

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

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 30 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年03月28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。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年12月31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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	18
4.10 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	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	24
7.3 净资产（基金净值）变动表	26
7.4 报表附注	29
§8 投资组合报告	63
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	64
8.3 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	65
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
8.6 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	76
8.7 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	76
8.8 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	77
8.9 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	77

8.10 本基金投资股指期货的投资政策	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77
8.12 投资组合报告附注	77
§9 基金份额持有人信息	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
9.3 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	78
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	78
§10 开放式基金份额变动	79
§11 重大事件揭示	79
11.1 基金份额持有人大会决议	79
11.2 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	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4 基金投资策略的改变	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	82
§12 影响投资者决策的其他重要信息	84
12.1 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	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	84
13.3 查阅方式	84

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	永赢惠泽一年
基金主代码	006836
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年06月05日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	274,880,533.75份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对宏观经济现状及趋势分析、相关政策研究的角度出发，自上而下地分析影响股票、债券、货币市场的各种关键因素，灵活配置大类资产，同时辅以自下而上地个股精选，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	目前国内宏观经济、产业政策、金融市场等多方面时刻面临着巨大且深刻的变化，本基金采用大类资产轮动配置模型驱动的投资策略进行基金资产灵活配置。本基金将资产配置与经济周期结合，形成大类资产配置策略。利用永赢基金自主研发的资产配置模型，结合经济周期表现，通过大类资产轮动切换配置、多风格的动态组合管理寻找具有投资价值的行业和个股，并对所挑选的投资标的进行资产配置和组合动态管理，实现长期稳定的投资收益。大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、开放期投资策略。

业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中风险和中等预期收益产品。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰
	联系电话	021-20430340
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com
客户服务电话	400-805-8888	95555
传真	021-51690177	0755-83195201
注册地址	浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	马宇晖	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	永赢基金管理有限公司	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2022年	2021年	2020年
本期已实现收益	-10,498,442.67	89,775,525.14	108,394,934.72
本期利润	-65,659,134.61	24,349,349.01	192,498,402.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1438	0.0403	0.4093
本期加权平均净值利润率	-10.36%	2.75%	31.90%
本期基金份额净值增长率	-8.91%	1.92%	35.10%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	98,132,677.42	265,226,115.51	153,911,139.96
期末可供分配基金份额利润	0.3570	0.4263	0.2603
期末基金资产净值	373,013,211.17	926,923,342.11	864,198,903.70
期末基金份额净值	1.3570	1.4897	1.4616
3.1.3 累计期末指标	2022年末	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	35.70%	48.97%	46.16%

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	0.63%	0.52%	0.70%	0.64%	-0.07%	-0.12%
过去六个月	-5.00%	0.52%	-6.85%	0.55%	1.85%	-0.03%
过去一年	-8.91%	0.66%	-10.80%	0.64%	1.89%	0.02%
过去三年	25.43%	0.71%	0.03%	0.64%	25.40%	0.07%
自基金合同生效起至今	35.70%	0.68%	7.53%	0.62%	28.17%	0.06%

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：沪深300指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

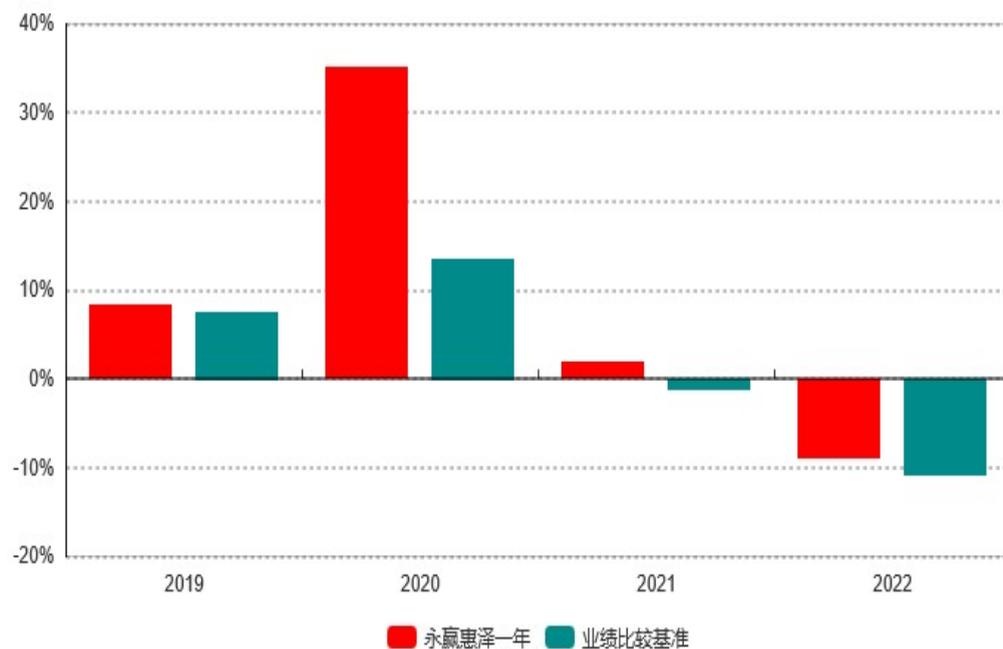
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年06月05日-2022年12月31日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2019年6月5日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年均未进行利润分配。

§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%，华侨银行有限公司持股28.51%。

截止2022年12月31日，本基金管理人共管理114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、永赢润益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢嘉益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盛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、永赢诚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、永赢合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、永赢中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、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指数型发起式证券投资基金、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、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、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、永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金、永赢中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金、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、永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金、永赢瑞宁87个月定期开放债券型证券投资基金、永赢成长领航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、永赢泰宁63个月定期开放债券型证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢鑫享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、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、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、永赢深证创新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、永赢深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、永赢合享混合型发起式证券投资基金、永赢安盈90天滚动持有债券型发起式证券投资基金、永赢优质精选混合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、永赢养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、永赢卓越臻选股票型发起式证券投资基金、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、永赢消费龙头智选混合型发起式证券投资基金、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。

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		
李永兴	副总经理/基金经理	2019-06-05	-	16	李永兴先生，北京大学经济学硕士。16年证券相关从业经验。曾担任交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理；九泰基金管理有限公司投资总监；永赢基金管理有限公司总经理助理。现任永赢基金管理有限公司副总经理。
牟琼屿	基金经理	2019-06-05	-	13	牟琼屿女士，中国人民大学经济学硕士，13年证券相关从业经验。曾任中融国际信托固定收益部交易员，国开证券固定收益部投资经理，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。
万纯	权益投资部指数与数量投资部副总监/基金经理	2019-07-01	2022-12-22	8	万纯先生，北京大学硕士，8年证券相关从业经验

					。曾任中国证券登记结算有限责任公司技术部基金业务组经理助理，平安基金管理有限公司指数投资部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司权益投资部指数与数量投资部副总监（主持工作）兼权益投资部智能投研部副总监（主持工作）。
张璐	基金经理助理	2022-07-22	2022-11-07	8	张璐先生，上海交通大学硕士研究生，8年证券相关从业经验。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化研究员，华泰证券（上海）资产管理有限公司量化研究员、基金经理，锐方（上海）投资管理有限公司投资经理，永赢基金管理有限公司投资经理，现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。
储可凡	基金经理助理	2022-11-07	-	6	储可凡女士，清华大学应用统计硕士，6年证券相关从业经验。曾任中银国际证券股份有限公司基金经理助理，现任永赢基金管理有限公司权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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢惠泽一年定期开放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 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限；投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预；基金经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同基金经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。另外，本基金管理人还建立机制要求公募基金经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进

