

永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

2022年第1季度报告

2022年03月31日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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 | 永赢宏泽一年定开混合 |
| 基金主代码 | 011093 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021年03月09日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,694,955,441.87份 |
| 投资目标 | 本基金通过对宏观经济现状及趋势分析、相关政策研究的角度出发，自上而下地分析影响股票、债券、货币市场的各种关键因素，灵活配置大类资产，同时辅以自下而上地个股精选，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 目前国内宏观经济、产业政策、金融市场等多方面时刻面临着巨大且深刻的变化，本基金采用大类资产轮动配置模型驱动的投资策略进行基金资产灵活配置。本基金将资产配置与经济周期结合，形成大类资产配置策略。利用永赢基金自主研发的资产配置模型，结合经济周期表现，通过大类资产轮动切换配置、多风格的动态组合管理寻找具有投资价值的行业和 |

个股，并对所挑选的投资标的进行资产配置和组合动态管理，实现长期稳定的投资收益。当估值较贵、盈利难预期时，本基金投资于股票的比例可降至0；当估值较低、盈利预期好时，本基金投资于股票的比例封闭期内可提至100%（开放期内为95%）。

1、大类资产配置策略

本基金基于基金经理及管理人投研团队"自上而下"的研究方法，通过深入的宏观经济和政策分析，判断市场利率水平、盈利变化等因素对证券市场的影响，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。

本基金存续期内，将在每年6月的最后一个工作日、12月的最后一个工作日根据当日A股参考市盈率（PE）进行仓位判断，当该日A股参考市盈率低于一定市盈率水平（即，A股历史最低市盈率+5%×（A股历史最高市盈率-A股历史最低市盈率））时，表示当下的A股市场具备估值优势、市场风险释放比较充分，可进行股票配置操作，因此本基金将在该日下一个工作日至下一个判断日保持较高的股票类资产配置比例；当该日A股参考市盈率高于等于一定市盈率水平（即，A股历史最低市盈率+5%×（A股历史最高市盈率-A股历史最低市盈率））时，表示当下的A股市场估值优势不显著、风险积聚较大，可减少股票配置，因此本基金将在该日下一个工作日至下一个判断日保持较低的股票类资产配置比例。

上述A股参考市盈率（PE）为在每年6月最后一个工作日或12月最后一个工作日，将沪深两市股票市盈率数据进行平均而得。

股票类资产配置比例与参考市盈率之间判定标准如下表：

| A 股参考市盈率（PE） | 股票类资产比例（S） |
|---|------------------------------------|
| $PE < A \text{ 股历史最低市盈率} + 5\% \times (A \text{ 股历史最高市盈率} - A \text{ 股历史最低市盈率})$ | $50\% < S \leq 100\%$ （开放期上限为 95%） |
| $PE \geq A \text{ 股历史最低市盈率} + 5\% \times (A \text{ 股历史最高市盈率} - A \text{ 股历史最低市盈率})$ | $0\% \leq S \leq 50\%$ |

备注：基金在实际运作过程中将面临股票类资产比例大幅调整、开放期申购赎回、证券市场波动、证券流动性受限等因素的影响，因此除以下情形外，本基金在每个交易日日终股票配置比例原则上应在上表配置范围内变动：1、基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合上述投资比例要求；2、本基金封闭期内，由于A股参考市盈率的变动致使股票类资产比例需要按照上述要求大幅调整时，应当在20个交易日内使股票类资产比例符合上述约定；3、为开放期流动性需求，保护基金份额持有人利益，在每个开放期的前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，本基金投资不受上表股票类资产比例限制；4、本基金如因持有流动性受限资产（如停牌股票、流通受限的新股等）致使股票类资产比例不符合上述配置要求的，应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易（如停牌股票复牌等）的10个交易日内根据当前股票类资产比例需求进行相应处置并使得股票类资产比例符合上述配置要求。基金管理人可根据宏观经济、金融市场等变化，在履行适当程序后，适时适当调整优化上述仓位调整时间标准及配置比例。

2、股票投资策略

在大类资产配置框架下，本基金通过定量和定性分析相结合、基本面与模型相结合、基金经理和研究团队相结合的研究方法，甄选优质上市公司构建投资组合，以获得长期持续稳健的投资收益。在灵活的大类别资产配置基础上，本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、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。

