

# 永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）

2022年第1季度报告

2022年03月31日

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2022年04月22日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至2022年3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）
基金主代码	013668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月22日
报告期末基金份额总额	227,841,080.09份
投资目标	在严格控制组合风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>为获取持续、稳健的投资收益，本基金的大类资产配置策略将以固定收益类资产为主，在此基础上，基金管理人将根据对未来市场环境所进行的预测和判断，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产的分配比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的配置比例。</p> <p>具体执行上：在战略层面，以价值投资为核心，制定长期的资产配置计划，主要关注宏观经济的周期、各类资产的估值水平以及企业的盈利状况等；在战术层面，以趋势投资为核心，主要关注基本面的边际变化、各类资产的价格走势、以及机构投资者的行为等，在长期资产配置计划的基础上，灵活调整</p>

产品资产结构，把握中期波段收益；在更短期的时间维度上，本产品会监控净值波动，通过科学的方法控制回撤，进行有效的下行保护。

## 2、基金投资策略

基于大类资产配置的战略资产配置（SAA）、战术资产配置（TAA）及回撤控制三部分得出的配置比重，配置各类子基金。

### （1）债券型基金

对于债券型基金的投资，首先根据战略和战术层面确定组合久期和期限结构，以及所投资债券基金类型及其投资比例。同时，通过归因分析拆解子基金库中基金的组合收益来源，明确基金在久期、信用和杠杆各个部分的收益贡献，将其进行分组。其次，采用定量分析和定性分析相结合的研究方法，综合评估各组内基金及基金经理的超额收益、稳定性、持续性等，精选投资风格稳健、前瞻性强的基金。

定量方面，结合简单收益、风险调整收益等指标，综合评价基金的历史风险与收益，并分别考察不同市场环境下的收益表现以及回撤情况。对于不同指标，采取标准分加权相加的方法，予以排名。

定性方面，主要对基金公司和基金经理进行评估，通过数据分析和实际调研，考察基金公司的信评体系、投资和风险控制流程，基金经理的投资业绩、投资风格和投资理念等方面，优选具有比较优势、投资理念稳健的债券型基金。

最后综合考虑基金的定量评价排名和基金经理的定性分析，选择综合能力较强的基金进行投资。

### （2）股票型基金

对于股票型基金，基于定量及定性的评价体系，从基金的投资收益、基金经理的投资理念、投资流程、投资团队、风险控制等维度进行评估。将定量及定性的评价结果进行交叉验证，综合评定，选择能持续创造超额收益、投资逻辑清晰、风险控制能力突出的子基进行行配置，以在基金精选层面获取超额收益。

### （3）混合类基金

对于混合型基金，综合评估子基金行业配置能力、择时能力、选股择券能力、以及权益和固定收益两部分的投资比例和风格，择优选取能够持续获取稳定收益、风格稳定、投资逻辑清晰的子基金进行配置。

#### （4）指数型基金

指数基金具有风格明确、费用低等多项优势。选择指数基金时，主要考虑跟踪误差、基金规模、费率等因素，选择成本低、跟踪误差小、流动性好的基金。

#### （5）货币市场基金

货币市场基金作为流动性管理工具，在投资选择时主要考虑基金规模、流动性、收益水平、赎回机制等方面因素，择优配置。

#### （6）商品类基金

本基金主要选择具备有效抵御通胀，与其他资产相关性较低的商品进行配置。商品类基金定量分析主要通过基金规模、费率、流动性、代表性，对商品类基金市场表现及管理水准进行评价，择优进行投资并合理控制风险。

### 3、股票投资策略

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

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

### 4、港股通标的股票投资策略

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。

本基金将重点关注：

- （1）相对A股有稀缺性行业与个股，对资本有显著的吸引力，具有较高的配置价值；
- （2）具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业具有良好成长性或高额股东回报率；
- （3）盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的上市公司；
- （4）相对A股同类公司具有显著的估值优势的公司。

