永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）
2023 年年度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 03 月 27 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 25 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
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 17
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 18
§5 托管人报告 18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18
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 18
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 18
§6 审计报告 18
6.1 审计报告基本信息 18
6.2 审计报告的基本内容 18
§7 年度财务报表 20
7.1 资产负债表 20
7.2 利润表 21
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 23
§8 投资组合报告 52
8.1 期末基金资产组合情况 52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 52
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 52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 52

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 53
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 53
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 53
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 53
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 53
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 53
8.12 本报告期投资基金情况 54
8.13 投资组合报告附注 55
§9 基金份额持有人信息 55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 56
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 56
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 57
§10 开放式基金份额变动 57
§11 重大事件揭示 57
11.1 基金份额持有人大会决议 57
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 57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 57
11.4 基金投资策略的改变 57
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 58
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 58
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 58
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 58
11.9 其他重大事件 59
§12 影响投资者决策的其他重要信息 60
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 61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 61
§13 备查文件目录 61
13.1 备查文件目录 61
13.2 存放地点 61
13.3 查阅方式 61

§2基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）	
基金简称	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）	
基金主代码	013668	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 22 日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,079,218.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C
下属分级基金的交易代码	013668	013669
报告期末下属分级基金的份额总额	10,905,260.70 份	173,957.64 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制组合风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将综合运用大类资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、港股通标的股票投资策略、固定收益投资策略、可转换债券投资策略、可交换债券配置策略和资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*10%+中债综合全价（总值）指数收益率*85%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF）、混合型基金、混合型基金中基金（FOF），高于货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。 本基金还可投资港股通投资标的股票，还需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		永赢基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰	张姗
	联系电话	021-20430340	400-61-95555
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-805-8888	400-61-95555
传真		021-51690177	0755-83195201
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址	上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	马宇晖	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	永赢基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年 12 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C
本期已实现收益	276,220.31	135,552.75	382,369.95	106,699.93	-4,963.40	-23,108.27
本期利润	102,227.10	166,972.19	184,074.65	-240,612.08	238,790.77	406,875.86
加权平均基金份额本期利润	0.0073	0.0216	0.0022	-0.0017	0.0029	0.0028
本期加权平均净值利润率	0.72%	2.16%	0.23%	-0.17%	0.29%	0.28%
本期基金份	0.33%	-0.14%	0.29%	-0.11%	0.29%	0.28%

额净值增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C
期末可供分配利润	99,438.95	57.68	224,082.59	79,994.32	-4,963.40	-23,108.27
期末可供分配基金份额利润	0.0091	0.0003	0.0053	0.0011	-0.0001	-0.0002
期末基金资产净值	11,004,699.65	174,015.32	42,833,415.42	71,385,776.49	82,666,781.69	145,819,263.75
期末基金份额净值	1.0091	1.0003	1.0058	1.0017	1.0029	1.0028
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C
基金份额累计净值增长率	0.91%	0.03%	0.58%	0.17%	0.29%	0.28%

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

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A

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	0.76%	0.10%	0.06%	0.09%	0.70%	0.01%
过去六个月	0.18%	0.09%	-0.35%	0.08%	0.53%	0.01%
过去一年	0.33%	0.08%	0.74%	0.08%	-0.41%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.91%	0.09%	-0.69%	0.11%	1.60%	-0.02%

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：中证 800 指数收益率*10%+中债综合全价（总值）指数收益率*85%+银行活期存款利率（税后）*5%。

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C

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	0.65%	0.10%	0.06%	0.09%	0.59%	0.01%
过去六个月	-0.04%	0.09%	-0.35%	0.08%	0.31%	0.01%
过去一年	-0.14%	0.08%	0.74%	0.08%	-0.88%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.03%	0.09%	-0.69%	0.11%	0.72%	-0.02%

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：中证 800 指数收益率*10%+中债综合全价（总值）指数收益率*85%+银行活期存款利率（税后）*5%。

