永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:永赢基金管理有限公司
基金托管人:华泰证券股份有限公司
送出日期:2018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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月24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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	永赢量化灵活配置混合发起式
基金主代码	001754
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年09月01日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,200,954.54份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活应用多种量化策略,在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用多因子选股策略为主,辅以事件驱动以及宏观择时等其他量化策略,力争实现稳定的绝对回报。 1、多因子选股策略 该策略以对中国股票市场较长期的回测研究为基础,运用量化多因子模型框架,结合定性指标和定量指标,综合考虑上市公司基本经营状况和市场对股票的反应两大因素,通过计算市场上所有股票的管理质量、价值、成长变化、市场情绪以及行业特殊因素等量化因子,将计算结果组合成alpha模型,同时结合风险模型构建股票现货组合。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断,适时调整各因子类别的具体组成及权重。 (1)基本面因子 管理质量:利用计算横截面多种比率来判断上市公司的报表质量以及管理能力,例如衡量报表质量的应收应付因子,衡量管理能力的周转率、偿债能力、ROA和ROE等因子; 成长变化:通过计算时间序列上各种比率的变化来衡量公司基本面的成长性; 价值:判断公司的股票价格相对于它的内在价值是否合理。由于内在价值无法直接计算,我们通过计算全市场所有公司的利润、销售量、总资产等多种指标来综合间接反映公司的内在价值。 (2)市场因子 市场情绪:从技术面的动量、反转、枢轴突破等指标来衡量投资者情绪; 分析师预测:通过扫描市场上分析师观点的变化来预测市场反应。 2、事件驱动策略 该策略通过对某些公司事件和市场事件的研究,分析事件对股价造成波动的方向,以赚取超额收益。此外,该策略还利用市场上存在的金融产品定价非有效性,实现套利收益。 3、宏观择时策略 该策略通过计算和跟踪多种宏观经济变量和市场变量,运用计量经济学方法对未来大盘走势进行预测。 4、其他投资策略 (1)债券投资策略 出于对流动性、有效利用基金财产的考虑,本基金适时对债券进行投资。通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势等因素,制定久期控制下的投资策略,构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。 (2)金融衍生工具投资策略 在法律法规允许的范围内,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制投资组合风险、提高投资效率,从而更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。

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	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧	吴冬云
	联系电话	021-51690145	025-83387219
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com	wudongyun@htsc.com
客户服务电话		021-51690111	95597
传真		021-51690177	025-83387215

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§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(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	-2,190,150.29
本期利润	-4,721,333.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0952
本期基金份额净值增长率	-10.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0708
期末基金资产净值	41,999,174.58
期末基金份额净值	0.9292

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、为更好地服务于广大投资者,在维护现有基金份额持有人利益的前提下,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的规定及基金合同的约定,基金管理人经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自2018年1月22日起对本基金基金份额净值的小数点保留精度由小数点后3位提高至小数点后4位,并相应修改基金合同和托管协议。具体请见基金管理人在指定媒介上披露的相关公告。

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
过去一个月	-8.11%	1.66%	-7.29%	1.22%	-0.82%	0.44%
过去三个月	-11.06%	1.25%	-9.45%	1.08%	-1.61%	0.17%
过去六个月	-10.52%	1.21%	-12.25%	1.10%	1.73%	0.11%
过去一年	-5.55%	1.04%	-3.97%	0.90%	-1.58%	0.14%
自基金合同生效起至今	-3.09%	1.19%	4.38%	1.14%	-7.47%	0.05%

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

2、本基金业绩比较基准为:95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率(税后)

