

# 永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金

## 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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
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	19
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	19
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	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
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	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	71
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	71
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	71
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	71

8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	71
8.12 投资组合报告附注 .....	71
§9 基金份额持有人信息 .....	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	73
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 .....	73
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	73
§10 开放式基金份额变动 .....	73
§11 重大事件揭示 .....	73
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	74
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 .....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	74
11.4 基金投资策略的改变 .....	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	74
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 .....	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	74
11.8 其他重大事件 .....	77
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
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 .....	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
§13 备查文件目录 .....	79
13.1 备查文件目录 .....	79
13.2 存放地点 .....	80
13.3 查阅方式 .....	80

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金
基金简称	永赢港股通品质生活慧选混合
基金主代码	009983
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年09月29日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,273,262,223.78份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资策略包含资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略。本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质股票，严选具有较高安全边际和成长潜力较大的股票构建投资组合。
业绩比较基准	恒生指数收益率（经汇率调整后）*65%+中债-综合指数（全价）收益率*20%+沪深300指数收益率*15%
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金将投资港股通投资标的股票，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。</p>

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	汪成杰	陆志俊
	联系电话	021-20430340	95559
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-805-8888	95559
传真		021-51690177	021-62701216
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		马宇晖	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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09月29日（基金合同生效日）- 2020年12月31日
本期已实现收益	-267,363,875.05	-169,731,462.39	-53,492,788.29
本期利润	-114,006,249.08	-336,113,627.21	64,212,169.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0840	-0.1891	0.0296
本期加权平均净值利润率	-11.59%	-18.79%	2.96%
本期基金份额净值增长率	-9.26%	-20.35%	3.02%
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	-415,044,316.16	-261,370,670.70	-52,304,614.01
期末可供分配基金份额利润	-0.3260	-0.1794	-0.0246
期末基金资产净值	948,067,032.72	1,195,580,726.43	2,187,692,987.13
期末基金份额净值	0.7446	0.8206	1.0302
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	-25.54%	-17.94%	3.02%

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	7.82%	1.31%	9.02%	1.67%	-1.20%	-0.36%
过去六个月	-3.22%	1.26%	-5.30%	1.35%	2.08%	-0.09%
过去一年	-9.26%	1.69%	-7.54%	1.43%	-1.72%	0.26%
自基金合同 生效起至今	-25.54%	1.54%	-10.16%	1.16%	-15.38%	0.38%

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：恒生指数收益率（经汇率调整后）\*65%+中债-综合指数（全价）收益率\*20%+沪深300指数收益率\*15%。

### 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

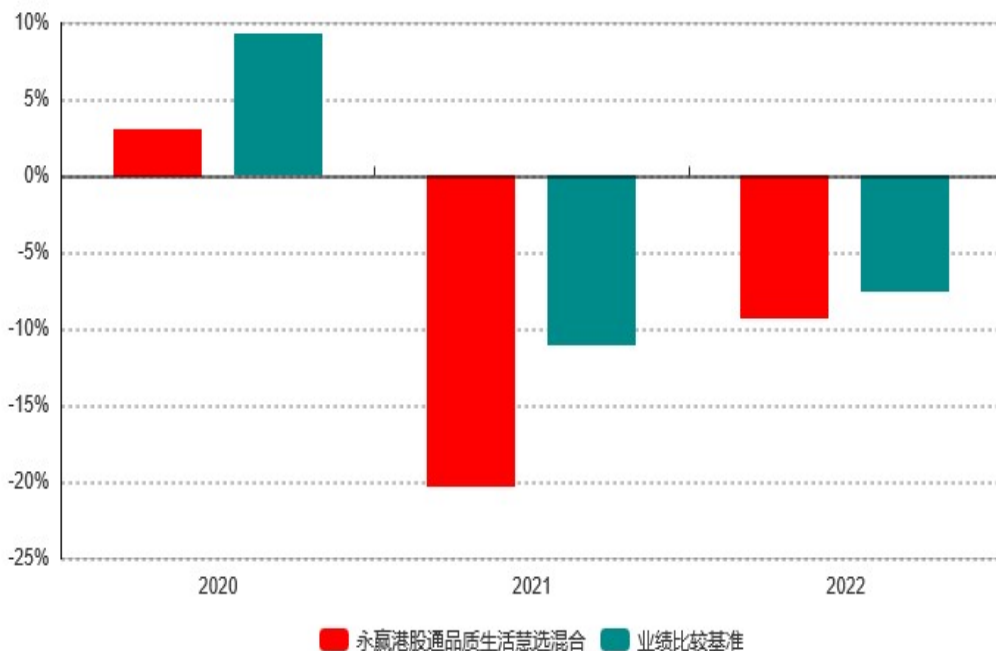
永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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2020年9月29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

本基金的合同生效日为2020年9月29日，截至本报告期末，本基金未进行过利润分配。

## §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		
晏青	权益投资部副总监/基金经理兼任投资经理	2020-09-29	-	16	晏青先生，上海交通大学经济学硕士，16年证券相关从业经验。曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理，上海弘尚资产管理中心（有限合

