

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

2021 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:2022 年 03 月 26 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2022年3月24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2021年01月01日起至2021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 | 8 |
| 2.4 信息披露方式 | 9 |
| 2.5 其他相关资料 | 9 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 9 |
| 3.2 基金净值表现 | 10 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 | 12 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 15 |
| 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 | 17 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 18 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 | 20 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 20 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 21 |
| 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 | 21 |
| 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 | 21 |
| §5 托管人报告 | 21 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 21 |
| 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 | 21 |
| 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 | 21 |
| §6 审计报告 | 21 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 21 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 22 |
| §7 年度财务报表 | 24 |
| 7.1 资产负债表 | 24 |
| 7.2 利润表 | 26 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 28 |
| 7.4 报表附注 | 29 |
| §8 投资组合报告 | 67 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 67 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 67 |
| 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 | 69 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 73 |
| 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 | 76 |
| 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 | 76 |

| | |
|---|----|
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 76 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 76 |
| 8.12 投资组合报告附注..... | 76 |
| §9 基金份额持有人信息..... | 77 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 77 |
| 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 |
| §10 开放式基金份额变动..... | 78 |
| §11 重大事件揭示..... | 78 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 78 |
| 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..... | 78 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 78 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 79 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 79 |
| 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..... | 79 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 79 |
| 11.8 其他重大事件..... | 83 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 86 |
| 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..... | 86 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 86 |
| §13 备查文件目录..... | 86 |
| 13.1 备查文件目录..... | 86 |
| 13.2 存放地点..... | 87 |
| 13.3 查阅方式..... | 87 |

§ 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 | 1,456,951,397.13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 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 品质生活类证券的界定</p> <p>伴随中国经济的快速发展，人民生活水平的不断提高，物质的供给已相对丰富。展望未来，一方面，随着传统产业相对饱和，企业将逐渐由原来的投资驱动转变为研发、创意驱动，提供高品质的产品和服务。另一方面，越来越多的居民步入中产阶级，将会更加注重产品、服务品质，带动消费升级。在此背景下，能够为居民提供优质的产品、服务、解决方案，用以直接或间接提升居民生活品质的相关上市公司将面临者巨大的商业空间和发展潜力，包括但不限于：纺织</p> |

服装、食品饮料、房地产及服务、汽车及服务、家用电器、建筑装饰、公用事业、医药生物、电商物流、教育教培、金融服务、休闲娱乐、传媒、计算机、消费电子、通信服务、交通运输、轻工制造等相关行业。

(2) 选股策略

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：

自上而下方面，宏观研究通过财政与货币政策、经济增长率和通货膨胀率等构建分析框架，分析这些核心因素的变化，预判宏观经济走势；策略研究分析宏观变化对市场估值影响，以及宏观政策对不同产业影响，通过比较投资的风险收益比，在不同的宏观背景下制定相应的股票市场和行业配置策略。

自下而上方面，通过分析行业所处阶段（重点配置成长期与成熟期的行业，积极跟踪处于幼稚期的行业，回避处于衰退期的行业）、公司商业模式（商业模式研究是企业价值评估的核心，拥有良好商业模式的企业能够持续创造较高的股东回报率，而有缺陷的商业模式则在长期经营中面临难以预测的风险，精选具有较强研发能力、明显成本优势和广泛品牌影响力的公司）、竞争格局（研究所处行业的竞争格局，包括行业进入与退出壁垒、公司市场地位和市场份额、竞争对手的产品与服务的替代性等，重点关注行业格局稳定的龙头公司）、公司治理结构（大股东对待小股东的态度和诚信程度、管理层的战略眼光和运营效率水平，优选治理结构优秀的公司）。定量上评估企业的成长性（主营业务收入增长率、营业利润增长率、净利润增长率、自由现金流增长率、每股收益增长率等，以及业务成长空间）、盈利能力（净资产收益率、销售毛利率、销售净利率、EBITDA/主营业务收入等，以及长期的股东回报水平）、估值水平（市盈率PE、市盈率相对盈利增长比率PEG、市销率PS等，看估值能否跟成长相匹配）。

结合宏观视角与微观研究，多维度 and 全视角对公

司做价值评估，结合其历史和动态估值水平，寻找投资具有较高性价比个股。

（3）港股通标的投资策略

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

本基金将精选品质生活类证券，重点关注：

1) 具有稀缺性，长期股东回报率出色，具有较高的配置价值的公司；

2) 具有持续领先优势或核心竞争力的公司，良好成长性 or 较高股东回报率；

3) 盈利能力强、分红稳定或分红潜力大的公司；

4) 相对 A 股同类公司具有显著的估值优势的公司。

（4）存托凭证投资策略

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

3、固定收益投资策略

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

4、可转换债券投资策略

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。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券、住房抵押贷款支持证券等证券品种。本基金将重点对

| | |
|---------------|--|
| | <p>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> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以期萃取相应债券组合的超额收益。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>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%</p> |
| <p>风险收益特征</p> | <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

| | | |
|-----------|--------------|--------------|
| <p>项目</p> | <p>基金管理人</p> | <p>基金托管人</p> |
|-----------|--------------|--------------|

| | | | |
|-------------|--------------------------------|--------------------------|-------------------|
| 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21世纪大厦21、22、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21世纪大厦21、22、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） | 上海市世纪大道100号环球金融中心50楼 |
| 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21世纪大厦21、22、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 | 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 | -169,731,462.39 | -53,492,788.29 |
| 本期利润 | -336,113,627.21 | 64,212,169.86 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1891 | 0.0296 |
| 本期加权平均净值利润率 | -18.79% | 2.96% |
| 本期基金份额净值增长率 | -20.35% | 3.02% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021年末 | 2020年末 |
| 期末可供分配利润 | -261,370,670.70 | -52,304,614.01 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1794 | -0.0246 |
| 期末基金资产净值 | 1,195,580,726.43 | 2,187,692,987.13 |
| 期末基金份额净值 | 0.8206 | 1.0302 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2021年末 | 2020年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | -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 | -9.74% | 1.05% | -3.91% | 0.72% | -5.83% | 0.33% |
| 过去六个月 | -22.08% | 1.48% | -13.97% | 0.93% | -8.11% | 0.55% |
| 过去一年 | -20.35% | 1.54% | -11.04% | 0.92% | -9.31% | 0.62% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -17.94% | 1.41% | -2.83% | 0.88% | -15.11% | 0.53% |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|

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



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2021年12月31日，本基金管理人共管理92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、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢嘉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、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢诚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、永赢伟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、永赢合益债券型证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、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、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、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、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫享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、永赢成长领航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、永赢惠添益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、永赢合享混合型发起式证券投资基金、永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、永赢安盈90天滚动持有债券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以及永赢优质精选混合型发起式证券投资基金。

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 | - | 15 | 晏青先生，上海交通大学经济学硕士，15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 | - | 9 | 李琦先生，硕士，9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，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。

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

国内经济2021年增长较好，国内生产总值同比增长8.1%，但结构不均衡的矛盾较为突出。1季度GDP因低基数增长18.2%，原油等大宗商品价格上涨推动PPI和CPI环比持续正增长。2季度经济比较平稳，GDP增速回落至7.9%，PPI高位有所回落，CPI温和修复。3季度经济有所减弱，GDP增速回落至4.9%，制造业PMI跌到荣枯线以内，PPI创新高，但CPI表现疲弱，二者显著背离。4季度GDP增长4%，除了出口比较旺盛，增长动能疲弱，制造业PMI处于荣枯线附近，基建投资和房地产投资处于下滑态势，疫情反复导致消费比较疲弱，PPI处于高位，CPI有所上行，显示了上下游景气度的不同。12月的中央经济工作会议提出“需求收缩、供给冲击和预期转弱三重压力”，政府对于经济稳增长的高度重视显著提升。美国经济全年实现5.6%的增长，呈持续扩张态势。美国全年的货币政策维持较为宽松局面，但到年末通胀压力高企，通胀率创40年来新高，美联储态度显著改变对货币政策的立场，不断提升加息的节奏和幅度的预期。

除了经济本身的周期波动外，国内出台的各项针对产业的政策也对相关行业形成较大冲击。2020年末推出的针对互联网平台反垄断的政策，对互联网行业的监管不断加强，对互联网巨头的增长也产生短期较为明显的抑制。“双碳”政策带来国内大宗商品价格暴涨的同时，也带来社会生活和生产的不稳定，出现了缺煤缺电的极端情况。2021年7月份推出的义务教育阶段的“双减”政策，对教培行业产生严重打击。监管部门为控制房地产企业有息负债的增长，设置“三道红线”，造成个别龙头企业现金流的困难，引发信用风险不断扩散，房地产市场快速冷却，对经济也产生较大拖累。

