

基金管理人：银华基金管理股份有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2019年4月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2019年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况	
基金名称	银华中证800等权重指数分级基金
场内简称	银华800
交易代码	150108
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月26日
报告期末基金份额总额	29,406,700.00份
投资目标	本基金以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采取被动投资策略，以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。本基金主要投资于中证800等权重指数的成份股及备选成份股，其中投资于中证800等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的85%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	中证800等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益特征，其预期收益和风险水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的交易代码	150108 150139 150125
报告期末下分级基金资产净值	1,696,262,000.00 1,696,262,000.00 30,712,072.00元
报告期末下分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳健、低风险、高风险、预期收益。

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年1月1日 - 2019年3月31日）
1.本期已实现收益	1,526,027.97
2.本期利润	8,690,528.17
3.本期归属于母基金的所有者权益	0.0394
4.期末基金资产净值	1,696,262,000.00
5.期末基金份额净值	0.0694

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.上述本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

阶段 1 本报告期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	净值增长率 ①	净值增长率标准差 ②	业绩比较基准 收益率③	净值增长率与业绩比较基准 收益率之差④	①-③	②-④
过去三个月	30.37%	1.64%	30.77%	1.61%	-0.40%	-0.07%

基金管理人：银华基金管理股份有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2019年4月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2019年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况	
基金名称	银华中证800等权重指数分级基金
场内简称	银华800
交易代码	150108
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月26日
报告期末基金份额总额	6,721,891,780.00份
投资目标	本基金采用被动投资策略，紧密跟踪标的指数，力求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用被动投资策略，紧密跟踪标的指数，力求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金主要投资于中证800等权重指数的成份股及备选成份股，其中投资于中证800等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的85%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	中证800等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益特征，其预期收益和风险水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的交易代码	150108 150139 150125
报告期末下分级基金资产净值	1,696,262,000.00 1,696,262,000.00 30,712,072.00元
报告期末下分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳健、低风险、高风险、预期收益。

注：本基金合同生效以来本基金资产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：本基金合同生效日期为2018年10月22日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

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
报告送出日期：2019年04月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2019年04月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2019年01月01日起至03月31日止。

基金产品概况	
基金名称	永赢鑫利债券型证券投资基金
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月26日
报告期末基金份额总额	1,030,446,772.00份
投资目标	本基金以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采取被动投资策略，以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。本基金主要投资于中证800等权重指数的成份股及备选成份股，其中投资于中证800等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的85%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	中证800等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益特征，其预期收益和风险水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
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
下属分级基金的交易代码	000007 000008
报告期末下分级基金资产净值	1,030,446,772.00 1,030,446,772.00

§3 主要财务指标和基金净值表现						
单位：人民币元						
主要财务指标	报告期（2019年1月1日 - 2019年3月31日）					
1.本期利润总额	1,030,446,772.00					
2.本期净利润	1,030,446,772.00					
3.本期归属于母基金的所有者权益	0.0404					
4.期末基金资产净值	1,030,446,772.00					
5.期末基金份额净值	1.1076					
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.上述本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率水平要低于所列数字。						
3.21 基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较						
阶段	净值增长率A	净值增长率B	业绩比较基准收益率C	净值增长率A-B	1-3	2-4
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
注：1.本基金合同生效以来本基金资产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						

银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金

2019年第一季度报告

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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：1.本基金合同生效以来基金资产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：2.上述本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率水平要低于所列数字。

注：3.22 自基金合同生效以来基金资产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：4.1 基金管理人（或基金托管人）简介

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2019年4月18日

基金产品概况	
基金名称	银华中证800等权重指数增强分级基金
场内简称	银华800
交易代码	150108
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月26日
报告期末基金份额总额	29,406,700.00份
投资目标	本基金以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采取被动投资策略，以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。本基金主要投资于中证800等权重指数的成份股及备选成份股，其中投资于中证800等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的85%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	中证800等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益特征，其预期收益和风险水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的交易代码	150108 150139 150125
报告期末下分级基金资产净值	1,696,262,000.00 1,696,262,000.00 30,712,072.00元
报告期末下分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳健、低风险、高风险、预期收益。

银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

姓名	职务	在本基金的基金经理期间		证券从业年限	说明
		自任职日期	离任日期		
					硕士学位，毕业于中国人民大学，2008年7月加盟银华基金管理有限公司，曾任银华基金金誉有限公司风控合规部高级研究员及基金管理部研究员等职。自2011年9月20日起至2014年11月6日担任过银华乐享300指数证券投资基金（LOF）基金经理职务。自2016年2月20日起兼任银华乐享中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金的基金经理职务。