					伙) 投资经理、海外投资总监。现任永赢基金管理有限公司权益投资部副总监。
李琦	基金经理助理	2021-01-29	-	10	李琦先生, 中山大学金融硕士, 10年证券相关从业经验。曾任易方达基金管理有限公司分析师, 上海弘尚资产管理中心(有限合伙)首席分析师, 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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
晏青	公募基金	3	1,520,587,964.10	2019-10-16
	私募资产管理计划	4	284,444,496.84	2022-03-11
	其他组合	-	-	-
	合计	7	1,805,032,460.94	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

#### 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、《永赢港股通品质生活慧选混合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 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

针对兼任基金经理，基金管理人加强投资指令管理，兼任基金经理下达所管理多个产品的同一证券、同日、同向投资指令，原则上应做到“同时同价”，尽量同时发送投资指令；对于因产品策略、头寸变化等原因导致无法“同时同价”的，应经管理人内部审议授权后方可执行交易。基金管理人每日开展兼任产品间的同日及临近交易日同向交易价差分析；每季度对兼任产品间不同时间窗下反向交易和同向交易价差进行监测分析，其中最长时间窗延长至10个交易日及以上；并结合投资指令下达时间、价格偏差、产品规模、产品投资策略和投资目标说明、成交量等情况开展进一步分析，独立分析

认为合理性不足的，将要求兼任基金经理进行解释说明。本报告期内，兼任基金经理所管理的产品严格执行公平交易制度，其管理的多个产品间未发现有显失公平的行为。

#### 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年全球市场波动较大，诸多不确定因素引发了权益市场的震荡，成为近几年表现最差的一个年份，其中上证指数和恒指本年度分别下跌15.13%和15.46%、标普500和纳斯达克指数分别下跌19.44%和33.10%。

首先是国内情况异常复杂，疫情的反复和多地多轮的疫情反复对短期经济产生巨大扰动，同时房地产市场的大幅下滑更让本就疲弱的国内经济雪上加霜。国内疫情扩散带来防控升级，疫情管控导致货币流通速度下降，市场整体流动性减少，资金持续流出股票市场。疫情前期，货币流通速度下降幅度更大，但随着政策力度的加大以及疫情的逐渐恢复，货币供应量增加或货币流通速度提升，疫情后期对冲的政策开始发挥效率，经济和股票市场见底回升。回看2022年国内市场的情况，随着防控的升级和放松，成为引发市场阶段性表现的核心主导因素。房地产的下滑远超市场的普遍预期，随着房地产企业信用风险的扩散，以及房地产销售量的下滑，企业融资性现金流还是经营性现金流面临困境，一部分企业面临生死存亡的挑战，拿地的能力和意愿受到抑制，整个行业陷入衰退状态。4季度地产融资政策的出台使得地产行业信用风险下降，解决了部分地产公司的融资问题，避免了金融危机的发生。

其次，美国通胀高企引发美联储快速升息，对全球资产价格影响巨大，特别是对股票市场的估值形成压制。海外发达经济体面临通胀的压力，俄乌冲突之后油价进一步上升，叠加美国国内就业强劲、工资通胀螺旋压力进一步加大，美国通货膨胀率创40年来新高最高触及9.1%，美联储在2022年加息7次将调联邦基金利率目标区间调到4.25%至4.50%之间。伴随着美元利率快速上行，美元指数大幅上升，因为美元利率是全球资产定价的锚，这引发了海外风险资产的大幅波动，高利率对海外风险资产和高估值资产形成显著的压制，创下近几年最大幅度的回撤。

最后，地缘政治发生超预期事件，俄乌的冲突不断升级，欧美对俄罗斯进行了严厉的金融制裁。俄乌冲突引发能源市场价格快速上升，特别是造成对俄罗斯能源依赖

较大的欧洲出现能源危机。同时，冲突对海外投资者的风险偏好产生冲击，海外中资股出现深幅调整，中国金融稳定发展委员会随即召开专题会议研究经济形势和资本市场问题，释放出积极信号，引发海外中资股投资情绪的回暖。

本基金本年面临了巨大的挑战，我们虽然积极根据对市场的判断做仓位的调整，并致力于持续优化组合结构，但股票市场的巨大波动拖累了基金的净值表现。在行业配置上，为了抵御各种不确定性，我们兼顾了组合的均衡性，增配一些具有防御性的低估值行业。自下而上选股上，我们坚持以业绩确定性、业务景气度和企业质量等标准精选优质个股。

回顾2022年的投资，我们需继续做投资框架的进化。首先，针对宏观环境的变化，特别是当核心宏观要素出现急剧变化时，一般会引发系统性的冲击，必须进行自上而下的判断，并及时调整组合结构，以防范市场可能的向上或向下风险。其次，继续强化价值投资的理念，股票是基本面和投资者情绪叠加的产物，以价值为准绳会在决策时更为理性，摒弃非理性才会提升决策的准确率。最后，相信优秀企业家的力量，投资之路任重道远，与成熟的企业家相伴同行才能分享成长的价值。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢港股通品质生活慧选混合基金份额净值为0.7446元，本报告期内，基金份额净值增长率为-9.26%，同期业绩比较基准收益率为-7.54%。