股票市场全年跌宕起伏。1季度先涨后跌，1月份国内基金发行市场呈现加速的态势，美国财政刺激方案显著提升投资者的风险偏好，国内与国外市场共振上行。2月份随着美国长期国债利率加速上行，国内外股票市场估值承压，估值较高的成长性股票剧烈调整。2季度表现较好，经历1季度的大起大落之后，市场波动性呈收敛态势。无论是国内还是海外，利率中枢相对1季度下行，股票市场短期估值压力缓解，以生物医药、新能源汽车、次高端白酒等为代表性的成长性股票大幅反弹。3季度股票市场表现分化较大，美股市场整体向上，A股市场指数波动不大，香港市场恒生指数受政策的负面冲击整体大跌。高景气的新能源行业和受益于PPI高企而价格涨幅较大的行业表现出色，受到政策冲击的房地产、互联网、教育等行业表现较差。4季度各股票市场分化较大，美股市

场继续整体向上，A股市场小幅上升，香港市场继续表现低迷。行业同样分化明显，景气度高的军工、元宇宙概念股表现领先，煤炭钢铁等行业因价格下跌表现落后、港股生物医药跌幅较大。

本基金全年净值发生回撤。1季度净值先涨后跌，前期布局的优质成长股在本轮调整中受到较大冲击。我们适度降低了股票仓位，并对一些估值过高的股票做了调整。2季度净值表现较为平稳，我们保持较高股票仓位，持续优化组合结构。3季度净值跟随市场呈现较大波动，部分行业政策对市场的冲击显著拖累了基金的净值表现。我们实时对一些基本面恶化的行业进行了减持，并加仓高景气度和边际好转的公司，保持了一贯的均衡风格。4季度净值下跌较大，虽然部分重点持有个股下跌较多拖累净值，但还是维持长期看好的个股的持仓。

回顾2021年的投资，我们需要认真总结反思。首先，需要加强对产业政策的重视，根据以往的投资经验，优秀的公司一般都能在政策扰动中成功跨越，但今年不管是针对地产、还是义务教育阶段课外辅导，以及针对互联网平台的反垄断政策，均出现持续高压的态势，对一些商业护城河很深的公司造成了严重打击，这些新情况我们需要不断总结，持续完善我们的投研框架。其次，坚持价值投资不动摇，金融市场本身带有很强的周期性，不同市场环境下会有着不同的估值体系。一旦投资者情绪进入亢奋状态，一般意味着风险即将来临，以价值作为尺度、保持客观的态度，会避免被市场情绪所裹挟，在市场悲观时保持信心，在市场乐观时保持冷静。其次，坚定研究发现投资机会的信念。股票虽然是风险性资产，但并不意味着不可知，每个股票背后都是一家实实在在的公司，对应着具体的资产、业务和团队。只要我们把研究做好，持续地提升研究质量，思考更深入一层，那么我们自然能发现其中的风险和机会。最后，任何时候都要有迎接变的准备。我们自身经历的投资周期不算太长，中国的产业演进依然未有停歇，十年的经验放在二十年的时间尺度无法从容应对并不稀奇。新的场景需要新的思想、新的解决之道，更需要破局的勇气去灵活应对。

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0.8206元，本报告期内，基金份额净值增长率为-20.35%，同期业绩比较基准收益率为-11.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年的市场再次为我们开启全新的一段旅程，但资本市场的每一天都充满挑战和机遇。2021年末的中央经济工作会议表明，政府对于经济稳增长的重视度显著提升。当下的宏观经济背景和历史上任何阶段都没有可比性，2021年众多产业政策的变化使得经济结构出现很多极端情况，货币政策也因此受到影响。2022年的政策组合的选择并不是

唯一的，不同的政策组合对经济结构和资本市场的影响完全不同，我们只能根据政策的变化做出及时应对。

政策变化的背后能够找到一些相对确定的方向，首先，只要利率不大幅上升，资金流向股票市场的态势不会发生大逆转，股票市场的估值将不会出现系统性收缩，那么结构性的机会将会存在；其次，“双碳”政策大方向不变，虽然政策执行层面如果产生负面影响会出现纠偏，但新能源（风电、光电、核电）发电、储能、电网改造等投资量将会大幅增加，这些细分行业值得关注；再次，房地产行业对于杠杆率不高且融资能力强的地产公司（尤其是国企）的基本面和股价已经见底，如果政策放松则整体行业见底，会是Beta性的机会，政策不松则对于地产行业就是一次供给侧改革，优质公司未来市场份额和利润率都有望上升。

从产业演进来看，依赖产业自身扩张而不受政策影响的行业更具生命力。首先，汽车的智能化是当下明确的产业方向。过去两年新能源车渗透率快速提升，带来造车新势力的快速发展及锂电池整个产业链的繁荣。随着传统汽车厂商的入局，外观设计的差异化在弱化，动力续航逐步标准化，需要更多创新来构建差异化或规模化来降成本，推动渗透率的进一步提升，相关细分领域值得关注。但无论是传统燃油乘用车还是新能源车，智能化无疑是对使用者的体验提升最为明显，未来有望加速推进。其次，下游需求好的制造业仍具机会。这些属于典型的供给创造需求的机会，如新旧能源转换对新能源行业整体占有率量的提升、不断崛起的军工装备相关的上游新材料及元器件、中美博弈下的半导体国产化等，相关行业景气度高且具有持续性，关键在于时点的准确把握。再次，消费结构性升级的态势并未发生变化，当下消费疲弱是复杂的多因素叠加的短期现象，除了上游原材料涨价，还有疫情反复、房地产拖累以及产业政策的冲击等，短期看未必快速好转，但宏观视角看，中国人均GDP在1万美元之上的整体消费能力是在提升的，这一般会伴随着消费品牌的崛起，需要紧密跟踪一系列本土品牌升级的进程。

香港市场影响因素较为复杂，我们会努力寻找结构性机会。首先，港股市场的估值处于较低水平，估值下行空间有限，相对具有防御性。影响港股市场的核心矛盾之一是国内经济的基本面（与企业盈利周期同步），虽然国内复苏的进程并不确定，但在中央稳增长的基调下，下半年国内经济企稳复苏是大概率事件。其次，2021年一系列的国内产业政策对港股最受投资者关注的行业进行了精准打击，相关行业估值已经跌到较低水平，投资者预期也较低，随着一些较为极端的政策开始纠偏，相关行业的投资风险偏好将有所提升。最后，中国与海外经济体所处经济周期的阶段不完全一致，中国将实施稳增长政策，而海外通胀压力较大将采取紧缩性政策，一般来说如果海外货币政策有实质性紧缩会对香港市场有负面影响。

虽然2021年我们的投资框架面对各方面的挑战，但我们对2022年依然充满信心。首先，金融市场是周期性的，市场有好的时候也有不好的时候，市场风险释放完毕后，机会自然会到来；其次，投资的长期收益来自发掘出的好的投资机会，我们一直在努力提

高研究质量，提升认知水平，争取不断发掘出好的投资机会；最后，投资是个不断进化的过程，投资能力是在不断改进中提升的，保持开放心态、持续学习定能不断超越。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021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。2021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。2021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（2022）审字第61090672_B66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2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（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2021年12月31日的财务状况以及2021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。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 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。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 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，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。 | |
| 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 | 蒋燕华 | 费泽旭 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市世纪大道100号环球金融中心50楼 | |
| 审计报告日期 | 2022-03-24 | |

§ 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: 2021年12月31日

单位: 人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 84,218,145.56 | 249,106,161.91 |

| | | | |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 结算备付金 | | 401,253.70 | 36,062,114.03 |
| 存出保证金 | | 227,316.98 | 10,012,044.48 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,085,368,245.09 | 1,759,725,589.53 |
| 其中：股票投资 | | 1,085,368,245.09 | 1,759,725,589.53 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 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 | 250,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | - | 31,397,275.31 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 32,819.81 | 8,553.21 |
| 应收股利 | | 102,756.78 | 318,706.92 |
| 应收申购款 | | - | 749,734.95 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,210,350,537.92 | 2,337,380,180.34 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020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 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 698,336.13 | 94,097,077.60 |
| 应付赎回款 | | 11,014,881.47 | 50,034,245.47 |
| 应付管理人报酬 | | 1,592,893.39 | 2,747,936.96 |
| 应付托管费 | | 265,482.21 | 457,989.52 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 947,524.73 | 2,064,230.22 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 250,693.56 | 285,713.44 |
| 负债合计 | | 14,769,811.49 | 149,687,193.21 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,456,951,397.13 | 2,123,544,881.86 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -261,370,670.70 | 64,148,105.27 |
| 所有者权益合计 | | 1,195,580,726.43 | 2,187,692,987.13 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,210,350,537.92 | 2,337,380,180.34 |