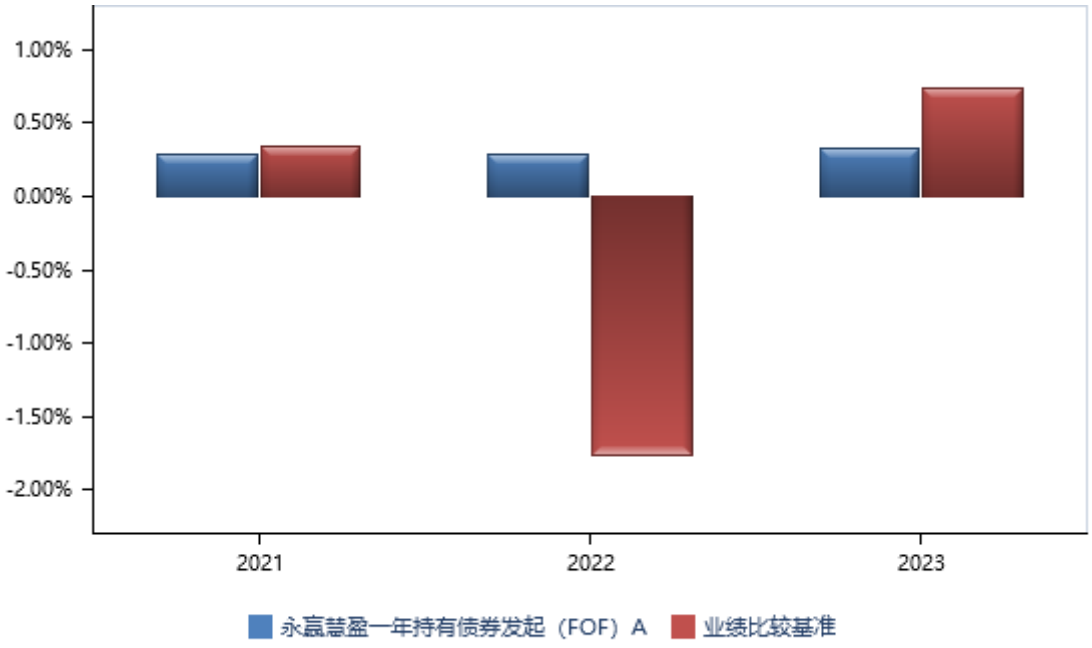
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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。

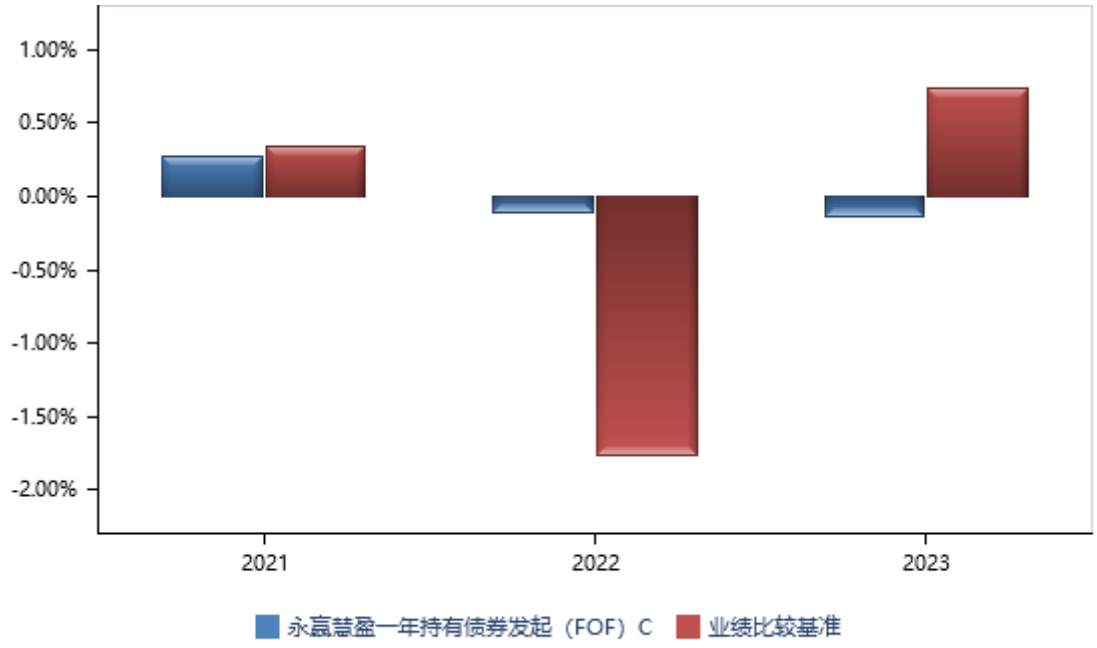
注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A