3、债券投资策略

在灵活的大类别资产配置基础上，本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果，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，以获取稳健的投资收益。

4、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（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）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。

5、股指期货投资策略

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。

6、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

7、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。

8、可交换债券投资策略

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。

9、开放期投资策略

本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他

| | |
|--------|---|
| | 品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收益率*50% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 永赢基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

§ 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） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -55,197,401.18 |
| 2. 本期利润 | -204,043,222.98 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0812 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,535,551,908.76 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9060 |

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

| 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 | -7.15% | 0.72% | -7.36% | 0.73% | 0.21% | -0.01% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月 | -4.31% | 0.59% | -6.34% | 0.59% | 2.03% | 0.00% |
| 过去一年 | -9.35% | 0.55% | -7.28% | 0.57% | -2.07% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.40% | 0.54% | -7.43% | 0.58% | -1.97% | -0.04% |

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

永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年03月09日-2022年03月31日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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 | 说明 |
|----|----|-------------|----|------|----|
| | | 任职 | 离任 | | |
| | | | | | |

| | | 日期 | 日期 | 年限 | |
|---------|-----------------------|----------------|----|----|---|
| 李永 兴 | 副总经理/基金经理 | 2021- 03-09 | - | 15 | 李永兴先生，北京大学经济学硕士，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，九泰基金管理有限公司投资总监，永赢基金管理有限公司总经理助理。现任永赢基金管理有限公司副总经理。 |
| 万纯 | 权益投资部指数与数量投资部副总监/基金经理 | 2021- 03-09 | - | 7 | 万纯先生，北京大学硕士，7年证券相关从业经验。曾任中国证券登记结算有限责任公司技术部基金业务组经理助理，平安基金管理有限公司指数投资部基金经理助理。现任永赢基金管理有限公司权益投资部指数与数量投资部副总监（主持工作）。 |
| 徐沛 琳 | 基金经理 | 2021- 03-22 | - | 10 | 徐沛琳女士，复旦大学硕士，10年证券相关从业经验。曾任东方基金管理有限公司交易部交易员，上海浦东发展银行股份有限公司资产管理部投资经理。现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。 |

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、《永赢宏泽一年定期开放灵活配置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 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，疫情有所反复，但总体向好，新冠特效药也陆续投放市场，疫情对市场影响逐渐递减。从美联储表态来看，今年可能加息七次，而俄乌复杂的地缘局势也使得大宗商品价格持续冲高，这也使得市场目前主要矛盾主要由美联储重启加息周期以及以原油为代表的大宗商品持续高位震荡主导，后续投资者可重点关注加息超预期程度以及大宗油价的高位持续时间。国内经济来看，由于一季度国内疫情的多点爆发，一季度国内经济复苏遇阻，其中消费不及预期的影响可能会使得接下来宽信用力度进一步加大。国内宏观数据来看，CPI仍在区间低位震荡，社融及M2数据均在预期范围内，货币政策整体维持中性偏松。

股票市场方面，2022年一季度，A股受美股加息影响即开始回调，其中以前期涨幅较大的新能源、军工、芯片、医疗服务等板块调整相对较大。期间沪深300下跌14.53%，创下15年四季度以来最大跌幅。行业层面，一季度领涨的行业主要集中大宗资源品及“稳增长”领域：首先是俄乌冲突下，涨价预期强化的石油石化、煤炭等大宗资源品，其次是“稳增长”下金融、地产等板块的低估值修复行情。

债券市场方面，首先利率债方面，一季度利率走势以春节为节点走势先下后上，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。

其次信用债方面，一季度期限利差走阔，1年和3年期中债隐含评级AA+中短期票据利率分别变动-2.98BP和17.22BP，中债隐含评级AA城投3年与1年期限利差走阔23BP。受合意资产荒和高等级信用债收益率上行影响，等级利差收窄，3年期中债隐含评级AA+与AA的中短期票据等级利差收窄22BP。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。