注：（1）报告截止日2021年12月31日，基金份额净值0.8206元，基金份额总额1,456,951,397.13份。

（2）本基金基金合同于2020年9月29日生效，上年度可比期间为2020年9月29日至2020年12月31日。

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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021年01月01日至 2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日 |
|-------------|----------|-----------------------------------|---|
| 一、收入 | | -288,958,177.68 | 78,356,712.50 |
| 1. 利息收入 | | 2,657,397.56 | 5,454,756.51 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 1,761,701.39 | 2,808,695.81 |
| 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 | | 148,523.30 | 2,646,060.70 |

| | | | |
|----------------------------|----------------|------------------------|----------------------|
| 入 | | | |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -130,751,557.90 | -44,929,163.50 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -154,402,436.70 | -45,501,034.11 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -232,340.94 | - |
| 资产支持证券投资 收益 | 7.4.7.13. 3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 23,883,219.74 | 571,870.61 |
| 3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -166,382,164.82 | 117,704,958.15 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-” 号填列） | 7.4.7.18 | 5,518,147.48 | 126,161.34 |
| 减：二、费用 | | 47,155,449.53 | 14,144,542.64 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2. 1 | 27,011,178.72 | 8,263,892.19 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2. 2 | 4,501,863.12 | 1,377,315.37 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 15,326,630.82 | 4,341,391.94 |
| 5. 利息支出 | | 53,361.57 | - |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | 53,361.57 | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.20 | 262,415.30 | 161,943.14 |
| 三、利润总额（亏损总额 | | -336,113,627.21 | 64,212,169.86 |

| | | | |
|-------------------|--|-----------------|---------------|
| 以“-”号填列) | | | |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列) | | -336,113,627.21 | 64,212,169.86 |

7.3 所有者权益（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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021年12月31日 | | |
|--|-------------------------------|-----------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值) | 2,123,544,881.86 | 64,148,105.27 | 2,187,692,987.13 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润) | - | -336,113,627.21 | -336,113,627.21 |
| 三、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 |
| 四、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) | - | - | - |
| 五、期末所有者权 | 1,456,951,397.13 | -261,370,670.70 | 1,195,580,726.43 |

| 益（基金净值） | | | |
|--|----------------------------------|---------------|------------------|
| 项 目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2020年09月29日（基金合同生效日）至2020年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 2,170,666,810.23 | - | 2,170,666,810.23 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 64,212,169.86 | 64,212,169.86 |
| 三、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） | -47,121,928.37 | -64,064.59 | -47,185,992.96 |
| 其中：1. 基金申购款 | 3,091,892.50 | 7,791.33 | 3,099,683.83 |
| 2. 基金赎回款 | -50,213,820.87 | -71,855.92 | -50,285,676.79 |
| 四、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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,123,544,881.86 | 64,148,105.27 | 2,187,692,987.13 |

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

黄庆

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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2021年12月31日的财务状况以及2021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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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的股票、债券等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(3) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认；

国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(6) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(7) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

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。

本基金持有的金融工具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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）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；

(13) 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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况对本基金进行收益分配，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；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告，且不需召开基金份额持有人大会。

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与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。

7.4.5 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

本基金本报告期无会计政策变更。

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，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本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。

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暂行条例（2011年修订）》、《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 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 84,218,145.56 | 249,106,161.91 |
| 定期存款 | - | - |
| 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 | - | - |
| 合计 | 84,218,145.56 | 249,106,161.91 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年12月31日 | | |
|---------------|---------------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 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 |
| 项目 | 上年度末 2020年12月31日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |

| | | | | |
|---------------|-------|------------------|------------------|----------------|
| 股票 | | 1,642,020,631.38 | 1,759,725,589.53 | 117,704,958.15 |
| 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 | | 1,642,020,631.38 | 1,759,725,589.53 | 117,704,958.15 |

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 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 | - |
| 项目 | 上年度末 2020年12月31日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 250,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 250,000,000.00 | - |

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 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 28,658.51 | 57,815.44 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 198.66 | 14,715.36 |
| 应收债券利息 | - | - |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | 3,901.37 | -64,109.59 |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 应收出借证券利息 | - | - |
| 其他 | 61.27 | 132.00 |
| 合计 | 32,819.81 | 8,553.21 |

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 947,524.73 | 2,063,550.71 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | 679.51 |
| 合计 | 947,524.73 | 2,064,230.22 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

| | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|-------------|-------------|-------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 40,693.56 | 125,713.44 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 预提费用 | 210,000.00 | 160,000.00 |
| 合计 | 250,693.56 | 285,713.44 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021年12月31日 | |
|---------------|-------------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,123,544,881.86 | 2,123,544,881.86 |
| 本期申购 | 1,337,239,736.73 | 1,337,239,736.73 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,003,833,221.46 | -2,003,833,221.46 |
| 本期末 | 1,456,951,397.13 | 1,456,951,397.13 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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 |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | -52,304,614.01 | 116,452,719.28 | 64,148,105.27 |
| 本期利润 | -169,731,462.39 | -166,382,164.82 | -336,113,627.21 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 28,775,555.62 | -18,180,704.38 | 10,594,851.24 |
| 其中：基金申购款 | -33,190,766.05 | 199,805,707.35 | 166,614,941.30 |
| 基金赎回款 | 61,966,321.67 | -217,986,411.73 | -156,020,090.06 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -193,260,520.78 | -68,110,149.92 | -261,370,670.70 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至 2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生效 日）至2020年12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|---|
| 活期存款利息收入 | 1,394,979.35 | 801,751.83 |
| 定期存款利息收入 | - | 1,818,333.33 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 321,941.73 | 173,358.44 |
| 其他 | 44,780.31 | 15,252.21 |
| 合计 | 1,761,701.39 | 2,808,695.81 |

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至 2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生效 日）至2020年12月31日 |
|------------|-----------------------------------|---|
| 卖出股票成交总额 | 4,369,205,454.59 | 666,051,748.70 |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,523,607,891.29 | 711,552,782.81 |
| 买卖股票差价收入 | -154,402,436.70 | -45,501,034.11 |

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2 021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生效 日）至2020年12月31日 |
|---------------------------------------|-----------------------------------|---|
| 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 | -232,340.94 | - |
|----|-------------|---|

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021 年12月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生效日） 至2020年12月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：应收利息总额 | 1,938,715.34 | - |
| 买卖债券差价收入 | -232,340.94 | - |

7.4.7.13.3 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 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。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至 2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生 效日）至2020年12月31日 |
|---------------|-----------------------------------|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 23,883,219.74 | 571,870.61 |
| 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 | 23,883,219.74 | 571,870.61 |

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2021年01月01日至20 21年12月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生效日） 至2020年12月31日 |
|--------------------------------|-----------------------------------|---|
| 1. 交易性金融资产 | -166,382,164.82 | 117,704,958.15 |
| ——股票投资 | -166,382,164.82 | 117,704,958.15 |
| ——债券投资 | - | - |
| ——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 | -166,382,164.82 | 117,704,958.15 |
|----|-----------------|----------------|

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至 2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生效 日）至2020年12月31日 |
|---------|-----------------------------------|---|
| 基金赎回费收入 | 4,977,763.88 | 125,717.88 |
| 基金转换费收入 | 540,383.60 | - |
| 其他 | - | 443.46 |
| 合计 | 5,518,147.48 | 126,161.34 |

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至 2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生效 日）至2020年12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|---|
| 交易所市场交易费用 | 15,326,630.82 | 4,341,391.94 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 合计 | 15,326,630.82 | 4,341,391.94 |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至 2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生效 日）至2020年12月31日 |
|---------|-----------------------------------|---|
| 审计费用 | 90,000.00 | 60,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 100,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 汇划手续费 | 19,915.30 | 1,543.14 |
| 账户维护费 | 31,500.00 | - |
| 其他 | 1,000.00 | 400.00 |

| | | |
|----|------------|------------|
| 合计 | 262,415.30 | 161,943.14 |
|----|------------|------------|

