

永赢量化混合型发起式证券投资基金
2016年半年度报告

2016年6月30日

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2016年8月25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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 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	45
7.7 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	45
7.8 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	45
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.10 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 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	47
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	47
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
10.2 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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49

10.4	基金投资策略的改变.....	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8	其他重大事件.....	50
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12	备查文件目录.....	51
12.1	备查文件目录.....	51
12.2	存放地点.....	52
12.3	查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	永赢量化混合型发起式证券投资基金
基金简称	永赢量化混合发起式
基金主代码	001565
交易代码	001565
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月6日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	159,336,499.09份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活应用多种绝对收益策略，对冲市场系统性风险，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用多因子选股策略为主，辅以事件驱动以及宏观择时等其他绝对收益策略，对冲系统性风险，力争实现稳定的绝对回报。</p> <p>1、多因子选股策略</p> <p>该策略以对中国股票市场较长期的回测研究为基础，运用量化多因子模型框架，结合定性指标和定量指标，综合考虑上市公司基本经营状况和市场对股票的反应两大因素，通过计算市场上所有股票的管理质量、价值、成长变化、市场情绪以及行业特殊因素等量化因子，将计算结果组合成alpha模型，同时结合风险模型构建股票现货组合。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>(1) 基本面因子</p>

管理质量：利用计算横截面多种比率来判断上市公司的报表质量以及管理能力，例如衡量报表质量的应收应付因子，衡量管理能力的周转率、偿债能力、ROA和ROE等因子；

成长变化：通过计算时间序列上各种比率的变化来衡量公司基本面的成长性；

价值：判断公司的股票价格相对于它的内在价值是否合理。由于内在价值无法直接计算，我们通过计算全市场所有公司的利润、销售量、总资产等多种指标来综合间接反映公司的内在价值。

(2) 市场因子

市场情绪：从技术面的动量、反转、枢轴突破等指标来衡量投资者情绪；

分析师预测：通过扫描市场上分析师观点的变化来预测市场反应。

2、事件驱动策略

该策略通过对某些公司事件和市场事件的研究，分析事件对股价造成波动的方向，以赚取超额收益。此外，该策略还利用市场上存在的金融产品定价非有效性，实现套利收益。

3、宏观择时策略

该策略通过计算和跟踪多种宏观经济变量和市场变量，运用计量经济学方法对未来大盘走势进行预测，为对冲窗口的调节提供参考。

4、市场中性投资策略

该策略主要运用股指期货合约与股票构建投资组合，规避市场系统性风险。在行业中性、市场中性的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算估值期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，以求取得与市场波动相关性较低的绝对收益。

5、其他投资策略

	<p>(1) 债券投资策略</p> <p>出于对流动性、有效利用基金财产的考虑，本基金适时对债券进行投资。通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势等因素，制定久期控制下的投资策略，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。</p> <p>(2) 金融衍生工具投资策略</p> <p>在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。</p>
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金属于特殊的混合型证券投资基金，预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金和一般的混合型基金。

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	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧
	联系电话	021-51690145
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com
客户服务电话	021-51690111	010-60836588
传真	021-51690177	010-84447094
注册地址	浙江省宁波市江东区中山路466号	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦27楼	北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦B座802室
邮政编码	200120	100125
法定代表人	罗维开	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	永赢基金管理有限公司登记注册中心	上海市世纪大道210号21世纪中心大厦27楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-292,006,009.58
本期利润	-229,147,614.83
加权平均基金份额本期利润	-0.1685
本期加权平均净值利润率	-18.66%
本期基金份额净值增长率	-14.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016年6月30日）
期末可供分配利润	-37,563,864.85
期末可供分配基金份额利润	-0.2358
期末基金资产净值	133,462,778.71
期末基金份额净值	0.838
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016年6月30日）
基金份额累计净值增长率	-16.20%