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持股71.49%,利安资金管理公司持股28.51%。

截止2018年6月30日,本基金管理人共管理16只开放式证券投资基金,即永赢货币市场基金、永赢量化混合型发起式证券投资基金、永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、永赢天天利货币市场基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、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、永赢泰益债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张大木	基金经理	2015-09-01	2018-01-31	17	张大木先生,硕士,17年金融行业投资研究经验,其中10年证券相关从业经验,曾任美国沃顿商学院高级数据分析师;巴克莱全球投资公司(BGI)投资分析员;博时基金管理有限公司投资经理兼量化分析师。现任永赢基金管理有限公司总经理助理兼量化投资总监。
周华睿	基金经理	2018-01-11	-	3	周华睿先生,CFA,香港城市大学金融工程硕士,6年金融数据分析经验,其中3年证券投资研究经验。曾任深圳证券信息有限公司数据分析师,上海大智慧股份有限公司金融工程师,现任职于永赢基金管理有限公司量化投资部。

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行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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权限管理制度、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"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,于每季度分别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以及不同时间窗口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,未发现任何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

2018年上半年,受中美贸易战升级影响,A股市场整体出现持续下跌行情。尽管以沪深300为代表的大盘蓝筹在前期表现相对抗跌,但在二季度末也出现较为剧烈的杀跌。尽管量化选股策略较好地控制了组合的相对风险,但基金净值依旧出现下跌。

在本季度,本基金遵循稳健原则,灵活配置基金资产,通过量化选股策略筛选出的股票组合表现符合预期,体现了本基金投资策略的有效性。未来,我们将继续保持谨慎,灵活配置基金资产,在进一步有效控制产品风险的前提下,力争本产品的平衡运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢量化灵活配置混合型发起式基金份额净值为0.9292元,本报告期内,基金份额净值增长率为-10.52%,同期业绩比较基准收益率为-12.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去一年A股以大为美,大盘蓝筹表现远远超越市场平均水平。2018年的A股市场大概率是一个结构性牛市,各风格、行业之间的强弱转换呈现反转效应的可能性较大,但不排除部分强势主题与风格延续2017年趋势的可能性。

A股市场整体波动率自2015年股灾后持续下降,目前处于历史低位,但较去年底已有明显反弹。在此背景下,通过控制投资风险,重点把握阶段性及结构性机会将是较好的选择。本基金通过量化模型分散个股风险,动态捕捉市场机会的量化灵活配置策略具有独特的优势。未来,我们将在严格控制本基金投资风险的前提下审慎决策,灵活配置基金资产,力争本基金的稳健运行。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同规定:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%, 若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。2018年05月24日,本基金进行了收益分配:其中每10份基金份额分红0.45元,共计分配利润2,161,723.14元,符合基金合同的规定。

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

在本报告期内(2018年1月1日至2018年6月30日),永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金基金托管人华泰证券股份有限公司按时进行了交易清算,及时完成了基金名下的资金划拨,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,并严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定,履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内, 本托管人依基金合同约定对基金管理人的投资运作行为进行了监督,对本基金资产净值计算、费用开支方面进行了复核,未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本基金2018年上半年度报告中的有关财务数据、净值表现、收益分配、投资组合报告等内容,相关内容真实、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:永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金
报告截止日:2018年06月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	4,132,807.10	5,067,180.55
结算备付金		645,414.29	1,940,887.61
存出保证金		45,946.76	81,202.88
交易性金融资产	6.4.7.2	37,828,940.54	54,831,334.87
其中:股票投资		37,828,940.54	54,831,334.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,768.08	3,332.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		42,654,876.77	61,923,938.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017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		-	-
应付证券清算款		7,326.75	-
应付赎回款		-	4,034.37
应付管理人报酬		55,122.25	78,080.50
应付托管费		7,349.64	10,410.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	86,890.62	246,127.73
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	499,012.93	380,000.00
负债合计		655,702.19	718,653.35
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	45,200,954.54	56,492,789.33
未分配利润	6.4.7.10	-3,201,779.96	4,712,496.02
所有者权益合计		41,999,174.58	61,205,285.35
负债和所有者权益总计		42,654,876.77	61,923,938.70

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.9292元,基金份额总额45,200,954.54份。