#### 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，影响市场的最重要宏观因素出现积极的边际变化，这些重要的变化有望成为影响市场的主要力量。

首先，国内疫情管控政策在二十大之后优化方向明确，各地快速放开严格的封控措施后疫情快速扩散，群体免疫加速推进，这意味着秩序恢复也将远快于国外。跟疫情管控政策优化的行业和公司将会受益，其中受益最直接的是消费行业，消费场景的恢复将带来很多细分行业基本面持续复苏。参照海外经验，放开之后会有多波疫情的冲击，这对消费复苏的节奏会有扰动。合适的投资策略是在预期较低的时点买入，然后等待基本面数据恢复程度的验证后再做进一步决策。疫情管控政策优化之后，整体经济也将会出现一定程度的恢复，失业率也会出现一定幅度的下降，有利于劳动生产率的提升和长期资本回报率提升，跟宏观经济关联的行业将会带来边际改善。

其次是地产方面，2022年4季度地产融资政策的出台使得地产行业信用风险大幅下降，对于经济和产业链而言，现有地产政策解决地产公司的融资问题，但不足以立刻扭转地产行业的供需关系。地产行业的供需关系的扭转，要么是看到房地产销售出现复苏，这依赖刺激需求的政策或购房者预期发生变化，要么等到2023年房地产新增供给大幅下降自然实现供需的均衡。当地产行业的供需关系发生逆转后，地产行业销售



到开工投资的传导将会打通，届时地产产业链中的优质公司将有望迎来上行周期中估值从周期股向成长股的提升。

随着地产政策和疫情管控优化政策的出台，国内资产价格出现反弹。相对不确定的是外需，大概率已经进入下行期，经历了两年多高景气的出口行业可能走弱。从本轮经济周期强度看增长的动力不强，需要参照历史上经济较弱阶段的情况。

再次，海外方面最重要的是通货膨胀，美国连续数月通胀边际走弱说明拐点已经出现，大致能够预判未来几个月美国通胀将继续下降，这意味着美国通胀压力最大的时候可能已经过去，货币政策进入新的阶段，全球风险资产将进入新的周期阶段。后续需要关注美国通胀高位持续的情况，以及经济的韧性，这些因素会对短期市场产生扰动。

最后，关于地缘政治，俄乌冲突带来了一系列重大影响，首先是引发能源价格的巨大波动，这对欧洲影响尤为明显，其次让投资者对全球未来格局产生担忧，但是从2022年下半年开始地缘政治冲突的影响开始淡化，能源价格压力有所缓解。2023年需要关注欧洲在地缘冲突扰动下，其区域内供给侧通胀的影响，相对美国来说欧洲增长更弱、通胀和杠杆率更高，这些因素对金融市场和资产价格产生多大的压力需要关注。

从市场来说，香港股市在过去一年多经历了内外交困的冲击，本轮熊市级别接近2008年的水平，恒生指数动态市盈率接近2018年末的水平，分行业来看包括能源业、金融业等在内的行业市盈率均接近08年以来历史最低水平，因目前港股中新经济行业占比显著提升，其结构已经优化，这意味着恒指的估值处于历史低点。在经历短期较快的修复之后，港股市场投资情绪逐渐恢复到正常，2023年需根据经济数据和政策变化来不断确认本轮周期上行的空间。

从产业自身发展的角度来看，短期看成长性行业依然是新能源电力、新能源车、军工等这些长期方向，但是因为这些主题在过去两年市场反应非常充分，未来关注的重点可能是一些新的技术，特别是处于从0至1突破阶段的技术。

从产业政策的角度。互联网行业从2021年4季度开始遭遇国内监管、海外审计、外资减配、大股东减持等多重压力，市场对大部分负面因素做了充分的反应，无论基本面和估值均遭受重创。近期政策信号释放出一些积极的变化，这对投资者的预期产生积极的影响。2023年此前这些负面因素很难完全消除，特别是互联网平台的体量已经大到跟宏观经济的关联度越来越高，在疲弱的经济环境下盈利前景有一定压力。从中长期角度，企业家精神、商业模式的稳固性、利润与现金流的质量、创新突破引领成长等依然具有深刻的意义和价值，预计在越过极端压力之后，基本面情况将会逐渐在股价中得到更直接的体现。

总体上，我们看好股票市场投资机会，因为压制市场的宏观因素都在出现积极的好转，但市场上涨的幅度和投资方向取决于资金后续流向的变化以及上述一些行业基

本面的演进。从短期看，市场预期与实际基本面之间会因经济复苏较弱而带来二者的阶段性背离，依然需要对短期市场的波动有所防范。

#### 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

本报告期内，基金托管人在永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，永赢基金管理有限公司在永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由永赢基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### §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_B78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	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了永赢港股通品质生活慧选混合型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，后附的永赢港股通品质生活慧选混合型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，公允反映了永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金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，我们独立于永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金，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	永赢港股通品质生活慧选混合型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

	<p>程中了解到的情况存在重大不一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港股通品质生活慧选混合型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港股通品质生活慧选混合型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</p>

	<p>计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，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，就可能对永赢港股通品质生活慧选混合型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港股通品质生活慧选混合型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：永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	79,883,416.01	84,218,145.56
结算备付金		10,020,256.89	401,253.70
存出保证金		947,251.72	227,316.98
交易性金融资产	7.4.7.2	863,063,636.02	1,085,368,245.09
其中：股票投资		858,029,355.20	1,085,368,245.09
基金投资		-	-
债券投资		5,034,280.82	-
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	-	40,000,000.00
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		79,455.63	-
应收股利		-	102,756.78
应收申购款		247,201.65	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	32,819.81
资产总计		954,241,217.92	1,210,350,537.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			