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。

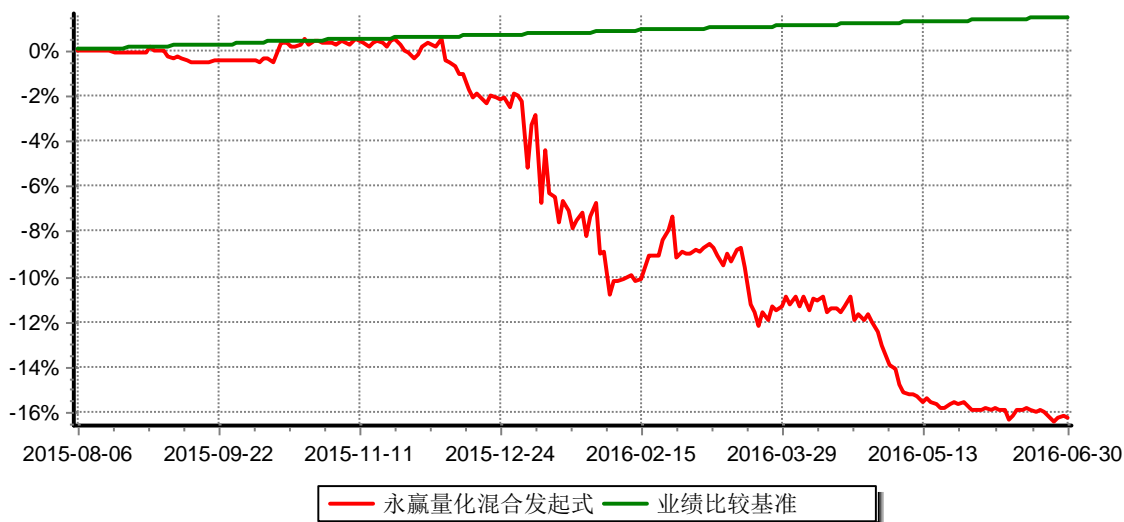
4、本基金合同生效日为2015年8月6日，截至本报告期末未满一年。

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
过去一个月	-0.36%	0.19%	0.12%	0.00%	-0.48%	0.19%
过去三个月	-5.63%	0.33%	0.37%	0.00%	-6.00%	0.33%
过去六个月	-14.23%	0.79%	0.75%	0.00%	-14.98%	0.79%
自基金合同生效日起至今（2015年08月06日-2016年06月30日）	-16.20%	0.61%	1.42%	0.00%	-17.62%	0.61%

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：1、本基金合同生效日为2015年8月6日，截至本报告期末未满一年。

2、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〕0008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）。2014年8月，本基金管理人完成增资扩股及员工持股计划，注册资本增加为人民币贰亿元，其中宁波银行股份有限公司持股67.5%，利安资金管理公司持股10%，员工股东持股22.5%。

截止2016年6月30日，本基金管理人共管理5只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢量化混合型发起式证券投资基金、永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金、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。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张大木	本基金基金经理、永赢基金管理有限公司总经理助理兼量化投资总监	2015年8月6日	—	15	硕士，15年金融行业投资研究经验，曾任美国沃顿商学院高级数据分析师；巴克莱全球投资公司（BGI）投资分析员；博时基金管理有限公司投资经理兼量化分析师。现任永赢基金管理有限公司总经理助理兼量化投资总监。

注：1. 任职日期与离任日期一般情况下指公司作出决定之日；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、《永赢量化混合型发起式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权限管理制度、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”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监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度分别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以及不同时间窗口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，未发现任何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 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

2016年初，A股市场经历了一波较为剧烈的下跌行情，市场跌幅巨大。在此背景下，采用量化对冲策略的产品体现出较好的市场风险控制能力。进入二季度，A股市场整体维持震荡走势，市场投资者情绪有所恢复，量化对冲策略表现较为稳定，体现出较好的alpha获取能力及市场风险控制能力。

自2015年下半年股灾后，中金所出台了一系列针对股指期货交易的限制措施，同时受市场情绪等一系列因素影响，股指期货长期保持贴水状态，这些都给量化对冲产品的

管理带来一定挑战。受限于严格的期现匹配政策监管，本基金可供对冲的现货组合选股池仅限于中证800指数成分股，无法充分体现量化模型的alpha获取能力，尽管现货组合区间收益明显超越基准指数，但依旧无法完全覆盖期货基差大幅度收敛损失，基金净值因此出现下跌。

