853.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,629.70	4,120.27
减：二、营业总支出		79,656.51	106,952.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,283.79	42,717.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,094.56	14,239.12
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	35,278.16	49,996.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,045,030.02	-624,972.78
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,045,030.02	-624,972.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,045,030.02	-624,972.78

6.3 净资产变动表

会计主体：永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金
本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	63,431,696.00	-15,067,338.15	48,364,357.85
二、本期期初净资产	63,431,696.00	-15,067,338.15	48,364,357.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	48,000,000.00	-11,427,280.67	36,572,719.33
（一）、综合收益总额	-	-2,045,030.02	-2,045,030.02
（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）	48,000,000.00	-9,382,250.65	38,617,749.35
其中：1. 基金申购款	58,000,000.00	-11,392,194.60	46,607,805.40
2. 基金赎回款	-10,000,000.00	2,009,943.95	-7,990,056.05
（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	111,431,696.00	-26,494,618.82	84,937,077.18
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	95,431,696.00	-35,374,631.17	60,057,064.83
二、本期期初净资产	95,431,696.00	-35,374,631.17	60,057,064.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,000,000.00	2,021,802.17	-5,978,197.83
（一）、综合收益总额	-	-624,972.78	-624,972.78
（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）	-8,000,000.00	2,646,774.95	-5,353,225.05
其中：1. 基金申购款	8,000,000.00	-3,194,052.73	4,805,947.27
2. 基金赎回款	-16,000,000.00	5,840,827.68	-10,159,172.32
（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	87,431,696.00	-33,352,829.00	54,078,867.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>芦特尔</u>	<u>虞俏依</u>	<u>曹婷</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]1087 号《关于准予永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人永赢基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2021 年 6 月 17 日生效。首次设立募集规模为 387,431,696.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为永赢基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2025 年 5 月 9 日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效暨基金更名、复牌及恢复办理申购赎回业务的公告》，自 2025 年 5 月 9 日起，永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型并更名为永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务以及转融通证券出借业务。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：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以

调整上述比例。

本基金的业绩比较基准为：深证创新 100 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

根据《永赢基金管理有限公司关于永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效暨基金更名、复牌及恢复办理申购赎回业务的公告》，本基金自 2025 年 5 月 9 日转型并更名为永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金继续运作。故本财务报表仍以持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 5 月 8 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 5 月 8 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；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。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 05 月 08 日
----	-------------------------

活期存款	448,330.52
等于：本金	448,058.37
加：应计利息	272.15
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	448,330.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 05 月 08 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	84,732,647.39	-	84,431,925.00	-300,722.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	84,732,647.39	-	84,431,925.00	-300,722.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 05 月 08 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	17,661.55
其中：交易所市场	17,661.55
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	35,068.16
合计	52,729.71

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,431,696.00	63,431,696.00
本期申购	58,000,000.00	58,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-10,000,000.00	-10,000,000.00
本期末	111,431,696.00	111,431,696.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,942,310.53	874,972.38	-15,067,338.15
本期期初	-15,942,310.53	874,972.38	-15,067,338.15
本期利润	953,222.98	-2,998,253.00	-2,045,030.02
本期基金份额交易产生的变动数	-11,512,825.32	2,130,574.67	-9,382,250.65
其中：基金申购款	-13,976,327.62	2,584,133.02	-11,392,194.60
基金赎回款	2,463,502.30	-453,558.35	2,009,943.95
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-26,501,912.87	7,294.05	-26,494,618.82

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日
活期存款利息收入	695.12
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	14.22
其他	1.08
合计	710.42

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日
股票投资收益--买卖股票差价收入	-28,799.07
股票投资收益--赎回差价收入	724,997.30
股票投资收益--申购差价收入	-
股票投资收益--证券出借差价收入	-
合计	696,198.23

6.4.7.10.2 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日
卖出股票成交总额	48,811,251.70
减：卖出股票成本总额	48,791,180.17
减：交易费用	48,870.60
买卖股票差价收入	-28,799.07

6.4.7.10.3 股票投资收益--赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日
赎回基金份额对价总额	7,990,056.05
减：现金支付赎回款总额	1,289.05
减：赎回股票成本总额	7,263,769.70
减：交易费用	-
赎回差价收入	724,997.30