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		-	-
应付清算款		2,632,387.35	698,336.13
应付赎回款		819,925.30	11,014,881.47
应付管理人报酬		1,220,563.79	1,592,893.39
应付托管费		203,427.32	265,482.21
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,297,881.44	1,198,218.29
负债合计		6,174,185.20	14,769,811.49
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	1,273,262,223.78	1,456,951,397.13
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-325,195,191.06	-261,370,670.70
净资产合计		948,067,032.72	1,195,580,726.43
负债和净资产总计		954,241,217.92	1,210,350,537.92

注：（1）报告截止日2022年12月31日，基金份额净值0.7446元，基金份额总额1,273,262,223.78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：永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金

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		-96,413,304.08	-288,958,177.68
1.利息收入		1,421,664.43	2,657,397.56
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,345,549.47	1,761,701.39
债券利息收入		-	747,172.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		76,114.96	148,523.30
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-251,425,480.10	-130,751,557.90
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-274,066,094.00	-154,402,436.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	2,060.27	-232,340.94
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
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	22,638,553.63	23,883,219.74
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	153,357,625.97	-166,382,164.82
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	232,885.62	5,518,147.48

列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		17,592,945.00	47,155,449.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	14,820,931.08	27,011,178.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,470,155.14	4,501,863.12
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	53,361.57
其中：卖出回购金融资产支出		-	53,361.57
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	301,858.78	15,589,046.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-114,006,249.08	-336,113,627.21
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-114,006,249.08	-336,113,627.21
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-114,006,249.08	-336,113,627.21

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：永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金

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）	1,456,951,397.1 3	-	-261,370,670.70	1,195,580,726.4 3
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）	1,456,951,397.1 3	-	-261,370,670.70	1,195,580,726.4 3
三、本期增减 变动额（减少 以“-”号填列）	-183,689,173.35	-	-63,824,520.36	-247,513,693.71
（一）、综合 收益总额	-	-	-114,006,249.08	-114,006,249.08
（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）	-183,689,173.35	-	50,181,728.72	-133,507,444.63
其中：1.基金 申购款	145,615,647.70	-	-39,238,879.50	106,376,768.20
2.基金 赎回款	-329,304,821.05	-	89,420,608.22	-239,884,212.83
（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)	1,273,262,223.78	-	-325,195,191.06	948,067,032.72
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)	2,123,544,881.86	-	64,148,105.27	2,187,692,987.13
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)	2,123,544,881.86	-	64,148,105.27	2,187,692,987.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-666,593,484.73	-	-325,518,775.97	-992,112,260.70
(一)、综合收益总额	-	-	-336,113,627.21	-336,113,627.21
(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)	-666,593,484.73	-	10,594,851.24	-655,998,633.49
其中: 1.基金申购款	1,337,239,736.73	-	166,614,941.30	1,503,854,678.03

2.基金 赎回款	-2,003,833,221. 46	-	-156,020,090.06	-2,159,853,311. 52
(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)	1,456,951,397.1 3	-	-261,370,670.70	1,195,580,726.4 3

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

永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金(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[2020]1551号《关于准予永赢港股通品质生活慧选混合型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2020年9月29日生效,首次设立募集规模为2,170,666,810.23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和注册登记机构为永赢基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证

券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货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的相关规定）。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：股票资产占基金资产的60%-95%，其中投资于品质生活类证券的比例不低于非现金基金资产的80%，港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准为：恒生指数收益率（经汇率调整后）\*65%+中债-综合指数（全价）收益率\*20%+沪深300指数收益率\*15%。

#### 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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 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84,218,145.56元，自应收利息转入的重分类金额为人民币28,658.51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84,246,804.07元。

结算备付金于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401,253.70元，自应收利息转入的重分类金额为人民币198.66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，结算备付金于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401,452.36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227,316.98元，自应收利息转入的重分类金额为人民币61.27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227,378.25元。

买入返售金融资产于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40,000,000.00元，自应收利息转入的重分类金额为人民币3,901.37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，买入返售金融资产于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40,003,901.37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32,819.81元，转出至银行存款的重分类金额为人民币28,658.51元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币198.66元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币61.27元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币3,901.37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。

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。

#### 7.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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	79,883,416.01	84,218,145.56
等于：本金	79,865,730.17	84,218,145.56
加：应计利息	17,685.84	-
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	79,883,416.01	84,218,145.56

## 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	753,348,063.89	-	858,029,355.20	104,681,291.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,991,372.01	43,780.82	5,034,280.82	-872.01
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,991,372.01	43,780.82	5,034,280.82	-872.01
资产支持证券	-	-	-	-	



基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	758,339,435.90	43,780.82	863,063,636.02	104,680,419.30
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	1,134,045,451.76	-	1,085,368,245.09	-48,677,206.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,134,045,451.76	-	1,085,368,245.09	-48,677,206.67

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末	

	2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	40,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	40,000,000.00	-

#### 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	-	32,819.81
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	32,819.81