未来，我们将继续密切关注监管机构的相关措施，同时时刻跟踪股指期货市场交易的流动性及基差水平，在严格控制本基金投资风险的前提下审慎决策，力争本基金的稳健运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，份额净值增长率为-14.23%，同期业绩比较基准收益率为0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年，中国经济将迎接经济结构转型、改变增长模式的挑战。美联储加息将吸引国际逐利资本从新兴市场回流美国，新兴市场受此影响面临动荡。结合宽松的货币政策与注册制带来的压力，2016年A股市场不确定性增加，较大概率将维持区间震荡。期间，严格控制投资风险，重点把握阶段性及结构性机会将是较好的选择。在此背景下，一方面通过量化模型选股分散现货组合个股风险，另一方面采用对冲基准指数规避市场系统性风险的量化对冲投资策略具有优势。尽管目前监管层对于股指期货对冲的限制尚未放开，股指期货长期贴水的交易状况也未发生改变，但随着跨期现“一码通”的上线，预期未来对冲策略交易环境将有所改善。未来，我们将继续密切关注监管机构的相关措施，同时时刻跟踪股指期货市场交易的流动性及基差水平，在严格控制本基金投资风险的前提下审慎决策，力争本基金的稳健运行。

4.6 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银行进行复核。本基金管理人估值委员会由分管运营副总经理负责，成员包括总经理、督察长、分管投资的副总经理、分管运营的副总经理、基金运营部负责人、监察稽核部负责人，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资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。

4.7 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，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 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，本基金未发生基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

§ 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，本基金托管人在对永赢量化混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的相关约定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的管理人永赢基金管理有限公司在本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金的管理人—永赢基金管理有限公司存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对永赢基金管理有限公司编制和披露的永赢量化混合型发起式证券投资基金2016年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢量化混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	109,334.98	255,697,662.50
结算备付金		16,633,744.56	168,762,988.85
存出保证金		10,216,238.59	270,973,626.99
交易性金融资产	6.4.7.2	42,460,433.78	1,619,183,573.07
其中：股票投资		42,460,433.78	1,619,183,573.07
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	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		68,532,963.56	13,578,589.98
应收利息	6.4.7.5	21,372.39	98,389.24
应收股利		—	—
应收申购款		25,093.19	19,457.51
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	78,755.42	—
资产总计		138,077,936.47	2,328,314,288.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		1,716,118.91	—
应付赎回款		987,502.17	45,988,529.88
应付管理人报酬		255,218.76	2,460,461.37

应付托管费		53,170.57	512,596.13
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	1,399,157.65	5,207,070.65
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	203,989.70	300,878.54
负债合计		4,615,157.76	54,469,536.57
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	159,336,499.09	2,328,251,955.59
未分配利润	6.4.7.10	-25,873,720.38	-54,407,204.02
所有者权益合计		133,462,778.71	2,273,844,751.57
负债和所有者权益总计		138,077,936.47	2,328,314,288.14

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值0.838元，基金份额总额159,336,499.09份。

6.2 利润表

会计主体：永赢量化混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入		-204,749,471.60
1. 利息收入		1,468,829.22
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,131,032.96
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		337,796.26

其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-271,660,316.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-320,244,131.33
基金投资收益		—
债券投资收益		—
资产支持证券投资收益	6.4.7.12.3	—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.13	46,946,406.03
股利收益	6.4.7.15	1,637,408.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	62,858,394.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,583,621.10
减：二、费用		24,398,143.23
1. 管理人报酬		7,467,169.97
2. 托管费		1,555,660.41
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	15,150,999.94
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6.4.7.19	224,312.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-229,147,614.83
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-229,147,614.83

注：本基金基金合同生效日为2015年8月6日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢量化混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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)	2,328,251,955.59	-54,407,204.02	2,273,844,751.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-229,147,614.83	-229,147,614.83
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)	-2,168,915,456.50	257,681,098.47	-1,911,234,358.03
其中：1. 基金申购款	1,716,149.03	-155,573.92	1,560,575.11
2. 基金赎回款	-2,170,631,605.53	257,836,672.39	-1,912,794,933.14
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)	159,336,499.09	-25,873,720.38	133,462,778.71

注：本基金基金合同生效日为2015年8月6日，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

宋宜农

田中甲

蒲昕玮

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

永赢量化混合型发起式证券投资基金(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【2015】1273号《关于准予永赢量化混合型

发起式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自2015年7月27日至2015年8月3日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2015）验字第61090672_B10号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年8月6日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币2,997,476,514.14元，募集资金在募集期间产生的存款利息为人民币361,313.35元，以上实收基金（本息）合计为人民币2,997,837,827.49元，折合2,997,837,827.49份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

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上市的股票）、债券（国债、金融债、企业（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（中小企业私募债除外））、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，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。

