

永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
2026 年中期报告

2026 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	6
§ 4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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 ..	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	16
6.3	净资产变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	36
7.1	期末基金资产组合情况	36
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47

7.12	投资组合报告附注	47
§ 8	基金份额持有人信息	48
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
§ 9	开放式基金份额变动	49
§ 10	重大事件揭示	49
10.1	基金份额持有人大会决议	49
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	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4	基金投资策略的改变	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	51
10.8	其他重大事件	52
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12	备查文件目录	54
12.1	备查文件目录	54
12.2	存放地点	54
12.3	查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	沪深 300ETF 永赢
场内简称	300 永赢、沪深 300ETF 永赢
基金主代码	563520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 08 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	379,065,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 11 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在 2%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内。主要投资策略有：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、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	沪深 300 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，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、27	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	层	
邮政编码	200120	100140
法定代表人	马宇晖	廖林

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金中期报告置备地点	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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	39,355,004.63
本期利润	38,505,564.66
加权平均基金份额本期利润	0.0967
本期加权平均净值利润率	7.96%
本期基金份额净值增长率	8.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	100,142,730.70
期末可供分配基金份额利润	0.2642
期末基金资产净值	486,007,041.32
期末基金份额净值	1.2821
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	28.21%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	12.46%	1.25%	11.90%	1.26%	0.56%	-0.01%
过去六个月	8.24%	1.12%	7.55%	1.13%	0.69%	-0.01%
过去一年	29.17%	1.02%	26.51%	1.02%	2.66%	0.00%
自基金合同生 效起至今	28.21%	1.01%	20.11%	1.02%	8.10%	-0.01%

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



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

永赢基金管理有限公司（以下简称“公司”）于 2013 年 10 月 8 日取得了中国证监会《关于核准设立永赢基金管理有限公司的批复》（证监许可[2013]1280 号），随后，公司于 2013 年 10 月 11 日取得商务部《中华人民共和国外商投资企业批准证书》（商外资资审字[2013]008 号），并于 2013 年 11 月 7 日在国家工商行政管理总局注册成立，此后，于 2013 年 11 月 12 日取得中国证监会核发的《基金管理资格证书》（编号 A087），并于 2017 年 3 月 14 日获得中国证监会颁发的信用代码为

913302007178854322 的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014 年 8 月 18 日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018 年 1 月 25 日，公司完成增资，注册资本由人民币贰亿元增至人民币玖亿元。目前，公司的股权结构为：宁波银行股份有限公司出资占比 71.49%，Oversea-Chinese Banking Corporation Limited 出资占比 25%，上海稳进同赢企业管理中心（有限合伙）出资占比 1.1739%，上海锐进同赢企业管理中心（有限合伙）出资占比 1.1696%，上海聚信同赢企业管理中心（有限合伙）出资占比 1.1665%。

截止 2026 年 06 月 30 日，本基金管理人共管理 199 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、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发起式联接基金、永赢汇达 6 个月持有期混合型证券投资基金、永赢恒生消费指数型发起式证券投资基金（QDII）、永赢中证港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金、永赢新材料智选混合型发起式证券投资基金、永赢港股通科技智选混合型发起式证券投资基金、永赢国企机遇慧选混合型发起式证券投资基金、永赢泓利债券型证券投资基金、永赢元盈稳健多资产 90 天持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢上证科创板人工智能指数型发起式证券投资基金、永赢中债-优选投资级信用债（1-3 年）指数证券投资基金、永赢资源慧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发起式联接基金、永赢中证港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、永赢锐见先锋混合型证券投资基金、永赢先锋半导体智选混合型发起式证券投资基金、永赢新兴产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、永赢上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金、永赢中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、永赢元享稳健多资产 90 天持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢沪深 300 指数增强型证券投资基金、永赢价值回报混合型证券投资基金、永赢中证家用电器交易型开放式指数证券投资基金、永赢优选增强债券型证券投资基金、永赢中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金、永赢启航慧选混合型证券投资基金、永赢国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金联接基金、永赢汇欣混合型证券投资基金、永赢价值核心混合型证券投资基金、永赢国证工业软件主题指数型证券投资基金、

永赢中证工程机械主题指数型证券投资基金、永赢产业机遇智选混合型发起式证券投资基金、永赢上证科创板 200 指数型证券投资基金、永赢中证畜牧养殖产业交易型开放式指数证券投资基金、永赢丰享 90 天持有期债券型证券投资基金、永赢锐见成长混合型证券投资基金、永赢国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金、永赢现金惠货币市场基金、永赢元鑫稳健多资产六个月持有期混合型基金中基金（FOF）、永赢元嘉平衡多资产 90 天持有期混合型基金中基金（FOF）、永赢致远成长混合型证券投资基金、永赢润泽增强债券型证券投资基金、永赢裕鑫稳健多资产六个月持有期混合型基金中基金（FOF）。