#### 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	887.68	40,693.56
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,096,993.76	947,524.73
其中：交易所市场	1,096,993.76	947,524.73
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	200,000.00	210,000.00
合计	1,297,881.44	1,198,218.29

## 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	1,456,951,397.13	1,456,951,397.13
本期申购	145,615,647.70	145,615,647.70
本期赎回（以“-”号填列）	-329,304,821.05	-329,304,821.05
本期末	1,273,262,223.78	1,273,262,223.78

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	-193,260,520.78	-68,110,149.92	-261,370,670.70
本期利润	-267,363,875.05	153,357,625.97	-114,006,249.08
本期基金份额交易产生的变动数	45,580,079.67	4,601,649.05	50,181,728.72
其中：基金申购款	-34,578,761.89	-4,660,117.61	-39,238,879.50
基金赎回款	80,158,841.56	9,261,766.66	89,420,608.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-415,044,316.16	89,849,125.10	-325,195,191.06

## 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	1,129,488.33	1,394,979.35
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	204,133.99	321,941.73

其他	11,927.15	44,780.31
合计	1,345,549.47	1,761,701.39

#### 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	2,437,508,630.80	4,369,205,454.59
减：卖出股票成本总额	2,702,154,009.73	4,523,607,891.29
减：交易费用	9,420,715.07	-
买卖股票差价收入	-274,066,094.00	-154,402,436.70

#### 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	2,060.27	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-	-232,340.94
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	2,060.27	-232,340.94

##### 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	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月
----	----------------------------	---------------------------------

	31日	31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	131,887,515.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	130,181,141.17
减：应计利息总额	-	1,938,715.34
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	-232,340.94

#### 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	22,638,553.63	23,883,219.74
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	22,638,553.63	23,883,219.74

## 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	153,357,625.97	-166,382,164.82
——股票投资	153,358,497.98	-166,382,164.82
——债券投资	-872.01	-
——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	153,357,625.97	-166,382,164.82

## 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	206,744.66	4,977,763.88
基金转换费收入	26,140.96	540,383.60
合计	232,885.62	5,518,147.48

## 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	80,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	6,576.09	19,915.30
账户维护费	36,000.00	31,500.00
其他	1,200.00	1,000.00
证券组合费	58,082.69	-
交易费用	-	15,326,630.82
合计	301,858.78	15,589,046.12

#### 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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	14,820,931.08	27,011,178.72
其中：支付销售机构的客户维护费	5,812,927.31	10,710,366.04

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	2,470,155.14	4,501,863.12

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：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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自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	上年度可比期间 2021年01月01日至

	2022年12月31日	2021年12月31日
报告期初持有的基金份额	30,005,600.00	30,005,600.00
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	30,005,600.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	30,005,600.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	2.0595%

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
交通银行	79,883,416.01	1,129,488.33	84,218,145.56	1,394,979.35

#### 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
688322	奥比中光	2022-06-30	6个月	新股限售	30.99	21.38	8,529	264,313.71	182,350.02	-
688084	晶品特装	2022-12-01	6个月	新股限售	60.98	74.73	1,875	114,337.50	140,118.75	-
688370	丛麟科技	2022-08-17	6个月	新股限售	59.76	34.87	3,254	194,459.04	113,466.98	-
301152	天力锂能	2022-08-19	6个月	新股限售	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301121	紫建电子	2022-08-01	6个月	新股限售	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301132	满坤科技	2022-08-03	6个月	新股限售	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6个月	新股限售	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301270	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	-

#### 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金融资产款余额。

##### 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金融资产款余额。

#### 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	5,034,280.82	-
合计	5,034,280.82	-

注：1、国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级；  
2、上年度末，本基金未持有短期债券投资。

#### 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

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

#### 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每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可

变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注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	79,883,416.01	-	-	-	-	-	79,883,416.01
结算备付金	10,020,256.89	-	-	-	-	-	10,020,256.89
存出保证金	947,251.72	-	-	-	-	-	947,251.72

永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 2022 年年度报告

交易性金融资产	-	-	5,034,280.82	-	-	858,029,355.20	863,063,636.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	79,455.63	79,455.63
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	247,201.65	247,201.65
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	90,850,924.62	-	5,034,280.82	-	-	858,356,012.48	954,241,217.92
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	2,632,387.35	2,632,387.35
应付赎回款	-	-	-	-	-	819,925.30	819,925.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,220,563.79	1,220,563.79
应付托管费	-	-	-	-	-	203,427.32	203,427.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,297,881.44	1,297,881.44
负债总计	-	-	-	-	-	6,174,185.20	6,174,185.20
利率敏感度缺	90,850,924.62	-	5,034,280.82	-	-	852,181,827.28	948,067,032.72

永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 2022 年年度报告

口							
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	84,218,145.56	-	-	-	-	-	84,218,145.56
结算备付金	401,253.70	-	-	-	-	-	401,253.70
存出保证金	227,316.98	-	-	-	-	-	227,316.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,085,368,245.09	1,085,368,245.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	40,000,000.00	-	-	-	-	-	40,000,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	102,756.78	102,756.78
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	32,819.81	32,819.81
资产总计	124,846,716.24	-	-	-	-	1,085,503,821.68	1,210,350,537.92
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	-	-	-	-	-	698,336.13	698,336.13
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,014,881.47	11,014,881.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,592,893.39	1,592,893.39
应付托管费	-	-	-	-	-	265,482.21	265,482.21
应付销	-	-	-	-	-	-	-