6.2 利润表

会计主体:永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金
本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		-3,589,630.99	4,114,427.86
1.利息收入		48,314.30	39,291.66
其中:存款利息收入	6.4.7.11	48,314.30	39,291.66
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)		-1,116,868.65	1,721,034.48
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-1,559,936.29	1,126,169.56
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	9,480.00
股利收益	6.4.7.17	443,067.64	585,384.92
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	-2,531,183.53	2,353,113.01
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.19	10,106.89	988.71
减:二、费用		1,131,702.83	1,678,653.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	395,117.08	422,208.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	52,682.26	56,294.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	564,890.56	1,036,506.47
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	119,012.93	163,643.91
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-4,721,333.82	2,435,774.11
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-4,721,333.82	2,435,774.11

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金
本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	56,492,789.33	4,712,496.02	61,205,285.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,721,333.82	-4,721,333.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-11,291,834.79	-1,031,219.02	-12,323,053.81
其中:1.基金申购款	1,151,960.33	81,919.09	1,233,879.42
2.基金赎回款	-12,443,795.12	-1,113,138.11	-13,556,933.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-2,161,723.14	-2,161,723.14
五、期末所有者权益(基金净值)	45,200,954.54	-3,201,779.96	41,999,174.58
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	59,038,073.20	964,885.43	60,002,958.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,435,774.11	2,435,774.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	8,919,237.05	-1,637,975.96	7,281,261.09
其中:1.基金申购款	25,444,517.65	-973,629.44	24,470,888.21
2.基金赎回款	-16,525,280.60	-664,346.52	-17,189,627.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	67,957,310.25	1,762,683.58	69,719,993.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署:

芦特尔 基金管理人负责人	高利民 主管会计工作负责人	虞俏依 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]1700号文《关于准予永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准,由永赢基金管理有限公司作为管理人自2015年8月17日至2015年8月28日止期间向社会公开发行募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2015)验字第61090672_B11号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年9月1日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币302,044,785.92元,募集资金在募集期间产生的利息为人民币95,463.65元,以上实收基金(本息)共计人民币302,140,249.57元,折合302,140,249.57份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为永赢基金管理有限公司, 基金托管人为华泰证券股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%;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, 现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金参与股指期货交易后,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。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。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号 〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1印花税

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

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.6.2增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改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,自2018年1月1日起,本基金的基金管理人运营本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。对本基金在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,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

城市维护建设税 – 按实际缴纳的流转税的7%计缴。
教育费附加 – 按实际缴纳的流转税的3%计缴。
地方教育附加 – 按实际缴纳的流转税的2%计缴。

6.4.6.4企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

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

6.4.6.5个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

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

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

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

2018年1月,本公司23名原自然人股东将其所持公司股权全部转让给利安资金管理公司(Lion Global Investors Limited)。本次股权变更完成后,本公司股权结构调整为:宁波银行持股71.49%,利安资金持股28.51%。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司("永赢基金")	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构、基金销售机构
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金托管人、基金代销机构
宁波银行股份有限公司("宁波银行")	基金管理人的股东、基金代销机构
利安资金管理公司	基金管理人的股东
华泰期货有限公司("华泰期货")	基金托管人的子公司
永赢资产管理有限公司("永赢资产")	基金管理人的子公司

注:1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据中国证券监督管理委员会2017年12月27日证监许可(2017)2415号《关于核准永赢基金管理有限公司变更股权的批复》,永赢基金管理有限公司原自然人股东将其所持18.51%转让给利安资金管理公司,并于2018年1月10日完成工商变更登记。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	142,948,170.14	28.40%	352,796,018.64	38.93%

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	133,024.32	50.75%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	324,463.61	64.25%	-	-

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	395,117.08	422,208.86
其中:支付销售机构的客户维护费	68,533.30	147,355.99

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×基金管理费年费率/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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	52,682.26	56,294.51

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×基金托管费年费率/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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2015年09月01日)持有的基金份额	10,004,850.00	10,004,850.00
报告期初持有的基金份额	31,078,611.85	10,004,850.00
报告期间申购/买入总份额	-	21,073,761.85
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	31,078,611.85	31,078,611.85
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	68.76%	45.73%