行的交易，各基金经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后分析，确保交易得到公平和公允的执行；对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，基金经理须提出申请并阐明具体原因，交由投资决策委员会进行严格的公平性审核；（4）严格控制同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外），确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生同日反向交易的，相关基金经理须向风险控制委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面，风险管理部开展定期分析工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了对非公开发行股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，以及对非连续竞价交易的价格公允性进行审查；事后分析评估上，风险管理部在每个季度的公平交易与异常交易稽核中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.3 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2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

2022年在地产周期回落、疫情扰动压制下，经济内生动能疲弱是贯穿全年的主线，反映内需的消费、居民信贷、地产投资、核心通胀等数据持续疲弱，外需下半年伴随积压订单的消耗也转为下行。与此同时，稳增长政策持续发力，地产放松政策密集落地、准财政工具积极扩容、货币政策配合宽松，基建投资和制造业维持较高增速，对经济总量形成托底效应。实体以外，通胀表现符合预期，PPI高位回落、CPI小幅回升，通胀水平整体处在温和区间。

股市表现上，2022年A股在疫情反复、内需疲弱、海外高通胀与流动性收紧、地缘政治等多重扰动下整体下行。四季度，防疫政策优化、海外加息边际放缓、稳增长政策不断加码，市场在复苏预期下反弹幅度可观。风格层面，以红利指数为代表的价值风格全年跑赢，大小盘风格分化不明显。行业层面，一到十月份，全球能源价格高企背景下煤炭行业一枝独秀，三十一个申万行业中仅煤炭取得正收益；年末反弹行情中，疫后复苏逻辑下食品饮料、社会服务、美容护理、商贸零售等消费板块以及稳增长相关的房地产、建材、银行等行业均取得15%以上的涨幅。

债市表现上，利率全年以震荡为主，上半年利率整体窄幅震荡，下半年伴随疫情扩散，央行降息，收益率快速下行。四季度，疫情防控优化政策、地产融资支持政策陆续落地，同时银行间资金价格向政策利率回归，债市下跌引发理财赎回的恶性循环，市场出现大幅调整，并创下年内高点。12月央行加大资金面呵护力度，市场情绪逐步修复，利率开始企稳回落。信用债方面，在疫情扩散、经济下行、理财规模增长等因素的共同作用下，1-10月收益率震荡下行，信用利差一度接近历史极值分位数水平。11月信用债市场大幅调整，其中流动性弱的长久期中低资质调整最大、达110BP左右，等级利差走阔；12月中下旬以来，受益于宽松资金面以及信用债超调后配置价值提升，高等级信用债需求回暖、收益率下行，其中短端中高等级下行幅度最大，达40BP左右，但中低等级信用债市场需求依然较弱，信用利差维持高位。

报告期内，本基金采用"自上而下"的研究方法，结合流动性和基本面边际变化情况，利用自主研发的资产配置模型合理确定本基金在股票、债券等各类资产类别的投资比例。股票部分，关注货币政策和利率走势，跟踪行业间景气度变化及市场风格趋势性切换的可能性，积极把握股票市场结构性机会。债券部分，本基金重点结合市场预期变化和货币政策走势等开展投资交易，一季度整体维持谨慎操作，主要持有中短久期品种，以票息杠杆策略为主。二、三季度主要关注在疫情扰动压制下，基本面下

行压力显著，货币政策宽松配合，因此，操作上从之前的票息策略转向久期策略。四季度稳增长持续发力，地产放松政策密集落地，防疫政策优化，操作上转为防御，相较于三季度末，四季度末产品杠杆和久期均明显下降。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢惠泽一年基金份额净值为1.3570元，本报告期内，基金份额净值增长率为-8.91%，同期业绩比较基准收益率为-10.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2023年，复苏是全年经济的主基调，修复幅度取决于内外需对冲结果。从需求侧来看，今年外需整体承压，出口下行压力将进一步加大，扩大内需是稳增长的核心重点，其中上半年经济的抓手关键在于基建、制造业投资，下半年关键在于消费和地产投资。通胀方面，预计今年PPI低位震荡、CPI先下后上，整体通胀环境相对温和。在稳增长诉求下，今年财政政策仍需保持积极，准财政工具大概率进一步加码，对广义财政形成重要补充；货币环境整体仍偏宽，但边际上将较2022年收敛，狭义流动性极度宽松的状态难以再现。对债券市场而言，2023年经济复苏对利率构成一定压制，同时净值化改革后的理财市场易阶段性放大市场波动。在利率波动增强的环境下，票息策略优于久期策略，同时需要重点关注银行资本管理新办法以及银行理财产品的规模、结构变化对债券品种和交易模式的影响。

展望23年的股票市场，整体维持积极乐观，主要股指的估值处于历史低位水平，内需修复、美联储加息接近尾声等定价逻辑均可能持续对市场构成利好，股市大概率将延续震荡向上的趋势。具体而言，美元加息周期接近尾声的逻辑并未变化，今年国内经济基本面修复而海外下行并有衰退风险的格局依然延续，外资大概率呈现净流入状态；温和复苏的宏观环境也没有变化，从金融数据来看，1月信贷超预期而社融存量同比增速下行，后续大概率温和上行；经济复苏的预期逐渐被数据验证，现实有望向预期靠拢，统计局2月制造业PMI为52.6，创2012年5月以来最高水平。全年重点投资逻辑关注以下三点：其一，内需修复是全年最重要的主线，寻找估值在相对低位但产业趋势、需求逻辑相对顺畅的板块，关注消费场景修复下的出行链、消费品投资机会。其二，稳增长政策的发力点大概率是多元化的，单纯基建不足以对冲需求下行，地产、消费类政策均值得关注期待，关注房地产、新能源车、养老服务、基建、机械等。其三，海外加息节奏直接影响国内风险偏好与价值成长风格，当前市场预期美联储上半年仍加息，下半年停止加息甚至降息，成长风格将在加息放缓预期中更为受益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障合规运作和投资者合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，持续健全、完善内控建设，提升风险管理水平，确保基金管理业务规范运作。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

1、持续加强制度建设。报告期内，公司根据法律法规、监管政策及业务开展实际情况，对公司制度进行了全面梳理、评估与更新，确保制度的合规性、有效性和可操作性，进一步完善公司制度体系。

2、新规解读及监管要求的落实。2022年，公司持续密切关注各项最新法律法规、监管政策，及时开展新规新政的传达和解读、并拟定落实方案，由各相关部门进行具体落实，同时定期对落实情况进行跟踪检查。

3、强化合规培训。为进一步提升员工合规意识，强化员工执业行为的合规性，合规部组织多次面向不同对象，针对不同主题的合规培训，包括针对新员工的合规培训，面向全员的合规宣导以及邀请外部律师开展专项培训等，并通过多样化的方式提高员工在合规培训中的参与度以及积极性。