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		
刘庭宇	基金经理	2024 年 11 月 08 日	—	8 年	刘庭宇先生，上海财经大学金融硕士，8 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。
蔡路平	指数与量化投资部总经理兼基金经理	2025 年 05 月 28 日	—	9 年	蔡路平先生，硕士，9 年证券相关从业经验，曾任 DIA Associates 数据分析师；南华基金管理有限公司量化投资部 ETF 基金经理助理；西部利得基金管理有限公司 ETF 投资部副总经理（主持工作），现任永赢基金管理有限公司指数与量化投资部总经理兼基金经理。

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。

3、刘庭宇已于 2026 年 08 月 05 日卸任永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理职务。

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、《永赢沪深 300 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，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

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

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

4.3.2 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。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 8 次，原因是指数投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

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

截至报告期末沪深 300ETF 永赢基金份额净值为 1.2821 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 8.24%，同期业绩比较基准收益率为 7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 上半年 A 股市场整体呈震荡走势，报告期内，沪深 300 指数上涨 7.5%，中证 500 指数上涨 21.0%，创业板指上涨 35.6%，整体来看大盘成长风格明显占优。作为大盘风格的代表，沪深 300 指数兼具规模性和流动性，指数盈利能力相对稳健。行业层面，受全球人工智能大规模资本开支带动和中东地缘冲突缓和影响，电子、通信等行业涨幅靠前，消费板块的商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料等行业回调幅度靠前。

展望 2026 下半年，海外流动性有可能转向紧缩，但若美国通胀和就业回落则货币政策保持中性的概率更高，国内权益市场有望从估值驱动转向盈利驱动，增量资金流入权益市场的持续性可期，因此对 A 股市场仍可以保持积极乐观。随着企业盈利的企稳修复，龙头公司的盈利和成长确定性相对更高，估值性价比凸显，其中代表新质生产力的硬科技板块、受益去美元化趋势且估值水平已回落至低位的有色金属板块、受益反内卷政策且产能有望出清的困境反转型行业值得重点关注。

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 2026 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	2,331,239.57	5,047,080.29
结算备付金		1,362.73	1,422,259.47
存出保证金		—	496,065.60
交易性金融资产	6.4.7.2	484,393,072.48	498,150,153.00
其中：股票投资		484,393,072.48	498,150,153.00
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		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	—
资产总计		486,786,167.41	505,115,558.36
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 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		567,996.75	2,481,448.41
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		59,054.84	79,565.39
应付托管费		19,684.95	26,521.78
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		—	5,065.44
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.6	132,389.55	202,616.00
负债合计		779,126.09	2,795,217.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	379,065,000.00	424,065,000.00
未分配利润	6.4.7.8	106,942,041.32	78,255,341.34
净资产合计		486,007,041.32	502,320,341.34
负债和净资产总计		486,786,167.41	505,115,558.36

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2821 元，基金份额总额 379,065,000.00

份。

2、货币资金中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.2 利润表

会计主体：永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		39,139,597.40	24,747,418.88
1. 利息收入		3,781.41	6,006.61
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,781.41	6,006.61
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）		40,102,348.83	6,818,278.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	35,062,986.24	-7,715,584.46
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	293,241.27	53,804.95
股利收益	6.4.7.15	4,746,121.32	14,480,058.20
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	-849,439.97	16,681,754.18
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	-117,092.87	1,241,379.40
减：二、营业总支出		634,032.74	1,421,501.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	359,277.23	935,617.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	119,759.07	311,872.51
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		1,056.52	194.61
8. 其他费用	6.4.7.19	153,939.92	173,816.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,505,564.66	23,325,917.47
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,505,564.66	23,325,917.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		38,505,564.66	23,325,917.47

6.3 净资产变动表

会计主体：永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	424,065,000.00	78,255,341.34	502,320,341.34
二、本期期初净资产	424,065,000.00	78,255,341.34	502,320,341.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-45,000,000.00	28,686,699.98	-16,313,300.02
（一）、综合收益总额	-	38,505,564.66	38,505,564.66
（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）	-45,000,000.00	-9,818,864.68	-54,818,864.68
其中：1. 基金申购款	159,000,000.00	34,691,716.52	193,691,716.52
2. 基金赎回款	-204,000,000.00	-44,510,581.20	-248,510,581.20
（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	379,065,000.00	106,942,041.32	486,007,041.32
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 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	1,324,065,000.00	-29,832,202.66	1,294,232,797.34
二、本期期初净资产	1,324,065,000.00	-29,832,202.66	1,294,232,797.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-327,000,000.00	22,441,673.03	-304,558,326.97
（一）、综合收益总额	-	23,325,917.47	23,325,917.47
（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）	-327,000,000.00	-884,244.44	-327,884,244.44
其中：1. 基金申购款	408,000,000.00	-24,295,755.35	383,704,244.65
2. 基金赎回款	-735,000,000.00	23,411,510.91	-711,588,489.09
（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	997,065,000.00	-7,390,529.63	989,674,470.37
-----------	----------------	---------------	----------------

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

永赢沪深 300 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[2024]1454 号《关于准予永赢沪深 300 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 2024 年 11 月 8 日生效。首次设立募集规模为 625,065,000.00 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，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；衍生品及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以对该比例做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 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发布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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发布的其他相关规定。