基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%-120%之间。本基金每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。本基金每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。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。

本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人永赢基金管理有限公司于2016年8月25日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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（以下合称“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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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<年度报告和半年度报告>》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。

6.4.3 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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 营业税、增值税

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，继续免征营业税；

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，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

6.4.6.2 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[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。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	109,334.98
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—

合计	109,334.98
----	------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,966,486.19	42,460,433.78	-506,052.41
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	42,966,486.19	42,460,433.78	-506,052.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	
货币衍生工具	—	—	—	
权益衍生工具	—	—	—	
其他衍生工具	-35,455,667.37	—	—	
合计	-35,455,667.37	—	—	

注：其他衍生工具具体如下：

项目	本期末 2016年6月30日
----	----------------

	持仓量（买/卖）	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
股指期货合约	-39.00	-35,455,667.37	-36,403,500.00	-947,832.63
总额合计				-947,832.63
减：可抵销期货暂收款				-947,832.63
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	11,158.18
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	8,892.79
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.42
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	1,321.00
合计	21,372.39

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	—
待摊费用	78,755.42
合计	78,755.42

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,398,797.65
银行间市场应付交易费用	360.00
合计	1,399,157.65

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3,702.74
预提费用	200,286.96
合计	203,989.70

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,328,251,955.59	2,328,251,955.59
本期申购	1,716,149.03	1,716,149.03
本期赎回（以“-”号填列）	-2,170,631,605.53	-2,170,631,605.53

本期末	159,336,499.09	159,336,499.09
-----	----------------	----------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	2,939,823.46	-57,347,027.48	-54,407,204.02
本期利润	-292,006,009.58	62,858,394.75	-229,147,614.83
本期基金份额交易产生的变动数	251,502,321.27	6,178,777.20	257,681,098.47
其中：基金申购款	-109,684.21	-45,889.71	-155,573.92
基金赎回款	251,612,005.48	6,224,666.91	257,836,672.39
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-37,563,864.85	11,690,144.47	-25,873,720.38

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	436,226.27
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	155,322.13
其他	539,484.56
合计	1,131,032.96

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-320,244,131.33
股票投资收益——赎回差价	—

收入	
合计	-320,244,131.33

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	8,441,926,184.75
减：卖出股票成本总额	8,762,170,316.08
买卖股票差价收入	-320,244,131.33

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本期未投资资产支持证券。

6.4.7.13 衍生工具投资

本基金本报告期无权证交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年6月30日
买卖股指期货差价收入	46,946,406.03

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,637,408.63
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,637,408.63

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	17,137,100.78
——股票投资	17,137,100.78
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	45,721,293.97
——权证投资	—
——股指期货	45,721,293.97
3. 其他	—
合计	62,858,394.75

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	2,570,451.41
转换费收入	13,169.69
合计	2,583,621.10

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	14,862,037.39
银行间市场交易费用	—
中金所交易费用	288,962.55
合计	15,150,999.94

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	166,420.26
汇划手续费	4,611.09
帐户维护费	13,500.00
合计	224,312.91

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，公司存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	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
员工股东	基金管理人的股东
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金托管人的子公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	8,054,792,796.88	51.61%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	5,062,166.32	58.37%	2,596,857.45	51.57%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.1.4 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	259,800,000.00	12.94%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,467,169.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,964,444.23

注：应支付基金管理人永赢基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 ×1.2% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,555,660.41

注：应支付基金托管人中信证券的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 ×0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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
	2016年1月1日至2016年6月30日
期初持有的基金份额	10,001,250.00
期间申购/买入总份额	—
期间因拆分变动份额	—
减：期间赎回/卖出总份额	—
期末持有的基金份额	10,001,250.00
期末持有的基金份额	6.28%

占基金总份额比例	
----------	--

6.4.10.4.2 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

本报告期末，本基金无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信证券活期存款	109,334.98	436,226.27

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末存放于中信期货的结算备付金金额为人民币11,434,371.20元。当期发生的基金应支付给中信期货的交易费用为人民币288,962.55元，本报告期末无应付中信期货的交易费用余额。

。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌原因	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末