#### 5、固定收益投资策略

本基金通过综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，实施积极主动的组合管理，以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。

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

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

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

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

本基金主动投资信用债的评级须在AA（含AA）以上，除短期融资券、超短期融资券以外的信用债采用债项评级，短期融资券、超短期融资券采用主体评级；若没有债项评级或者债项评级体系与前述评级要求不一致的，参照主体评级。其中评级为AA的信用债占信用债资产比例不超过20%，评级为AA+的信用债占信用债资产比例不超过50%，评级为AAA的信用债

	<p>占信用债资产比例不低于50%。基金持有信用债期间，如果其评级下降、基金规模变动、变现信用债支付赎回款项等使得投资比例不再符合上述约定，应在评级报告发布之日或不再符合上述约定之日起3个月内调整至符合约定。本基金对信用债评级的认定参照基金管理人选定的评级机构出具的债券信用评级。所指信用债包括金融债（不包括政策性金融债）、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券。</p> <p>6、可转换债券投资策略</p> <p>本基金在综合分析可转债的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上，审慎筛选其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，以及基础股票基本面优良的品种，并以合理的价格买入，争取稳健的投资回报。</p> <p>7、可交换债券配置策略</p> <p>可交换债券的价值取决于其股权价值、债券价值以及内嵌期权价值。其中其债券价值与可转换债券相同，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而其股权价值则需要关注发行人持有的其他上市公司（目标公司）的股票价值。本基金将结合对可交换债券的纯债部分价值以及对目标公司的股票价值的综合评估，选择具有较高投资价值的可交换债券进行投资。</p> <p>8、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券、住房抵押贷款支持证券等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p>
业绩比较基准	中证800指数收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×85%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金中基金（FOF），理论上其预期

	风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF）、混合型基金、混合型基金中基金（FOF），高于货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。 本基金还可投资港股通投资标的股票，还需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C
下属分级基金的交易代码	013668	013669
报告期末下属分级基金的份额总额	82,428,539.74份	145,412,540.35份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年01月01日 - 2022年03月31日)	
	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C
1. 本期已实现收益	-1,311,480.48	-2,454,702.25
2. 本期利润	-1,455,353.38	-2,708,405.40
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0177	-0.0186
4. 期末基金资产净值	81,211,968.87	143,111,008.35
5. 期末基金份额净值	0.9852	0.9842

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.76%	0.12%	-1.41%	0.16%	-0.35%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-1.48%	0.12%	-1.07%	0.15%	-0.41%	-0.03%

## 永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.85%	0.12%	-1.41%	0.16%	-0.44%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-1.58%	0.12%	-1.07%	0.15%	-0.51%	-0.03%

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



永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 12 月 22 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

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

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 12 月 22 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田沁琰	基金经理	2021-12-22	-	6	田沁琰女士，硕士，6年证券相关从业经验。曾任汇丰银行个人银行及财富管理部客户助理，宁波银行金融市场部交易及流动性管理岗，海通证券固定收益部投资经理，现任永赢基金管理有限公司FOF投资部基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

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

债市方面，一季度利率走势以春节为节点，呈现先下后上的V型走势，市场由宽货币交易逐步切换至宽信用预期。具体而言，春节前在央行降息、官员讲话推动下收益率显著下行；节后伴随信贷开门红落地、地产放松政策密集出台，市场宽信用预期逐步发酵，极端情绪出现修正，带动收益率震荡回升；3月中旬以来随着国内疫情发酵，市场收益率再度小幅回落。总体上一季度末10年国债相对去年末上行1bp。一季度仍有信用风险事件发生，新增违约风险事件主要集中在房地产行业，部分民营房企债券展期，部分民营房企更换审计师或无法按时披露审计年报，引发市场对民企地产财务真实性的担忧。此外，理财产品到期赎回也对债券市场带来一定负反馈，银行二级资本债调整较大，期间3年和5年期的中债隐含评级AAA-的估值收益率最高分别上行25BP和27BP。权益市场方面，受海外货币政策收紧等因素影响，一季度整体走势偏弱。