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金报告期末及上年同比期末均无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末无存放于华泰期货的结算备付金余额,本报告期间无发生的基金应支付给华泰期货的交易费用,以及本报告期末无应付华泰期货的交易费用余额。

本基金上年度末存放于华泰期货的结算备付金金额为人民币474,953.29元,上年度可比期间发生的基金应支付给华泰期货的交易费用为124.36元,上年度末无应付华泰期货的交易费用余额。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1公允价值

6.4.10.1.1不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

6.4.10.1.2以公允价值计量的金融工具

6.4.10.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,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中属于第一层次的余额为人民币37,828,940.54元,无属于第二层次和第三层次的余额。

6.4.10.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票、可转换债券、资产支持证券和私募债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别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不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.10.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.10.2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。

6.4.10.3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。

6.4.10.4财务报表的批准

本财务报表已于2018年8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	37,828,940.54	88.69
	其中:股票	37,828,940.54	88.69
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	4,778,221.39	11.20
8	其他各项资产	47,714.84	0.11
9	合计	42,654,876.77	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,052,467.00	7.27
C	制造业	20,192,952.75	48.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	752,279.31	1.79
E	建筑业	757,698.00	1.80
F	批发和零售业	3,771,442.20	8.98
G	交通运输、仓储和邮政业	1,100,037.00	2.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,779,959.00	6.62
J	金融业	1,852,959.00	4.41
K	房地产业	738,072.00	1.76
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	790,050.00	1.88
N	水利、环境和公共设施管理业	746,997.00	1.78
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	1,125,089.28	2.68
S	综合	168,938.00	0.40
	合计	37,828,940.54	90.07

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600081	东风科技	80,500	813,050.00	1.94
2	600618	氯碱化工	94,300	802,493.00	1.91
3	600776	东方通信	165,300	800,052.00	1.90
4	603859	能科股份	45,800	790,050.00	1.88
5	601857	中国石油	102,300	788,733.00	1.88
6	603416	信捷电气	30,300	785,679.00	1.87
7	603169	兰石重装	156,300	783,063.00	1.86
8	603707	健友股份	28,800	781,344.00	1.86
9	600028	中国石化	120,200	780,098.00	1.86
10	600655	豫园股份	82,500	779,625.00	1.86