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 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2021年01月01日 至2021年12月31 日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同 生效日）至2020年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 27,011,178.72 | 8,263,892.19 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10,710,366.04 | 3,340,200.71 |

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 2021年01月01日 至2021年12月31 日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生 效日）至2020年12月31日 |
|----------------|---------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,501,863.12 | 1,377,315.37 |

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

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2021年01月01 日至2021年12 月31日 | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金 合同生效日）至2020年1 月31日 |
|-----------------------------|---------------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2020年09月29日）持有的基金份额 | 0.00 | 30,005,600.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 30,005,600.00 | 0.00 |
| 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 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 30,005,600.00 | 30,005,600.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 2.0595% | 1.413% |

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 2021年01月01日至2021年12月31日 | | 上年度可比期间 2020年09月29日（基金合同生效日） 至2020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 | 84,218,145.56 | 1,394,979.35 | 249,106,161.91 | 801,751.83 |

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—按摊余成本法核算的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（2021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 | 可流通日 | 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 |
| 301136 | 招标股份 | 2021-12-31 | 2022-01-11 | 认购新发证券 | 10.52 | 10.52 | 7,172 | 75,449.44 | 75,449.44 | - |
| 301050 | 雷电微力 | 2021-08-17 | 2022-02-24 | 新股限售 | 60.64 | 234.74 | 233 | 14,129.12 | 54,694.42 | - |
| 301029 | 怡合达 | 2021-07-14 | 2022-01-24 | 新股限售 | 14.14 | 89.87 | 462 | 6,532.68 | 41,519.94 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 301035 | 润丰股份 | 2021-07-21 | 2022-01-28 | 新股限售 | 22.04 | 56.28 | 644 | 14,193.76 | 36,244.32 | - |
| 301211 | 亨迪药业 | 2021-12-14 | 2022-06-22 | 新股限售 | 25.80 | 33.65 | 967 | 24,948.60 | 32,539.55 | - |
| 301090 | 华润材料 | 2021-10-19 | 2022-04-26 | 新股限售 | 10.45 | 11.22 | 2,764 | 28,883.80 | 31,012.08 | - |
| 301127 | 天源环保 | 2021-12-23 | 2022-06-30 | 新股限售 | 12.03 | 17.12 | 1,685 | 20,270.55 | 28,847.20 | - |
| 301039 | 中集车辆 | 2021-07-01 | 2022-01-10 | 新股限售 | 6.96 | 12.51 | 2,064 | 14,365.44 | 25,820.64 | - |
| 301099 | 雅创电子 | 2021-11-10 | 2022-05-23 | 新股限售 | 21.99 | 71.36 | 351 | 7,718.49 | 25,047.36 | - |
| 301221 | 光庭信息 | 2021-12-15 | 2022-06-22 | 新股限售 | 69.89 | 88.72 | 280 | 19,569.20 | 24,841.60 | - |
| 301189 | 奥尼电子 | 2021-12-21 | 2022-06-28 | 新股限售 | 66.18 | 56.62 | 435 | 28,788.30 | 24,629.70 | - |
| 301166 | 优宁维 | 2021-12-21 | 2022-06-28 | 新股限售 | 86.06 | 94.50 | 253 | 21,773.18 | 23,908.50 | - |
| 301069 | 凯盛新材 | 2021-09-16 | 2022-03-28 | 新股限售 | 5.17 | 44.21 | 539 | 2,786.63 | 23,829.19 | - |
| 301096 | 百诚医药 | 2021-12-13 | 2022-06-20 | 新股限售 | 79.60 | 78.53 | 272 | 21,651.20 | 21,360.16 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 301093 | 华兰股份 | 2021-10-21 | 2022-05-05 | 新股限售 | 58.08 | 49.85 | 409 | 23,754.72 | 20,388.65 | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021-06-28 | 2022-01-07 | 新股限售 | 8.29 | 26.06 | 782 | 6,482.78 | 20,378.92 | - |
| 301082 | 久盛电气 | 2021-10-14 | 2022-04-27 | 新股限售 | 15.48 | 21.53 | 915 | 14,164.20 | 19,699.95 | - |
| 300994 | 久祺股份 | 2021-08-02 | 2022-02-14 | 新股限售 | 11.90 | 45.45 | 420 | 4,998.00 | 19,089.00 | - |
| 301100 | 风光股份 | 2021-12-10 | 2022-06-17 | 新股限售 | 27.81 | 31.14 | 599 | 16,658.19 | 18,652.86 | - |
| 301168 | 通灵股份 | 2021-12-02 | 2022-06-10 | 新股限售 | 39.08 | 52.13 | 329 | 12,857.32 | 17,150.77 | - |
| 301091 | 深城交 | 2021-10-20 | 2022-04-29 | 新股限售 | 36.50 | 31.31 | 524 | 19,126.00 | 16,406.44 | - |
| 301101 | 明月镜片 | 2021-12-09 | 2022-06-16 | 新股限售 | 26.91 | 43.36 | 371 | 9,983.61 | 16,086.56 | - |
| 301190 | 善水科技 | 2021-12-17 | 2022-06-24 | 新股限售 | 27.85 | 27.46 | 575 | 16,013.75 | 15,789.50 | - |
| 301108 | 洁雅股份 | 2021-11-25 | 2022-06-06 | 新股限售 | 57.27 | 53.71 | 280 | 16,035.60 | 15,038.80 | - |
| 301179 | 泽宇智能 | 2021-12-01 | 2022-06-08 | 新股限售 | 43.99 | 50.77 | 295 | 12,977.05 | 14,977.15 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 301089 | 拓新药业 | 2021-10-20 | 2022-04-27 | 新股限售 | 19.11 | 67.93 | 220 | 4,204.20 | 14,944.60 | - |
| 301180 | 万祥科技 | 2021-11-09 | 2022-05-16 | 新股限售 | 12.20 | 22.72 | 654 | 7,978.80 | 14,858.8 | - |
| 301046 | 能辉科技 | 2021-08-10 | 2022-02-17 | 新股限售 | 8.34 | 48.99 | 290 | 2,418.60 | 14,207.10 | - |
| 301111 | 粤万年青 | 2021-11-30 | 2022-06-07 | 新股限售 | 10.48 | 36.68 | 379 | 3,971.92 | 13,901.72 | - |
| 301188 | 力诺特玻 | 2021-11-04 | 2022-05-11 | 新股限售 | 13.00 | 20.48 | 647 | 8,411.00 | 13,250.56 | - |
| 301199 | 迈赫股份 | 2021-11-30 | 2022-06-07 | 新股限售 | 29.28 | 32.00 | 402 | 11,770.56 | 12,864.00 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021-06-28 | 2022-01-06 | 新股限售 | 10.64 | 30.44 | 421 | 4,479.44 | 12,815.24 | - |
| 301138 | 华研精机 | 2021-12-08 | 2022-06-15 | 新股限售 | 26.17 | 44.86 | 285 | 7,458.45 | 12,785.10 | - |
| 301026 | 浩通科技 | 2021-07-08 | 2022-01-17 | 新股限售 | 18.03 | 62.73 | 203 | 3,660.09 | 12,734.19 | - |
| 301126 | 达嘉维康 | 2021-11-30 | 2022-06-07 | 新股限售 | 12.37 | 19.23 | 662 | 8,188.94 | 12,730.26 | - |
| 301185 | 鸥玛软件 | 2021-11-11 | 2022-05-19 | 新股限售 | 11.88 | 21.16 | 578 | 6,866.64 | 12,230.48 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|--------------------|--------------------|----------|-----------|-----------|-----|--------------|-------------------|---|
| 3010 21 | 英诺 激光 | 2021 -06- 28 | 2022 -01- 06 | 新股 限售 | 9.46 | 41.4 3 | 290 | 2,74 3.40 | 12,0 14.7 0 | - |
| 3010 48 | 金鹰 重工 | 2021 -08- 11 | 2022 -02- 28 | 新股 限售 | 4.13 | 12.9 6 | 843 | 3,48 1.59 | 10,9 25.2 8 | - |
| 3010 28 | 东亚 机械 | 2021 -07- 12 | 2022 -01- 20 | 新股 限售 | 5.31 | 13.5 0 | 733 | 3,89 2.23 | 9,89 5.50 | - |
| 3007 74 | 倍杰 特 | 2021 -07- 26 | 2022 -02- 16 | 新股 限售 | 4.57 | 21.0 8 | 444 | 2,02 9.08 | 9,35 9.52 | - |
| 3010 78 | 孩子 王 | 2021 -09- 30 | 2022 -04- 14 | 新股 限售 | 5.77 | 12.1 4 | 756 | 4,36 2.12 | 9,17 7.84 | - |
| 3011 82 | 凯旺 科技 | 2021 -12- 16 | 2022 -06- 23 | 新股 限售 | 27.1 2 | 30.5 8 | 294 | 7,97 3.28 | 8,99 0.52 | - |
| 3010 62 | 上海 艾录 | 2021 -09- 07 | 2022 -03- 14 | 新股 限售 | 3.31 | 17.0 1 | 523 | 1,73 1.13 | 8,89 6.23 | - |
| 3011 93 | 家联 科技 | 2021 -12- 02 | 2022 -06- 09 | 新股 限售 | 30.7 3 | 29.1 4 | 297 | 9,12 6.81 | 8,65 4.58 | - |
| 3010 52 | 果麦 文化 | 2021 -08- 23 | 2022 -02- 28 | 新股 限售 | 8.11 | 33.6 4 | 252 | 2,04 3.72 | 8,47 7.28 | - |
| 3010 25 | 读客 文化 | 2021 -07- 06 | 2022 -01- 24 | 新股 限售 | 1.55 | 20.8 8 | 403 | 624. 65 | 8,41 4.64 | - |
| 3010 66 | 万事 利 | 2021 -09- 13 | 2022 -03- 22 | 新股 限售 | 5.24 | 22.8 4 | 344 | 1,80 2.56 | 7,85 6.96 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 300814 | 中富电路 | 2021-08-04 | 2022-02-14 | 新股限售 | 8.40 | 23.88 | 328 | 2,755.20 | 7,832.64 | - |
| 301198 | 喜悦智行 | 2021-11-25 | 2022-06-02 | 新股限售 | 21.76 | 29.20 | 262 | 5,701.12 | 7,650.40 | - |
| 301030 | 仕净科技 | 2021-07-15 | 2022-01-24 | 新股限售 | 6.10 | 31.52 | 242 | 1,476.20 | 7,627.84 | - |
| 301081 | 严牌股份 | 2021-10-13 | 2022-04-20 | 新股限售 | 12.95 | 17.44 | 403 | 5,218.85 | 7,028.32 | - |
| 301033 | 迈普医学 | 2021-07-15 | 2022-01-26 | 新股限售 | 15.14 | 59.97 | 108 | 1,635.12 | 6,476.76 | - |
| 301049 | 超越科技 | 2021-08-17 | 2022-02-24 | 新股限售 | 19.34 | 32.92 | 196 | 3,790.64 | 6,452.32 | - |
| 301032 | 新柴股份 | 2021-07-15 | 2022-01-24 | 新股限售 | 4.97 | 12.51 | 513 | 2,549.61 | 6,417.63 | - |
| 301056 | 森赫股份 | 2021-08-27 | 2022-03-07 | 新股限售 | 3.93 | 11.09 | 572 | 2,247.96 | 6,343.48 | - |
| 301036 | 双乐股份 | 2021-07-21 | 2022-02-16 | 新股限售 | 23.38 | 29.93 | 205 | 4,792.90 | 6,135.65 | - |
| 301041 | 金百泽 | 2021-08-02 | 2022-02-11 | 新股限售 | 7.31 | 28.21 | 215 | 1,571.65 | 6,065.15 | - |
| 301072 | 中捷精工 | 2021-09-22 | 2022-03-29 | 新股限售 | 7.46 | 33.41 | 181 | 1,350.26 | 6,047.21 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 301083 | 百胜智能 | 2021-10-13 | 2022-04-21 | 新股限售 | 9.08 | 14.21 | 416 | 3,777.28 | 5,911.36 | - |
| 300854 | 中兰环保 | 2021-09-08 | 2022-03-16 | 新股限售 | 9.96 | 27.29 | 203 | 2,021.88 | 5,539.87 | - |
| 301063 | 海锅股份 | 2021-09-09 | 2022-03-24 | 新股限售 | 17.40 | 36.11 | 153 | 2,662.20 | 5,524.83 | - |
| 301038 | 深水规院 | 2021-07-22 | 2022-02-07 | 新股限售 | 6.68 | 20.23 | 266 | 1,776.88 | 5,381.18 | - |
| 301059 | 金三江 | 2021-09-03 | 2022-03-14 | 新股限售 | 8.09 | 19.30 | 259 | 2,095.31 | 4,998.70 | - |
| 301027 | 华蓝集团 | 2021-07-08 | 2022-01-19 | 新股限售 | 11.45 | 16.65 | 286 | 3,274.70 | 4,761.90 | - |
| 301037 | 保立佳 | 2021-07-21 | 2022-02-07 | 新股限售 | 14.82 | 24.26 | 193 | 2,860.26 | 4,682.18 | - |
| 301073 | 君亭酒店 | 2021-09-22 | 2022-03-30 | 新股限售 | 12.24 | 32.00 | 144 | 1,762.56 | 4,608.00 | - |
| 301053 | 远信工业 | 2021-08-25 | 2022-03-01 | 新股限售 | 11.87 | 28.78 | 155 | 1,839.85 | 4,460.90 | - |
| 301057 | 汇隆新材 | 2021-08-31 | 2022-03-09 | 新股限售 | 8.03 | 19.02 | 218 | 1,750.54 | 4,146.36 | - |
| 301068 | 大地海洋 | 2021-09-16 | 2022-03-28 | 新股限售 | 13.98 | 28.38 | 144 | 2,013.12 | 4,086.72 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|--------------------|--------------------|----------|-----------|-----------|-----|--------------|--------------|---|
| 3010 79 | 邵阳 液压 | 2021 -10- 11 | 2022 -04- 19 | 新股 限售 | 11.9 2 | 24.8 2 | 140 | 1,66 8.80 | 3,47 4.80 | - |
|------------|----------|--------------------|--------------------|----------|-----------|-----------|-----|--------------|--------------|---|