永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C



注：本基金合同于 2021 年 12 月 22 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 2021 年 12 月 22 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%，Oversea-Chinese Banking Corporation Limited 持股 28.51%。

截止 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 121 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、永赢通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、永赢中债-1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢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、永赢中债-1-5 年国开行债券指数证券投资基金、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、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、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、永赢优质精选混合型发起式证券投资基金、永赢添添欣 12 个月持有期混合型证券投资基金、永赢养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、永赢卓越臻选股票型发起式证券投资基金、永赢新能源智选混合型发起式证券投资基金、永赢坤益债券型证券投资基金、永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金、永赢宏泰短债债券型证券投资基金、永赢添添悦 6 个月持有期混合型证券投资基金、永赢优质生活混合型证券投资基金、永赢安悦 60 天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢湖北国有企业债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、永赢半导体产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢低碳环保智选混合型发起式证券投资基金、永赢安泰中短债债券型证券投资基金、永赢医药创新智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费鑫选 6 个月持有期混合型证券投资基金、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费龙头智选混合型发起式证券投资基金、永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金、永赢季季享 90 天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢昭利债券型证券投资基金、永赢恒欣稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、永赢数字经济智选混合型发起式证券投资基金、永赢月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金、永赢先进制造智选混合型发起式证券投资基金、永赢浩益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢匠心增利债券型证券投资基金、永赢启源混合型发起式证券投资基金、永赢中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、永赢睿信混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田沁琰	基金经理	2021 年 12 月 22 日	-	8 年	田沁琰女士，硕士，8 年证券相关从业经验。曾任汇丰银行个人银行及财富管理部客户助理，宁波银行金融市场部交易及流动性管理岗，海通证券固定收

					益部投资经理，现任永赢基金管理有限公司 FOF 投资部基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限；投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预；基金经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同基金经理之间的持仓和交易等重大

非公开投资信息相互隔离。另外，本基金管理人还建立机制要求公募基金经理与资产管理计划投资经理互相隔离，且原则上不能互相授权投资。

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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。

4.3.3 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

宏观方面，2023 年经济全年呈现 N 型走势，一至四季度实际 GDP 增速依次录得 4.5%、6.3%、4.9%、5.2%，全年 GDP 增速 5.2%。2023 年经济整体处于疫后修复期，但修复过程仍有曲折，总需求不足、居民与企业预期偏弱是制约经济向上弹性的主要因素。从经济结构上看，地产投资仍在低位徘徊，消费缓慢回补、制造业投资相对稳定，基建投资在稳增长政策支撑下维持高增速，出口年初脉冲后全年整体偏弱。实体以外，社融信贷年内投放节奏前置、增速前高后低，通胀中枢整体下移。

利率方面，债市表现上，利率全年震荡下行，收益率曲线整体平坦化。节奏上，年初经济脉冲上行，信贷开门红带动资金边际收敛，利率出现小幅调整。春节后经济修复动能开始转弱，3 月央行降准 25bp 带动资金价格和波动率双双下降，在基本面和资金面助推下，利率开启震荡下行，接连突破 2.8、2.7、2.6 等整数关口，并在 8 月降息后创下年内低点。9 月后地产认房不认贷、活跃资本市场等政策陆续落地，万亿国债增发、地方特殊再融资债发行带动资金面边际收敛，债券收益率开始震荡调整，但因为基本面修复斜率偏缓，整体调整幅度有限。年末在机构配置、宽松预期抢跑等因素带动下，收益率再度下行，十年国债活跃券全年下行近 28bp。

信用方面，2023 年债券市场违约仍主要集中在非国有地产，违约率处于近年来低位。无风险利率下行、资产荒以及城投化债利好决定了全年牛市行情，信用利差、等级利差和期限利差悉数收窄，信用债录得自 2020 年以来的最好收益。

转债方面，2023 年在疫后复苏弹性不足、海外加息超预期等因素下，股票市场呈现先上后下的走势，转债市场在债市宽松环境下维持偏高估值，相比股票体现出较强的抗跌性，中证转债指数全年收跌 0.48%。

报告期内，为获取稳健的收益，本基金的大类资产配置以固定收益资产为主，跟随长端利率下行以及信用利差的收窄，适当拉长了所配置的债券型基金的久期，并增配部分信用债基，整体维持较高债券型基金仓位及中性久期。受到权益市场整体较为低迷的影响，权益仓位整体低于中枢，优