报告期内，为获取稳健的收益，本基金的大类资产配置以固定收益类资产为主，在此基础上，跟随各类资产风险收益特征的趋势变化，动态调整组合久期以及权益类资产的配置比例和配置风格。在一季度基本面没有提供显著配置机会的情况下，交易以把握波段趋势为主，并监控净值波动，控制回撤，进行有效的下行保护。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A基金份额净值为0.9852元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.76%，同期业绩比较基准收益率为-1.41%；截至报告期末永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C基金份额净值为0.9842元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.85%，同期业绩比较基准收益率为-1.41%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	180,476,213.15	80.34
3	固定收益投资	13,836,005.34	6.16
	其中：债券	13,836,005.34	6.16
	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	28,036,619.16	12.48
	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	2,282,003.61	1.02
8	其他资产	12,630.48	0.01
9	合计	224,643,471.74	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

##### 5.2.2 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。

#### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净
----	------	---------	--------

			值比例（%）
1	国家债券	13,836,005.34	6.17
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	13,836,005.34	6.17

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019664	21国债16	137,000	13,836,005.34	6.17

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

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

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,973.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	10,457.18
4	应收利息	-
5	应收申购款	199.84
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	12,630.48

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 基金中基金

### 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	006664	易方达安悦超短债债券F	契约型开放式	43,051,650.40	43,693,119.99	19.48	否
2	007	南方梦元	契约	32,168,9	34,32	15.30	否

	790	短债债券A	型开 放式	92.42	7,531. 81		
3	010 169	天弘安利 短债债券C	契约 型开 放式	30,944,3 04.72	32,48 8,425. 53	14.48	否
4	002 086	大成景安 短融债券E	契约 型开 放式	21,997,5 10.94	27,06 1,337. 96	12.06	否
5	110 016	易方达货 币B	契约 型开 放式	19,509,0 26.97	19,50 9,026. 97	8.70	否
6	011 622	汇添富短 债债券E	契约 型开 放式	15,555,3 43.42	17,01 5,990. 17	7.59	否
7	070 009	嘉实超短 债C	契约 型开 放式	3,467,09 5.93	3,640, 797.44	1.62	否
8	006 852	永赢迅利 中高等级 短债债券A	契约 型开 放式	2,613,98 9.01	2,739, 983.28	1.22	是

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用2022年01月01日至 2022年03月31日	其中：交易及持有基金管理 人以及管理人关联方所管理 基金产生的费用
当期交易基金产生的申 购费（元）	100.00	-
当期交易基金产生的赎 回费（元）	11,411.21	11,411.21
当期持有基金产生的应 支付销售服务费（元）	40,858.82	-
当期持有基金产生的应 支付管理费（元）	126,410.38	7,996.20
当期持有基金产生的应 支付托管费（元）	36,732.11	2,665.42

注：（1）当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

（2）根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内，本基金所持有的子基金未发生重大影响事件。

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C
报告期期初基金份额总额	82,427,990.92	145,412,387.89
报告期期间基金总申购份额	548.82	152.46
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	82,428,539.74	145,412,540.35

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-



报告期期末管理人持有的本基金份 额	10,000,000.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例（%）	4.39	-

## 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 9 报告期末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	10,000,000.00	4.39%	10,000,000.00	4.39%	不少于3 年
基金管理人高 级管理人员	10,000.00	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	10,010,000.00	4.39%	10,000,000.00	4.39%	不少于3 年

## § 10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 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。

### 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）注册的文件；
2. 《永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
3. 《永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
4. 《永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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。

## 11.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层

## 11.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：[www.maxwealthfund.com](http://www.maxwealthfund.com)。

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司

2022年04月22日