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。

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2021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2021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、自控和互控的第一道防线，部门内控和部门之间互相监督的第二道防线，合规管理及风险管理部门监控检查的第三道防线，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管理进行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

本期末及上年度末，本基金均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 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 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 32,819.81 | 32,819.81 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 102,756.78 | 102,756.78 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 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 |

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

| | | | | | | | |
|-----------------------------|----------------|-------|--------|------|------|------------------|------------------|
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 265,482.21 | 265,482.21 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 947,524.73 | 947,524.73 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 250,693.56 | 250,693.56 |
| 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 |
| 上年度末 2020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 | 249,106,161.91 | - | - | - | - | - | 249,106,161.91 |
| 结算备付金 | 36,062,114.03 | - | - | - | - | - | 36,062,114.03 |
| 存出保证金 | 10,012,044.48 | - | - | - | - | - | 10,012,044.48 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 1,759,725,589.53 | 1,759,725,589.53 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 250,000,000.00 | - | - | - | - | - | 250,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 31,397,275.31 | 31,397,275.31 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 8,553.21 | 8,553.21 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 318,706.92 | 318,706.92 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 749,734.95 | 749,734.95 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 545,180,320.4 | - | - | - | - | 1,792,199,859.9 | 2,337,380,180.3 |

| | | | | | | | |
|-----------|--------------------|---|---|---|---|----------------------|----------------------|
| 计 | 2 | | | | | 2 | 4 |
| 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 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 94,097,077.60 | 94,097,077.60 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 50,034,245.47 | 50,034,245.47 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 2,747,936.96 | 2,747,936.96 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 457,989.52 | 457,989.52 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 2,064,230.22 | 2,064,230.22 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 285,713.44 | 285,713.44 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 149,687,193.21 | 149,687,193.21 |
| 利率敏感度缺口 | 545,180,320.4 2 | - | - | - | - | 1,642,512,666.7 1 | 2,187,692,987.1 3 |

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

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债券，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 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. 36 | - | 934,942,851. 36 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - |
| 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 |
| 项目 | 上年度末 2020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 | - | 982,764,511.92 | - | 982,764,511.92 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | 318,706.92 | - | 318,706.92 |
| 应收申购款 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产合计 | - | 983,083,218.84 | - | 983,083,218.84 |
| 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 | - | 983,083,218.84 | - | 983,083,218.84 |

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 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| | 所有外币相对于人民币升值5% | 46,752,280.41 | 49,154,160.94 |
| | 所有外币相对于人民币贬值5% | -46,752,280.41 | -49,154,160.94 |

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 2021年12月31日 | | 上年度末 2020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 | 1,085,368,245.09 | 90.78 | 1,759,725,589.53 | 80.44 |
| 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 | 1,085,368,245.09 | 90.78 | 1,759,725,589.53 | 80.44 |

