

永赢优质生活混合型证券投资基金

2022年第3季度报告

2022年09月30日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月24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08月23日（基金合同生效日）起至2022年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 永赢优质生活混合 |
| 基金主代码 | 015287 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022年08月23日 |
| 报告期末基金份额总额 | 332,599,635.13份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于优质生活主题相关的资产，在力争控制组合风险的前提下，实现资产净值的中长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，在优质生活主题所涵盖“衣、食、居、行、康、乐、美”七大领域寻找可持续成长的优质企业，从而实现基金的投资目标。本基金主要投资策略包含大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债-综合指数（全价）收益率×20% |
| 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。本基金可投资港股通标的股票，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。 | |
| 基金管理人 | 永赢基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 浙商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 永赢优质生活混合A | 永赢优质生活混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 015287 | 015288 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 186,686,370.15份 | 145,913,264.98份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2022年08月23日 - 2022年09月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|----------------|
| | 永赢优质生活混合A | 永赢优质生活混合C |
| 1. 本期已实现收益 | -1,358,714.83 | -1,152,373.32 |
| 2. 本期利润 | -1,254,186.86 | -1,070,789.23 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0067 | -0.0073 |
| 4. 期末基金资产净值 | 185,432,183.29 | 144,842,475.75 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9933 | 0.9927 |

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、本基金合同生效日为2022年08月23日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

永赢优质生活混合A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | -0.67% | 0.10% | -7.29% | 0.71% | 6.62% | -0.61% |

永赢优质生活混合C净值表现

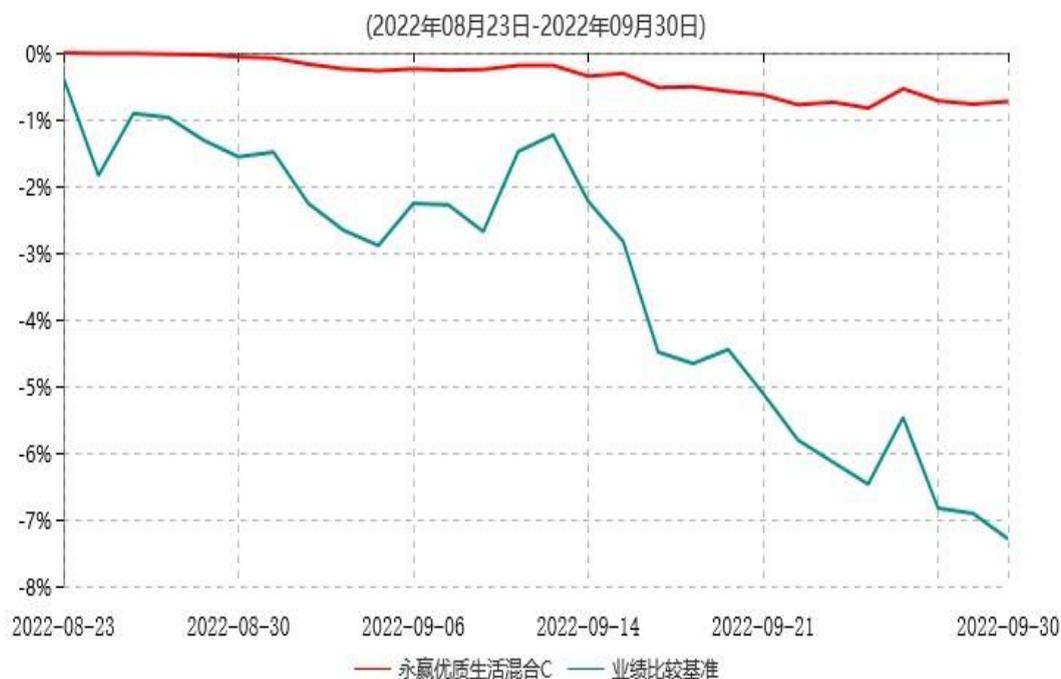
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | -0.73% | 0.09% | -7.29% | 0.71% | 6.56% | -0.62% |

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



注：1、本基金合同生效日为 2022 年 8 月 23 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；
2、本基金建仓期为本基金合同生效日起六个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

永赢优质生活混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2022 年 8 月 23 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-----------------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 光磊 | 权益投资部 副总监/基金经理兼任 投资经理 | 2022-08-23 | - | 14 | 光磊先生，浙江大学理学硕士，14年证券相关从业经验。曾任汇添富基金管理有限公司投资研究部高级行业分析师，华宝兴业基金管理有限公司国内投资部基金经理助理，华宝基金管理有限公司国内投资部投资副总监、基金经理，现任永赢基金管理有限公司权益投资部副总监。 |