理相结合的方式模拟基金日常运作中所碰到的申购赎回压力，结构配比校验、风险优化等一系列事件，通过预先进行压力测试，争取上市后将基金的跟踪误差控制在合理水平，并取得一定的相对收益。

展望2019年第一季度，我们对市场持谨慎乐观态度。随着市场趋近活跃，市场整体风险偏好有所提升。一季度市场的大幅上涨，使得前期市场悲观情绪已经得到很好地释放，中美贸易谈判预期利好以及MSCI扩大入大企业因子等都将为A股带来持续正面影响。同时，美股大幅波动、美国和欧洲经济数据走弱，也会带动投资者对全球经济增长预期下降。我们对二季度市场持谨慎乐观态度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

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	001087	中国石化	150,136,006	1,141,430,286.00	31.22
2	001766	中国中车	29,284,600	296,400,224.00	8.16
3	001939	招商港口	10,291,776	227,121,974.90	6.16
4	001889	中国国航	3,989,124	239,477,000.00	6.59
5	600710	华阳股份	27,144,000	196,256,126.71	5.42
6	000848	华鲁化工	13,651,513	194,389,547.80	5.40
7	001989	富荣特钢	32,721,778	189,486,912.80	5.13

银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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：1.本基金合同生效以来基金资产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：2.上述本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率水平要低于所列数字。

注：3.22 自基金合同生效以来基金资产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：4.1 基金管理人（或基金托管人）简介

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

报告送出日期：2019年04月18日

基金产品概况	
基金名称	永赢鑫利债券型证券投资基金
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月26日
报告期末基金份额总额	1,030,446,772.00份
投资目标	本基金以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采取被动投资策略，以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。本基金主要投资于中证800等权重指数的成份股及备选成份股，其中投资于中证800等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的85%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	中证800等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益特征，其预期收益和风险水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
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
下属分级基金的交易代码	000007 000008
报告期末下分级基金资产净值	1,030,446,772.00 1,030,446,772.00

4	会费摊销	187,540.000000	18.20
5	企业短期债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换)	-	-
8	债券回购	203,360.000000	19.73
9	其他	-	-
10	合计	1,222,620.000000	118.63

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	162894	16国债附息1	1,000,000	102,400,000.00	0.94
2	172322	17国开债02	1,000,000	101,880,000.00	0.93
3	173840	17年清扬转债	900,000	66,778,000.00	0.29
4	162301	16广发转债	850,000	69,000,000.00	0.62
5	162004	16浦发转债	700,000	71,631,000.00	0.65

5.6 报告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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金持有的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告

5.11.1 报告期末前十大重仓股的发行主体

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,通过投资交易系统对公平交易机制,以尽可能确保公平对待待投资组合。

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与交易行为事后分析,分别于每季度和年度对所管理的不连续投资组合的整体收益差异、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间交易的交易价差进行分析,通过事后评估和信息披露加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期末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,未发现异常交易及不公平交易行为。本报告报告期内,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显著不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度,国内债券市场出现震荡格局,主要分为以下几个阶段:春节前后,在资金宽松推动下,债券利率下行,且中短端下行幅度大于长端;春节后公布的1月社融超预期超预期,而A股行情启动并快速上涨,对债券形成压力;各期限利率开始反升;进入3月,2月金融数据企稳但总体符合预期,债券收益率窄幅震荡,但下旬海外经济走弱,美联储货币政策转向鸽派,国内二季度降准降息预期增强,债券收益率再次出现下行。一季度,本基金对债券市场走势趋于谨慎,资产组合久期有所降低。

4.5 报告期内基金的投资业绩表现

截至报告期末永赢盛益债券A基金份额净值为1.0040元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为0.58%,同期业绩比较基准收益率为0.47%;截至报告期末永赢盛益债券C基金份额净值为0.9101元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为0.80%,同期业绩比较基准收益率为0.47%。

4.6 报告期内基金持有人数及基金资产净值预警说明

本报告期末基金管理人无应说明的预警信息。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

永赢宏益债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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：1.本基金合同生效以来基金资产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：2.上述本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率水平要低于所列数字。

注：3.22 自基金合同生效以来基金资产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：4.1 基金管理人（或基金托管人）简介