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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 2026 年 06 月 30 日
活期存款	5,001.19
等于：本金	5,000.00
加：应计利息	1.19
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	2,326,238.38
等于：本金	2,326,169.16
加：应计利息	69.22
合计	2,331,239.57

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	421,774,089.60	-	484,393,072.48	62,618,982.88
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	421,774,089.60	-	484,393,072.48	62,618,982.88

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 2026 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	114,219.55
其他	18,170.00
合计	132,389.55

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	424,065,000.00	424,065,000.00
本期申购	159,000,000.00	159,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-204,000,000.00	-204,000,000.00
本期末	379,065,000.00	379,065,000.00

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	68,721,522.91	9,533,818.43	78,255,341.34
本期期初	68,721,522.91	9,533,818.43	78,255,341.34
本期利润	39,355,004.63	-849,439.97	38,505,564.66
本期基金份额交易产生的变动数	-7,933,796.84	-1,885,067.84	-9,818,864.68
其中：基金申购款	34,398,430.59	293,285.93	34,691,716.52
基金赎回款	-42,332,227.43	-2,178,353.77	-44,510,581.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	100,142,730.70	6,799,310.62	106,942,041.32

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	17.17
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,512.12
结算备付金利息收入	1,252.12

其他	-
合计	3,781.41

注：1、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。

2、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益--买卖股票差价收入	23,638,298.79
股票投资收益--赎回差价收入	11,424,687.45
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	35,062,986.24

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	144,550,817.70
减：卖出股票成本总额	120,770,919.95
减：交易费用	141,598.96
买卖股票差价收入	23,638,298.79

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	248,510,581.20
减：现金支付赎回款总额	102,519,996.00
减：赎回股票成本总额	134,565,897.75
减：交易费用	-
赎回差价收入	11,424,687.45

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**6.4.7.14.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益—其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	293,241.27
合计	293,241.27

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,746,121.32
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	4,746,121.32

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-706,759.97
--股票投资	-706,759.97
--债券投资	-
--资产支持证券投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-142,680.00
--权证投资	-
--股指期货	-142,680.00
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	-849,439.97
----	-------------

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
ETF 基金替代损益	-117,092.87
合计	-117,092.87

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	213.00
其他	69,424.36
合计	153,939.92

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、关联关系

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

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(“永赢沪深 300ETF 发起联接”)	本基金的联接基金
--	----------

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	359,277.23	935,617.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,453.13	86,499.23
应支付基金管理人的净管理费	346,824.10	849,118.16

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	119,759.07	311,872.51

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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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

永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	320,488,900.00	84.5472%	317,571,600.00	74.8875%
--------------------------------	----------------	----------	----------------	----------

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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
工商银行	5,001.19	17.17	5,000.50	20.00

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的股东宁波银行发行的股票宁波银行（002142.SZ）；基金托管人工商银行发行的股票工商银行（601398.SH）。于本报告期末，本基金持有的基金管理人的股东宁波银行发行的股票宁波银行（002142.SZ）56,600 股，期末公允价值为人民币 1,680,454.00 元，占基金净值比例为 0.35%；本基金持有的基金托管人工商银行发行的股票工商银行（601398.SH）554,100 股，期末公允价值为人民币 3,917,487.00 元，占基金净值比例为 0.81%。于上年度末，本基金持有的基金管理人的股东宁波银行发行的股票宁波银行（002142.SZ）64,900 股，期末公允价值为人民币 1,823,041.00 元，占基金净值比例为 0.36%；本基金持有的基金托管人工商银行发行的股票工商银行（601398.SH）636,100 股，期末公允价值为人民币 5,044,273.00 元，占基金净值比例为 1.00%。

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（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	3,400	2,367,081.28	2,828,800.00	

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 2026 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 2026 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。

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。

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。

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。

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。

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 2026 年 06 月 30 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	2,331,239.57	-	-	-	-	-	2,331,239.57
结算备付金	1,362.73	-	-	-	-	-	1,362.73
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	484,393,072.48	484,393,072.48
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	-	-	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	2,332,602.30	-	-	-	-	484,453,565.11	486,786,167.41
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	-	-	-	-	-	567,996.75	567,996.75
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	59,054.84	59,054.84
应付托管费	-	-	-	-	-	19,684.95	19,684.95
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	-	-	-	-	-	132,389.55	132,389.55
负债总计	-	-	-	-	-	779,126.09	779,126.09
利率敏感度缺口	2,332,602.30	-	-	-	-	483,674,439.02	486,007,041.32
上年度末 2025 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	5,047,080.29	-	-	-	-	-	5,047,080.29
结算备付金	1,422,259.47	-	-	-	-	-	1,422,259.47

存出保证金	-	-	-	-	496,065.60	496,065.60
交易性金融资产	-	-	-	-	498,150,153.00	498,150,153.00
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	6,469,339.76	-	-	-	498,646,218.60	505,115,558.36
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	-	-	-	-	2,481,448.41	2,481,448.41
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	79,565.39	79,565.39
应付托管费	-	-	-	-	26,521.78	26,521.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	5,065.44	5,065.44
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	202,616.00	202,616.00
负债总计	-	-	-	-	2,795,217.02	2,795,217.02
利率敏感度缺口	6,469,339.76	-	-	-	-495,851,001.58	502,320,341.34