代码	名称	日期		估值单价	日期	开盘单价		成本总额	估值总额
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项	4.90		—	324,400	1,684,305.86	1,589,560.00
600511	国药股份	2016-02-18	重大事项	27.42	2016-08-04	30.16	53	1,860.17	1,453.26
600640	号百控股	2016-04-18	重大事项	16.79		—	13,000	202,591.53	218,270.00
600751	天海投资	2016-02-15	重大事项	6.11	2016-07-26	6.72	50	328.36	305.50
000524	岭南控股	2016-04-05	重大事项	13.08		—	23,500	300,229.79	307,380.00
000619	海螺型材	2016-05-16	重大事项	11.35	2016-07-13	11.35	76	820.61	862.60
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项	19.22		—	72,000	1,365,823.92	1,383,840.00

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型基金，通过灵活应用多种绝对收益策略，对冲市场系统性风险，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险控制委员会以及在董事会层面建立的审计及风险管理委员会负责对与所投资金融工具相关的

风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人监察稽核部负责具体落实和日常跟踪的工作机制。本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。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

6.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在中国工商银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。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并对证券交割方式进行限制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。

于2016年6月30日，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

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，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模式带来的流动性风险，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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券

不得超过该证券的10%。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。

于2016年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月 30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	109,334 .98	—	—	—	—	—	109,334 .98
结算备付金	16,633, 744.56	—	—	—	—	—	16,633, 744.56
存出保证金	10,216, 238.59	—	—	—	—	—	10,216, 238.59
交易性金融 资产	—	—	—	—	—	42,460, 433.78	42,460, 433.78

应收证券清算款	—	—	—	—	—	68,532,963.56	68,532,963.56
应收利息	—	—	—	—	—	21,372.39	21,372.39
应收申购款	—	—	—	—	—	25,093.19	25,093.19
其他资产	—	—	—	—	—	78,755.42	78,755.42
资产总计	26,959,318.13	—	—	—	—	111,118,618.34	138,077,936.47
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	1,716,118.91	1,716,118.91
应付赎回款	—	—	—	—	—	987,502.17	987,502.17
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	255,218.76	255,218.76
应付托管费	—	—	—	—	—	53,170.57	53,170.57
应付交易费用	—	—	—	—	—	1,399,157.65	1,399,157.65
其他负债	—	—	—	—	—	203,989.70	203,989.70
负债总计	—	—	—	—	—	4,615,157.76	4,615,157.76
利率敏感度缺口	26,959,318.13	—	—	—	—	106,503,460.58	133,462,778.71
上年度末 2015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	255,697	—	—	—	—	—	255,697

	, 662. 50						, 662. 50
结算备付金	168, 762 , 988. 85	—	—	—	—	—	168, 762 , 988. 85
存出保证金	270, 973 , 626. 99	—	—	—	—	—	270, 973 , 626. 99
交易性金融资产	—	—	—	—	—	1, 619, 1 83, 573. 07	1, 619, 1 83, 573. 07
应收证券清算款	—	—	—	—	—	13, 578, 589. 98	13, 578, 589. 98
应收利息	—	—	—	—	—	98, 389. 24	98, 389. 24
应收申购款	—	—	—	—	—	19, 457. 51	19, 457. 51
资产总计	695, 434 , 278. 34	—	—	—	—	1, 632, 8 80, 009. 80	2, 328, 3 14, 288. 14
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	45, 988, 529. 88	45, 988, 529. 88
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2, 460, 4 61. 37	2, 460, 4 61. 37
应付托管费	—	—	—	—	—	512, 596 . 13	512, 596 . 13
应付交易费用	—	—	—	—	—	5, 207, 0 70. 65	5, 207, 0 70. 65
其他负债	—	—	—	—	—	300, 878 . 54	300, 878 . 54
负债总计	—	—	—	—	—	54, 469, 536. 57	54, 469, 536. 57
利率敏感度缺口	695, 434 , 278. 34	—	—	—	—	1, 578, 4 10, 473. 23	2, 273, 8 44, 751. 57

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2016年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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上市的股票）、债券（国债、金融债、企业（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（中小企业私募债除外））、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，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。

基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。

本基金每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	42,460,433.78	31.81	1,619,183,573.07	71.21
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	42,460,433.78	31.81	1,619,183,573.07	71.21

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 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。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2016年6月30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42,460,433.78元，无属于第二层次和第三层次的余额。

6.4.14.1.2.2 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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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，确定相关股票和债券

公允价值应属第二层次或第三层次。本基金本期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的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.1.2.3 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未发生变动。