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

报告送出日期：2019年04月18日

基金产品概况	
基金名称	永赢鑫利债券型证券投资基金
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月26日
报告期末基金份额总额	1,030,446,772.00份
投资目标	本基金以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采取被动投资策略，以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。本基金主要投资于中证800等权重指数的成份股及备选成份股，其中投资于中证800等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的85%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	中证800等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益特征，其预期收益和风险水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
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
下属分级基金的交易代码	000007 000008
报告期末下分级基金资产净值	1,030,446,772.00 1,030,446,772.00

7	银行存款和结算备付金合计	57,966,164.30	0.77
8	应收资产	201,286,240.00	0.27
9	合计	7,902,162,165.04	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	1,569,940,393.13	21.34
B	医药	2,913,381,762.48	36.97
C	制造业	640,764,203.28	8.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	691,600,356.63	8.75
E	建筑业	7,673,166.00	0.10
F	信息技术服务业	364,427,852.79	4.62
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	559,170,043.93	7.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	134,344,000.00	1.70
J	金融业	431,619,115.67	5.46
K	房地产业	209,477,003.92	2.65
L	批发和零售业	6,320,366.00	0.08
M	公共管理和社会组织	—	—
N	其他行业	—	—
O	国防军工、建筑业和其他服务业	—	—
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		7,424,320,004.54	94.04

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

5.3 报告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

5.1.0 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.1 投资组合报告附注

5.1.1.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在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、处罚的情况。

5.1.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情况。

5.1.1.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	925,761.89
2	应收证券清算款	19,064,719.27
3	应收股利	—
4	应收利息	19,023.74
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	70,714,540
8	其他	—
9	合计	19,230,344.90

5.1.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.1.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.1.1.6 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，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期初基金份额总额	7,329,881,790.00
报告期内申购基金份额总额	48,000,000.00
减：报告期内基金份额赎回份额	546,000,000.00
报告期末基金份额总额	7,329,881,790.00
报告期内基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	—
报告期末基金份额净增加额	

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	10,681,722	0.08
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	-	-
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	教育、体育和娱乐业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	其他	10,681,722	0.08

基金产品概况	
基金名称	永赢鑫利债券型证券投资基金
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月26日
报告期末基金份额总额	1,030,446,772.00份
投资目标	本基金以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采取被动投资策略，以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。本基金主要投资于中证800等权重指数的成份股及备选成份股，其中投资于中证800等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的85%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	中证800等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益特征，其预期收益和风险水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
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
下属分级基金的交易代码	000007 000008
报告期末下分级基金资产净值	1,030,446,772.00 1,030,446,772.00

数证券投资基金

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	001897	中国国航	150,136,000	1,141,024,280.00	15.22
2	001766	中国石化	29,204,640	296,490,224.00	3.96
3	001099	招商局A	10,291,796	237,121,574.40	3.16
4	001088	中国国航	2,089,124	239,477,000.00	3.29
5	600010	宝钢股份	27,144,569	196,265,436.31	2.62
6	600040	保利地产	13,661,813	194,397,546.12	2.59
7	001389	中国国航	32,271,736	198,466,332.60	2.61
8	600050	中国联通	5,579,500	172,229,521.00	2.30
9	601398	工商银行	8,723,221	171,983,344.31	2.28
10	600096	长江电力	9,661,522	162,221,280.40	2.17

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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	1,599,940,981.11	21.84
C	制造业	2,931,381,762.48	39.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	691,500,306.53	9.52
E	建筑业	7,675,556.00	0.10
F	批发和零售业	362,427,852.77	4.83
G	交通运输、仓储和邮政业	569,179,943.33	7.76
H	住宿和餐饮业	134,248,000.00	1.83
I	信息传输、软件和信息技术服务业	431,259,132.62	5.79
J	金融业	269,477,900.02	3.59
K	房地产业	8,340,890.00	0.11
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	教育、体育和娱乐业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	其他	-	-
合计	-	7,424,301,804.54	99.04

基金产品概况	
基金名称	永赢鑫利债券型证券投资基金
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月26日
报告期末基金份额总额	1,030,446,772.00份
投资目标	本基金以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采取被动投资策略，以中证800等权重指数为标的指数，在有效控制投资组合跟踪误差的前提下，力争实现基金份额净值增长率持续超越业绩比较基准。本基金主要投资于中证800等权重指数的成份股及备选成份股，其中投资于中证800等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的85%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	中证800等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益特征，其预期收益和风险水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
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
下属分级基金的交易代码	000007 000008
报告期末下分级基金资产净值	