选指数型基金进行轮动配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A 基金份额净值为 1.0091 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.33%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%；截至报告期末永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C 基金份额净值为 1.0003 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.14%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年宏观环境，“经济弱修复、中央加杠杆、货币宽松配合”是基本格局组合。经济基本面将延续修复态势，在基数主导下全年 GDP 走势或将呈现 N 型。结构上，在信贷结构优化调整、盘活存量资金的导向下，制造业投资预计表现平稳；基建投资是财政发力核心抓手，重点在于实物工作量落地效果。消费弹性受到收入预期、消费意愿约束，预计延续弱复苏态势。需求端可能弹性来源于出口，关注海外周期回升对外需的拉动作用。通胀方面，CPI、PPI 中枢有望小幅抬升，整体仍处于偏低位置。在高质量发展基调下，政策提效是关键，财政扩张有赖于中央加杠杆，货币政策在配合思路下将延续宽松基调，年内宽松操作仍可期待。对债券市场而言，广谱利率下移仍是长期趋势，利率中枢仍处于下行通道，由于金融机构负债端成本对下行幅度存在一定牵制，需在基本面和政策节奏中把握交易机会。

信用方面，2024 年宏观环境仍有利于无风险利率中枢下移，票息类资产供给仍面临压力、信用资产荒的程度或较 2023 年更为显著。需求方面，贷款投放节奏平滑背景下，银行信用债配置需求或有所增加，居民较低的风险偏好也有利于固收类产品规模稳中有增，保费持续增长及非标收缩也有利于险资加大债券配置。整体来看，预计 2024 年信用债收益率和利差中枢继续下降，但信用环境、政策变化和机构行为等因素放大信用债的波动性，预计全年呈震荡下行趋势，低利率和低利差环境下，票息及资本利得收益或将边际下降。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 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。2023 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。2023 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信息技术专项审计、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/研究的分管领导、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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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（2024）审字第 70077306_B96 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	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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，公允反映了永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经

	营成果和净资产变动情况。
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，我们独立于永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF），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	-
其他事项	-
其他信息	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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，就可能导致对永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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	石静筠　　沈熙苑
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2024 年 03 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）
报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	533,732.49	43,405,231.45
结算备付金		22,511.11	140,883.15
存出保证金		240.44	21,153.22
交易性金融资产	7.4.7.2	10,636,800.30	117,279,725.11
其中：股票投资		-	-
基金投资		9,926,862.22	110,030,360.73
债券投资		709,938.08	7,249,364.38
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-5,556.16
应收清算款		-	52,248,170.27
应收股利		11,486.30	-
应收申购款		35.97	169.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	298.47	-
资产总计		11,205,105.08	213,089,776.97
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 12 月 31 日**	**上年度末 2022 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	98,520,082.54
应付管理人报酬		4,608.65	110,085.58
应付托管费		1,408.13	23,366.46
应付销售服务费		58.47	46,770.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	20,314.86	170,280.12
负债合计		26,390.11	98,870,585.06
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	11,079,218.34	113,851,140.45
未分配利润	7.4.7.8	99,496.63	368,051.46
净资产合计		11,178,714.97	114,219,191.91
负债和净资产总计		11,205,105.08	213,089,776.97

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0090 元，基金份额总额 11,079,218.34 份。

其中永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A 类基金份额净值 1.0091 元，份额总额 10,905,260.70 份；

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C 类基金份额净值 1.0003 元，份额总额 173,957.64 份。

7.2 利润表

会计主体：永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）
本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	**附注号**	**本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月**	**上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31**

		31 日	日
一、营业总收入		531,007.19	2,370,612.42
1.利息收入		18,213.42	78,897.53
其中：存款利息收入	7.4.7.9	6,476.38	17,657.46
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,737.04	61,240.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		654,645.98	2,837,322.20
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-	0.00
基金投资收益	7.4.7.11	367,581.42	-3,116,250.21
债券投资收益	7.4.7.12	81,318.23	3,109,583.12
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	205,746.33	2,843,989.29
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-142,573.77	-545,607.31
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	721.56	-
减：二、营业总支出		261,807.90	2,427,149.85
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	136,223.19	1,331,449.59
2．托管费	7.4.10.2.2	30,494.89	297,132.78
3．销售服务费		34,374.54	575,034.47
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		1,942.82	55,493.46
其中：卖出回购金融资产支出		1,942.82	55,493.46
6．信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	7.4.7.21	58,772.46	168,039.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		269,199.29	-56,537.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		269,199.29	-56,537.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		269,199.29	-56,537.43