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2016年8月23日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	42,460,433.78	30.75
	其中：股票	42,460,433.78	30.75
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—

4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	16,743,079.54	12.13
7	其他各项资产	78,874,423.15	57.12
8	合计	138,077,936.47	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,373,708.00	1.03
C	制造业	27,270,540.36	20.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,827,550.00	1.37
E	建筑业	86,715.00	0.06
F	批发和零售业	1,370,357.26	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,510,069.50	1.13
H	住宿和餐饮业	307,380.00	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,689,025.00	2.76
J	金融业	3,263,118.00	2.44
K	房地产业	1,149,435.00	0.86
L	租赁和商务服务业	342,095.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	88,320.00	0.07
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	182,120.66	0.14
S	综合	—	—

	合计	42,460,433.78	31.81
--	----	---------------	-------

7.3 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	600019	宝钢股份	324,400	1,589,560.00	1.19
2	000778	新兴铸管	299,900	1,391,536.00	1.04
3	600688	上海石化	227,300	1,386,530.00	1.04
4	000651	格力电器	72,000	1,383,840.00	1.04
5	600100	同方股份	91,900	1,374,824.00	1.03
6	600583	海油工程	198,800	1,373,708.00	1.03
7	600582	天地科技	303,400	1,365,300.00	1.02
8	601179	中国西电	235,000	1,191,450.00	0.89
9	600816	安信信托	68,200	1,150,534.00	0.86
10	000540	中天城投	184,500	1,149,435.00	0.86
11	600741	华域汽车	77,400	1,084,374.00	0.81
12	601998	中信银行	190,500	1,080,135.00	0.81
13	000625	长安汽车	78,600	1,074,462.00	0.81
14	000623	吉林敖东	42,900	1,070,355.00	0.80
15	601872	招商轮船	227,100	1,062,828.00	0.80
16	600050	中国联通	271,300	1,033,653.00	0.77
17	600022	山东钢铁	391,600	928,092.00	0.70
18	600578	京能电力	214,800	919,344.00	0.69
19	600252	中恒集团	209,000	907,060.00	0.68
20	600352	浙江龙盛	101,500	874,930.00	0.66
21	600827	百联股份	64,300	776,744.00	0.58
22	603000	人民网	45,200	750,772.00	0.56
23	600485	信威集团	41,500	740,360.00	0.55
24	600089	特变电工	84,600	720,792.00	0.54
25	000338	潍柴动力	91,296	713,021.76	0.53

26	000709	河钢股份	249,500	691,115.00	0.52
27	601633	长城汽车	81,800	690,392.00	0.52
28	600875	东方电气	69,300	680,526.00	0.51
29	002294	信立泰	24,600	669,120.00	0.50
30	601718	际华集团	86,100	657,804.00	0.49
31	600804	鹏博士	33,200	605,236.00	0.45
32	601211	国泰君安	33,400	594,186.00	0.45
33	600027	华电国际	116,500	576,675.00	0.43
34	600104	上汽集团	27,800	564,062.00	0.42
35	601600	中国铝业	144,000	542,880.00	0.41
36	600271	航天信息	22,400	533,120.00	0.40
37	300315	掌趣科技	49,300	517,157.00	0.39
38	601766	中国中车	52,300	479,591.00	0.36
39	002195	二三四五	36,800	452,272.00	0.34
40	601006	大秦铁路	69,400	446,936.00	0.33
41	000100	TCL 集团	131,800	433,622.00	0.32
42	600153	建发股份	32,500	390,000.00	0.29
43	601727	上海电气	49,000	370,440.00	0.28
44	600369	西南证券	45,200	328,152.00	0.25
45	600873	梅花生物	52,400	325,404.00	0.24
46	002202	金风科技	20,900	316,217.00	0.24
47	000524	岭南控股	23,500	307,380.00	0.23
48	300146	汤臣倍健	22,600	306,004.00	0.23
49	600362	江西铜业	22,000	296,560.00	0.22
50	600690	青岛海尔	32,400	287,712.00	0.22
51	000895	双汇发展	11,500	240,120.00	0.18
52	600640	号百控股	13,000	218,270.00	0.16
53	600600	青岛啤酒	7,500	218,025.00	0.16
54	601607	上海医药	11,200	202,160.00	0.15
55	000039	中集集团	14,200	201,214.00	0.15
56	601928	凤凰传媒	17,279	182,120.66	0.14