站在二季度关口展望未来一段时间，一季度的回调已经较大的释放了市场风险，从股债性价比走势来看，目前市场已经重回价值区间；在生产资料价格中枢高位震荡、稳增长力度加码、新兴产业增长一致预期较强且政策不断支持的背景下，价值与成长可能会相对均衡，待大宗商品价格回落及国内宽信用进一步落地后，市场情绪有望回暖。

本基金采用“自上而下”的研究方法，结合流动性和基本面边际变化情况，利用自主研发的资产配置模型合理确定本基金在股票、债券等各类资产类别的投资比例。股票部分关注货币政策和利率走势，跟踪行业间景气度变化及市场风格趋势性切换的可能性，积极把握股票市场结构性机会。债券部分一季度在1月增持中高等级信用债提升久期及组合收益，2至3月基于宽货币向宽信用过度的预期变化适度降低组合久期，同时置换存量持仓提升组合流动性。展望后市将继续维持中低久期、票息策略为主，适度把握利率波段机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢宏泽一年定开混合基金份额净值为0.9060元，本报告期内，基金份额净值增长率为-7.15%，同期业绩比较基准收益率为-7.36%。

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 | 754,886,615.22 | 49.02 |
| | 其中：股票 | 754,886,615.22 | 49.02 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 706,736,219.93 | 45.89 |
| | 其中：债券 | 705,166,148.52 | 45.79 |
| | 资产支持证券 | 1,570,071.41 | 0.10 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 60,037,215.85 | 3.90 |
| | 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 | 18,261,708.27 | 1.19 |
| 8 | 其他资产 | 119,684.09 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 1,540,041,443.36 | 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

| 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 | 24,126,349.00 | 1.57 |
| C | 制造业 | 474,696,080.25 | 30.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 22,098,323.00 | 1.44 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 62,212.83 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 19,992,240.00 | 1.30 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 63,788,430.19 | 4.15 |
| J | 金融业 | 110,010,076.00 | 7.16 |
| K | 房地产业 | 14,854,438.60 | 0.97 |
| L | 租赁和商务服务业 | 8,185,626.00 | 0.53 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 15,016,227.90 | 0.98 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,056,611.45 | 0.13 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 754,886,615.22 | 49.16 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 50,800 | 26,024,840.00 | 1.69 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 13,000 | 22,347,000.00 | 1.46 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 787,100 | 19,945,114.00 | 1.30 |
| 4 | 603566 | 普莱柯 | 633,900 | 17,514,657.00 | 1.14 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 331,000 | 15,490,800.00 | 1.01 |
| 6 | 603501 | 韦尔股份 | 74,013 | 14,314,114.20 | 0.93 |
| 7 | 601012 | 隆基股份 | 165,900 | 11,976,321.00 | 0.78 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 549,570 | 11,486,013.00 | 0.75 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 512,000 | 10,583,040.00 | 0.69 |
| 10 | 002555 | 三七互娱 | 442,900 | 10,386,005.00 | 0.68 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 162,141,547.95 | 10.56 |
| | 其中：政策性金融债 | 110,317,041.10 | 7.18 |
| 4 | 企业债券 | 51,334,076.17 | 3.34 |
| 5 | 企业短期融资券 | 50,468,211.51 | 3.29 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| 6 | 中期票据 | 441,222,312.89 | 28.73 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 705,166,148.52 | 45.92 |

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 | 220205 | 22国开05 | 1,100,000 | 110,317,041.10 | 7.18 |
| 2 | 102100558 | 21新长宁MTN001 | 700,000 | 70,902,336.44 | 4.62 |
| 3 | 102100187 | 21桐庐国投MTN001 | 500,000 | 52,122,465.75 | 3.39 |
| 4 | 1723001 | 17人保健康 | 500,000 | 51,824,506.85 | 3.37 |
| 5 | 101900299 | 19江北国资MTN001 | 500,000 | 51,816,506.85 | 3.37 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 136472 | 东曦4A1 | 200,000 | 1,570,071.41 | 0.10 |

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国家开发银行在报告编制日前一年受到行政处罚,处罚金额合计为440万元。

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

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

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 80,480.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | 39,203.77 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 119,684.09 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,751,451,599.56 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 563,669.89 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,057,059,827.58 |
| 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 | 1,694,955,441.87 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢宏泽一年定期开放灵活配置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。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

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

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