7.3 净资产变动表

会计主体：永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配	净资产合计

		利润	
一、上期期末净资产	113,851,140.45	368,051.46	114,219,191.91
二、本期期初净资产	113,851,140.45	368,051.46	114,219,191.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-102,771,922.11	-268,554.83	-103,040,476.94
（一）、综合收益总额	-	269,199.29	269,199.29
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-102,771,922.11	-537,754.12	-103,309,676.23
其中：1.基金申购款	90,289.33	505.28	90,794.61
2.基金赎回款	-102,862,211.44	-538,259.40	-103,400,470.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	11,079,218.34	99,496.63	11,178,714.97

项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	227,840,378.81	645,666.63	228,486,045.44
二、本期期初净资产	227,840,378.81	645,666.63	228,486,045.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-113,989,238.36	-277,615.17	-114,266,853.53
（一）、综合收益总额	-	-56,537.43	-56,537.43
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-113,989,238.36	-221,077.74	-114,210,316.10
其中：1.基金申购款	22,506.99	-71.60	22,435.39
2.基金赎回款	-114,011,745.35	-221,006.14	-114,232,751.49
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	113,851,140.45	368,051.46	114,219,191.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

芦特尔	汪成杰	虞俏依
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）（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[2021]2885 号《关于准予永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）注册的批复》的核准，由基金管理人永赢基金管理有限公司向社会

公开募集，基金合同于 2021 年 12 月 22 日生效，首次设立募集规模为 227,840,378.81 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含 ETF、LOF、QDII、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）和香港互认基金）、国内依法公开发行上市交易的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括但不限于国债、政府支持机构债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金，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相关规定）。本基金不投资于股指期货、国债期货及股票期权等衍生类金融工具。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券型证券投资基金（含债券指数基金）的比例不低于本基金资产的 80%；投资于股票（含存托凭证）、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为基金资产的 0-20%，本基金投资的属于权益类资产的混合型基金是满足如下条件之一的基金：①基金合同中载明的股票资产占基金资产的比例下限大于等于 60%的混合型基金，②最近四个季度定期报告披露的股票资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。本基金投资于货币市场基金的比例不得超过基金资产的 15%。本基金投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产 50%；本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×85%+银行活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编

报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公

允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），

按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体

情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关

税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)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相应类别的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；红利再投资所得份额的持有期，按原份额的持有期计算；

(3)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；本基金同一类别的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。

在不违反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，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂

免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用

基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.6.6 境外投资

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	533,732.49	43,405,231.45
等于：本金	533,675.40	43,402,809.04
加：应计利息	57.09	2,422.41
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	533,732.49	43,405,231.45

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	701,415.00	9,868.08	709,938.08	-1,345.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	701,415.00	9,868.08	709,938.08	-1,345.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		9,939,960.00	-	9,926,862.22	-13,097.78
其他		-	-	-	-
合计		10,641,375.00	9,868.08	10,636,800.30	-14,442.78
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,215,336.00	63,044.38	7,249,364.38	-29,016.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,215,336.00	63,044.38	7,249,364.38	-29,016.00
资产支持证券		-	-	-	-

基金	109,873,213.74	-	110,030,360.73	157,146.99
其他	-	-	-	-
合计	117,088,549.74	63,044.38	117,279,725.11	128,130.99

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-5,556.16	-
银行间市场	-	-
合计	-5,556.16	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	298.47	-
待摊费用	-	-
合计	298.47	-

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	314.86	25,280.12
其中：交易所市场	314.86	18,680.12
银行间市场	-	6,600.00
应付利息	-	-
预提费用	20,000.00	145,000.00
合计	20,314.86	170,280.12

7.4.7.7 实收基金

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,585,681.73	42,585,681.73
本期申购	81,323.37	81,323.37
本期赎回（以“-”号填列）	-31,761,744.40	-31,761,744.40
本期末	10,905,260.70	10,905,260.70

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,265,458.72	71,265,458.72
本期申购	8,965.96	8,965.96
本期赎回（以“-”号填列）	-71,100,467.04	-71,100,467.04
本期末	173,957.64	173,957.64