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

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值(元) | 任职时间 |
|----|----------|---------|----------------|------------|
| 光磊 | 公募基金 | 3 | 374,020,870.54 | 2021-12-28 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 18,304,942.07 | 2022-7-21 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 4 | 392,325,812.61 | - |

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、《永赢优质生活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

三季度美联储持续加息的节奏超预期，全球流动性持续紧张，美元以外的货币均承受了较大压力。同时由于疫情的扩散，国内经济复苏的节奏受到影响。在此背景下，权益市场出现了一定幅度的调整。三季度期间上证指数涨幅为-11.01%，沪深300为-15.16%，中小板指数为-16.73%，创业板指为-18.56%，总体看偏大盘和价值风格相对表现较好。

本基金在报告期间处于建仓期。本着对审慎建仓的原则，在市场调整的过程中逐步积累仓位。主要的投资方向为长期业绩较好，短期受制于疫情但后续有望修复的消费类公司，以及部分业绩保持增长，估值处于低位的医药公司，并配置了部分业绩稳定、重视分红的价值型公司。后续本基金将保持审慎建仓的风格，力争为投资者创造收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢优质生活混合A基金份额净值为0.9933元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.67%，同期业绩比较基准收益率为-7.29%；截至报告期末永赢优质生活混合C基金份额净值为0.9927元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.73%，同期业绩比较基准收益率为-7.29%。

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 | 61,069,633.50 | 18.46 |
| | 其中：股票 | 61,069,633.50 | 18.46 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 47,706,832.33 | 14.42 |
| | 其中：债券 | 47,706,832.33 | 14.42 |
| | 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 | 131,815,551.19 | 39.84 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 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 | 90,278,379.43 | 27.29 |
| 8 | 其他资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 330,870,396.45 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 34,841,375.50 | 10.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,431,466.00 | 1.04 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 6,873,998.00 | 2.08 |
| J | 金融业 | 10,424,980.00 | 3.16 |
| K | 房地产业 | 3,488,668.00 | 1.06 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 2,009,146.00 | 0.61 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 61,069,633.50 | 18.49 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 5,345 | 10,008,512.50 | 3.03 |
| 2 | 600809 | 山西汾酒 | 23,300 | 7,057,337.00 | 2.14 |
| 3 | 600941 | 中国移动 | 100,600 | 6,873,998.00 | 2.08 |
| 4 | 002311 | 海大集团 | 107,800 | 6,498,184.00 | 1.97 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 190,900 | 6,423,785.00 | 1.94 |
| 6 | 603517 | 绝味食品 | 95,900 | 4,804,590.00 | 1.45 |
| 7 | 601628 | 中国人寿 | 126,500 | 4,001,195.00 | 1.21 |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 150,900 | 3,431,466.00 | 1.04 |
| 9 | 300973 | 立高食品 | 39,500 | 3,406,480.00 | 1.03 |
| 10 | 603882 | 金城医学 | 31,700 | 2,009,146.00 | 0.61 |

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 | 47,706,832.33 | 14.44 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 47,706,832.33 | 14.44 |

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

| 号 | | | | | 值比例 (%) |
|---|--------|--------|---------|---------------|---------|
| 1 | 019664 | 21国债16 | 300,000 | 30,631,734.25 | 9.27 |
| 2 | 019679 | 22国债14 | 170,000 | 17,075,098.08 | 5.17 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内,基金投资的前十名证券的发行主体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300万元。

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

本基金本报告期末未持有其他各项资产。

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

| | 永赢优质生活混合A | 永赢优质生活混合C |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2022年08月23日)基金份额总额 | 186,686,370.15 | 145,913,264.98 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 186,686,370.15 | 145,913,264.98 |

§ 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

单位：份

| | 永赢优质生活混合A | 永赢优质生活混合C |
|--------------------------|---------------|-----------|
| 基金合同生效日管理人持有的本基金份额 | 10,002,972.22 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,002,972.22 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 3.01 | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|------|---------|---------|------|
|----|------|------|---------|---------|------|

| | | | | | |
|----|----|------------|---------------|--------------|---|
| 1 | 认购 | 2022-08-23 | 10,002,972.22 | 9,999,000.00 | - |
| 合计 | | | 10,002,972.22 | 9,999,000.00 | |

注：本基金管理人认购永赢优质生活混合型证券投资基金认购费率为1000元/笔。

§ 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优质生活混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《永赢优质生活混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢优质生活混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢优质生活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号二十一世纪大厦21、22、23、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10月26日