售服务费							
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,198,218.29	1,198,218.29
负债总计	-	-	-	-	-	14,769,811.49	14,769,811.49
利率敏感度缺口	124,846,716.24	-	-	-	-	1,070,734,010.19	1,195,580,726.43

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	-13,293.02	-
	市场利率平行下降50个基点	13,293.02	-

注：上年度末，本基金未持有债券，无重大利率风险。

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合	合计

	币		人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	817,579,870.6 3	-	817,579,870.6 3
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	817,579,870.6 3	-	817,579,870.6 3
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	817,579,870.6 3	-	817,579,870.6 3
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元折 合人民 币	港币折合人 民币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	934,942,851.3 6	-	934,942,851.3 6
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收股利	-	102,756.78	-	102,756.78
应收申购款	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	935,045,608.14	-	935,045,608.14
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	935,045,608.14	-	935,045,608.14

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的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
	所有外币相对于人民币升值5%	40,878,993.53	46,752,280.41
	所有外币相对于人民币贬值5%	-40,878,993.53	-46,752,280.41

#### 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	858,029,355.20	90.50	1,085,368,245.09	90.78

产—股票投资				
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	858,029,355.20	90.50	1,085,368,245.09	90.78

#### 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%	9,194,589.34	17,186,344.80
	业绩比较基准减少1%	-9,194,589.34	-17,186,344.80

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	857,530,418.19	1,084,323,203.01
第二层次	5,034,280.82	75,449.44
第三层次	498,937.01	969,592.64
合计	863,063,636.02	1,085,368,245.09

## 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	-	969,592.64	969,592.64
当期购买	-	646,621.67	646,621.67
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	843,614.11	843,614.11

当期利得或损失总额	-	-273,663.19	-273,663.19
其中：计入损益的利得或损失	-	-273,663.19	-273,663.19
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	498,937.01	498,937.01
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	-	-147,684.66	-147,684.66
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	-	536,760.19	536,760.19
当期购买	-	548,474.27	548,474.27
当期出售/结算	-	217,854.40	217,854.40
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	497,617.40	497,617.40
当期利得或损失总额	-	599,829.98	599,829.98
其中：计入损益的利得或损失	-	599,829.98	599,829.98
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	969,592.64	969,592.64
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	-	421,118.37	421,118.37

## 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	498,937.01	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	0.1444-0.6535	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	969,592.64	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	0.3138-2.7417	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	858,029,355.20	89.92
	其中：股票	858,029,355.20	89.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,034,280.82	0.53
	其中：债券	5,034,280.82	0.53
	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	89,903,672.90	9.42
8	其他各项资产	1,273,909.00	0.13
9	合计	954,241,217.92	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817,579,870.63元，占期末净值比例86.24%。

## 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,067,859.89	3.07
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	4,815,500.00	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,957.70	0.00
J	金融业	-	-



K	房地产业	2,307,000.00	0.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,384,700.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	113,466.98	0.01
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	2,755,000.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	40,449,484.57	4.27

### 8.2.2 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(%)
原材料	-	-
非日常生活消费品	202,520,909.53	21.36
日常消费品	37,809,135.58	3.99
能源	94,357,561.67	9.95
金融	57,322,565.13	6.05
医疗保健	113,504,509.33	11.97
工业	20,325,422.70	2.14
信息技术	14,730,879.84	1.55
通讯业务	141,722,913.10	14.95
公用事业	4,761,700.79	0.50
房地产	130,524,272.96	13.77
合计	817,579,870.63	86.24

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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	H01797	新东方在线	1,908,000	89,478,855.90	9.44
2	H00700	腾讯控股	185,100	55,224,988.52	5.83
3	H01658	邮储银行	12,536,000	54,310,458.69	5.73
4	H00728	中国电信	19,270,000	52,844,870.60	5.57
5	H01109	华润置地	1,458,000	46,560,358.85	4.91
6	H02883	中海油田服务	5,390,000	45,691,743.10	4.82
7	H00688	中国海外发展	2,414,000	44,420,887.87	4.69
8	H00941	中国移动	728,000	33,653,053.98	3.55
9	H03690	美团-W	215,000	33,551,667.84	3.54
10	H00883	中国海洋石油	3,300,000	29,418,954.18	3.10
11	H09926	康方生物-B	705,000	27,079,480.05	2.86
12	H01458	周黑鸭	4,973,000	24,965,342.21	2.63
13	H09995	荣昌生物-B	458,000	23,687,912.51	2.50
14	H00175	吉利汽车	2,084,000	21,221,951.35	2.24
15	H01072	东方电气	1,713,400	20,325,422.70	2.14
15	600875	东方电气	40,000	840,800.00	0.09
16	H00027	银河娱乐	419,000	19,312,854.71	2.04
17	H01088	中国神华	955,500	19,246,864.39	2.03
18	002291	遥望科技	1,462,200	19,008,600.00	2.00
19	H02269	药明生物	287,500	15,370,385.23	1.62
20	H01789	爱康医疗	1,728,000	15,111,555.78	1.59
21	H01928	金沙中国有限公司	550,800	12,743,139.70	1.34
22	H03900	绿城中国	1,218,500	12,408,324.24	1.31
23	H01579	颐海国际	489,000	12,055,929.23	1.27
24	H00013	和黄医药	531,000	11,383,832.88	1.20