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A

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	224,082.59	23,651.10	247,733.69
本期期初	224,082.59	23,651.10	247,733.69
本期利润	276,220.31	-173,993.21	102,227.10
本期基金份额交易产生的变动数	-252,047.81	1,525.97	-250,521.84
其中：基金申购款	1,100.89	-603.77	497.12
基金赎回款	-253,148.70	2,129.74	-251,018.96
本期已分配利润	-	-	-

本期末	248,255.09	-148,816.14	99,438.95

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C

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	79,994.32	40,323.45	120,317.77
本期期初	79,994.32	40,323.45	120,317.77
本期利润	135,552.75	31,419.44	166,972.19
本期基金份额交易产生的变动数	-213,132.67	-74,099.61	-287,232.28
其中：基金申购款	40.26	-32.10	8.16
基金赎回款	-213,172.93	-74,067.51	-287,240.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,414.40	-2,356.72	57.68

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
活期存款利息收入	5,069.65	14,572.47
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,312.99	2,953.95
其他	93.74	131.04
合计	6,476.38	17,657.46

7.4.7.10 股票投资收益--买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	188,569,034.15	1,412,128,157.04
减：卖出/赎回基金成本总额	188,172,438.30	1,415,051,230.28
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-	-
减：交易费用	29,014.43	193,176.97
基金投资收益	367,581.42	-3,116,250.21

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
债券投资收益--利息收入	32,753.23	502,179.53
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	48,565.00	2,607,403.59
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	81,318.23	3,109,583.12

7.4.7.12.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	27,111,152.83	430,125,424.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,835,766.00	423,587,412.35
减：应计利息总额	226,121.83	3,922,558.44
减：交易费用	700.00	8,050.00
买卖债券差价收入	48,565.00	2,607,403.59

7.4.7.13 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	-	-
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	205,746.33	2,843,989.29

合计	205,746.33	2,843,989.29

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-142,573.77	-545,607.31
--股票投资	-	-
--债券投资	27,671.00	-48,196.00
--资产支持证券投资	-	-
--基金投资	-170,244.77	-497,411.31
--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	-142,573.77	-545,607.31

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他	721.56	-
合计	721.56	-

7.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	20,596.42	201,380.87
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	60,547.19	494,545.43
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	17,397.02	147,442.69

注：此处是根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费、托管费等进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

7.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00	45,000.00
信息披露费	-	100,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	6,372.46	10,639.55
账户维护费	31,500.00	12,000.00
其他	900.00	400.00
合计	58,772.46	168,039.55

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、基金注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
Oversea-Chinese Banking Corporation Limited（“Oversea-Chinese Banking”）	基金管理人的股东
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司
永赢国际资产管理有限公司（“永赢国际”）	基金管理人的子公司

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据中国证券监督管理委员会的相关批复，永赢基金管理有限公司已在香港特别行政区政府的公司注册处办理完成香港子公司——永赢国际资产管理有限公司的注册登记手续，并于 2022 年 11 月 14 日获得香港证券及期货事务监察委员会颁发的第四号（就证券提供意见）及第九号（提供资产管理）牌照。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

7.4.10.1.6 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	136,223.19	1,331,449.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	32,894.46	518,162.75
应支付基金管理人的净管理费	103,328.73	813,286.84

注：基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金所持有本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.60%年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金管理费年费率/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除基金所持有本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,494.89	297,132.78

注：基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金所持有本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.15%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×基金托管费年费率/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除基金所持有本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	合计
永赢基金	0.00	45.57	45.57
宁波银行	0.00	34,918.78	34,918.78
招商银行	0.00	2.41	2.41
合计	0.00	34,966.76	34,966.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	合计
永赢基金	0.00	50.29	50.29
宁波银行	0.00	574,401.41	574,401.41
招商银行	0.00	1.21	1.21
合计	0.00	574,452.91	574,452.91

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

H=E×C 类基金销售服务费年费率/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
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	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	90.2591%	8.7834%

永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间

	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
报告期初持有的基金份额	0.00	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	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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
招商银行	533,732.49	5,069.65	43,405,231.45	14,572.47

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

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有基金管理人永赢基金管理有限公司所管理的基金合计 2,353,849.04 元，占本基金资产净值的比例为 21.06%；上年度末，本基金未持有基金管理人永赢基金管理有限公司所管理的基金。

7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	11,429.72
当期持有基金产生的应支付销	721.56	-

售服务费（元）		
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,146.18	10,554.61
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	201.68	3,518.18