6.4.7.10.4 股票投资收益--证券出借差价收入

本基金本报告期无股票投资收益--证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日
股票投资产生的股利收益	330,341.14
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	330,341.14

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日
1. 交易性金融资产	-2,998,253.00
--股票投资	-2,998,253.00
--债券投资	-
--资产支持证券投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-
--权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,998,253.00

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日
基金赎回费收入	-
ETF 基金替代损益	5,629.70
合计	5,629.70

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日
审计费用	7,013.12
信息披露费	28,055.04
证券出借违约金	-
汇划手续费	210.00
合计	35,278.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	33,283.79	42,717.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	640.97	-
应支付基金管理人的净管理费	32,642.82	42,717.29

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,094.56	14,239.12

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 05 月 08 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份额 的比例
永赢资产	50,773,000.00	45.5642%	-	-

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 05 月 08 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	448,330.52	695.12	683,744.26	1,105.57

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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宁波银行发行的股票。于本报告期末，本基金持有的基金管理人股东发行的股票宁波银行（002142.SZ）45,800.00 股，期末公允价值为人民币 1,143,626.00 元，占基金净值比例为 1.35%。于上年度末，本基金未持有基金管理人股东发行的股票宁波银行（002142.SZ）

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 2025 年 05 月 08 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股限售	22.36	67.84	84	1,878.24	5,698.56	
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股限售	23.95	43.22	69	1,652.55	2,982.18	
301560	众捷汽车	2025 年 04 月 17 日	6 个月	新股限售	16.50	32.60	85	1,402.50	2,771.00	
301617	博苑股份	2024 年 12 月 03 日	6 个月	新股限售	27.76	46.07	60	1,665.60	2,764.20	
301631	壹连科	2024 年	6 个月	新股限	72.99	111.46	24	1,751.7	2,675.0	

	技	11 月 12 日		售				6	4	
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股限售	2.30	6.72	347	798.10	2,331.84	
301665	泰禾股份	2025 年 04 月 02 日	6 个月	新股限售	10.27	20.78	112	1,150.24	2,327.36	
301662	宏工科技	2025 年 04 月 10 日	6 个月	新股限售	26.60	41.57	39	1,037.40	1,621.23	
001335	信凯科技	2025 年 04 月 02 日	6 个月	新股限售	12.80	28.40	35	448.00	994.00	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 05 月 08 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 05 月 08 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体系。五道防线分别为员工自律及业务部门的自控和互控的第一道防线，合规风控部门监督管理的第

二道防线，审计部事后检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险控制监督管理的第五道防线。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 05 月 08 日	1 个月内	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	448,330.52	-	-	-	-	-	448,330.52
结算备付金	10,191.12	-	-	-	-	-	10,191.12
存出保证金	471.65	-	-	-	-	-	471.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	84,431,925.00	84,431,925.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	102,517.07	102,517.07
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	458,993.29	-	-	-	-	84,534,442.07	84,993,435.36
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	-	-	-	-	-	2,721.36	2,721.36
应付托管费	-	-	-	-	-	907.11	907.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	52,729.71	52,729.71
负债总计	-	-	-	-	-	56,358.18	56,358.18
利率敏感度缺口	458,993.29	-	-	-	-	84,478,083.89	84,937,077.18
上年度末 2024 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	567,724.23	-	-	-	-	-	567,724.23
结算备付金	7,544.26	-	-	-	-	-	7,544.26
存出保证金	1,052.81	-	-	-	-	-	1,052.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	47,899,652.37	47,899,652.37
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	576,321.30	-	-	-	-	47,899,652.37	48,475,973.67
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	-	-	-	-	-	9.83	9.83
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,127.15	7,127.15
应付托管费	-	-	-	-	-	2,375.71	2,375.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	102,103.13	102,103.13
负债总计	-	-	-	-	-	111,615.82	111,615.82
利率敏感度缺口	576,321.30	-	-	-	-	47,788,036.55	48,364,357.85

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债券，无重大利率风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 05 月 08 日		上年度末 2024 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	84,431,925.00	99.41	47,899,652.37	99.04
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	84,431,925.00	99.41	47,899,652.37	99.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2025 年 05 月 08 日)	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 1%	842,925.90	479,125.49
	业绩比较基准减少 1%	-842,925.90	-479,125.49