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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	484,393,072.48	99.67	498,150,153.00	99.17
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	484,393,072.48	99.67	498,150,153.00	99.17

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(2026 年 06 月 30 日)	上年度末 (2025 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准增加 1%	4,831,846.38	5,014,326.56
	业绩比较基准减少 1%	-4,831,846.38	-5,014,326.56

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	481,564,272.48	493,551,985.41
第二层次	2,828,800.00	4,079,590.44
第三层次	-	518,577.15
合计	484,393,072.48	498,150,153.00

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 2026 年 08 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
----	----	----	--------------

1	权益投资	484,393,072.48	99.51
	其中：股票	484,393,072.48	99.51
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	2,332,602.30	0.48
8	其他各项资产	60,492.63	0.01
9	合计	486,786,167.41	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	2,758,849.00	0.57
B	采矿业	20,269,014.00	4.17
C	制造业	310,562,577.82	63.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,032,381.00	2.48
E	建筑业	5,509,356.00	1.13
F	批发和零售业	715,672.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	11,732,944.82	2.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,971,186.24	5.34
J	金融业	84,829,295.60	17.45
K	房地产业	1,578,537.00	0.32
L	租赁和商务服务业	2,215,136.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	5,279,224.00	1.09
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	658,322.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	280,577.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	484,393,072.48	99.67

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内积极投资股票。

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	300308	中际旭创	19,100	24,257,000.00	4.99
2	300750	宁德时代	45,417	17,849,335.17	3.67
3	300502	新易盛	23,892	14,502,444.00	2.98
4	600519	贵州茅台	10,710	12,696,597.90	2.61
5	603986	兆易创新	11,300	9,209,500.00	1.89
6	601318	中国平安	182,500	8,712,550.00	1.79
7	688256	寒武纪	5,327	8,499,494.85	1.75
8	600036	招商银行	211,900	7,522,450.00	1.55
9	601899	紫金矿业	282,100	7,091,994.00	1.46
10	002371	北方华创	7,385	6,532,475.60	1.34
11	000333	美的集团	83,244	6,287,419.32	1.29
12	002475	立讯精密	87,300	6,145,920.00	1.26
13	688008	澜起科技	19,726	6,113,087.40	1.26
14	688012	中微公司	12,841	6,016,008.50	1.24
15	688041	海光信息	15,909	5,891,102.70	1.21
16	002384	东山精密	22,000	5,771,700.00	1.19
17	688981	中芯国际	34,965	5,553,141.30	1.14
18	600900	长江电力	209,500	5,545,465.00	1.14
19	000725	京东方 A	622,200	5,400,696.00	1.11
20	603259	药明康德	42,400	5,279,224.00	1.09
21	601138	工业富联	68,100	4,913,415.00	1.01
22	600030	中信证券	167,200	4,803,656.00	0.99
23	601166	兴业银行	289,700	4,797,432.00	0.99
24	300059	东方财富	216,800	4,418,384.00	0.91
25	600183	生益科技	25,000	4,335,000.00	0.89
26	600276	恒瑞医药	76,500	3,981,060.00	0.82
27	300274	阳光电源	24,825	3,947,671.50	0.81
28	601398	工商银行	554,100	3,917,487.00	0.81
29	300408	三环集团	23,000	3,838,700.00	0.79

30	002594	比亚迪	46,500	3,706,050.00	0.76
31	300476	胜宏科技	10,500	3,637,515.00	0.75
32	002463	沪电股份	23,100	3,529,680.00	0.73
33	601211	国泰海通	193,418	3,520,207.60	0.72
34	300394	天孚通信	11,260	3,408,176.80	0.70
35	000988	华工科技	17,200	3,175,292.00	0.65
36	301308	江波龙	4,400	3,096,720.00	0.64
37	600176	中国巨石	41,100	2,995,368.00	0.62
38	601288	农业银行	491,900	2,985,833.00	0.61
39	601328	交通银行	456,800	2,937,224.00	0.60
40	000651	格力电器	76,900	2,883,750.00	0.59
41	688072	拓荆科技	3,400	2,828,800.00	0.58
42	600522	中天科技	46,300	2,809,484.00	0.58
43	688521	芯原股份	7,300	2,709,322.00	0.56
44	600919	江苏银行	251,100	2,706,858.00	0.56
45	603019	中科曙光	25,100	2,691,473.00	0.55
46	603993	洛阳钼业	150,000	2,632,500.00	0.54
47	600150	中国船舶	77,400	2,615,346.00	0.54
48	600887	伊利股份	108,300	2,594,868.00	0.53
49	600584	长电科技	24,521	2,539,149.55	0.52
50	000338	潍柴动力	92,100	2,509,725.00	0.52
51	000858	五粮液	33,200	2,456,800.00	0.51
52	601816	京沪高铁	502,600	2,276,778.00	0.47
53	600309	万华化学	32,200	2,202,802.00	0.45
54	300124	汇川技术	32,400	2,149,092.00	0.44
55	002415	海康威视	62,800	2,147,760.00	0.44
56	002916	深南电路	4,670	2,138,393.00	0.44
57	600111	北方稀土	43,400	2,085,370.00	0.43
58	000100	TCL 科技	356,400	2,074,248.00	0.43
59	601688	华泰证券	100,000	2,062,000.00	0.42
60	000063	中兴通讯	55,200	1,997,688.00	0.41
61	600000	浦发银行	228,200	1,964,802.00	0.40
62	600089	特变电工	86,500	1,946,250.00	0.40
63	601857	中国石油	221,400	1,921,752.00	0.40
64	002028	思源电气	10,700	1,851,100.00	0.38
65	300433	蓝思科技	34,200	1,835,172.00	0.38
66	601088	中国神华	47,000	1,834,880.00	0.38
67	600031	三一重工	101,700	1,757,376.00	0.36
68	300014	亿纬锂能	26,000	1,690,780.00	0.35
69	002142	宁波银行	56,600	1,680,454.00	0.35
70	002050	三花智控	38,300	1,678,689.00	0.35

