

# 永赢稳健增强债券型证券投资基金

2022年第1季度报告

2022年03月31日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年04月22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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年4月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年03月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	永赢稳健增强债券
基金主代码	014088
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月28日
报告期末基金份额总额	2,269,196,007.10份
投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策及资本市场资金环境的研究，综合运用资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略等多种投资策略。在做好风险管理的基础上，运用多样化的投资策略追求基金资产的稳定增值。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风</p>

险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

## 2、股票投资策略

### （1）A股投资策略

在资产配置的基础上，本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。

### （2）港股通标的投资策略

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注：相对A股有稀缺性行业与个股，对资本有显著的吸引力，具有较高的配置价值；具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业具有良好成长性或高额股东回报率；盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的上市公司；相对 A 股同类公司具有显著的估值优势的公司。

### （3）存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

## 3、固定收益类资产投资策略

本基金的债券投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的，具有良好流动性的金融工具。债券投资主要用于提高非股票资产的收益率，严格控制风险，追求合理的回报。本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。

### （1）久期策略

本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市

场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。

### （2）收益率曲线策略

本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。

### （3）信用策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响，相应地采用以下两种投资策略：

A. 信用利差曲线变化策略：首先分析经济周期和相关市场变化情况，其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势，最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定本基金信用债分行业投资比例。

B. 信用变化策略：信用债信用等级发生变化后，本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。

本基金将根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

本基金投资的信用债主体评级或债项评级不低于AA+（含），其中评级为AA+的信用债占信用债资产比例不超过50%，评级为AAA的信用债占信用债资产比例高于50%。本基金对信用债评级的认定主要参照基金管理人选定的评级机构出具的信用评级，可以结合基金管理人的内部信用评级进行综合认定。基金持有信用债期间，如果其评级下降、基金规模变动、变现信用债支付赎回款项等使得投资比例不再符合上述约定，应在评级报告发布之日或不再符合上述

约定之日起3个月内调整至符合约定。所指信用债包括金融债（不包括政策性金融债）、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、证券公司短期公司债券。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合上述比例要求。

#### （4）息差策略

息差策略操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在息差空间，从而确定是否进行正回购。进行息差策略操作时，基金管理人将严格控制回购比例以及信用风险和期限错配风险。

#### （5）证券公司短期公司债券投资策略

本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。

#### 4、可转换债券、可交换债券投资策略

本基金在综合分析可转换债券、可交换债券的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上，审慎筛选其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，以及基础股票基本面优良的品种，并以合理的价格买入，争取稳健的投资回报。

本基金投资于可转换债券（含分离交易可转债）及可交换债券的比例合计不超过基金资产的20%。

#### 5、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券、住房抵押贷款支持证券等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡罗方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相

	对投资价值并做出相应的投资决策。	
	6、国债期货投资策略 本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以期萃取相应债券组合的超额收益。 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，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深300指数收益率*8%+恒生综合指数收益率*2%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	永赢稳健增强债券A	永赢稳健增强债券C
下属分级基金的交易代码	014088	014089
报告期末下属分级基金的份额总额	925,717,419.47份	1,343,478,587.63份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年01月01日 - 2022年03月31日)	
	永赢稳健增强债券A	永赢稳健增强债券C
1. 本期已实现收益	-4,786,912.85	-8,382,948.55
2. 本期利润	-14,244,054.82	-22,189,356.13
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0146	-0.0155
4. 期末基金资产净值	912,358,551.62	1,322,741,816.77
5. 期末基金份额净值	0.9856	0.9846

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

永赢稳健增强债券A净值表现

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.44%	0.15%	-1.29%	0.17%	-0.15%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-1.44%	0.14%	-1.08%	0.17%	-0.36%	-0.03%

永赢稳健增强债券C净值表现

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.54%	0.15%	-1.29%	0.17%	-0.25%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-1.54%	0.15%	-1.08%	0.17%	-0.46%	-0.02%

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

永赢稳健增强债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 12 月 28 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

2、本基金建仓期为本基金合同生效日起六个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

永赢稳健增强债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 12 月 28 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