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 05 月 08 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	84,407,759.59	47,886,211.40
第二层次	-	-
第三层次	24,165.41	13,440.97
合计	84,431,925.00	47,899,652.37

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 08 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告（转型后）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	81,570,237.49	98.87
	其中：股票	81,570,237.49	98.87
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	855,886.95	1.04
8	其他各项资产	78,266.58	0.09
9	合计	82,504,391.02	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,482,909.00	3.01
B	采矿业	612,624.00	0.74
C	制造业	61,893,864.13	75.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	350,172.00	0.42
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	387,456.00	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	1,712,860.00	2.08
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,298,470.00	2.79
J	金融业	8,612,064.00	10.45
K	房地产业	925,441.00	1.12
L	租赁和商务服务业	933,670.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	651,724.00	0.79
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	687,648.00	0.83

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	81,548,902.13	98.94

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	20,353.61	0.02
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	981.75	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,335.36	0.03

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	32,600	8,222,372.00	9.98
2	000333	美的集团	62,400	4,505,280.00	5.47
3	300059	东方财富	158,400	3,663,792.00	4.45

4	002594	比亚迪	10,800	3,584,628.00	4.35
5	000858	五粮液	23,000	2,734,700.00	3.32
6	000651	格力电器	55,000	2,470,600.00	3.00
7	002475	立讯精密	59,100	2,050,179.00	2.49
8	000725	京东方 A	419,100	1,672,209.00	2.03
9	300124	汇川技术	25,100	1,620,707.00	1.97
10	300308	中际旭创	10,980	1,601,542.80	1.94
11	002371	北方华创	3,600	1,591,956.00	1.93
12	300760	迈瑞医疗	6,900	1,550,775.00	1.88
13	300502	新易盛	11,080	1,407,381.60	1.71
14	002352	顺丰控股	28,000	1,365,280.00	1.66
15	002714	牧原股份	31,700	1,331,717.00	1.62
16	002415	海康威视	47,720	1,323,275.60	1.61
17	000063	中兴通讯	40,300	1,309,347.00	1.59
18	000001	平安银行	107,100	1,292,697.00	1.57
19	300274	阳光电源	18,520	1,255,100.40	1.52
20	002142	宁波银行	43,300	1,184,688.00	1.44
21	002230	科大讯飞	24,500	1,173,060.00	1.42
22	300498	温氏股份	67,400	1,151,192.00	1.40
23	000568	泸州老窖	9,500	1,077,300.00	1.31
24	000100	TCL 科技	229,900	995,467.00	1.21
25	000338	潍柴动力	64,400	990,472.00	1.20
26	002027	分众传媒	127,900	933,670.00	1.13
27	000425	徐工机械	105,200	817,404.00	0.99
28	000792	盐湖股份	45,200	772,016.00	0.94
29	300014	亿纬锂能	16,000	732,960.00	0.89
30	002463	沪电股份	17,000	723,860.00	0.88
31	002241	歌尔股份	30,900	720,588.00	0.87
32	300033	同花顺	2,600	709,826.00	0.86
33	002050	三花智控	26,700	704,346.00	0.85
34	000625	长安汽车	54,900	700,524.00	0.85
35	300015	爱尔眼科	55,100	687,648.00	0.83
36	000977	浪潮信息	13,100	666,528.00	0.81
37	000776	广发证券	35,700	600,117.00	0.73
38	002179	中航光电	14,483	584,533.88	0.71
39	002311	海大集团	9,900	580,041.00	0.70
40	000938	紫光股份	22,900	549,371.00	0.67
41	300433	蓝思科技	24,600	548,580.00	0.67
42	000002	万科 A	85,000	545,700.00	0.66
43	002049	紫光国微	8,240	542,686.40	0.66
44	300408	三环集团	15,900	531,060.00	0.64