57	000725	京东方 A	76,800	177,408.00	0.13
58	600098	广州发展	22,400	175,168.00	0.13
59	600585	海螺水泥	11,900	173,026.00	0.13
60	002236	大华股份	13,100	171,610.00	0.13
61	002152	广电运通	10,400	170,976.00	0.13
62	002153	石基信息	6,000	158,280.00	0.12
63	002027	分众传媒	7,500	123,825.00	0.09
64	000750	国海证券	14,900	110,111.00	0.08
65	600660	福耀玻璃	7,600	106,400.00	0.08
66	000876	新 希 望	11,200	93,184.00	0.07
67	000069	华侨城 A	13,800	88,320.00	0.07
68	601618	中国中冶	23,500	86,715.00	0.06
69	300085	银之杰	2,900	86,710.00	0.06
70	600637	东方明珠	3,500	84,945.00	0.06
71	600863	内蒙华电	27,000	81,540.00	0.06
72	000729	燕京啤酒	10,100	76,659.00	0.06
73	600023	浙能电力	14,700	74,823.00	0.06
74	600511	国药股份	53	1,453.26	—
75	000619	海螺型材	76	862.60	—
76	600751	天海投资	50	305.50	—

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601818	光大银行	118,628,625.14	5.22
2	601009	南京银行	112,154,962.21	4.93
3	601998	中信银行	104,490,013.80	4.60
4	601988	中国银行	94,163,295.00	4.14
5	600823	世茂股份	89,754,077.97	3.95

6	601166	兴业银行	88,598,711.99	3.90
7	600566	济川药业	76,619,474.59	3.37
8	000830	鲁西化工	57,381,841.42	2.52
9	000623	吉林敖东	56,877,232.80	2.50
10	600657	信达地产	54,037,432.13	2.38
11	600067	冠城大通	52,889,521.44	2.33
12	000919	金陵药业	51,450,682.76	2.26
13	300002	神州泰岳	48,380,435.34	2.13
14	600062	华润双鹤	48,350,689.50	2.13
15	600761	安徽合力	48,173,062.72	2.12
16	000338	潍柴动力	47,526,101.95	2.09
17	600426	华鲁恒升	46,672,738.43	2.05
18	002736	国信证券	46,252,885.88	2.03
19	600837	海通证券	45,270,937.25	1.99
20	000686	东北证券	44,877,837.28	1.97

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。

7.4.2 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	601009	南京银行	128,008,271.45	5.63
2	601166	兴业银行	125,710,742.65	5.53
3	601818	光大银行	116,487,818.20	5.12
4	601988	中国银行	111,624,264.56	4.91
5	600566	济川药业	111,067,648.56	4.88
6	601998	中信银行	102,454,073.57	4.51
7	000001	平安银行	98,910,777.02	4.35
8	600823	世茂股份	93,340,101.08	4.10
9	002736	国信证券	85,815,864.05	3.77
10	000919	金陵药业	73,448,343.73	3.23

11	000728	国元证券	68,258,169.50	3.00
12	000830	鲁西化工	66,269,868.20	2.91
13	600894	广日股份	63,167,084.56	2.78
14	000686	东北证券	61,763,068.02	2.72
15	600761	安徽合力	61,243,506.64	2.69
16	000338	潍柴动力	61,188,977.80	2.69
17	601126	四方股份	59,442,554.88	2.61
18	000719	大地传媒	55,704,207.79	2.45
19	600531	豫光金铅	54,251,493.49	2.39
20	600067	冠城大通	54,105,025.43	2.38
21	000623	吉林敖东	53,178,103.84	2.34
22	600657	信达地产	51,229,764.74	2.25
23	600426	华鲁恒升	50,254,691.00	2.21
24	600062	华润双鹤	49,848,867.58	2.19
25	002440	闰土股份	49,836,793.15	2.19
26	000848	承德露露	47,653,548.53	2.10
27	300002	神州泰岳	47,368,133.75	2.08
28	000921	海信科龙	47,271,478.27	2.08
29	000543	皖能电力	46,947,062.74	2.06
30	600790	轻纺城	46,717,183.93	2.05

注：卖出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。

7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	7,168,310,076.01
卖出股票的收入（成交）总额	8,441,926,184.75

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末，本基金未持有债券。

7.6 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

本报告期末，本基金未持有债券。

7.7 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

本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.8 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