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 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| | 业绩比较基准增加1% | 17,186,344.80 | 13,684,580.60 |

| | | | |
|--|------------|----------------|----------------|
| | 业绩比较基准减少1% | -17,186,344.80 | -13,684,580.60 |
|--|------------|----------------|----------------|

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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，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中属于第一层次的余额为人民币1,084,323,203.01元，属于第二层次的余额为人民币75,449.44元，属于第三层次的余额为人民币969,592.64元（于2020年12月31日，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中属于第一层次的余额为人民币1,758,981,710.28元，属于第二层次的余额为人民币207,119.06元，属于第三层次的余额为人民币536,760.19元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期变动情况如下：上年度末余额为人民币536,760.19元，2021年度转入第三层次人民币0.00元，转出第三层次人民币497,617.40元，当期计入损益的利得或损失总额人民币599,829.98元，购买人民币548,474.27元，出售人民币217,854.40元，本期末人民币969,592.64元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动人民币421,118.37元。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月24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 | 1,085,368,245.09 | 89.67 |
| | 其中：股票 | 1,085,368,245.09 | 89.67 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 40,000,000.00 | 3.30 |
| | 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 | 84,619,399.26 | 6.99 |
| 8 | 其他各项资产 | 362,893.57 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 1,210,350,537.92 | 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934,942,851.36元，占期末净值比例78.20%。

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 | 113,756,316.89 | 9.51 |
| 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 | 84,862.56 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,101,400.00 | 0.26 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 30,074,549.23 | 2.52 |
| J | 金融业 | 1,855,500.00 | 0.16 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,481,066.22 | 0.12 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 50,198.91 | 0.00 |
| 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 | 16,891.92 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 150,425,393.73 | 12.58 |

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(%) |
|----------|----------------|--------------|
| 基础材料 | 60,191,712.00 | 5.03 |
| 非日常生活消费品 | 163,998,296.00 | 13.72 |
| 日常消费品 | 255,466,478.40 | 21.37 |
| 能源 | - | - |
| 金融 | 163,881,379.20 | 13.71 |
| 医疗保健 | - | - |

| | | |
|------|----------------|-------|
| 工业 | 28,002,800.00 | 2.34 |
| 信息技术 | 28,226,822.40 | 2.36 |
| 电信服务 | 56,220,710.56 | 4.7 |
| 公用事业 | 13,563,984.00 | 1.13 |
| 地产业 | 165,390,668.80 | 13.83 |
| 合计 | 934,942,851.36 | 78.2 |