45	000538	云南白药	9,500	530,005.00	0.64
46	002028	思源电气	7,200	524,952.00	0.64
47	002422	科伦药业	14,600	524,432.00	0.64
48	000166	申万宏源	103,500	519,570.00	0.63
49	002304	洋河股份	7,600	490,580.00	0.60
50	002460	赣锋锂业	14,200	479,534.00	0.58
51	000768	中航西飞	16,500	451,110.00	0.55
52	000157	中联重科	61,800	446,814.00	0.54
53	300394	天孚通信	5,500	439,120.00	0.53
54	002252	上海莱士	62,000	425,940.00	0.52
55	002001	新和成	19,700	419,019.00	0.51
56	002466	天齐锂业	13,000	416,520.00	0.51
57	000975	山金国际	21,600	409,104.00	0.50
58	002736	国信证券	34,700	399,744.00	0.48
59	000963	华东医药	9,600	387,456.00	0.47
60	002236	大华股份	24,100	382,708.00	0.46
61	001979	招商蛇口	43,300	379,741.00	0.46
62	002648	卫星化学	21,900	379,527.00	0.46
63	000661	长春高新	3,800	376,884.00	0.46
64	300661	圣邦股份	5,115	372,218.55	0.45
65	300418	昆仑万维	10,800	363,204.00	0.44
66	300347	泰格医药	6,700	357,244.00	0.43
67	002920	德赛西威	3,400	347,242.00	0.42
68	002916	深南电路	3,150	339,601.50	0.41
69	000895	双汇发展	13,500	329,535.00	0.40
70	003816	中国广核	88,200	321,048.00	0.39
71	302132	中航成飞	3,600	316,584.00	0.38
72	002601	龙佰集团	19,400	314,474.00	0.38
73	002600	领益智造	35,800	307,522.00	0.37
74	300442	润泽科技	6,200	307,086.00	0.37
75	300782	卓胜微	4,300	306,891.00	0.37
76	000786	北新建材	11,400	301,872.00	0.37
77	002493	荣盛石化	36,400	301,392.00	0.37
78	300896	爱美客	1,700	297,177.00	0.36
79	300759	康龙化成	12,000	294,480.00	0.36
80	001965	招商公路	24,000	288,000.00	0.35
81	301269	华大九天	2,300	284,924.00	0.35
82	300122	智飞生物	14,300	280,137.00	0.34
83	002938	鹏鼎控股	8,300	265,849.00	0.32
84	000876	新希望	26,800	251,384.00	0.30
85	000999	华润三九	8,020	250,865.60	0.30

86	000301	东方盛虹	29,300	244,069.00	0.30
87	000617	中油资本	33,100	241,630.00	0.29
88	000596	古井贡酒	1,800	239,670.00	0.29
89	300832	新产业	4,200	238,224.00	0.29
90	002459	晶澳科技	22,800	227,544.00	0.28
91	300316	晶盛机电	7,800	211,770.00	0.26
92	300999	金龙鱼	7,100	209,663.00	0.25
93	300628	亿联网络	5,980	207,864.80	0.25
94	000983	山西焦煤	31,800	203,520.00	0.25
95	300413	芒果超媒	7,800	170,196.00	0.21
96	000708	中信特钢	10,700	125,832.00	0.15
97	300979	华利集团	1,900	99,883.00	0.12
98	000877	天山股份	17,600	81,664.00	0.10
99	001872	招商港口	3,000	59,580.00	0.07
100	001289	龙源电力	1,800	29,124.00	0.04

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

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	001388	信通电子	426	6,994.92	0.01
2	301678	新恒汇	119	5,300.26	0.01
3	301662	宏工科技	39	3,217.50	0.00
4	301665	泰禾股份	112	2,507.68	0.00
5	301560	众捷汽车	85	2,333.25	0.00
6	001335	信凯科技	35	981.75	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002600	领益智造	304,137.00	0.37
2	302132	中航成飞	294,853.00	0.36
3	300442	润泽科技	277,151.00	0.34
4	300124	汇川技术	96,048.00	0.12
5	002230	科大讯飞	52,154.00	0.06
6	300033	同花顺	50,445.00	0.06
7	300750	宁德时代	48,907.00	0.06
8	002371	北方华创	41,667.00	0.05
9	000333	美的集团	35,838.00	0.04
10	002594	比亚迪	34,295.00	0.04