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

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

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末 2023 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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 2023 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证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体系。五道防线分别为员工自律及业务部门的自控和互控的第一道防线，合规风控部门监督管理的第二道防线，审计部事后检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险控制监督管理的第五道防线。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	709,938.08	7,249,364.38
合计	709,938.08	7,249,364.38

注：国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合

中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于固定收益品种，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 2023 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							
货币资金	533,732.49	-	-	-	-	-	533,732.49
结算备付金	22,511.11	-	-	-	-	-	22,511.11
存出保证金	240.44	-	-	-	-	-	240.44
交易性金融资产	-	-	709,938.08	-	-	9,926,862.22	10,636,800.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-	11,486.30	11,486.30
应收申购款	-	-	-	-	-	35.97	35.97
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	298.47	298.47
资产总计	556,484.04	-	709,938.08	-	-	9,938,682.96	11,205,105.08
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,608.65	4,608.65
应付托管费	-	-	-	-	-	1,408.13	1,408.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	58.47	58.47
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	20,314.86	20,314.86
负债总计	-	-	-	-	-	26,390.11	26,390.11
利率敏感度缺口	556,484.04	-	709,938.08	-	-	9,912,292.85	11,178,714.97
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	43,405,231.45	-	-	-	-	-	43,405,231.45
结算备付金	140,883.15	-	-	-	-	-	140,883.15
存出保证金	21,153.22	-	-	-	-	-	21,153.22
交易性金融资产	-	-	7,249,364.38	-	-	110,030,360.73	117,279,725.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-5,556.16	-	-	-	-	-	-5,556.16

应收清算款	-	-	-	-	-	52,248,170.27	52,248,170.27
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	169.93	169.93
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	43,561,711.66	-	7,249,364.38	-	-	162,278,700.93	213,089,776.97
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	98,520,082.54	98,520,082.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	110,085.58	110,085.58
应付托管费	-	-	-	-	-	23,366.46	23,366.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-	46,770.36	46,770.36
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	170,280.12	170,280.12
负债总计	-	-	-	-	-	98,870,585.06	98,870,585.06
利率敏感度缺口	43,561,711.66	-	7,249,364.38	-	-	63,408,115.87	114,219,191.91

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率曲线向上、向下平行移动 50 个基点 2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率平行上升 50 个基点	-1,115.67	-19,141.95
	市场利率平行下降 50 个基点	1,115.67	19,141.95

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	9,926,862.22	88.80	-	-
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	9,926,862.22	88.80	-	-

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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 1%	90,980.17	-
	业绩比较基准减少 1%	-90,980.17	-

注：上年度末，本基金未持有股票等交易性权益投资，因此无重大其他价格风险。本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	9,926,862.22	110,030,360.73
第二层次	709,938.08	7,249,364.38
第三层次	-	-
合计	10,636,800.30	117,279,725.11

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 03 月 25 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	9,926,862.22	88.59
3	固定收益投资	709,938.08	6.34
	其中：债券	709,938.08	6.34
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	556,243.60	4.96
8	其他各项资产	12,061.18	0.11
9	合计	11,205,105.08	100.00

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

本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内无买入股票。

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

本基金本报告期内无卖出股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票投资变动。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	709,938.08	6.35
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	709,938.08	6.35

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019703	23 国债 10	7,000	709,938.08	6.35

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金为债券型基金中基金，投资于债券型证券投资基金（含债券指数基金）的比例不低于本基金资产的 80%。理论上，本基金预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金(FOF)、混合型基金、混合型基金中基金（FOF），高于货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。本基金主要投资于开放式基金，符合本基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	009532	广发景明中短债 E	契约型开放式	1,980,640.18	2,043,822.60	18.28	否
2	015833	永赢宏泰短债 C	契约型开放式	1,740,348.56	1,750,964.69	15.66	是
3	040041	华安纯债债券 C	契约型开放式	1,179,242.74	1,268,747.26	11.35	否
4	007791	南方梦元短债债券 C	契约型开放式	1,092,382.43	1,202,931.53	10.76	否
5	007790	南方梦元短债债券 A	契约型开放式	719,519.08	802,191.82	7.18	否
6	013449	广发景宁纯债 C	契约型开放式	711,942.64	793,673.66	7.10	否
7	007199	永赢泰利债券 A	契约型开放式	565,557.55	602,884.35	5.39	是
8	006662	易方达安悦超短债债券 A	契约型开放式	512,753.15	522,803.11	4.68	否
9	510300	300ETF	交易型开放式	108,000.00	377,892.00	3.38	否
10	510050	50ETF	交易型开放式	94,400.00	222,312.00	1.99	否