71	601601	中国太保	58,600	1,671,272.00	0.34
72	000001	平安银行	166,200	1,670,310.00	0.34
73	000792	盐湖股份	54,400	1,642,336.00	0.34
74	002714	牧原股份	46,700	1,634,033.00	0.34
75	600549	厦门钨业	19,100	1,627,320.00	0.33
76	002353	杰瑞股份	10,500	1,601,250.00	0.33
77	600406	国电南瑞	68,900	1,574,365.00	0.32
78	601668	中国建筑	353,500	1,534,190.00	0.32
79	000657	中钨高新	15,600	1,493,232.00	0.31
80	601229	上海银行	170,100	1,476,468.00	0.30
81	601919	中远海控	107,330	1,423,195.80	0.29
82	002602	世纪华通	100,900	1,422,690.00	0.29
83	300760	迈瑞医疗	10,400	1,412,632.00	0.29
84	601988	中国银行	246,000	1,407,120.00	0.29
85	601939	建设银行	144,900	1,395,387.00	0.29
86	600660	福耀玻璃	27,400	1,382,056.00	0.28
87	601728	中国电信	265,700	1,378,983.00	0.28
88	603501	豪威集团	14,500	1,375,325.00	0.28
89	600016	民生银行	424,800	1,367,856.00	0.28
90	601012	隆基绿能	103,900	1,363,168.00	0.28
91	601225	陕西煤业	66,300	1,349,205.00	0.28
92	600999	招商证券	63,600	1,341,960.00	0.28
93	002230	科大讯飞	32,800	1,339,552.00	0.28
94	600941	中国移动	15,438	1,329,674.94	0.27
95	600690	海尔智家	64,200	1,310,322.00	0.27
96	002352	顺丰控股	41,200	1,287,912.00	0.26
97	601985	中国核电	140,800	1,271,424.00	0.26
98	002460	赣锋锂业	19,300	1,262,220.00	0.26
99	600926	杭州银行	86,900	1,255,705.00	0.26
100	002709	天赐材料	24,400	1,254,892.00	0.26
101	603799	华友钴业	26,000	1,254,760.00	0.26
102	002938	鹏鼎控股	11,900	1,254,022.00	0.26
103	300033	同花顺	5,197	1,252,477.00	0.26
104	601169	北京银行	253,900	1,244,110.00	0.26
105	000977	浪潮信息	17,600	1,232,000.00	0.25
106	600160	巨化股份	23,100	1,224,531.00	0.25
107	000776	广发证券	50,400	1,179,360.00	0.24
108	300442	润泽科技	14,100	1,171,287.00	0.24
109	000425	徐工机械	140,600	1,137,454.00	0.23
110	000938	紫光股份	39,200	1,131,312.00	0.23
111	688126	沪硅产业	28,300	1,128,887.00	0.23