2、本基金建仓期为本基金合同生效日起六个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。



## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
常远	基金经理	2021-12-28	-	10	常远先生，同济大学理学博士，10年证券相关从业经验。曾任易方达基金管理有限公司权益投资部基金经理，现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。
杨凡颖	固定收益投资部总监助理/基金经理	2021-12-30	-	11	杨凡颖女士，厦门大学经济学硕士，11年证券相关从业经验。曾任鹏华基金管理有限公司固定收益部高级研究员、基金经理助理、社保投资助理，兴银基金管理有限责任公司固定策略分析部总经理兼基金经理，永赢基金管理有限公司固定收益投资部投资经理。现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部总监助理。
余国豪	基金经理助理	2021-12-27	-	6	余国豪先生，硕士，6年证券相关从业经验。曾任兴业基金管理有限公司固定收益研究员，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理助理。

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行业协会《证券业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、《永赢稳健增强债券型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 公平交易专项说明

### 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间交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

债券市场方面，2022年一季度实体经济受疫情冲击先起后落，年初经济数据全面改善，工业生产反弹、出口韧性仍存、投资显著回升，但3月中旬后多地疫情爆发，对消费生产活动造成明显冲击，同时房地产下行态势仍待扭转。融资方面，年初信贷开门红兑现但2月表现低迷，合并1-2月来看融资总量不弱但结构较差，房地产市场疲软对居民和企业融资需求均构成拖累。通胀方面，CPI和核心CPI延续低位震荡，工业品价格上行拉动PPI环比回升，同比在高基数压制下延续回落。

政策方面，两会设定5.5%左右增速目标体现稳增长诉求，货币政策维持平稳偏松，年初MLF利率调降、防止“信贷塌方”等表述体现强烈宽信用意愿。货币政策先行后，财政、产业财政跟随发力并逐步成为主导，一季度地方债发行以及项目开工节奏均较往年明显加快，各地取消房地产限购、限售等政策陆续出台，同时放松力度逐步加大。

一季度利率走势以春节为节点，呈现先下后上的V型走势，市场由宽货币交易逐步切换至宽信用预期。具体而言，春节前在央行降息、官员讲话推动下收益率显著下行；节后伴随信贷开门红落地、地产放松政策密集出台，市场宽信用预期逐步发酵，极端情绪出现修正，带动收益率震荡回升；3月中旬以来随着国内疫情发酵，市场收益率再度小幅回落。总体上一季度末10年国债相对去年末上行1bp。

报告期内，组合根据市场情况积极进行了久期的灵活调节，在3月信用债市场大幅回撤时努力控制组合回撤。同时，积极进行信用债个券交易，增厚组合收益。展望二季度，我们认为在宽松的货币政策环境及目前相对较高的信用利差背景下，信用债具备较好的配置价值，我们将继续在严控信用风险的前提下，灵活调整久期，同时挖掘个券进行配置和交易，努力为持有人创造收益。

权益市场方面，2022年一季度受地产政策调控和疫情反复影响，国内经济阶段性下行压力加大。海外主要经济体在通胀大幅上行的压力下，美联储开始货币紧缩和逐步加息的步伐。而突如其来的“俄乌战争”又加剧了权益市场的不确定性。在上述多重不利因素的影响，权益市场在一季度震荡下行，期间上证指数涨幅为-10.65%，沪深300指数下跌14.53%，创业板指数下跌19.96%，恒生科技指数下跌19.63%。

从申万标准划分的31个行业看，一季度煤炭、房地产、综合、银行等行业指数涨幅靠前，也仅这四个行业取得正收益。电子、国防军工、汽车、家用电器等行业指数跌幅较大。一季度基金的股票持仓始终保持在10%以内的较低水平，在市场调整过程中，择机布局了一批具备较高投资性价比的标的，并且坚持了行业相对分散的配置策略，在金融、化工、地产、白酒、锂电、军工、煤炭、电子等行业都有少量布局。

展望未来一个季度，从宏观角度看，国内经济复苏的力度是核心的关注点。短期本土疫情对经济的冲击相信经过此次管控之后，未来的管理将会更加完善，对社会经济造成的损失也将降到更低的水平。同时，上游资源品价格、美国货币紧缩是相对偏长的影响因素，需要持续的考量其对于市场的影响。