25	H06160	百济神州	90,500	10,848,853.48	1.14
26	H02162	康诺亚-B	220,000	10,022,489.40	1.06
27	H06862	海底捞	494,000	9,884,568.51	1.04
28	H00960	龙湖集团	451,000	9,789,613.91	1.03
29	H06098	碧桂园服务	558,000	9,689,764.19	1.02
30	H00763	中兴通讯	579,800	8,908,188.67	0.94
31	H00780	同程旅行	396,000	6,643,141.80	0.70
32	H09922	九毛九	318,000	5,922,648.08	0.62
33	H00354	中国软件国际	960,000	5,822,691.17	0.61
34	H00836	华润电力	334,000	4,761,700.79	0.50
35	H06049	保利物业	100,000	4,113,508.35	0.43
36	H01209	华润万象生活	100,000	3,541,815.55	0.37
37	H00388	香港交易所	10,000	3,012,106.44	0.32
38	002352	顺丰控股	50,000	2,888,000.00	0.30
39	001914	招商积余	150,000	2,307,000.00	0.24
40	300788	中信出版	100,000	2,025,000.00	0.21
41	601021	春秋航空	30,000	1,927,500.00	0.20
42	600572	康恩贝	400,000	1,892,000.00	0.20
43	600519	贵州茅台	1,000	1,727,000.00	0.18
44	002304	洋河股份	10,000	1,605,000.00	0.17
45	H00667	中国东方教育	262,000	1,458,048.89	0.15
46	H00839	中教控股	159,000	1,434,502.29	0.15
47	688133	泰坦科技	10,000	1,384,700.00	0.15
48	688501	青达环保	50,000	1,292,500.00	0.14
49	603369	今世缘	20,000	1,018,000.00	0.11
50	H09633	农夫山泉	20,000	787,864.14	0.08
51	H09987	百胜中国	2,000	784,291.06	0.08
52	300144	宋城演艺	50,000	730,000.00	0.08
53	600809	山西汾酒	2,500	712,475.00	0.08
54	002735	王子新材	25,000	523,250.00	0.06
55	688322	奥比中光	8,529	182,350.02	0.02

56	688084	晶品特装	1,875	140,118.75	0.01
57	688370	从麟科技	3,254	113,466.98	0.01
58	H09658	特海国际	9,600	85,239.40	0.01
59	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
60	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
61	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
62	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
63	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
64	301270	汉仪股份	210	5,957.70	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	H03690	美团-W	155,653,760.63	13.02
2	H00700	腾讯控股	128,794,383.22	10.77
3	H00941	中国移动	117,920,004.11	9.86
4	H01024	快手-W	88,467,690.65	7.40
5	H00883	中国海洋石油	79,057,080.99	6.61
6	H01797	新东方在线	70,572,474.26	5.90
7	000625	长安汽车	68,918,225.90	5.76
8	H00728	中国电信	62,107,522.09	5.19
9	H00175	吉利汽车	61,009,833.63	5.10
10	H00884	旭辉控股集团	55,933,068.21	4.68
11	600197	伊力特	52,933,753.68	4.43
12	H00388	香港交易所	52,544,820.75	4.39
13	600519	贵州茅台	48,807,414.00	4.08

14	H00027	银河娱乐	48,206,444.50	4.03
15	H01088	中国神华	45,955,615.04	3.84
16	H01658	邮储银行	44,692,874.55	3.74
17	002291	遥望科技	43,935,226.00	3.67
18	H00817	中国金茂	43,794,920.93	3.66
19	H02883	中海油田服务	41,570,453.73	3.48
20	H00688	中国海外发展	38,750,708.69	3.24
21	H01928	金沙中国有限公司	38,674,804.52	3.23
22	H01171	兖矿能源	36,960,344.89	3.09
23	H00123	越秀地产	30,944,175.85	2.59
24	H03606	福耀玻璃	28,678,333.31	2.40
25	H01109	华润置地	28,153,711.15	2.35
26	601728	中国电信	26,524,841.00	2.22
27	H03900	绿城中国	26,189,675.41	2.19
28	600875	东方电气	24,536,285.80	2.05
29	600941	中国移动	24,433,477.50	2.04
30	H00857	中国石油股份	24,189,159.16	2.02
31	H01128	永利澳门	23,988,815.46	2.01

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	H01024	快手-W	128,439,471.42	10.74
2	H03690	美团-W	103,644,872.82	8.67
3	H00175	吉利汽车	102,330,017.81	8.56
4	H03968	招商银行	93,530,384.51	7.82