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 | H03968 | 招商银行 | 1,800,000 | 89,110,224.00 | 7.45 |
| 2 | H00175 | 吉利汽车 | 5,000,000 | 87,074,400.00 | 7.28 |
| 3 | H01458 | 周黑鸭 | 18,000,000 | 86,534,784.00 | 7.24 |
| 4 | H02319 | 蒙牛乳业 | 1,740,000 | 62,879,980.80 | 5.26 |
| 5 | H02238 | 广汽集团 | 10,000,000 | 62,873,440.00 | 5.26 |
| 6 | H01772 | 赣锋锂业 | 600,000 | 60,191,712.00 | 5.03 |
| 7 | 000848 | 承德露露 | 5,500,053 | 59,675,575.05 | 4.99 |
| 8 | H01109 | 华润置地 | 2,150,000 | 57,657,152.00 | 4.82 |
| 9 | H01024 | 快手-W | 910,000 | 53,606,352.80 | 4.48 |
| 10 | H00388 | 香港交易所 | 130,000 | 48,403,555.20 | 4.05 |
| 11 | H03900 | 绿城中国 | 4,500,000 | 46,210,752.00 | 3.87 |
| 12 | H09633 | 农夫山泉 | 1,080,000 | 45,430,761.60 | 3.80 |
| 13 | H00688 | 中国海外发展 | 3,000,000 | 45,278,688.00 | 3.79 |
| 14 | H01579 | 颐海国际 | 1,500,000 | 44,211,720.00 | 3.70 |
| 15 | 600519 | 贵州茅台 | 20,300 | 41,615,000.00 | 3.48 |
| 16 | 600406 | 国电南瑞 | 750,000 | 30,022,500.00 | 2.51 |
| 17 | H02382 | 舜宇光学科技 | 140,000 | 28,226,822.40 | 2.36 |
| 18 | H03908 | 中金公司 | 1,500,000 | 26,367,600.00 | 2.21 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 19 | H03898 | 时代电气 | 700,000 | 25,840,248.00 | 2.16 |
| 20 | H03998 | 波司登 | 3,500,000 | 14,050,456.00 | 1.18 |
| 21 | H01816 | 中广核电力 | 7,000,000 | 13,563,984.00 | 1.13 |
| 22 | H00291 | 华润啤酒 | 200,000 | 10,440,752.00 | 0.87 |
| 23 | H00168 | 青岛啤酒股份 | 100,000 | 5,968,480.00 | 0.50 |
| 24 | H00817 | 中国金茂 | 3,000,000 | 5,911,248.00 | 0.49 |
| 25 | H01918 | 融创中国 | 400,000 | 3,852,531.20 | 0.32 |
| 26 | H06049 | 保利物业 | 70,000 | 3,508,321.60 | 0.29 |
| 27 | 002352 | 顺丰控股 | 45,000 | 3,101,400.00 | 0.26 |
| 28 | H01209 | 华润万象生活 | 100,000 | 2,971,976.00 | 0.25 |
| 29 | 300999 | 金龙鱼 | 45,000 | 2,831,850.00 | 0.24 |
| 30 | 600486 | 扬农化工 | 20,000 | 2,624,000.00 | 0.22 |
| 31 | H00700 | 腾讯控股 | 7,000 | 2,614,357.76 | 0.22 |
| 32 | H02618 | 京东物流 | 100,000 | 2,162,552.00 | 0.18 |
| 33 | 300059 | 东方财富 | 50,000 | 1,855,500.00 | 0.16 |
| 34 | 605499 | 东鹏饮料 | 10,000 | 1,818,400.00 | 0.15 |
| 35 | 002508 | 老板电器 | 50,000 | 1,801,000.00 | 0.15 |
| 36 | 002304 | 洋河股份 | 10,000 | 1,647,300.00 | 0.14 |
| 37 | 300012 | 华测检测 | 50,000 | 1,343,500.00 | 0.11 |
| 38 | 603606 | 东方电缆 | 20,000 | 1,023,200.00 | 0.09 |
| 39 | 301136 | 招标股份 | 7,172 | 75,449.44 | 0.01 |
| 40 | 301050 | 雷电微力 | 233 | 54,694.42 | 0.00 |
| 41 | 301029 | 怡合达 | 462 | 41,519.94 | 0.00 |
| 42 | 301035 | 润丰股份 | 644 | 36,244.32 | 0.00 |
| 43 | 301211 | 亨迪药业 | 967 | 32,539.55 | 0.00 |
| 44 | 301090 | 华润材料 | 2,764 | 31,012.08 | 0.00 |
| 45 | 301127 | 天源环保 | 1,685 | 28,847.20 | 0.00 |
| 46 | 301039 | 中集车辆 | 2,064 | 25,820.64 | 0.00 |
| 47 | 301099 | 雅创电子 | 351 | 25,047.36 | 0.00 |
| 48 | 301221 | 光庭信息 | 280 | 24,841.60 | 0.00 |
| 49 | 301189 | 奥尼电子 | 435 | 24,629.70 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 50 | 301166 | 优宁维 | 253 | 23,908.50 | 0.00 |
| 51 | 301069 | 凯盛新材 | 539 | 23,829.19 | 0.00 |
| 52 | 301096 | 百诚医药 | 272 | 21,360.16 | 0.00 |
| 53 | 301093 | 华兰股份 | 409 | 20,388.65 | 0.00 |
| 54 | 301018 | 申菱环境 | 782 | 20,378.92 | 0.00 |
| 55 | 301082 | 久盛电气 | 915 | 19,699.95 | 0.00 |
| 56 | 300994 | 久祺股份 | 420 | 19,089.00 | 0.00 |
| 57 | 301100 | 风光股份 | 599 | 18,652.86 | 0.00 |
| 58 | 301168 | 通灵股份 | 329 | 17,150.77 | 0.00 |
| 59 | 301091 | 深城交 | 524 | 16,406.44 | 0.00 |
| 60 | 301101 | 明月镜片 | 371 | 16,086.56 | 0.00 |
| 61 | 301190 | 善水科技 | 575 | 15,789.50 | 0.00 |
| 62 | 301108 | 洁雅股份 | 280 | 15,038.80 | 0.00 |
| 63 | 301179 | 泽宇智能 | 295 | 14,977.15 | 0.00 |
| 64 | 301089 | 拓新药业 | 220 | 14,944.60 | 0.00 |
| 65 | 301180 | 万祥科技 | 654 | 14,858.88 | 0.00 |
| 66 | 301046 | 能辉科技 | 290 | 14,207.10 | 0.00 |
| 67 | 301015 | 百洋医药 | 462 | 13,998.60 | 0.00 |
| 68 | 301111 | 粤万年青 | 379 | 13,901.72 | 0.00 |
| 69 | 301188 | 力诺特玻 | 647 | 13,250.56 | 0.00 |
| 70 | 301199 | 迈赫股份 | 402 | 12,864.00 | 0.00 |
| 71 | 301020 | 密封科技 | 421 | 12,815.24 | 0.00 |
| 72 | 301138 | 华研精机 | 285 | 12,785.10 | 0.00 |
| 73 | 301026 | 浩通科技 | 203 | 12,734.19 | 0.00 |
| 74 | 301126 | 达嘉维康 | 662 | 12,730.26 | 0.00 |
| 75 | 301185 | 鸥玛软件 | 578 | 12,230.48 | 0.00 |
| 76 | 301021 | 英诺激光 | 290 | 12,014.70 | 0.00 |
| 77 | 301048 | 金鹰重工 | 843 | 10,925.28 | 0.00 |
| 78 | 301028 | 东亚机械 | 733 | 9,895.50 | 0.00 |
| 79 | 300774 | 倍杰特 | 444 | 9,359.52 | 0.00 |
| 80 | 301078 | 孩子王 | 756 | 9,177.84 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 81 | 301182 | 凯旺科技 | 294 | 8,990.52 | 0.00 |
| 82 | 301062 | 上海艾录 | 523 | 8,896.23 | 0.00 |
| 83 | 301193 | 家联科技 | 297 | 8,654.58 | 0.00 |
| 84 | 301052 | 果麦文化 | 252 | 8,477.28 | 0.00 |
| 85 | 301025 | 读客文化 | 403 | 8,414.64 | 0.00 |
| 86 | 301066 | 万事利 | 344 | 7,856.96 | 0.00 |
| 87 | 300814 | 中富电路 | 328 | 7,832.64 | 0.00 |
| 88 | 301198 | 喜悦智行 | 262 | 7,650.40 | 0.00 |
| 89 | 301030 | 仕净科技 | 242 | 7,627.84 | 0.00 |
| 90 | 301016 | 雷尔伟 | 275 | 7,128.00 | 0.00 |
| 91 | 301081 | 严牌股份 | 403 | 7,028.32 | 0.00 |
| 92 | 301033 | 迈普医学 | 108 | 6,476.76 | 0.00 |
| 93 | 301049 | 超越科技 | 196 | 6,452.32 | 0.00 |
| 94 | 301032 | 新柴股份 | 513 | 6,417.63 | 0.00 |
| 95 | 301056 | 森赫股份 | 572 | 6,343.48 | 0.00 |
| 96 | 301036 | 双乐股份 | 205 | 6,135.65 | 0.00 |
| 97 | 301041 | 金百泽 | 215 | 6,065.15 | 0.00 |
| 98 | 301072 | 中捷精工 | 181 | 6,047.21 | 0.00 |
| 99 | 301083 | 百胜智能 | 416 | 5,911.36 | 0.00 |
| 100 | 300854 | 中兰环保 | 203 | 5,539.87 | 0.00 |
| 101 | 301063 | 海锅股份 | 153 | 5,524.83 | 0.00 |
| 102 | 301038 | 深水规院 | 266 | 5,381.18 | 0.00 |
| 103 | 301059 | 金三江 | 259 | 4,998.70 | 0.00 |
| 104 | 301027 | 华蓝集团 | 286 | 4,761.90 | 0.00 |
| 105 | 301037 | 保立佳 | 193 | 4,682.18 | 0.00 |
| 106 | 301073 | 君亭酒店 | 144 | 4,608.00 | 0.00 |
| 107 | 301053 | 远信工业 | 155 | 4,460.90 | 0.00 |
| 108 | 301057 | 汇隆新材 | 218 | 4,146.36 | 0.00 |
| 109 | 301068 | 大地海洋 | 144 | 4,086.72 | 0.00 |
| 110 | 301079 | 邵阳液压 | 140 | 3,474.80 | 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 | H00175 | 吉利汽车 | 224,388,899.51 | 10.26 |
| 2 | H03690 | 美团-W | 186,885,014.65 | 8.54 |
| 3 | H00941 | 中国移动 | 175,357,917.73 | 8.02 |
| 4 | H01918 | 融创中国 | 174,676,997.38 | 7.98 |
| 5 | 000799 | 酒鬼酒 | 121,354,182.96 | 5.55 |
| 6 | H00388 | 香港交易所 | 117,345,366.24 | 5.36 |
| 7 | H00291 | 华润啤酒 | 105,730,549.06 | 4.83 |
| 8 | H00268 | 金蝶国际 | 97,316,065.89 | 4.45 |
| 9 | H03606 | 福耀玻璃 | 97,182,497.52 | 4.44 |
| 10 | H00728 | 中国电信 | 96,929,313.81 | 4.43 |
| 11 | H00700 | 腾讯控股 | 96,371,526.75 | 4.41 |
| 12 | 000858 | 五粮液 | 82,718,303.62 | 3.78 |
| 13 | H00883 | 中国海洋石油 | 81,927,869.88 | 3.74 |
| 14 | H00384 | 中国燃气 | 80,482,437.97 | 3.68 |
| 15 | H02202 | 万科企业 | 78,695,303.85 | 3.60 |
| 16 | H01579 | 颐海国际 | 78,454,734.98 | 3.59 |
| 17 | H02013 | 微盟集团 | 75,500,027.02 | 3.45 |
| 18 | H00688 | 中国海外发展 | 75,459,941.99 | 3.45 |
| 19 | H01109 | 华润置地 | 75,186,234.37 | 3.44 |
| 20 | 002415 | 海康威视 | 75,156,338.78 | 3.44 |
| 21 | H01772 | 赣锋锂业 | 74,428,141.78 | 3.40 |
| 22 | H01898 | 中煤能源 | 71,321,385.13 | 3.26 |
| 23 | H01024 | 快手-W | 68,249,041.59 | 3.12 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 24 | 000848 | 承德露露 | 68,009,261.67 | 3.11 |
| 25 | 603369 | 今世缘 | 67,263,953.70 | 3.07 |
| 26 | H02319 | 蒙牛乳业 | 66,626,921.01 | 3.05 |
| 27 | H00520 | 呷哺呷哺 | 65,702,123.07 | 3.00 |
| 28 | H02238 | 广汽集团 | 63,548,222.86 | 2.90 |
| 29 | H02196 | 复星医药 | 62,039,063.06 | 2.84 |
| 30 | H01458 | 周黑鸭 | 60,475,806.01 | 2.76 |
| 31 | 600702 | 舍得酒业 | 52,583,266.00 | 2.40 |
| 32 | H06969 | 思摩尔国际 | 52,376,620.92 | 2.39 |
| 33 | H01658 | 邮储银行 | 50,866,120.05 | 2.33 |
| 34 | H03900 | 绿城中国 | 44,745,317.50 | 2.05 |
| 35 | H01209 | 华润万象生活 | 44,071,583.05 | 2.01 |
| 36 | 600570 | 恒生电子 | 43,995,141.20 | 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 | H03690 | 美团-W | 269,169,379.25 | 12.30 |
| 2 | H00700 | 腾讯控股 | 198,946,444.76 | 9.09 |
| 3 | 000799 | 酒鬼酒 | 197,594,408.81 | 9.03 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 183,689,432.98 | 8.40 |
| 5 | H00941 | 中国移动 | 161,273,298.45 | 7.37 |
| 6 | H01918 | 融创中国 | 151,320,064.31 | 6.92 |
| 7 | H00388 | 香港交易所 | 141,056,271.82 | 6.45 |
| 8 | H00175 | 吉利汽车 | 136,192,337.04 | 6.23 |
| 9 | H00268 | 金蝶国际 | 120,320,697.05 | 5.50 |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 114,969,126.00 | 5.26 |