4、深入开展内部审计工作。公司建立了全面的内部审计体系和流程，并设置审计部作为公司风险防控机制中的一道重要防线独立履行内部审计检查职责。2022年，公司有序开展各类专项审计、离任审查、年度/季度监察稽核项目、即时通讯工具例行检查、风险事件调查等内审工作，并聘请外部机构独立开展合规有效性评估、年度内控评价等项目。针对上述审计检查发现的问题，审计部牵头推进整改，促进制度体系及业务流程不断完善，为公司防范风险、完善内控管理提供有力支持。

4.7 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/研究的分管领导、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。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，未发生会计师事务所出具非标准审计报告的情形。

4.10 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第61090672_B51号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了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的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的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的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了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2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于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，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	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管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一

	<p>致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估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的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督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的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，</p>

	<p>但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对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持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致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不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	石静筠	费泽旭
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层	
审计报告日期	2023-03-28	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2022年12月31日	2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	8,834,947.96	2,441,285.14
结算备付金		1,276,678.94	-
存出保证金		90,955.75	83,051.39
交易性金融资产	7.4.7.2	363,762,611.91	1,047,620,971.52
其中：股票投资		179,554,317.43	456,572,971.52
基金投资		-	-
债券投资		184,208,294.48	591,048,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
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	7.4.7.5	-	7,907,442.92
资产总计		373,965,194.56	1,058,052,750.97
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	129,056,406.41
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		480,502.57	1,177,685.63
应付托管费		80,083.74	196,280.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14,565.80	45,580.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	376,831.28	653,455.28
负债合计		951,983.39	131,129,408.86
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	274,880,533.75	622,208,425.39
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	98,132,677.42	304,714,916.72
净资产合计		373,013,211.17	926,923,342.11
负债和净资产总计		373,965,194.56	1,058,052,750.97

注：(1)报告截止日2022年12月31日，基金份额净值1.3570元，基金份额总额274,880,533.75份。

(2) 比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-52,961,473.59	43,889,254.22
1.利息收入		225,616.64	19,202,823.01
其中：存款利息收入	7.4.7.9	81,977.46	60,183.24
债券利息收入		-	18,956,667.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		143,639.18	185,972.22
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,744,565.33	89,711,195.21
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-16,964,575.96	84,282,312.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	12,904,022.96	-153,599.35
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	0.00	0.00
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,805,118.33	5,582,481.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-55,160,691.94	-65,426,176.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	229,036.38	401,412.13

列)			
减：二、营业总支出		12,697,661.02	19,539,905.21
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,603,818.15	13,279,795.95
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,600,636.41	2,213,299.32
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,212,851.73	2,001,271.99
其中：卖出回购金融资产支出		1,212,851.73	2,001,271.99
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		37,055.75	49,138.41
8. 其他费用	7.4.7.19	243,298.98	1,996,399.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-65,659,134.61	24,349,349.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-65,659,134.61	24,349,349.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-65,659,134.61	24,349,349.01

注：

比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年12月31日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	622,208,425.39	-	304,714,916.72	926,923,342.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	622,208,425.39	-	304,714,916.72	926,923,342.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-347,327,891.64	-	-206,582,239.30	-553,910,130.94
（一）、综合收益总额	-	-	-65,659,134.61	-65,659,134.61
（二）、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）	-347,327,891.64	-	-140,923,104.69	-488,250,996.33
其中：1.基金申购款	454,978.32	-	185,535.15	640,513.47
2.基金赎回款	-347,782,869.96	-	-141,108,639.84	-488,891,509.80
（三）、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	274,880,533.75	-	98,132,677.42	373,013,211.17
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	591,251,142.60	-	272,947,761.10	864,198,903.70
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	591,251,142.60	-	272,947,761.10	864,198,903.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	30,957,282.79	-	31,767,155.62	62,724,438.41
(一)、综合收益总额	-	-	24,349,349.01	24,349,349.01
(二)、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)	30,957,282.79	-	7,417,806.61	38,375,089.40
其中: 1.基金	488,153,008.67	-	222,320,633.66	710,473,642.33

申购款				
2.基金 赎回款	-457,195,725.88	-	-214,902,827.05	-672,098,552.93
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他 综合收益结转 留存收益	-	-	-	-
四、本期期末 净资产(基金 净值)	622,208,425.39	-	304,714,916.72	926,923,342.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

芦特尔

汪成杰

虞俏依

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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（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[2018]2090号《关于准予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注册的批复》的核准，由永赢基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于2019年6月5日生效，首次设立募集规模为338,868,389.00份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为招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，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、存托凭证）、债券（国债、地方政府债、政策性金融债、商业银行金融债与次级债、企业债、公司债、公开

发行的次级债、中小企业私募债、可转换债券（含分离交易可转债纯债部分）、可交换债券、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、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、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）。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。

基金的投资组合比例为：封闭期内，本基金投资于股票的比例为0-100%；开放期内，本基金投资于股票的比例为0-95%。在开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；在封闭期内，本基金不受前述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证投资比例为基金资产净值的0-3%。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50%。

7.4.2 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第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<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；

如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市

场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2) 不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(3) 本基金收益分配方式默认为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为相应类别的基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

(4) 若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额；

(5) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》、《企业会计准则第37号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于2022年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币2,441,285.14元，自应收利息转入的重分类金额为人民币356.11元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币2,441,641.25元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币83,051.39元，自应收利息转入的重分类金额为人民币41.14元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币83,092.53元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币7,907,442.92元，转出至银行存款的重分类金额为人民币356.11元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币41.14元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币7,907,045.67元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,047,620,971.52元，自应收利息转入的重分类金额为人民币7,907,045.67元。经上述重分类后，交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币1,055,528,017.19元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币129,056,406.41元，自应付利息转入的重分类金额为人民币80,075.89元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币129,136,482.30元。

应付利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币80,075.89元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币80,075.89元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

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

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

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

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

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

7.4.6.3 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）及地方教育费附加。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	8,834,947.96	2,441,285.14
等于：本金	8,833,596.32	2,441,285.14
加：应计利息	1,351.64	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-

等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	8,834,947.96	2,441,285.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	190,840,426.79	-	179,554,317.43	-11,286,109.36	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	30,536,597.53	397,865.21	30,526,865.21	-407,597.53
	银行间市场	153,178,440.74	1,659,429.27	153,681,429.27	-1,156,440.74
	合计	183,715,038.27	2,057,294.48	184,208,294.48	-1,564,038.27
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	374,555,465.06	2,057,294.48	363,762,611.91	-12,850,147.63	
项目	上年度末 2021年12月31日				

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	415,558,021.78	-	456,572,971.52	41,014,949.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	30,137,720.00	30,156,000.00	18,280.00
	银行间市场	559,614,685.43	560,892,000.00	1,277,314.57
	合计	589,752,405.43	591,048,000.00	1,295,594.57
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,005,310,427.21	-	1,047,620,971.52	42,310,544.31

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	7,907,442.92
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	7,907,442.92

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31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	186,831.28	373,379.39
其中：交易所市场	172,227.78	344,770.94
银行间市场	14,603.50	28,608.45
应付利息	-	80,075.89
预提费用	190,000.00	200,000.00
合计	376,831.28	653,455.28

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	622,208,425.39	622,208,425.39
本期申购	454,978.32	454,978.32
本期赎回（以“-”号填列）	-347,782,869.96	-347,782,869.96
本期末	274,880,533.75	274,880,533.75