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	603600	永艺股份	3,413,289.49	5.58
2	601012	隆基股份	3,001,452.11	4.90
3	600188	兖州煤业	2,962,038.00	4.84
4	600299	安迪苏	2,955,719.00	4.83
5	600569	安阳钢铁	2,878,184.00	4.70
6	601991	大唐发电	2,757,048.60	4.50
7	601003	柳钢股份	2,659,893.00	4.35
8	600455	博通股份	2,562,593.92	4.19
9	600272	开开实业	2,430,090.44	3.97
10	601811	新华文轩	2,427,929.00	3.97
11	603566	普莱柯	2,384,966.60	3.90
12	601877	正泰电器	2,364,045.43	3.86
13	600438	通威股份	2,343,893.00	3.83
14	603585	苏利股份	2,255,121.72	3.68
15	600835	上海机电	2,231,227.00	3.65
16	600233	圆通速递	2,220,804.00	3.63
17	600651	飞乐音响	2,208,332.10	3.61
18	601088	中国神华	2,175,117.35	3.55
19	601900	南方传媒	2,143,999.50	3.50
20	601186	中国铁建	2,101,554.00	3.43
21	603025	大豪科技	2,066,097.59	3.38
22	600782	新钢股份	2,029,053.00	3.32
23	603186	华正新材	2,012,847.40	3.29
24	603658	安图生物	1,978,826.03	3.23
25	600746	江苏索普	1,976,815.12	3.23
26	603656	泰禾光电	1,956,258.64	3.20
27	600126	杭钢股份	1,898,993.05	3.10
28	601628	中国人寿	1,859,842.00	3.04
29	600998	九州通	1,806,329.00	2.95
30	603258	电魂网络	1,805,438.00	2.95
31	600754	锦江股份	1,785,576.00	2.92
32	600487	亨通光电	1,778,331.29	2.91
33	600216	浙江医药	1,776,166.00	2.90
34	600426	华鲁恒升	1,773,273.00	2.90
35	603868	飞科电器	1,770,859.00	2.89
36	600519	贵州茅台	1,769,136.46	2.89
37	601155	新城控股	1,766,960.00	2.89
38	603298	杭叉集团	1,750,826.26	2.86
39	600697	欧亚集团	1,739,604.42	2.84
40	600097	开创国际	1,699,897.54	2.78
41	603099	长白山	1,696,103.48	2.77
42	601398	工商银行	1,678,418.00	2.74
43	601800	中国交建	1,673,609.67	2.73
44	600302	标准股份	1,638,929.00	2.68
45	600683	京投发展	1,637,735.00	2.68
46	603223	恒通股份	1,634,090.17	2.67
47	601233	桐昆股份	1,603,213.00	2.62
48	600281	太化股份	1,600,985.00	2.62
49	601866	中远海发	1,600,833.00	2.62
50	600671	天目药业	1,592,031.00	2.60
51	600390	五矿资本	1,574,754.00	2.57
52	603444	吉比特	1,560,229.00	2.55
53	600028	中国石化	1,536,370.00	2.51
54	600612	老凤祥	1,456,960.00	2.38
55	600731	湖南海利	1,431,099.00	2.34
56	600985	雷鸣科化	1,424,222.01	2.33
57	601318	中国平安	1,410,148.00	2.30
58	600864	哈投股份	1,392,859.00	2.28
59	600231	凌钢股份	1,379,651.00	2.25
60	600808	马钢股份	1,376,526.00	2.25
61	601001	大同煤业	1,370,905.00	2.24
62	603090	宏盛股份	1,364,133.00	2.23
63	600851	海欣股份	1,361,421.34	2.22
64	600276	恒瑞医药	1,361,145.00	2.22
65	603595	东尼电子	1,359,933.00	2.22
66	603556	海兴电力	1,289,874.26	2.11
67	601857	中国石油	1,276,799.00	2.09
68	600681	百川能源	1,274,427.00	2.08
69	603908	牧高笛	1,271,718.00	2.08
70	603208	江山欧派	1,263,873.00	2.06