11	002920	德赛西威	29,199.00	0.04
12	000157	中联重科	28,520.00	0.03
13	300760	迈瑞医疗	24,032.00	0.03
14	002252	上海莱士	22,756.00	0.03
15	000938	紫光股份	21,108.00	0.03
16	002050	三花智控	20,312.00	0.02
17	300059	东方财富	19,447.00	0.02
18	300274	阳光电源	18,815.00	0.02
19	000651	格力电器	17,816.00	0.02
20	301678	新恒汇	15,232.00	0.02

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002180	纳思达	279,144.00	0.34
2	002129	TCL 中环	277,885.00	0.34
3	002709	天赐材料	261,683.00	0.32
4	300750	宁德时代	49,806.00	0.06
5	301678	新恒汇	49,336.00	0.06
6	000166	申万宏源	45,402.00	0.06
7	000792	盐湖股份	38,640.00	0.05
8	002594	比亚迪	34,700.00	0.04
9	300498	温氏股份	28,128.00	0.03
10	000858	五粮液	23,922.00	0.03
11	300760	迈瑞医疗	23,231.00	0.03
12	000651	格力电器	22,350.00	0.03
13	000301	东方盛虹	20,600.00	0.02
14	000725	京东方 A	19,500.00	0.02
15	300059	东方财富	19,233.00	0.02
16	300896	爱美客	17,378.00	0.02
17	002352	顺丰控股	14,634.00	0.02
18	000596	古井贡酒	13,432.00	0.02
19	002241	歌尔股份	13,314.00	0.02
20	002714	牧原股份	13,029.00	0.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,842,752.92
卖出股票收入（成交）总额	1,520,165.96

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	326.61
2	应收清算款	2,323.59
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	75,616.38
8	其他	—
9	合计	78,266.58

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	001388	信通电子	6,994.92	0.01	认购新发证券
2	301678	新恒汇	5,300.26	0.01	新股限售
3	301662	宏工科技	3,217.50	0.00	新股限售
4	301665	泰禾股份	2,507.68	0.00	新股限售
5	301560	众捷汽车	2,333.25	0.00	新股限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	84,431,925.00	99.34

	其中：股票	84,431,925.00	99.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	458,521.64	0.54
8	其他各项资产	102,988.72	0.12
9	合计	84,993,435.36	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,023,891.59	42.41
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,201,674.00	1.41
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,225,565.59	43.83

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末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	2,562,795.00	3.02
B	采矿业	677,469.00	0.80
C	制造业	28,783,104.57	33.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	366,262.00	0.43
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	399,100.00	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	1,678,978.84	1.98
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	846,893.00	1.00
J	金融业	8,475,680.00	9.98
K	房地产业	1,041,940.00	1.23
L	租赁和商务服务业	998,514.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	618,143.00	0.73
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	757,480.00	0.89
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	47,206,359.41	55.58

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	34,400	8,413,208.00	9.91
2	000333	美的集团	65,600	4,920,000.00	5.79
3	002594	比亚迪	11,400	4,095,792.00	4.82
4	300124	汇川技术	25,100	1,772,311.00	2.09
5	002371	北方华创	3,800	1,705,782.00	2.01
6	300760	迈瑞医疗	7,200	1,626,120.00	1.91
7	002415	海康威视	50,520	1,461,038.40	1.72
8	000063	中兴通讯	42,700	1,411,662.00	1.66

9	300274	阳光电源	19,320	1,235,514.00	1.45
10	002230	科大讯飞	24,900	1,201,674.00	1.41
11	300308	中际旭创	11,480	1,107,705.20	1.30
12	000338	潍柴动力	67,700	1,015,500.00	1.20
13	002050	三花智控	27,400	741,170.00	0.87
14	002241	歌尔股份	33,100	737,137.00	0.87
15	000977	浪潮信息	13,800	720,774.00	0.85
16	002179	中航光电	15,083	637,709.24	0.75
17	300408	三环集团	16,800	584,472.00	0.69
18	002049	紫光国微	8,740	578,413.20	0.68
19	300433	蓝思科技	26,000	560,040.00	0.66
20	002028	思源电气	7,600	541,880.00	0.64
21	300661	圣邦股份	4,135	411,225.75	0.48
22	002236	大华股份	25,400	407,416.00	0.48
23	002920	德赛西威	3,400	363,018.00	0.43
24	002916	深南电路	2,500	298,125.00	0.35
25	300316	晶盛机电	8,200	237,554.00	0.28
26	300832	新产业	4,300	224,890.00	0.26
27	300628	亿联网络	6,180	215,434.80	0.25