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 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
本期期初	265,226,115.51	39,488,801.21	304,714,916.72
本期利润	-10,498,442.67	-55,160,691.94	-65,659,134.61
本期基金份额交易产生的变动数	-152,665,861.25	11,742,756.56	-140,923,104.69
其中：基金申购款	199,410.04	-13,874.89	185,535.15

基金赎回款	-152,865,271.29	11,756,631.45	-141,108,639.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	102,061,811.59	-3,929,134.17	98,132,677.42

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	33,059.18	33,951.25
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	47,511.36	25,187.38
其他	1,406.92	1,044.61
合计	81,977.46	60,183.24

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	836,919,655.98	630,377,492.68
减：卖出股票成本总额	851,826,827.79	546,095,179.69
减：交易费用	2,057,404.15	-
买卖股票差价收入	-16,964,575.96	84,282,312.99

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
----	-----------------------------------	--

债券投资收益——利息收入	12,464,174.70	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	439,848.26	-153,599.35
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	12,904,022.96	-153,599.35

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	2,022,979,741.49	1,638,458,401.93
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	1,996,926,539.58	1,613,102,420.52
减：应计利息总额	25,579,673.19	25,509,580.76
减：交易费用	33,680.46	-
买卖债券差价收入	439,848.26	-153,599.35

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益--其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,805,118.33	5,582,481.57
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	5,805,118.33	5,582,481.57

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-55,160,691.94	-65,426,176.13
——股票投资	-52,301,059.10	-67,167,399.84
——债券投资	-2,859,632.84	1,741,223.71
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-

合计	-55,160,691.94	-65,426,176.13
----	----------------	----------------

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	182,754.85	400,661.38
基金转换费收入	46,281.53	750.75
合计	229,036.38	401,412.13

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	70,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	16,098.98	20,565.20
账户维护费	36,000.00	35,580.00
其他	1,200.00	1,200.00
交易费用	-	1,739,054.34
合计	243,298.98	1,996,399.54

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构、基金注册登记机构、基金发起人
招商银行股份有限公司 ("招商银行")	基金托管人、基金销售机构
宁波银行股份有限公司 ("宁波银行")	基金管理人的股东、基金销售机构
华侨银行有限公司 ("华侨银行")	基金管理人的股东
永赢资产管理有限公司 ("永赢资产")	基金管理人的子公司
永赢国际资产管理有限公司 ("永赢国际")	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的相关批复，永赢基金管理有限公司已在香港特别行政区政府的公司注册处办理完成香港子公司--永赢国际资产管理有限公司的注册登记手续，并于2022年11月14日获得香港证券及期货事务监察委员会颁发的第四号（就证券提供意见）及第九号（提供资产管理）牌照。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,603,818.15	13,279,795.95
其中：支付销售机构的客户维护费	3,947,457.89	5,376,733.05

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：

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

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,600,636.41	2,213,299.32

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

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

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

上年度可比期间

2021年01月01日至2021年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖 出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支 出
招商银行	-	-	-	-	200,152,000.0 0	87,828.0 1

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年12月31日
报告期初持有的基金份额	10,000,900.00	10,000,900.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	10,000,900.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	10,000,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	1.6073%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.5.2 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

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。

7.4.10.6 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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	8,834,947.96	33,059.18	2,441,285.14	33,951.25

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688271	联影医疗	2022-08-12	6个月	新股限售	109.88	171.68	2,209	242,724.92	379,241.12	-
688409	富创精密	2022-09-26	6个月	新股限售	69.99	95.65	1,520	106,384.80	145,388.00	-
688503	聚和材料	2022-12-02	6个月	新股限售	110.00	136.39	942	103,620.00	128,479.38	-
6884	三未	2022-	6个	新股	78.89	90.62	1,260	99,40	114,1	-

89	信安	11-25	月	限售				1.40	81.20	
3012 39	普瑞 眼科	2022- 06-22	6个 月	新股 限售	33.65	69.68	575	19,34 8.75	40,06 6.00	-
3011 75	中科 环保	2022- 06-30	6个 月	新股 限售	3.82	6.01	6,370	24,33 3.40	38,28 3.70	-
3013 27	华宝 新能	2022- 09-08	6个 月	新股 限售	237.5 0	176.9 7	133	31,58 7.50	23,53 7.01	-
3013 01	川宁 生物	2022- 12-20	6个 月	新股 限售	5.00	7.53	3,007	15,03 5.00	22,64 2.71	-
3013 67	怡和 嘉业	2022- 10-21	6个 月	新股 限售	119.8 8	175.7 8	110	13,18 6.80	19,33 5.80	-
3012 67	华夏 眼科	2022- 10-26	6个 月	新股 限售	50.88	66.20	269	13,68 6.72	17,80 7.80	-
3011 52	天力 锂能	2022- 08-19	6个 月	新股 限售	57.00	46.64	294	16,75 8.00	13,71 2.16	-
3013 63	美好 医疗	2022- 09-28	6个 月	新股 限售	30.66	37.85	360	11,03 7.60	13,62 6.00	-
3011 65	锐捷 网络	2022- 11-14	6个 月	新股 限售	32.38	31.61	418	13,53 4.84	13,21 2.98	-
3013 11	昆船 智能	2022- 11-23	6个 月	新股 限售	13.88	15.86	832	11,54 8.16	13,19 5.52	-
3012 97	富乐 德	2022- 12-23	6个 月	新股 限售	8.48	12.99	1,015	8,607 .20	13,18 4.85	-
3012 30	泓博 医药	2022- 10-21	6个 月	新股 限售	40.00	48.32	269	10,76 0.00	12,99 8.08	-
3011 21	紫建 电子	2022- 08-01	6个 月	新股 限售	61.07	49.77	256	15,63 3.92	12,74 1.12	-
3013 56	天振 股份	2022- 11-03	6个 月	新股 限售	63.00	43.33	282	17,76 6.00	12,21 9.06	-
3013 77	鼎泰 高科	2022- 11-11	6个 月	新股 限售	22.88	17.63	693	15,85 5.84	12,21 7.59	-
3013 89	隆扬 电子	2022- 10-18	6个 月	新股 限售	22.50	17.16	708	15,93 0.00	12,14 9.28	-

301339	通行宝	2022-09-02	6个月	新股限售	18.78	15.59	737	13,840.86	11,489.83	-
301280	珠城科技	2022-12-19	6个月	新股限售	67.40	44.80	256	17,254.40	11,468.80	-
301290	东星医疗	2022-11-23	6个月	新股限售	44.09	35.13	325	14,329.25	11,417.25	-
301335	天元宠物	2022-11-11	6个月	新股限售	49.98	33.82	336	16,793.28	11,363.52	-
301277	新天地	2022-11-09	6个月	新股限售	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301379	天山电子	2022-10-19	6个月	新股限售	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
301132	满坤科技	2022-08-03	6个月	新股限售	26.80	24.48	448	12,006.40	10,967.04	-
301361	众智科技	2022-11-08	6个月	新股限售	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301223	中荣股份	2022-10-13	6个月	新股限售	26.28	18.13	596	15,662.88	10,805.48	-
301365	矩阵股份	2022-11-14	6个月	新股限售	34.72	23.87	429	14,894.88	10,240.23	-
301366	一博科技	2022-09-19	6个月	新股限售	65.35	45.09	219	14,311.65	9,874.71	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6个月	新股限售	30.38	25.25	374	11,362.12	9,443.50	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6个月	新股限售	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301349	信德新材	2022-08-30	6个月	新股限售	138.88	103.52	82	11,388.16	8,488.64	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6个月	新股限售	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6个月	新股限售	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
3012	华新	2022-	6个	新股	13.28	11.40	691	9,176	7,877	-