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	600188	兖州煤业	4,043,545.00	6.61
2	603600	永艺股份	3,429,035.60	5.60
3	601012	隆基股份	3,396,211.64	5.55
4	600299	安迪苏	3,068,212.20	5.01
5	600126	杭钢股份	2,838,424.67	4.64
6	601003	柳钢股份	2,727,494.92	4.46
7	600569	安阳钢铁	2,727,416.00	4.46
8	600612	老凤祥	2,473,874.00	4.04
9	601877	正泰电器	2,417,965.49	3.95
10	600272	开开实业	2,409,286.17	3.94
11	603566	普莱柯	2,403,343.04	3.93
12	603025	大豪科技	2,316,699.44	3.79
13	603099	长白山	2,301,079.08	3.76
14	601991	大唐发电	2,215,624.70	3.62
15	600455	博通股份	2,192,854.33	3.58
16	601800	中国交建	2,171,136.44	3.55
17	600808	马钢股份	2,159,974.00	3.53
18	601088	中国神华	2,144,256.00	3.50
19	600651	飞乐音响	2,137,417.00	3.49
20	600835	上海机电	2,133,926.00	3.49
21	603658	安图生物	2,083,885.00	3.40
22	603186	华正新材	2,056,931.70	3.36
23	600302	标准股份	2,043,874.91	3.34
24	601811	新华文轩	2,023,940.89	3.31
25	600708	光明地产	2,009,721.80	3.28
26	600233	圆通速递	1,998,430.00	3.27
27	600380	健康元	1,996,438.00	3.26
28	600782	新钢股份	1,973,532.00	3.22
29	600681	百川能源	1,973,022.26	3.22
30	601628	中国人寿	1,889,383.00	3.09
31	600282	南钢股份	1,872,194.00	3.06
32	603228	景旺电子	1,859,716.68	3.04
33	603225	新凤鸣	1,839,179.90	3.00
34	600746	江苏索普	1,822,915.25	2.98
35	600306	商业城	1,811,064.16	2.96
36	600426	华鲁恒升	1,807,072.00	2.95
37	601155	新城控股	1,802,256.00	2.94
38	603633	徕木股份	1,796,895.03	2.94
39	600097	开创国际	1,790,002.59	2.92
40	600754	锦江股份	1,777,368.00	2.90
41	600104	上汽集团	1,765,673.00	2.88
42	603556	海兴电力	1,753,497.40	2.86
43	603223	恒通股份	1,740,090.06	2.84
44	603421	鼎信通讯	1,730,534.09	2.83
45	600697	欧亚集团	1,713,675.48	2.80
46	601233	桐昆股份	1,664,367.80	2.72
47	600513	联环药业	1,656,295.52	2.71
48	603868	飞科电器	1,590,254.30	2.60
49	601398	工商银行	1,584,645.00	2.59
50	603298	杭叉集团	1,567,636.00	2.56
51	600216	浙江医药	1,560,693.00	2.55
52	603585	苏利股份	1,508,855.16	2.47
53	600377	宁沪高速	1,508,616.00	2.46
54	603258	电魂网络	1,496,664.00	2.45
55	600276	恒瑞医药	1,492,958.00	2.44
56	600281	太化股份	1,474,730.00	2.41
57	601006	大秦铁路	1,465,595.00	2.39
58	600398	海澜之家	1,462,046.00	2.39
59	601318	中国平安	1,435,072.00	2.34
60	603090	宏盛股份	1,405,961.00	2.30
61	603288	海天味业	1,393,736.35	2.28
62	600438	通威股份	1,386,035.00	2.26
63	600566	济川药业	1,357,102.00	2.22
64	600548	深高速	1,349,969.00	2.21
65	601001	大同煤业	1,327,310.00	2.17
66	601225	陕西煤业	1,326,605.00	2.17
67	603656	泰禾光电	1,312,445.40	2.14
68	600864	哈投股份	1,294,870.00	2.12
69	600309	万华化学	1,291,837.00	2.11
70	603908	牧高笛	1,287,745.00	2.10
71	603100	川仪股份	1,281,207.00	2.09
72	603518	维格娜丝	1,277,000.00	2.09
73	600483	福能股份	1,268,414.20	2.07
74	601900	南方传媒	1,229,728.68	2.01
75	600755	厦门国贸	1,227,335.00	2.01
76	603208	江山欧派	1,224,492.40	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	245,226,233.00
卖出股票收入(成交)总额	258,137,507.51

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(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前十名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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期内没有出现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、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	45,946.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,768.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,714.84

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
558	81,005.29	31,078,611.85	68.76%	14,122,342.69	31.24%

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	441,453.79	0.98%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

8.4发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	31,078,611.85	68.76%	10,004,850.00	22.13%	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	159,004.39	0.35%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	31,237,616.24	69.11%	10,004,850.00	22.13%	-

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年09月01日)基金份额总额	302,140,249.57
本报告期期初基金份额总额	56,492,789.33
本报告期基金总申购份额	1,151,960.33
减:本报告期基金总赎回份额	12,443,795.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,200,954.54

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金管理人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,本基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内,本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本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
信达证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	142,948,170.14	28.40%	133,024.32	50.75%	-
申万宏源证券	2	283,246,002.89	56.27%	103,516.36	39.50%	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	77,135,977.48	15.33%	25,554.89	9.75%	-
国元证券	2	-	-	-	-	新增

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018年1月1日-2018年6月30日	31,078,611.85	0.00	0.00	31,078,611.85	68.76%
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,存在可能因投资者的大额申购或赎回造成基金份额波动的风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

永赢基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日