11	510500	500ETF	交易型开放式	38,800.00	214,137.20	1.92	否
12	511260	十年国债	交易型开放式	1,000.00	124,502.00	1.11	否

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.13.3 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	240.44
2	应收清算款	-
3	应收股利	11,486.30
4	应收利息	-
5	应收申购款	35.97
6	其他应收款	298.47
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,061.18

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.13.6 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

份额级别	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
永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	76	143,490.27	10,000,000.00	91.6989%	905,260.70	8.3011%
永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	92	1,890.84	0.00	0.0000%	173,957.64	100.0000%
合计	168	65,947.73	10,000,000.00	90.2591%	1,079,218.34	9.7409%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	47,931.33	0.44%
	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	12,132.75	6.97%
	合计	60,064.08	0.54%

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	份额级别	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	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	0
	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	0~10
	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C	0
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	90.26%	10,000,000.00	90.26%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	10,000.00	0.09%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	47,788.79	0.43%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,057,788.79	90.78%	10,000,000.00	90.26%	不少于 3 年

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）A	永赢慧盈一年持有债券发起（FOF）C
基金合同生效日（2021 年 12 月 22 日）基金份额总额	82,427,990.92	145,412,387.89
本报告期期初基金份额总额	42,585,681.73	71,265,458.72
本报告期基金总申购份额	81,323.37	8,965.96
减：本报告期基金总赎回份额	31,761,744.40	71,100,467.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,905,260.70	173,957.64

§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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，本基金将公开募集基础设施证券投资基金纳入本基金的投资范围，新增了公开募集基础设施证券投资基金的投资策略，并修改了基金合同和托管协议，对招募说明书和基金产品资料概要进行了更新。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响。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。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内，本基金所持有的子基金未发生重大影响事件。

11.6 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 20,000.00 元。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	5,503.97	54.37%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	1,020.27	10.08%	-
民生证券	2	-	-	246.53	2.44%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	2,465.72	24.36%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	1	-	-	886.14	8.75%	-

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。

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	6,393,926.00	80.99%	44,970,000.00	80.97%	-	-	8,340,480.50	44.43%
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	1,650,000.00	2.97%	-	-	1,341,993.40	7.15%
民生证券	1,401,297.00	17.75%	300,000.00	0.54%	-	-	324,058.90	1.73%
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	5,950,000.00	10.71%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	3,242,980.90	17.27%
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	99,923.00	1.27%	2,670,000.00	4.81%	-	-	5,524,186.20	29.43%

11.9 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	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）暂停个人投资者大额申购（含定期定额投资）的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 01 月 10 日
2	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	2023 年 01 月 12 日
3	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 01 月 20 日
4	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）恢复办理个人投资者大额申购（含定期定额投资）业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 02 月 23 日
5	永赢基金管理有限公司关于新增平安银行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	2023 年 02 月 24 日
6	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 03 月 30 日
7	永赢基金管理有限公司关于广州分公司	中国证监会规定媒介	2023 年 03 月 31

	办公地址变更的公告		日
8	永赢基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 04 月 08 日
9	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 04 月 21 日
10	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）招募说明书更新(2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 05 月 31 日
11	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）（C 份额）基金产品资料概要更新(2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 05 月 31 日
12	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）（A 份额）基金产品资料概要更新(2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 05 月 31 日
13	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 07 月 10 日
14	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 07 月 20 日
15	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）更新招募说明书(2023 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 25 日
16	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）（A 份额）基金产品资料概要更新(2023 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 25 日
17	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）托管协议	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 25 日
18	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 25 日
19	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）（C 份额）基金产品资料概要更新(2023 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 25 日
20	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金中基金可投资于公开募集基础设施证券投资基金并修订基金合同及托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 25 日
21	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）2023 年中期报告	中国证监会规定媒介	2023 年 08 月 30 日
22	永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 10 月 25 日

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230217 - 20231231	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	90.26%
产品特有风险							
本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1.中国证监会准予永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）注册的文件；

2.《永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；

3.《永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；

4.《永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》及其更新（如有）；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照；

6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层

13.3 查阅方式

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

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

2024 年 03 月 27 日