112	002202	金风科技	47,200	1,128,080.00	0.23
113	300498	温氏股份	91,300	1,124,816.00	0.23
114	600938	中国海油	41,000	1,113,150.00	0.23
115	601600	中国铝业	135,400	1,112,988.00	0.23
116	600028	中国石化	249,200	1,111,432.00	0.23
117	600460	士兰微	20,000	1,093,200.00	0.22
118	688082	盛美上海	2,526	1,091,232.00	0.22
119	002600	领益智造	62,700	1,087,218.00	0.22
120	002466	天齐锂业	17,700	1,085,364.00	0.22
121	601766	中国中车	208,000	1,081,600.00	0.22
122	300661	圣邦股份	7,480	1,073,230.40	0.22
123	600050	中国联通	267,900	1,071,600.00	0.22
124	601009	南京银行	106,100	1,049,329.00	0.22
125	002837	英维克	13,100	1,042,236.00	0.21
126	002049	紫光国微	11,700	1,038,375.00	0.21
127	601628	中国人寿	28,600	1,011,010.00	0.21
128	002179	中航光电	21,700	1,002,540.00	0.21
129	601100	恒立液压	9,140	983,098.40	0.20
130	000568	泸州老窖	12,600	976,752.00	0.20
131	601872	招商轮船	55,500	975,135.00	0.20
132	002241	歌尔股份	42,700	962,031.00	0.20
133	603288	海天味业	28,600	948,376.00	0.20
134	601006	大秦铁路	203,800	939,518.00	0.19
135	601658	邮储银行	188,500	929,305.00	0.19
136	000408	藏格矿业	13,400	928,888.00	0.19
137	605117	德业股份	8,728	926,739.04	0.19
138	600809	山西汾酒	8,373	915,755.01	0.19
139	601818	光大银行	315,400	911,506.00	0.19
140	600905	三峡能源	244,600	907,466.00	0.19
141	601888	中国中免	16,800	902,328.00	0.19
142	002625	光启技术	29,600	897,472.00	0.18
143	600489	中金黄金	49,700	897,085.00	0.18
144	688396	华润微	9,164	893,948.20	0.18
145	000630	铜陵有色	138,000	877,680.00	0.18
146	600893	航发动力	22,800	874,152.00	0.18
147	600010	宝钢股份	386,700	862,341.00	0.18
148	601127	赛力斯	14,000	857,500.00	0.18
149	688271	联影医疗	8,441	854,482.43	0.18
150	601336	新华保险	14,300	853,138.00	0.18
151	688111	金山办公	3,989	849,856.45	0.17
152	600958	东方证券	89,500	844,880.00	0.17

153	601689	拓普集团	14,900	840,658.00	0.17
154	002027	分众传媒	173,000	837,320.00	0.17
155	600118	中国卫星	10,100	828,705.00	0.17
156	600019	宝钢股份	148,900	808,527.00	0.17
157	600760	中航沈飞	19,376	796,353.60	0.16
158	000807	云铝股份	35,700	790,398.00	0.16
159	601838	成都银行	43,600	771,720.00	0.16
160	600104	上汽集团	78,700	768,112.00	0.16
161	688183	生益电子	5,800	767,920.00	0.16
162	600362	江西铜业	17,700	766,410.00	0.16
163	300450	先导智能	18,800	765,536.00	0.16
164	600989	宝丰能源	37,600	764,408.00	0.16
165	601727	上海电气	108,100	756,700.00	0.16
166	600875	东方电气	26,100	750,897.00	0.15
167	002001	新和成	26,300	747,446.00	0.15
168	601825	沪农商行	98,800	740,012.00	0.15
169	002422	科伦药业	19,000	731,880.00	0.15
170	601390	中国中铁	175,400	731,418.00	0.15
171	000538	云南白药	15,320	725,708.40	0.15
172	603296	华勤技术	9,700	720,419.00	0.15
173	601995	中金公司	19,900	719,385.00	0.15
174	600547	山东黄金	31,000	715,790.00	0.15
175	601377	兴业证券	118,300	714,532.00	0.15
176	600795	国电电力	153,000	714,510.00	0.15
177	600015	华夏银行	108,900	695,871.00	0.14
178	600585	海螺水泥	40,900	693,255.00	0.14
179	601669	中国电建	147,400	692,780.00	0.14
180	000166	申万宏源	154,300	678,920.00	0.14
181	002648	卫星化学	28,900	678,861.00	0.14
182	601916	浙商银行	258,000	678,540.00	0.14
183	603893	瑞芯微	3,600	678,096.00	0.14
184	300316	晶盛机电	11,200	676,480.00	0.14
185	300015	爱尔眼科	79,700	658,322.00	0.14
186	601698	中国卫通	21,600	653,400.00	0.13
187	601066	中信建投	22,300	648,261.00	0.13
188	600346	恒力石化	36,200	641,102.00	0.13
189	600482	中国动力	19,400	636,320.00	0.13
190	601868	中国能建	237,100	633,057.00	0.13
191	601998	中信银行	90,800	629,244.00	0.13
192	002311	海大集团	14,100	629,001.00	0.13
193	002558	巨人网络	22,800	628,368.00	0.13