65	环保	12-08	月	限售				.48	.40	
3013 98	星源 卓镁	2022- 12-08	6个 月	新股 限售	34.40	28.94	255	8,772 .00	7,379 .70	-
3013 13	凡拓 数创	2022- 09-22	6个 月	新股 限售	25.25	29.14	247	6,236 .75	7,197 .58	-
3012 76	嘉曼 服饰	2022- 09-01	6个 月	新股 限售	40.66	22.61	303	12,31 9.98	6,850 .83	-
3013 88	欣灵 电气	2022- 10-26	6个 月	新股 限售	25.88	21.60	292	7,556 .96	6,307 .20	-
3013 68	丰立 智能	2022- 12-07	6个 月	新股 限售	22.33	18.52	337	7,525 .21	6,241 .24	-
3013 19	唯特 偶	2022- 09-22	6个 月	新股 限售	47.75	53.27	115	5,491 .25	6,126 .05	-
3012 70	汉仪 股份	2022- 08-19	6个 月	新股 限售	25.68	28.37	210	5,392 .80	5,957 .70	-
3012 31	荣信 文化	2022- 08-31	6个 月	新股 限售	25.49	20.38	275	7,009 .75	5,604 .50	-
3012 33	盛帮 股份	2022- 06-24	6个 月	新股 限售	41.52	34.30	158	6,560 .16	5,419 .40	-
3013 09	万得 凯	2022- 09-08	6个 月	新股 限售	39.00	24.46	217	8,463 .00	5,307 .82	-
3013 16	慧博 云通	2022- 09-29	6个 月	新股 限售	7.60	14.32	359	2,728 .40	5,140 .88	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体系。五道防线分别为员工自律及业务部门的自控和互控的第一道防线，合规风控部门监督管理的第二道防线，审计部事后检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险控制监督管理的第五道防线。

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

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	60,064,756.72	170,299,000.00
合计	60,064,756.72	170,299,000.00

注：国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	71,276,756.71	166,307,000.00
AAA以下	52,866,781.05	152,184,000.00
未评级	-	102,258,000.00
合计	124,143,537.76	420,749,000.00

注：国债或政策性金融债列示为未评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

7.4.13.3 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开放期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。

7.4.13.3.1 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在每个开放期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7.4.12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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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							
银行存款	8,834,947.96	-	-	-	-	-	8,834,947.96
结算备付金	1,276,678.94	-	-	-	-	-	1,276,678.94
存出保证金	90,955.75	-	-	-	-	-	90,955.75
交易性金融资产	-	10,014,997.81	92,470,386.54	81,722,910.13	-	179,554,317.43	363,762,611.91
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	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,202,582.65	10,014,997.81	92,470,386.54	81,722,910.13	-	179,554,317.43	373,965,194.56
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管	-	-	-	-	-	480,502.57	480,502.57

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 2022 年年度报告

理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	80,083.74	80,083.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	14,565.80	14,565.80
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	376,831.28	376,831.28
负债总计	-	-	-	-	-	951,983.39	951,983.39
利率敏感度缺口	10,202,582.65	10,014,997.81	92,470,386.54	81,722,910.13	-	178,602,334.04	373,013,211.17
上年度末 2021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							
银行存款	2,441,285.14	-	-	-	-	-	2,441,285.14
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	83,051.39	-	-	-	-	-	83,051.39
交易性金融资产	40,141,000.00	10,136,000.00	221,181,000.00	278,822,000.00	40,768,000.00	456,572,971.52	1,047,620,971.52
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	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	7,907,442.92	7,907,442.92
资产总计	42,665,336.53	10,136,000.00	221,181,000.00	278,822,000.00	40,768,000.00	464,480,414.44	1,058,052,750.97
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	129,056,406.41	-	-	-	-	-	129,056,406.41
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,177,685.63	1,177,685.63
应付托管费	-	-	-	-	-	196,280.93	196,280.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	45,580.61	45,580.61
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	653,455.28	653,455.28
负债总计	129,056,406.41	-	-	-	-	2,073,002.45	131,129,408.86
利率敏感度缺口	-86,391,069.88	10,136,000.00	221,181,000.00	278,822,000.00	40,768,000.00	462,407,411.99	926,923,342.11

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率曲线向上、向下平行移动50个基点		
假设	2. 其他市场变量保持不变		
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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-840,645.66	-5,427,855.28

市场利率平行下降50个基点	840,645.66	5,427,855.28
---------------	------------	--------------

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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	179,554,317.43	48.14	456,572,971.52	49.26
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	179,554,317.43	48.14	456,572,971.52	49.26

7.4.13.4.3.2 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准增加1%	3,516,957.01	9,717,730.97
	业绩比较基准减少1%	-3,516,957.01	-9,717,730.97

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	178,256,040.10	451,987,647.71
第二层次	184,208,294.48	591,422,724.86
第三层次	1,298,277.33	4,210,598.95
合计	363,762,611.91	1,047,620,971.52

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	4,210,598.95	4,210,598.95
当期购买	-	1,111,082.10	1,111,082.10
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,417,097.52	3,417,097.52
当期利得或损失总额	-	-606,306.20	-606,306.20
其中：计入损益的利得或损失	-	-606,306.20	-606,306.20
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,298,277.33	1,298,277.33
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	187,195.23	187,195.23
项目	上年度可比同期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计

	债券投资	股票投资	
期初余额	-	7,462,798.74	7,462,798.74
当期购买	-	3,329,991.30	3,329,991.30
当期出售/结算	-	1,016,184.20	1,016,184.20
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	6,540,210.47	6,540,210.47
当期利得或损失总额	-	974,203.58	974,203.58
其中：计入损益的利得或损失	-	974,203.58	974,203.58
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	4,210,598.95	4,210,598.95
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	880,607.65	880,607.65

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,298,277.33	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2063-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	4,210,598.95	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2927-2.7417	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2023年3月28日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	179,554,317.43	48.01
	其中：股票	179,554,317.43	48.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	184,208,294.48	49.26
	其中：债券	184,208,294.48	49.26
	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	10,111,626.90	2.70
8	其他各项资产	90,955.75	0.02

9	合计	373,965,194.56	100.00
---	----	----------------	--------

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	1,174,760.00	0.31
B	采矿业	3,921,303.00	1.05
C	制造业	121,582,532.06	32.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,395,373.00	0.91
E	建筑业	661,810.00	0.18
F	批发和零售业	6,316,688.00	1.69
G	交通运输、仓储和邮政业	3,038,673.00	0.81
H	住宿和餐饮业	1,172,835.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,133,355.39	2.72
J	金融业	9,250,804.50	2.48
K	房地产业	3,408,970.00	0.91
L	租赁和商务服务业	2,616,908.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	1,217,995.48	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	3,674,002.70	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	713,136.00	0.19
Q	卫生和社会工作	57,873.80	0.02
R	文化、体育和娱乐业	7,217,297.50	1.93
S	综合	-	-
	合计	179,554,317.43	48.14