5	H00388	香港交易所	92,402,032.36	7.73
6	600519	贵州茅台	89,046,643.00	7.45
7	H00941	中国移动	83,751,121.25	7.01
8	H03900	绿城中国	69,613,374.60	5.82
9	H00700	腾讯控股	68,449,686.53	5.73
10	H01797	新东方在线	66,028,524.44	5.52
11	H02238	广汽集团	61,741,462.81	5.16
12	H02319	蒙牛乳业	58,156,600.82	4.86
13	H01458	周黑鸭	55,895,991.12	4.68
14	H01772	赣锋锂业	54,293,790.72	4.54
15	H00688	中国海外发展	52,835,410.62	4.42
16	600197	伊力特	52,765,626.59	4.41
17	000625	长安汽车	49,184,461.21	4.11
18	000848	承德露露	48,954,681.30	4.09
19	H01109	华润置地	47,070,009.55	3.94
20	H00883	中国海洋石油	46,344,777.65	3.88
21	H01171	兖矿能源	41,947,731.46	3.51
22	H01579	颐海国际	40,406,340.64	3.38
23	H00817	中国金茂	37,629,309.70	3.15
24	H09633	农夫山泉	33,658,662.36	2.82
25	H02382	舜宇光学科技	30,111,736.85	2.52
26	H00027	银河娱乐	29,566,999.86	2.47
27	H00884	旭辉控股集团	28,829,777.82	2.41
28	600406	国电南瑞	28,546,171.84	2.39
29	H03606	福耀玻璃	27,228,745.31	2.28

30	H01088	中国神华	26,748,640.97	2.24
31	601728	中国电信	26,743,464.89	2.24
32	H00123	越秀地产	26,367,379.46	2.21
33	H00857	中国石油股份	24,975,788.60	2.09

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	2,321,456,621.86
卖出股票收入（成交）总额	2,437,508,630.80

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	5,034,280.82	0.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,034,280.82	0.53

#### 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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净
---	------	------	-------	------	--------

号					值比例(%)
1	019679	22国债14	50,000	5,034,280.82	0.53

### 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

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中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年受到行政处罚, 处罚金额合计为370万元。

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。

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	947,251.72
2	应收清算款	79,455.63
3	应收股利	-
4	应收利息	-



5	应收申购款	247,201.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,273,909.00

#### 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
40,668	31,308.70	54,658,558.69	4.2928%	1,218,603,665.09	95.7072%

#### 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	2,714,373.42	0.21%

#### 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、基金投资和研究	10~50

部门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的 产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
晏青	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年09月29日)基金份额总额	2,170,666,810.23
本报告期期初基金份额总额	1,456,951,397.13
本报告期基金总申购份额	145,615,647.70
减：本报告期基金总赎回份额	329,304,821.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,273,262,223.78

### §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。

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

#### 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80,000.00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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	14,549,469.00	0.31%	10,639.97	0.31%	-
安信证券	2	85,181,971.74	1.79%	61,585.47	1.82%	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	689,402,453.17	14.53%	498,767.21	14.71%	-

东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	161,356,897.79	3.40%	116,475.87	3.43%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	81,600,555.56	1.72%	59,659.49	1.76%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	121,163,535.01	2.55%	87,010.22	2.57%	-
光大证券	2	138,864,412.51	2.93%	101,433.95	2.99%	-
广发证券	2	441,774,189.83	9.31%	306,581.39	9.04%	-
国金证券	2	647,718,212.74	13.65%	450,192.64	13.28%	-
国盛证券	2	41,735,448.31	0.88%	30,389.93	0.90%	-
国泰君安证券	2	467,315,362.06	9.85%	337,881.66	9.96%	-
国信证券	2	2,160,536.73	0.05%	1,561.70	0.05%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	541,445.44	0.01%	395.77	0.01%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	606,409,131.23	12.78%	438,428.66	12.93%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华兴证券	2	5,864,395.60	0.12%	4,280.58	0.13%	-
申万宏源证券	2	5,562,524.00	0.12%	3,994.38	0.12%	-
天风	2	25,747,057.94	0.54%	18,573.39	0.55%	-

证券						
西部证券	2	670,486,193.81	14.13%	485,298.91	14.31%	-
信达证券	2	50,393,572.97	1.06%	36,600.83	1.08%	-
兴业证券	2	78,955,665.58	1.66%	57,674.36	1.70%	-
银河证券	2	386,697,917.26	8.15%	267,390.29	7.89%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	14,606,839.18	0.31%	10,567.48	0.31%	-
中信建投	2	7,792,644.08	0.16%	5,602.77	0.17%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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

### 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
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	77,000,000.00	62.51%	-	-	-	-
信达证券	4,991,372.01	100.00%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	46,174,000.00	37.49%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2021年第四季度报告	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、最低赎回（含转换转出）份额和最低持有份额数额限制的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-04
4	永赢基金管理有限公司关于新增招商银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并	中国证监会规定媒介	2022-03-23

	参加费率优惠活动的公告		
5	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-26
6	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
7	永赢基金管理有限公司关于新增中国中金财富证券有限公司为永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-07-18
8	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金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	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金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
13	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2022年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2022-10-26
14	永赢基金管理有限公司关于新增华宝证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-16
15	永赢基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2022-11-16

	设立香港子公司及获批相关业务牌照的公告		
16	永赢港股通品质生活慧选混合型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	2022-12-30
17	永赢港股通品质生活慧选混合型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	2022-12-30
18	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金2023年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-12-30

## §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港股通品质生活慧选混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《永赢港股通品质生活慧选混合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。

### 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](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  
二〇二三年三月三十日