194	300418	昆仑万维	15,400	621,544.00	0.13
195	000625	长安汽车	85,000	609,450.00	0.13
196	600066	宇通客车	22,700	608,587.00	0.13
197	600426	华鲁恒升	25,400	607,568.00	0.13
198	002532	天山铝业	55,400	594,442.00	0.12
199	600221	海航控股	440,200	594,270.00	0.12
200	000157	中联重科	84,700	590,359.00	0.12
201	688036	传音控股	9,863	581,423.85	0.12
202	605499	东鹏饮料	4,680	577,652.40	0.12
203	300803	指南针	6,300	577,521.00	0.12
204	600011	华能国际	75,200	570,768.00	0.12
205	600048	保利发展	123,000	569,490.00	0.12
206	600436	片仔癀	5,200	568,256.00	0.12
207	600438	通威股份	46,000	557,060.00	0.11
208	601077	渝农商行	91,000	556,010.00	0.11
209	600115	中国东航	145,200	553,212.00	0.11
210	002236	大华股份	33,400	550,766.00	0.11
211	002493	荣盛石化	51,200	550,400.00	0.11
212	600570	恒生电子	25,900	548,821.00	0.11
213	600886	国投电力	41,100	547,041.00	0.11
214	600188	兖矿能源	30,600	543,762.00	0.11
215	688047	龙芯中科	3,475	537,478.25	0.11
216	003816	中国广核	134,400	525,504.00	0.11
217	002736	国信证券	52,500	524,475.00	0.11
218	601360	三六零	59,800	519,662.00	0.11
219	601058	赛轮轮胎	44,800	516,544.00	0.11
220	000301	东方盛虹	45,000	515,250.00	0.11
221	600026	中远海能	28,600	513,084.00	0.11
222	002074	国轩高科	18,600	511,686.00	0.11
223	601901	方正证券	70,200	505,440.00	0.10
224	600009	上海机场	21,200	489,720.00	0.10
225	600196	复星医药	21,700	487,599.00	0.10
226	000768	中航西飞	23,800	487,424.00	0.10
227	601111	中国国航	80,100	484,605.00	0.10
228	000975	山金国际	28,400	482,800.00	0.10
229	601788	光大证券	33,400	481,962.00	0.10
230	600029	南方航空	92,300	478,114.00	0.10
231	601456	国联民生	53,900	476,476.00	0.10
232	600674	川投能源	33,600	476,112.00	0.10
233	600415	小商品城	46,800	475,488.00	0.10
234	600219	南山铝业	117,900	470,421.00	0.10

235	601186	中国铁建	78,500	467,075.00	0.10
236	601881	中国银河	37,100	466,347.00	0.10
237	601877	正泰电器	18,500	463,795.00	0.10
238	600233	圆通速递	29,300	461,475.00	0.09
239	601117	中国化学	62,500	459,375.00	0.09
240	301236	软通动力	10,700	454,215.00	0.09
241	600372	中航机载	41,300	448,105.00	0.09
242	601878	浙商证券	46,800	444,600.00	0.09
243	301269	华大九天	3,700	441,854.00	0.09
244	688506	百利天恒	1,500	441,045.00	0.09
245	000963	华东医药	15,100	424,612.00	0.09
246	600741	华域汽车	27,000	419,040.00	0.09
247	002920	德赛西威	5,100	415,650.00	0.09
248	000895	双汇发展	17,800	398,720.00	0.08
249	002304	洋河股份	10,400	396,760.00	0.08
250	001979	招商蛇口	61,500	395,445.00	0.08
251	300866	安克创新	3,700	386,650.00	0.08
252	601898	中煤能源	31,300	381,234.00	0.08
253	601021	春秋航空	8,300	378,314.00	0.08
254	601319	中国人保	54,500	368,420.00	0.08
255	600023	浙能电力	68,800	361,888.00	0.07
256	601800	中国交建	61,500	351,165.00	0.07
257	000002	万科 A	117,600	348,096.00	0.07
258	600039	四川路桥	44,000	344,080.00	0.07
259	688223	晶科能源	70,226	333,573.50	0.07
260	600588	用友网络	35,400	324,972.00	0.07
261	601633	长城汽车	21,500	324,435.00	0.07
262	001965	招商公路	35,200	322,432.00	0.07
263	600600	青岛啤酒	6,100	318,603.00	0.07
264	603369	今世缘	12,900	305,859.00	0.06
265	600027	华电国际	68,400	304,380.00	0.06
266	601618	中国中冶	121,400	296,216.00	0.06
267	603260	合盛硅业	6,100	294,386.00	0.06
268	300628	亿联网络	8,700	294,234.00	0.06
269	302132	中航成飞	5,000	291,600.00	0.06
270	600918	中泰证券	54,800	291,536.00	0.06
271	601607	上海医药	18,900	291,060.00	0.06
272	600061	国投资本	43,600	285,580.00	0.06
273	600025	华能水电	32,100	285,369.00	0.06
274	000617	中油资本	43,100	284,029.00	0.06
275	300832	新产业	6,700	281,400.00	0.06

276	300251	光线传媒	25,300	280,577.00	0.06
277	600085	同仁堂	11,800	272,698.00	0.06
278	688472	阿特斯	24,904	269,461.28	0.06
279	601059	信达证券	16,600	268,754.00	0.06
280	600930	华电新能	56,200	268,074.00	0.06
281	600515	海南机场	96,900	265,506.00	0.05
282	000999	华润三九	11,330	254,811.70	0.05
283	600803	新奥股份	16,100	254,380.00	0.05
284	600018	上港集团	51,600	243,552.00	0.05
285	600845	宝信软件	14,600	242,798.00	0.05
286	300122	智飞生物	20,600	240,814.00	0.05
287	300999	金龙鱼	10,100	234,926.00	0.05
288	300896	爱美客	2,600	226,720.00	0.05
289	000596	古井贡酒	2,800	223,440.00	0.05
290	000708	中信特钢	17,500	220,850.00	0.05
291	688009	中国通号	44,694	212,743.44	0.04
292	601018	宁波港	66,000	207,900.00	0.04
293	688303	大全能源	11,301	196,976.43	0.04
294	601238	广汽集团	38,300	194,564.00	0.04
295	001280	中国铀业	2,900	193,430.00	0.04
296	300413	芒果超媒	12,900	188,727.00	0.04
297	301165	锐捷网络	2,300	185,035.00	0.04
298	603392	万泰生物	6,375	171,933.75	0.04
299	601136	首创证券	9,400	131,130.00	0.03
300	001391	国货航	25,486	103,728.02	0.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300308	中际旭创	10,751,427.00	2.14
2	300750	宁德时代	9,064,937.00	1.80
3	002371	北方华创	3,750,020.20	0.75
4	300502	新易盛	3,682,314.00	0.73
5	000333	美的集团	3,102,149.50	0.62
6	000988	华工科技	2,725,188.00	0.54
7	002475	立讯精密	2,428,661.00	0.48