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

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	300059	东方财富	167,400	3,552,228.00	4.18
2	000858	五粮液	24,300	3,202,740.00	3.77
3	000651	格力电器	58,400	2,716,768.00	3.20
4	002475	立讯精密	62,500	2,046,250.00	2.41
5	000725	京东方 A	446,000	1,730,480.00	2.04
6	002714	牧原股份	33,600	1,333,920.00	1.57
7	002352	顺丰控股	29,600	1,288,488.00	1.52
8	000568	泸州老窖	10,000	1,271,800.00	1.50
9	000001	平安银行	113,500	1,257,580.00	1.48
10	300498	温氏股份	72,500	1,228,875.00	1.45
11	002142	宁波银行	45,800	1,143,626.00	1.35
12	000100	TCL 科技	243,400	1,036,884.00	1.22
13	002027	分众传媒	135,300	998,514.00	1.18
14	000425	徐工机械	111,700	993,013.00	1.17
15	300502	新易盛	8,400	906,780.00	1.07
16	000792	盐湖股份	49,900	801,893.00	0.94
17	300015	爱尔眼科	58,000	757,480.00	0.89

18	300014	亿纬锂能	16,900	733,629.00	0.86
19	300033	同花顺	2,700	720,036.00	0.85
20	000625	长安汽车	57,500	715,300.00	0.84
21	000002	万科 A	90,000	619,200.00	0.73
22	000776	广发证券	37,700	599,430.00	0.71
23	000938	紫光股份	23,300	599,276.00	0.71
24	000538	云南白药	10,000	570,500.00	0.67
25	000166	申万宏源	118,300	565,474.00	0.67
26	002463	沪电股份	18,000	565,200.00	0.67
27	002311	海大集团	10,500	564,165.00	0.66
28	002304	洋河股份	8,000	553,360.00	0.65
29	002422	科伦药业	15,500	527,310.00	0.62
30	000157	中联重科	61,100	464,360.00	0.55
31	000975	山金国际	22,800	460,104.00	0.54
32	002460	赣锋锂业	14,800	458,504.00	0.54
33	002001	新和成	20,400	453,492.00	0.53
34	000768	中航西飞	17,400	432,738.00	0.51
35	002648	卫星化学	23,200	425,952.00	0.50
36	001979	招商蛇口	46,000	422,740.00	0.50
37	002252	上海莱士	62,000	422,220.00	0.50
38	002466	天齐锂业	13,800	405,720.00	0.48
39	002736	国信证券	36,700	400,030.00	0.47
40	000963	华东医药	10,200	398,106.00	0.47
41	000661	长春高新	4,100	380,316.00	0.45
42	300418	昆仑万维	11,100	364,857.00	0.43
43	000786	北新建材	12,200	358,192.00	0.42
44	000895	双汇发展	14,300	353,496.00	0.42
45	002601	龙佰集团	20,600	347,110.00	0.41
46	300782	卓胜微	4,500	342,450.00	0.40
47	003816	中国广核	93,600	334,152.00	0.39
48	002493	荣盛石化	38,200	328,902.00	0.39
49	001965	招商公路	25,400	328,422.00	0.39
50	300347	泰格医药	7,100	326,387.00	0.38
51	000596	古井贡酒	1,900	314,925.00	0.37
52	300394	天孚通信	4,100	313,322.00	0.37
53	002129	TCL 中环	39,400	309,684.00	0.36
54	300896	爱美客	1,800	308,412.00	0.36
55	000301	东方盛虹	33,300	300,366.00	0.35
56	300122	智飞生物	15,200	297,312.00	0.35
57	002180	纳思达	13,300	297,255.00	0.35
58	300759	康龙化成	12,300	291,756.00	0.34