8.2.2 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。

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	7,000	2,753,940.00	0.74
2	603606	东方电缆	34,700	2,353,701.00	0.63
3	300124	汇川技术	33,200	2,307,400.00	0.62
4	301155	海力风电	25,400	2,218,690.00	0.59
5	601012	隆基绿能	50,884	2,150,357.84	0.58
6	600580	卧龙电驱	171,600	2,138,136.00	0.57
7	603699	纽威股份	137,400	1,525,140.00	0.41
8	300144	宋城演艺	102,400	1,495,040.00	0.40
9	601888	中国中免	6,800	1,469,004.00	0.39
10	000759	中百集团	240,300	1,463,427.00	0.39
11	000729	燕京啤酒	137,100	1,456,002.00	0.39
12	000625	长安汽车	118,100	1,453,811.00	0.39
13	000568	泸州老窖	6,100	1,368,108.00	0.37
14	603177	德创环保	82,600	1,358,770.00	0.36
15	000858	五粮液	7,500	1,355,175.00	0.36
16	600152	维科技术	91,400	1,349,978.00	0.36
17	603180	金牌厨柜	46,900	1,344,623.00	0.36
18	601318	中国平安	28,200	1,325,400.00	0.36
19	600757	长江传媒	232,400	1,324,680.00	0.36
20	603043	广州酒家	51,300	1,324,566.00	0.36
21	601801	皖新传媒	252,200	1,313,962.00	0.35
22	603657	春光科技	81,900	1,303,848.00	0.35
23	002304	洋河股份	8,100	1,300,050.00	0.35
24	002462	嘉事堂	90,000	1,295,100.00	0.35
25	300839	博汇股份	68,890	1,277,909.50	0.34
26	603233	大参林	32,200	1,275,120.00	0.34
27	600356	恒丰纸业	173,100	1,267,092.00	0.34

28	601900	南方传媒	151,400	1,258,134.00	0.34
29	600582	天地科技	236,900	1,231,880.00	0.33
30	600390	五矿资本	240,600	1,222,248.00	0.33
31	000513	丽珠集团	37,400	1,214,752.00	0.33
32	603939	益丰药房	19,000	1,212,960.00	0.33
33	600475	华光环能	137,900	1,212,141.00	0.32
34	300059	东方财富	62,456	1,211,646.40	0.32
35	000156	华数传媒	160,500	1,202,145.00	0.32
36	002275	桂林三金	90,900	1,201,698.00	0.32
37	600449	宁夏建材	101,200	1,201,244.00	0.32
38	600990	四创电子	40,200	1,197,960.00	0.32
39	000989	九芝堂	135,100	1,190,231.00	0.32
40	603989	艾华集团	46,200	1,186,416.00	0.32
41	601898	中煤能源	137,600	1,186,112.00	0.32
42	601985	中国核电	196,600	1,179,600.00	0.32
43	600271	航天信息	113,100	1,177,371.00	0.32
44	600754	锦江酒店	20,100	1,172,835.00	0.31
45	002391	长青股份	166,300	1,169,089.00	0.31
46	300074	华平股份	310,400	1,164,000.00	0.31
47	605158	华达新材	181,500	1,161,600.00	0.31
48	002757	南兴股份	105,500	1,144,675.00	0.31
49	300349	金卡智能	120,600	1,130,022.00	0.30
50	600461	洪城环境	161,400	1,121,730.00	0.30
51	601512	中新集团	139,400	1,113,806.00	0.30
52	000413	东旭光电	627,200	1,110,144.00	0.30
53	002228	合兴包装	345,800	1,110,018.00	0.30
54	601212	白银有色	425,200	1,105,520.00	0.30
55	000983	山西焦煤	94,700	1,103,255.00	0.30
56	300168	万达信息	130,000	1,095,900.00	0.29
57	600782	新钢股份	267,800	1,095,302.00	0.29
58	603042	华脉科技	118,900	1,090,313.00	0.29

59	605155	西大门	83,400	1,085,034.00	0.29
60	600261	阳光照明	339,100	1,081,729.00	0.29
61	300078	思创医惠	234,700	1,079,620.00	0.29
62	603188	亚邦股份	292,300	1,078,587.00	0.29
63	300760	迈瑞医疗	3,400	1,074,298.00	0.29
64	601827	三峰环境	165,600	1,064,808.00	0.29
65	002594	比亚迪	4,100	1,053,577.00	0.28
66	000999	华润三九	22,300	1,043,863.00	0.28
67	002415	海康威视	30,000	1,040,400.00	0.28
68	300637	扬帆新材	161,400	1,039,416.00	0.28
69	601156	东航物流	68,100	1,039,206.00	0.28
70	603926	铁流股份	114,400	1,036,464.00	0.28
71	688382	益方生物	77,500	1,029,200.00	0.28
72	600529	山东药玻	36,100	1,025,240.00	0.27
73	300484	蓝海华腾	97,200	1,020,600.00	0.27
74	002484	江海股份	44,900	1,004,413.00	0.27
75	002729	好利科技	38,600	977,738.00	0.26
76	000700	模塑科技	207,800	964,192.00	0.26
77	603596	伯特利	12,000	957,600.00	0.26
78	300555	ST路通	150,700	953,931.00	0.26
79	688501	青达环保	36,700	948,695.00	0.25
80	002913	奥士康	38,300	933,371.00	0.25
81	600845	宝信软件	20,743	929,286.40	0.25
82	300979	华利集团	16,100	919,471.00	0.25
83	603833	欧派家居	7,400	899,322.00	0.24
84	601015	陕西黑猫	191,100	867,594.00	0.23
85	002291	遥望科技	66,000	858,000.00	0.23
86	688235	百济神州	6,254	828,342.30	0.22
87	000596	古井贡酒	3,100	827,390.00	0.22
88	603456	九洲药业	19,400	823,142.00	0.22
89	603486	科沃斯	11,100	809,634.00	0.22

90	002582	好想你	85,000	808,350.00	0.22
91	600809	山西汾酒	2,800	797,972.00	0.21
92	603688	石英股份	6,000	787,920.00	0.21
93	600199	金种子酒	29,400	785,568.00	0.21
94	600050	中国联通	175,000	784,000.00	0.21
95	603345	安井食品	4,800	777,024.00	0.21
96	601100	恒立液压	12,300	776,745.00	0.21
97	300861	美畅股份	15,606	767,190.96	0.21
98	600298	安琪酵母	16,900	764,218.00	0.20
99	300661	圣邦股份	4,400	759,440.00	0.20
100	002402	和而泰	51,700	753,786.00	0.20
101	002049	紫光国微	5,700	751,374.00	0.20
102	603501	韦尔股份	9,745	751,242.05	0.20
103	000001	平安银行	56,900	748,804.00	0.20
104	600926	杭州银行	56,200	735,096.00	0.20
105	002821	凯莱英	4,900	725,200.00	0.19
106	300192	科德教育	99,600	713,136.00	0.19
107	002460	赣锋锂业	10,180	707,611.80	0.19
108	603536	惠发食品	87,800	700,644.00	0.19
109	002371	北方华创	3,100	698,430.00	0.19
110	002311	海大集团	11,300	697,549.00	0.19
111	002961	瑞达期货	52,200	695,826.00	0.19
112	300679	电连技术	18,800	695,600.00	0.19
113	002410	广联达	11,500	689,425.00	0.18
114	688351	微电生理	26,000	688,220.00	0.18
115	300748	金力永磁	23,300	681,758.00	0.18
116	603566	普莱柯	24,900	681,264.00	0.18
117	603816	顾家家居	15,900	679,089.00	0.18
118	300498	温氏股份	34,400	675,272.00	0.18
119	603317	天味食品	24,400	670,512.00	0.18
120	002036	联创电子	54,200	670,454.00	0.18