本报告期末，本基金未持有贵金属。

7.9 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

本报告期末，本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1607	沪深300股指期货1607合约	-37	-34,558,740.00	-949,692.63	
IF1608	沪深300股指期货1608合约	-2	-1,844,760.00	1,860.00	
公允价值变动总额合计（元）					-947,832.63
股指期货投资本期收益（元）					46,946,406.03
股指期货投资本期公允价值变动（元）					45,721,293.97

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用市场中性策略，利用股指期货对冲市场系统性风险，对冲敞口控制在合同范围内。针对股灾后股指期货市场流动性明显下降，期货、现货之间长期保持贴水状态，本基金管理人密切关注市场动态，时刻跟踪流动性及基差水平，在严格控制本基金投资风险前提下对期货对冲合约进行合理选择。本基金投资于股指期货，剥离系统性风险，大幅降低净值波动率，符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报

告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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。

7.11.3 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	10,216,238.59
2	应收证券清算款	68,532,963.56
3	应收股利	—
4	应收利息	21,372.39
5	应收申购款	25,093.19
6	其他应收款	—
7	待摊费用	78,755.42
8	其他	—
9	合计	78,874,423.15

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末，本基金未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600019	宝钢股份	1,589,560.00	1.19	重大资产重组
2	000651	格力电器	1,383,840.00	1.04	重大资产重组

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
3,434	46,399.68	13,485,370.66	8.46%	145,851,128.43	91.54%

8.2 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	107.67	0.00%

8.3 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 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	10,001,250.00	6.28%	10,001,250.00	6.28%	自合同生效 之日起不少 于三年
基金管理人高级管 理人员					
基金经理等人员	—	—	—	—	

基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,001,250.00	6.28%	10,001,250.00	6.28%	

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年8月6日)基金份额总额	2,997,837,827.49
本报告期期初基金份额总额	2,328,251,955.59
本报告期基金总申购份额	1,716,149.03
减：本报告期基金总赎回份额	2,170,631,605.53
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	159,336,499.09

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

经永赢基金管理有限公司第一届董事会2015年书面决议审议通过，聘任赵鹏先生担任永赢基金副总经理职务。本基金管理人已于2016年1月15日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报以及公司网站登载了《永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。上述变更事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会和上海证监局报备。

经永赢基金管理有限公司第一届董事会2015年书面决议审议通过，聘任毛慧女士担任永赢基金督察长职务。本基金管理人已于2016年1月15日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报以及公司网站登载了《永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。上述变更事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会、上海证监局及中国基金业协会报备。

经永赢基金管理有限公司第一届董事会2016年书面决议审议通过，赵鹏先生不再担任永赢基金副总经理职务。本基金管理人已于2016年7月2日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报以及公司网站登载了《永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公

告》。上述变更事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会和上海证监局报备。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 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的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	840,600,043.74	5.39%	261,681.95	5.2%	—
信达证券	2	3,087,895,833.51	19.78%	1,005,567.12	19.97%	—
英大证券	2	3,624,221,589.03	23.22%	1,171,401.23	23.26%	—
中信证券	2	8,054,792,796.88	51.61%	2,596,857.45	51.57%	—

招商证券	2	—	—	—	—	—
渤海证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	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。

10.7.2 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	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
华泰证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	1,748,700,000	87.06%	—	—
英大证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	259,800,000	12.94%	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
渤海证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—

10.8 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	永赢基金关于旗下开放式基金开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016-01-16
2	永赢量化混合型发起式证券投资基金2015年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016-01-22
3	永赢量化混合型发起式证券投资基金更新招募说明书(2016年第1	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公	2016-03-21

	号)	司网站	
4	永赢量化混合型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要(2016年第1号)	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016-03-21
5	永赢量化混合型发起式证券投资基金2015年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016-03-26
6	永赢量化混合型发起式证券投资基金2015年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016-03-26
7	永赢量化混合型发起式证券投资基金2016年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016-04-21
8	永赢基金关于新增天风证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016-04-26
9	永赢基金关于新增杭州数米基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016-04-28
10	永赢基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016-05-05
11	永赢基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016-06-01

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准永赢量化混合型发起式基金募集的文件；
2. 《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢量化混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新；
4. 《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金托管协议》；
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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 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，也可按工本费购买复印件。

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：021-51690111。

永赢基金管理有限公司

二〇一六年八月二十五日