59	002709	天赐材料	16,000	286,560.00	0.34
60	301269	华大九天	2,400	286,488.00	0.34
61	000876	新希望	28,400	277,184.00	0.33
62	000999	华润三九	6,500	271,505.00	0.32
63	002938	鹏鼎控股	8,700	262,653.00	0.31
64	002459	晶澳科技	24,100	241,241.00	0.28
65	300999	金龙鱼	7,500	237,750.00	0.28
66	000617	中油资本	33,800	237,276.00	0.28
67	000983	山西焦煤	33,700	217,365.00	0.26
68	300413	芒果超媒	8,300	195,548.00	0.23
69	000708	中信特钢	11,300	134,922.00	0.16
70	300979	华利集团	2,000	107,560.00	0.13
71	000877	天山股份	18,600	92,814.00	0.11
72	001872	招商港口	3,100	59,737.00	0.07
73	001289	龙源电力	1,900	32,110.00	0.04
74	301622	英思特	84	5,698.56	0.01
75	301585	蓝宇股份	69	2,982.18	0.00
76	301560	众捷汽车	85	2,771.00	0.00
77	301617	博苑股份	60	2,764.20	0.00
78	301631	壹连科技	24	2,675.04	0.00
79	001391	国货航	347	2,331.84	0.00
80	301665	泰禾股份	112	2,327.36	0.00
81	301662	宏工科技	39	1,621.23	0.00
82	001335	信凯科技	35	994.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	3,564,735.00	7.37
2	000858	五粮液	3,213,272.00	6.64
3	000651	格力电器	2,716,856.00	5.62
4	002475	立讯精密	2,045,900.00	4.23
5	000725	京东方 A	1,734,316.00	3.59
6	002714	牧原股份	1,337,292.00	2.77
7	002352	顺丰控股	1,295,429.00	2.68
8	000568	泸州老窖	1,273,475.00	2.63
9	000001	平安银行	1,256,129.00	2.60
10	300498	温氏股份	1,230,694.00	2.54
11	002142	宁波银行	1,142,398.00	2.36

12	000100	TCL 科技	1,041,239.00	2.15
13	002027	分众传媒	1,004,306.00	2.08
14	000425	徐工机械	997,144.00	2.06
15	300502	新易盛	864,917.00	1.79
16	000792	盐湖股份	802,746.00	1.66
17	300015	爱尔眼科	761,956.00	1.58
18	300014	亿纬锂能	734,142.00	1.52
19	300033	同花顺	721,722.00	1.49
20	000625	长安汽车	716,705.00	1.48

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	3,996,811.00	8.26
2	002594	比亚迪	3,578,156.00	7.40
3	300750	宁德时代	3,548,981.00	7.34
4	002625	光启技术	1,439,944.00	2.98
5	300124	汇川技术	1,426,525.00	2.95
6	002371	北方华创	1,347,372.00	2.79
7	300760	迈瑞医疗	1,306,123.00	2.70
8	002415	海康威视	1,180,422.00	2.44
9	000063	中兴通讯	1,142,668.00	2.36
10	300274	阳光电源	994,259.20	2.06
11	002230	科大讯飞	969,393.00	2.00
12	300308	中际旭创	962,632.00	1.99
13	002456	欧菲光	832,868.00	1.72
14	000338	潍柴动力	820,206.00	1.70
15	000066	中国长城	739,365.00	1.53
16	002156	通富微电	704,648.00	1.46
17	300207	欣旺达	652,287.00	1.35
18	002241	歌尔股份	608,701.00	1.26
19	002050	三花智控	600,982.00	1.24
20	002850	科达利	599,401.00	1.24

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	49,083,258.50
卖出股票收入（成交）总额	48,811,251.70

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	471.65
2	应收清算款	102,517.07
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	102,988.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,487	70,902.28	55,991,487.00	53.1069%	49,440,209.00	46.8931%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	永赢资产管理有限公司	50,773,000.00	48.16%

2	陈君	5,000,097.00	4.74%
3	孟永良	4,887,477.00	4.64%
4	中信建投证券股份有限公司	2,054,471.00	1.95%
5	朱春林	1,850,077.00	1.75%
6	中信证券股份有限公司	1,577,115.00	1.50%
7	方正证券股份有限公司	1,336,400.00	1.27%
8	王涛	1,000,019.00	0.95%
9	郭文增	700,000.00	0.66%
10	王丽君	633,100.00	0.60%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,510	73,795.83	60,922,775.00	54.6728%	50,508,921.00	45.3272%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	永赢资产管理有限公司	50,773,000.00	45.56%
2	中信建投证券股份有限公司	5,132,959.00	4.61%
3	陈君	5,000,097.00	4.49%
4	孟永良	4,887,477.00	4.39%
5	中信证券股份有限公司	2,506,015.00	2.25%