121	300401	花园生物	46,500	669,135.00	0.18
122	600429	三元股份	125,400	667,128.00	0.18
123	688052	纳芯微	2,100	666,960.00	0.18
124	600873	梅花生物	65,200	663,736.00	0.18
125	603933	睿能科技	55,400	663,692.00	0.18
126	688170	德龙激光	14,100	661,995.00	0.18
127	601868	中国能建	289,000	661,810.00	0.18
128	600938	中国海油	43,000	653,600.00	0.18
129	600300	维维股份	182,300	648,988.00	0.17
130	601238	广汽集团	57,800	637,534.00	0.17
131	688187	时代电气	11,600	633,012.00	0.17
132	000008	神州高铁	273,500	629,050.00	0.17
133	600968	海油发展	217,800	627,264.00	0.17
134	600031	三一重工	39,400	622,520.00	0.17
135	600825	新华传媒	155,600	617,732.00	0.17
136	300855	图南股份	13,200	617,628.00	0.17
137	603860	中公高科	26,300	610,949.00	0.16
138	688188	柏楚电子	2,800	607,824.00	0.16
139	300454	深信服	5,400	607,770.00	0.16
140	601187	厦门银行	106,000	607,380.00	0.16
141	000848	承德露露	71,600	607,168.00	0.16
142	600059	古越龙山	62,000	602,020.00	0.16
143	600011	华能国际	78,800	599,668.00	0.16
144	603708	家家悦	47,500	598,025.00	0.16
145	603260	合盛硅业	7,100	588,874.00	0.16
146	600309	万华化学	6,300	583,695.00	0.16
147	603682	锦和商管	106,400	575,624.00	0.15
148	600867	通化东宝	62,700	575,586.00	0.15
149	601665	齐鲁银行	137,800	574,626.00	0.15
150	000061	农产品	100,400	572,280.00	0.15
151	300316	晶盛机电	9,000	572,040.00	0.15

152	600737	中粮糖业	82,300	571,162.00	0.15
153	603171	税友股份	15,600	567,840.00	0.15
154	600531	豫光金铅	108,900	567,369.00	0.15
155	002895	川恒股份	21,500	560,505.00	0.15
156	601616	广电电气	165,100	559,689.00	0.15
157	301077	星华新材	25,900	558,404.00	0.15
158	300999	金龙鱼	12,500	544,500.00	0.15
159	600796	钱江生化	101,700	542,061.00	0.15
160	601018	宁波港	150,900	540,222.00	0.14
161	002109	兴化股份	104,700	529,782.00	0.14
162	601636	旗滨集团	46,000	523,940.00	0.14
163	600519	贵州茅台	302	521,554.00	0.14
164	600989	宝丰能源	42,900	517,803.00	0.14
165	300563	神宇股份	47,100	516,216.00	0.14
166	601021	春秋航空	8,000	514,000.00	0.14
167	600426	华鲁恒升	15,400	510,510.00	0.14
168	000002	万科 A	28,000	509,600.00	0.14
169	001227	兰州银行	133,600	503,672.00	0.14
170	601528	瑞丰银行	79,700	502,907.00	0.13
171	600598	北大荒	36,300	499,488.00	0.13
172	600570	恒生电子	12,300	497,658.00	0.13
173	300789	唐源电气	28,400	496,148.00	0.13
174	600905	三峡能源	87,500	494,375.00	0.13
175	600887	伊利股份	15,800	489,800.00	0.13
176	002352	顺丰控股	8,400	485,184.00	0.13
177	000411	英特集团	40,800	472,056.00	0.13
178	300496	中科创达	4,700	471,410.00	0.13
179	601155	新城控股	22,900	469,450.00	0.13
180	002532	天山铝业	60,100	463,972.00	0.12
181	600233	圆通速递	22,900	460,061.00	0.12
182	603605	珀莱雅	2,700	452,196.00	0.12

183	002237	恒邦股份	42,300	445,842.00	0.12
184	600383	金地集团	43,300	442,959.00	0.12
185	000786	北新建材	16,900	437,372.00	0.12
186	601628	中国人寿	11,700	434,304.00	0.12
187	300635	中达安	34,300	433,552.00	0.12
188	600030	中信证券	21,710	432,246.10	0.12
189	002959	小熊电器	6,700	404,144.00	0.11
190	000651	格力电器	12,300	397,536.00	0.11
191	300645	正元智慧	15,700	395,326.00	0.11
192	000333	美的集团	7,500	388,500.00	0.10
193	601058	赛轮轮胎	38,700	387,774.00	0.10
194	002866	传艺科技	8,400	384,468.00	0.10
195	000656	金科股份	199,800	381,618.00	0.10
196	002271	东方雨虹	11,300	379,341.00	0.10
197	688271	联影医疗	2,209	379,241.12	0.10
198	600690	海尔智家	15,365	375,827.90	0.10
199	603589	口子窖	6,200	357,554.00	0.10
200	000975	银泰黄金	31,800	351,072.00	0.09
201	600096	云天化	16,600	349,264.00	0.09
202	600141	兴发集团	11,900	345,100.00	0.09
203	688087	英科再生	9,600	333,600.00	0.09
204	300174	元力股份	16,500	329,340.00	0.09
205	300586	美联新材	18,800	329,000.00	0.09
206	002812	恩捷股份	2,500	328,225.00	0.09
207	002508	老板电器	11,700	324,792.00	0.09
208	688116	天奈科技	4,073	314,191.22	0.08
209	600048	保利发展	20,300	307,139.00	0.08
210	603789	星光农机	35,600	306,160.00	0.08
211	002861	瀛通通讯	27,300	274,911.00	0.07
212	600908	无锡银行	48,700	256,649.00	0.07
213	603867	新化股份	6,300	203,490.00	0.05

214	001979	招商蛇口	14,600	184,398.00	0.05
215	603227	雪峰科技	18,400	152,536.00	0.04
216	301297	富乐德	10,147	150,256.17	0.04
217	688409	富创精密	1,520	145,388.00	0.04
218	688503	聚和材料	942	128,479.38	0.03
219	688489	三未信安	1,260	114,181.20	0.03
220	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.02
221	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.02
222	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.01
223	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.01
224	301327	华宝新能	133	23,537.01	0.01
225	301301	川宁生物	3,007	22,642.71	0.01
226	301367	怡和嘉业	110	19,335.80	0.01
227	301267	华夏眼科	269	17,807.80	0.00
228	301152	天力锂能	294	13,712.16	0.00
229	301363	美好医疗	360	13,626.00	0.00
230	301165	锐捷网络	418	13,212.98	0.00
231	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
232	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
233	301121	紫建电子	256	12,741.12	0.00
234	301112	信邦智能	399	12,404.91	0.00
235	301356	天振股份	282	12,219.06	0.00
236	301377	鼎泰高科	693	12,217.59	0.00
237	301389	隆扬电子	708	12,149.28	0.00
238	301339	通行宝	737	11,489.83	0.00
239	301280	珠城科技	256	11,468.80	0.00
240	301290	东星医疗	325	11,417.25	0.00
241	301335	天元宠物	336	11,363.52	0.00
242	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
243	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
244	301132	满坤科技	448	10,967.04	0.00