整体看，权益市场目前的估值已经回到了一个相对偏低的位置，未来基于疫情得到管控和国际政治局势缓和的预期，我们可以对权益市场持有更加乐观的态度。对于权益市场而言，核心还是要选择质地优秀和盈利置信度较好的公司，历史上看优质企业才是穿越牛熊的根本所在。

未来一段时间，本基金将更高效利用目前的权益仓位，适度通过交易力争积累一定的安全边际，并且考虑在性价比合适的时候，逐步增加权益持仓。本基金将继续秉承优选个股、均衡配置思路，积极通过自下而上深度挖掘个股投资机会，平衡各行业持仓配置来争取稳定而优异的回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢稳健增强债券A基金份额净值为0.9856元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.44%，同期业绩比较基准收益率为-1.29%；截至报告期末永赢稳

健增强债券C基金份额净值为0.9846元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.54%，同期业绩比较基准收益率为-1.29%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	227,873,144.54	10.18
	其中：股票	227,873,144.54	10.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,719,425,565.29	76.84
	其中：债券	1,719,425,565.29	76.84
	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	230,112,121.97	10.28
	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	59,765,791.31	2.67
8	其他资产	458,715.98	0.02
9	合计	2,237,635,339.09	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币9,842,368.70元，占期末净值比例0.44%。

#### 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、渔业	-	-
B	采矿业	32,125,266.40	1.44
C	制造业	126,995,514.44	5.68

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	29,853,720.00	1.34
K	房地产业	29,056,275.00	1.30
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	218,030,775.84	9.75

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	4,015,553.81	0.18
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	5,826,814.89	0.26

公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	9,842,368.70	0.44

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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细

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	600036	招商银行	637,900	29,853,720.00	1.34
2	002304	洋河股份	145,500	19,734,165.00	0.88
3	601088	中国神华	570,700	16,989,739.00	0.76
4	688776	国光电气	117,020	16,957,368.20	0.76
5	600426	华鲁恒升	513,472	16,723,783.04	0.75
6	000858	五粮液	97,200	15,071,832.00	0.67
7	600048	保利发展	850,200	15,048,540.00	0.67
8	002466	天齐锂业	173,400	14,113,026.00	0.63
9	000537	广宇发展	823,500	14,007,735.00	0.63
10	002460	赣锋锂业	105,300	13,230,945.00	0.59

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	40,675,911.60	1.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	735,689,982.46	32.92
	其中：政策性金融债	336,681,424.65	15.06
4	企业债券	368,445,856.45	16.48
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	574,613,814.78	25.71
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,719,425,565.29	76.93

**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（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	210206	21国开06	800,000	81,902,158.90	3.66
2	1828002	18农业银行二级01	600,000	63,537,846.58	2.84
3	1828006	18中国银行二级01	600,000	63,345,376.44	2.83
4	210208	21国开08	600,000	61,076,367.12	2.73
5	210218	21国开18	600,000	60,824,761.64	2.72

**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**

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。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**5.11 投资组合报告附注**

5.11.1 本报告期内,基金投资的前十名证券的发行主体中信银行股份有限公司、国家开发银行、中国农业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年受到行政处罚,处罚金额分别合计为290万元、440万元、630万元、7470万元、9241万元。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11.2 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。

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	418,117.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,598.03
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	458,715.98

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告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。

#### 5.11.6 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢稳健增强债券A	永赢稳健增强债券C
报告期期初基金份额总额	980,479,770.05	1,431,680,297.83
报告期期间基金总申购份额	40,534.27	3,809.62
减：报告期期间基金总赎回份额	54,802,884.85	88,205,519.82
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	925,717,419.47	1,343,478,587.63

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	永赢稳健增强债券A	永赢稳健增强债券C
报告期期初管理人持有的本基金份 额	10,000,350.00	-



报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,350.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.44	-

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予永赢稳健增强债券型证券投资基金注册的文件；
2. 《永赢稳健增强债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢稳健增强债券型证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢稳健增强债券型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。

### 9.2 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21世纪大厦21、22、27层

### 9.3 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](http://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

2022年04月22日