6	方正证券股份有限公司	2,205,300.00	1.98%
7	朱春林	1,850,077.00	1.66%
8	王涛	1,000,019.00	0.90%
9	郭文增	680,000.00	0.61%
10	王丽君	633,100.00	0.57%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2025 年 05 月 09 日）基金份额总额	111,431,696.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	6,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	105,431,696.00

§ 9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2021 年 06 月 17 日）基金份额总额	387,431,696.00
本报告期初基金份额总额	63,431,696.00
本报告期基金总申购份额	58,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	111,431,696.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票起止时间为自 2025 年 3 月 17 日起，至 2025 年 4 月 16 日 17:00 止。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次基金份额持有人大会于 2025 年 4 月 17 日表决通过了《关于永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效并实施。根据本次持有人大会决议，基金管理人于 2025 年 4 月 25 日发布了《永赢基金管理有限公司关于永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的公告》，自 2025 年 5 月 9 日起，本基金变更为永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经永赢基金管理有限公司董事会审议通过，李永兴先生不再担任公司副总经理职务。本基金管理人已于 2025 年 1 月 25 日在规定信息披露媒介登载了高级管理人员变更公告。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金自 2025 年 5 月 9 日起由永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金转型为永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金。永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的投资策略请详见 2025 年 5 月 9 日刊登在本公司网站的《永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券	2	—	—	—	—	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	2	3,340,691.96	100.00%	621.12	100.00%	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源证券	2	—	—	—	—	—
五矿证券	2	—	—	—	—	—
浙商证券	3	—	—	—	—	新增
中金公司	2	—	—	—	—	—
中信建投证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—

注：1、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。

2、基金交易单元的选择程序如下：(1) 本基金管理人根据证券公司选择标准进行评估并确定选用的证券公司。(2) 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

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

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

10.8.1 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	
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	97,854,320.10	100.00%	18,191.52	100.00%	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-

浙商证券	2	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-

注：1、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。

2、基金交易单元的选择程序如下：(1) 本基金管理人根据证券公司选择标准进行评估并确定选用的证券公司。(2) 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.8.2 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		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 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
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件（转型后）

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永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效暨基金更名、复牌及恢复办理申购	中国证监会规定媒介	2025年05月09日

	赎回业务的公告		
2	永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2025年05月09日
3	永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025年05月09日
4	永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025年05月09日
5	永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025年05月09日
6	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2025年05月20日

10.10 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2025年01月21日
2	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025年01月25日
3	永赢基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	中国证监会规定媒介	2025年02月14日
4	永赢基金管理有限公司关于以通讯方式召开永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2025年03月13日
5	永赢基金管理有限公司关于以通讯方式召开永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2025年03月14日
6	永赢基金管理有限公司关于以通讯方式召开永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2025年03月15日
7	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2025年03月18日
8	永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定媒介	2025年03月28日
9	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	2025年03月28日
10	永赢基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度)	中国证监会规定媒介	2025年03月31日
11	永赢基金管理有限公司关于永赢深证创	中国证监会规定媒介	2025年04月17日

	新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日停牌的提示性公告		
12	永赢基金管理有限公司关于永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会规定媒介	2025年04月18日
13	永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2025年04月21日
14	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2025年04月23日
15	永赢基金管理有限公司关于永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的公告	中国证监会规定媒介	2025年04月25日
16	永赢基金管理有限公司关于永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2025年04月30日
17	永赢基金管理有限公司关于永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2025年05月06日
18	永赢基金管理有限公司关于永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金停牌及暂停办理申购赎回的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025年05月07日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250313-20250630	0.00	50,773,000.00	0.00	50,773,000.00	48.16%
产品特有风险							
本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况,存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金变更注册为永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2. 《永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3. 《永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4. 《永赢深证 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新（如有）；

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；

6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司
2025 年 08 月 28 日