245	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
246	301223	中荣股份	596	10,805.48	0.00
247	301365	矩阵股份	429	10,240.23	0.00
248	301366	一博科技	219	9,874.71	0.00
249	301282	金禄电子	374	9,443.50	0.00
250	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
251	301349	信德新材	82	8,488.64	0.00
252	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
253	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
254	301265	华新环保	691	7,877.40	0.00
255	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
256	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
257	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
258	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
259	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
260	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
261	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
262	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
263	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
264	301309	万得凯	217	5,307.82	0.00
265	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300750	宁德时代	19,760,952.00	2.13
2	603566	普莱柯	8,438,982.00	0.91
3	603606	东方电缆	8,288,430.00	0.89
4	002555	三七互娱	6,775,482.00	0.73

5	601965	中国汽研	6,524,805.96	0.70
6	300760	迈瑞医疗	6,086,375.00	0.66
7	601398	工商银行	5,143,707.00	0.55
8	600007	中国国贸	4,624,885.00	0.50
9	603305	旭升集团	4,268,156.00	0.46
10	688508	芯朋微	4,016,321.66	0.43
11	601012	隆基绿能	3,922,562.80	0.42
12	301155	海力风电	3,848,203.00	0.42
13	300699	光威复材	3,813,893.00	0.41
14	000776	广发证券	3,802,592.00	0.41
15	601899	紫金矿业	3,586,819.92	0.39
16	601888	中国中免	3,453,487.00	0.37
17	300785	值得买	3,377,281.00	0.36
18	002643	万润股份	3,369,025.00	0.36
19	002008	大族激光	3,217,801.00	0.35
20	300316	晶盛机电	3,152,312.00	0.34

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。

8.4.2 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	600519	贵州茅台	15,624,808.00	1.69
2	300750	宁德时代	14,772,632.00	1.59
3	000001	平安银行	11,939,148.18	1.29
4	603596	伯特利	11,083,417.00	1.20
5	300059	东方财富	11,011,162.92	1.19
6	601166	兴业银行	10,644,232.27	1.15
7	603305	旭升集团	8,675,145.28	0.94
8	603606	东方电缆	8,587,203.00	0.93
9	603466	风语筑	8,214,998.00	0.89

10	002041	登海种业	8,011,939.00	0.86
11	603566	普莱柯	7,931,557.00	0.86
12	601012	隆基绿能	7,701,773.92	0.83
13	600030	中信证券	6,526,147.18	0.70
14	601965	中国汽研	6,505,599.00	0.70
15	300014	亿纬锂能	6,282,701.00	0.68
16	000786	北新建材	6,138,688.00	0.66
17	002920	德赛西威	5,480,062.23	0.59
18	601888	中国中免	5,430,973.54	0.59
19	000338	潍柴动力	5,026,174.00	0.54
20	002555	三七互娱	4,982,591.00	0.54

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。

8.4.3 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	627,109,232.80
卖出股票收入（成交）总额	836,919,655.98

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	32,533,645.16	8.72
5	企业短期融资券	60,064,756.72	16.10
6	中期票据	91,609,892.60	24.56
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	184,208,294.48	49.38

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	012284002	22张家城投SC P005	200,000	20,027,934.25	5.37
2	101900285	19绍兴交投M TN001	100,000	10,540,473.97	2.83
3	102100045	21宜兴城投M TN001	100,000	10,405,837.26	2.79
4	102100080	21上虞城建M TN001	100,000	10,357,570.41	2.78
5	175754	21浦房01	100,000	10,288,219.18	2.76

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	90,955.75
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	-
8	其他	-
9	合计	90,955.75

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
7,425	37,020.95	0.00	0.0000%	274,880,533.75	100.0000%

9.2 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	40,608.42	0.01%

9.3 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、基金投资和研发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

9.4 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	0.00	0.00%	10,000,900.00	3.64%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	9,989.81	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	9,989.81	0.00%	10,000,900.00	3.64%	不少于3年

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满3年，发起份额全部赎回。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年06月05日)基金份额总额	338,868,389.00
本报告期期初基金份额总额	622,208,425.39
本报告期基金总申购份额	454,978.32
减：本报告期基金总赎回份额	347,782,869.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	274,880,533.75

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经永赢基金管理有限公司董事会审议通过，黄庆先生不再担任公司首席信息官职务，徐翔先生不再担任公司副总经理职务。本基金管理人已分别于2022年7月30日、2022年10月22日在规定信息披露媒介登载了高级管理人员变更公告。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

自2022年07月15日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为70,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
浙商证券	1	-	-	-	-	新增
中信建投	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	656,500,005.04	45.67%	473,149.04	45.55%	新增
方正证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	187,446,748.11	13.04%	136,711.39	13.16%	-
民生证券	2	77,506,581.41	5.39%	55,747.18	5.37%	-
兴业证券	2	491,500,244.85	34.19%	355,637.68	34.23%	-
招商证券	2	3,874,452.58	0.27%	2,791.63	0.27%	-
甬兴证券	3	20,558,064.44	1.43%	14,822.81	1.43%	新增

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，并由本基金管理人董事会授权

管理层批准。

(2) 本基金本报告期内退租甬兴证券交易席位2个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	132,382,348.63	18.58%	1,767,000,000.00	30.88%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	19,994,250.68	2.81%	364,000,000.00	6.36%	-	-	-	-
民生证券	9,910,384.11	1.39%	511,580,000.00	8.94%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	1,199,599,000.00	20.96%	-	-	-	-
招商证券	550,303,719.98	77.23%	1,067,000,000.00	18.65%	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	813,100,000.00	14.21%	-	-	-	-

11.8 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公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-01
2	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2021年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-22
3	永赢基金管理有限公司关于调整部分基金最低申购金额、最低追加申购金额、最低	中国证监会规定媒介	2022-03-04

	赎回（含转换转出）份额和最低持有份额数额限制的公告		
4	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2021年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-26
5	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2022年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
6	永赢基金管理有限公司关于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在部分销售机构开展赎回（含转换转出）费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-07-04
7	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开放日常申购、赎回、转换业务公告	中国证监会规定媒介	2022-07-04
8	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2022年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2022-07-20
9	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-07-30
10	永赢基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2022-08-01
11	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2022年中期报告	中国证监会规定媒介	2022-08-30
12	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基金产品资料概要更新(2022年第1号)	中国证监会规定媒介	2022-09-29

13	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更新招募说明书(2022年第1号)	中国证监会规定媒介	2022-09-29
14	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2022-10-22
15	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2022年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2022-10-26
16	永赢基金管理有限公司关于设立香港子公司及获批相关业务牌照的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-16
17	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基金产品资料概要更新(2022年第2号)	中国证监会规定媒介	2022-12-23
18	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更新(招募说明书2022年第2号)	中国证监会规定媒介	2022-12-23
19	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的基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2022-12-23

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1.中国证监会准予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注册的文件；

2.《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基金合同》；

3.《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托管协议》；

4.《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。

13.2 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

13.3 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
二〇二三年三月三十日