8	301308	江波龙	2,428,409.00	0.48
9	688072	拓荆科技	2,367,081.28	0.47
10	300394	天孚通信	2,269,570.00	0.45
11	002594	比亚迪	2,124,268.00	0.42
12	300059	东方财富	2,027,128.00	0.40
13	002384	东山精密	1,841,784.00	0.37
14	300476	胜宏科技	1,838,545.60	0.37
15	688521	芯原股份	1,723,797.46	0.34
16	002353	杰瑞股份	1,709,836.00	0.34
17	300274	阳光电源	1,668,605.00	0.33
18	002602	世纪华通	1,614,893.00	0.32
19	688256	寒武纪	1,602,697.44	0.32
20	000858	五粮液	1,593,667.00	0.32

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	300308	中际旭创	13,018,355.00	2.59
2	300750	宁德时代	11,831,486.00	2.36
3	300502	新易盛	5,190,144.00	1.03
4	002371	北方华创	4,236,898.00	0.84
5	000333	美的集团	4,161,615.50	0.83
6	002475	立讯精密	3,206,955.00	0.64
7	002594	比亚迪	2,829,595.00	0.56
8	300394	天孚通信	2,721,243.00	0.54
9	300059	东方财富	2,674,112.00	0.53
10	300476	胜宏科技	2,314,976.00	0.46
11	002384	东山精密	2,310,588.52	0.46
12	688256	寒武纪	2,299,077.09	0.46
13	300274	阳光电源	2,208,557.00	0.44
14	000858	五粮液	2,090,424.00	0.42
15	000725	京东方 A	1,785,426.00	0.36
16	688012	中微公司	1,768,485.27	0.35
17	000651	格力电器	1,729,658.00	0.34
18	000338	潍柴动力	1,693,959.00	0.34
19	300124	汇川技术	1,607,190.00	0.32
20	002028	思源电气	1,466,856.00	0.29

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	130,770,851.33
卖出股票收入（成交）总额	144,550,817.70

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

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。

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约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约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	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	—
9	合计	60,492.63

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		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	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
1, 100	344, 604. 55	358, 149, 799 .00	94. 4824 %	20, 915, 201 .00	5. 517 6%	320, 488, 900 .00	84. 547 2%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“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”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 11 月 08 日）基金份额总 额	625, 065, 000.00
本报告期期初基金份额总额	424, 065, 000.00
本报告期基金总申购份额	159, 000, 000.00
减：本报告期基金总赎回份额	204, 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	379, 065, 000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《基金合同》及《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	永赢基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 02 月 09 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度建设、加强培训宣导等措施完成整改，整改结果已经监管部门验收通过。
其他	无

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
--------------------	----

受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 02 月 09 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度建设、加强培训宣导等措施完成整改，整改结果已经监管部门验收通过。
其他	无
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 02 月 09 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度建设、加强培训宣导等措施完成整改，整改结果已经监管部门验收通过。
其他	无

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	

金融街证 券	4	275, 321, 669. 03	100. 00%	51, 669. 58	100. 00%	-
-----------	---	-------------------	----------	-------------	----------	---

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 基金租用或者通过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
金融街证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢基金管理有限公司关于旗下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	2026年01月12日
2	永赢基金管理有限公司关于上海分公司负责人变更的公告	中国证监会规定媒介	2026年01月12日
3	永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年01月21日
4	永赢基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的公告	中国证监会规定媒介	2026年01月31日
5	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	2026年02月12日
6	永赢基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	中国证监会规定媒介	2026年03月11日
7	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国联民生证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2026年03月20日
8	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加民生证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2026年03月20日
9	永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026年03月31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(2025 年度)	中国证监会规定媒介	2026年03月31日
11	永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年04月22日
12	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加山西证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2026年04月30日
13	永赢基金对外行使投票表决权(2025 年度)情况信息披露	中国证监会规定媒介	2026年04月30日
14	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	中国证监会规定媒介	2026年05月13日
15	永赢基金管理有限公司深圳分公司成立公告	中国证监会规定媒介	2026年05月22日
16	永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新(2026 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2026年06月30日
17	永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2026 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2026年06月30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
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	1	20260101-20260630	317,571,600.00	96,263,900.00	93,346,600.00	320,488,900.00	84.55%
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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
2. 《永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢沪深 300 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

2026 年 08 月 31 日