| | | | | |
|----|--------|--------|----------------|------|
| 11 | H02013 | 微盟集团 | 108,537,881.04 | 4.96 |
| 12 | H01898 | 中煤能源 | 95,264,297.69 | 4.35 |
| 13 | H00291 | 华润啤酒 | 90,680,287.78 | 4.15 |
| 14 | H00728 | 中国电信 | 84,373,635.86 | 3.86 |
| 15 | H00883 | 中国海洋石油 | 76,563,927.23 | 3.50 |
| 16 | 603369 | 今世缘 | 76,326,985.50 | 3.49 |
| 17 | H03606 | 福耀玻璃 | 75,330,777.85 | 3.44 |
| 18 | H02883 | 中海油田服务 | 74,269,935.22 | 3.39 |
| 19 | 600690 | 海尔智家 | 73,609,556.70 | 3.36 |
| 20 | H00384 | 中国燃气 | 71,049,935.81 | 3.25 |
| 21 | H02202 | 万科企业 | 71,032,817.28 | 3.25 |
| 22 | H01579 | 颐海国际 | 69,637,457.84 | 3.18 |
| 23 | 002444 | 巨星科技 | 69,065,751.04 | 3.16 |
| 24 | 002415 | 海康威视 | 62,955,919.00 | 2.88 |
| 25 | 002410 | 广联达 | 55,601,173.20 | 2.54 |
| 26 | H01030 | 新城发展 | 55,105,553.33 | 2.52 |
| 27 | H00520 | 呷哺呷哺 | 52,816,765.36 | 2.41 |
| 28 | 600989 | 宝丰能源 | 52,228,596.00 | 2.39 |
| 29 | H03998 | 波司登 | 51,288,180.34 | 2.34 |
| 30 | H02196 | 复星医药 | 49,574,746.18 | 2.27 |
| 31 | 600702 | 舍得酒业 | 48,263,208.00 | 2.21 |
| 32 | H06049 | 保利物业 | 47,171,441.12 | 2.16 |
| 33 | 600305 | 恒顺醋业 | 45,655,863.72 | 2.09 |
| 34 | 600521 | 华海药业 | 44,132,056.50 | 2.02 |
| 35 | H01658 | 邮储银行 | 43,915,514.96 | 2.01 |
| 36 | H00884 | 旭辉控股集团 | 43,768,123.74 | 2.00 |

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 | 4,015,632,711.67 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,369,205,454.59 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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。

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招商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7170万元。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 | 227,316.98 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 102,756.78 |
| 4 | 应收利息 | 32,819.81 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 362,893.57 |

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 |
| 49,226 | 29,597.19 | 54,352,397.20 | 3.7306% | 1,402,598,999.93 | 96.2694% |

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 | 2,999,106.08 | 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | >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 | 2,123,544,881.86 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,337,239,736.73 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,003,833,221.46 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,456,951,397.13 |

§ 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，毛慧女士不再担任公司督察长职务，聘任汪成杰先生担任公司督察长职务。本基金管理人已分别于2021年9月18日、2021年9月29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，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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90,000.00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

本报告期内，未发生基金管理人、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 | |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申港证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | 50,366,766.74 | 0.60% | 36,833.24 | 0.61% | - |
| 安信证券 | 2 | 503,976,691.36 | 6.05% | 364,371.71 | 6.08% | - |
| 财通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江 | 2 | 2,338,103,385.48 | 28.08% | 1,688,524.29 | 28.16% | - |

| | | | | | | |
|----------------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 证券 | | | | | | |
| 东北 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方 财富 | 2 | 277,439,912.59 | 3.33% | 198,103.00 | 3.30% | - |
| 东方 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴 证券 | 2 | 93,600,756.70 | 1.12% | 68,223.14 | 1.14% | - |
| 方正 证券 | 2 | 794,813.42 | 0.01% | 574.54 | 0.01% | - |
| 光大 证券 | 2 | 1,678,272.28 | 0.02% | 1,211.01 | 0.02% | - |
| 广发 证券 | 2 | 608,609,275.93 | 7.31% | 423,446.12 | 7.06% | - |
| 国金 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛 证券 | 2 | 18,017,639.27 | 0.22% | 12,915.05 | 0.22% | - |
| 国泰 君安 证券 | 2 | 206,647,203.38 | 2.48% | 149,404.32 | 2.49% | - |
| 国信 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国元 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 宏信 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华安 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创 | 2 | 2,212,089,593.87 | 26.57% | 1,597,636.56 | 26.64% | - |

| | | | | | | |
|--------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 证券 | | | | | | |
| 华西证券 | 2 | 3,181,970.33 | 0.04% | 2,322.91 | 0.04% | - |
| 华兴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | 2 | 259,537.36 | 0.00% | 184.62 | 0.00% | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 2 | 1,542,870,653.04 | 18.53% | 1,113,931.93 | 18.58% | - |
| 信达证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | 451,673,816.42 | 5.43% | 327,210.52 | 5.46% | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | 12,966,017.78 | 0.16% | 9,357.43 | 0.16% | - |
| 中信建投 | 2 | 3,059,269.90 | 0.04% | 2,204.41 | 0.04% | - |
| 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 | 成交金额 | 占当 | 成交 | 占当 | 成交 | 占当 |
| | | | | | | | | |

| | | 期债券成交总额的比例 | | 期债券回购成交总额的比例 | 金额 | 期权证成交总额的比例 | 金额 | 期基金成交总额的比例 |
|------------|-------------------|------------|--------------------|--------------|----|------------|----|------------|
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申港证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 41,106,74 1.18 | 15.8 0% | 106,500,0 00.00 | 8.02% | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 89,074,39 9.99 | 34.2 4% | 704,000,0 00.00 | 52.9 9% | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | - | - | 420,000,0 00.00 | 31.6 1% | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 41,016,43 9.90 | 15.7 7% | - | - | - | - | - | - |
| 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 | 88,932,36 0.33 | 34.1 9% | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | 98,000,00 0.00 | 7.38% | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 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部分基金开展网上直销平台认购、申购费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-01-06 |
| 2 | 永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销平台认购、申购费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-01-07 |
| 3 | 关于永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2021年非港股通交易日暂停基金申购、赎回及定期定额投资业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-01-08 |
| 4 | 永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2020年第 | 中国证监会规定媒介 | 2021-01-22 |

| | | | |
|----|--|-----------|------------|
| | 4季度报告 | | |
| 5 | 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 | 2021-01-26 |
| 6 | 永赢基金管理有限公司关于新增甬兴证券有限公司为旗下部分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 | 2021-01-29 |
| 7 | 永赢基金管理有限公司关于新增平安证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参与其费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-02-01 |
| 8 | 永赢基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-06 |
| 9 | 永赢基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的声明 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-08 |
| 10 | 永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-16 |
| 11 | 永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2020年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-27 |
| 12 | 永赢基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为永赢基金旗下部分基金代销机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-31 |
| 13 | 永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2021年第1季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-04-21 |
| 14 | 永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金开放日常转换业务公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-05-27 |

| | | | |
|----|---|-----------|------------|
| 15 | 永赢基金管理有限公司关于调整部分基金最低赎回（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 | 2021-06-17 |
| 16 | 永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2021年第2季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-07-20 |
| 17 | 永赢基金管理有限公司关于新增腾安基金销售（深圳）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 | 2021-07-21 |
| 18 | 永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2021年中期报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-08-28 |
| 19 | 永赢基金管理有限公司关于新增上海万得基金销售有限公司为旗下部分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 | 2021-08-31 |
| 20 | 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 | 2021-09-18 |
| 21 | 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 | 2021-09-29 |
| 22 | 永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2021年第3季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-10-27 |
| 23 | 永赢基金管理有限公司关于新增国信证券股份有限公司为旗下部分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 | 2021-11-03 |
| 24 | 永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-12-09 |

| | | | |
|----|--|-----------|------------|
| 25 | 永赢基金管理有限公司关于新增国金证券股份有限公司为旗下部分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 | 2021-12-13 |
| 26 | 永赢基金管理有限公司关于永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金2021年底和2022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 | 2021-12-24 |
| 27 | 永赢基金管理有限公司关于新增国联证券股份有限公司为旗下部分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 | 2021-12-24 |
| 28 | 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(2021年第1号) | 中国证监会规定媒介 | 2021-12-28 |
| 29 | 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(2021年第1号) | 中国证监会规定媒介 | 2021-12-28 |
| 30 | 永赢基金管理有限公司广州分公司成立公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-12-30 |

§ 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. 中国证监会核准永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金募集的文件；

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21世纪大厦21、22、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
二〇二二年三月二十六日