

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要(2016年第2号)

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

二〇一六年十月

重要提示

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）于2015年7月17日获中国证券监督管理委员会证监许可〔2015〕1700号文准予注册募集。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。本招募说明书是对原《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2016年第1号）》的更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集申请的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

本基金为混合型证券投资基金，通过灵活应用多种量化策略，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，因此除面临普通混合型基金风险外还包括本基金所特有的风险。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险；另外，本基金的投资工具股指期货还可能引发的杠杆风险、对手方风险、盯市结算风险等。此外，在本基金开放申购、赎回业务前，基金份额持有人还面临不能赎回基金份额的风险。

本基金为发起式基金，在基金募集时，基金管理人运用其固有资金认购本基金份额的金额不低于1000万元，认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不低于3年。但基金管理人的股东对本基金的发起认购，并不代表对本基金的风险或收益的任何判断、预测、推荐和保证，发起资金也并不用于对投资人投资亏损的补偿，投资人及发起资金认购人均自行承担投资风险。基金管理人的股东认购的本基金份额持有期限自基金合同生效日起满3年后，基金管理人的股东将根据自身情况决定是否继续持有，届时基金管理人的股东有可能赎回认购的本基金份额。另外，在基金合同生效满3年后的对应日，如果本基金的资产规模低于2亿元，本基金将按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。因此，投资人将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，理性判断市场，谨慎做出投资决策，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构购买基金。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年9月1日，投资组合报告为2016年2季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日。

第一部分 基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：永赢基金管理有限公司

住所：浙江省宁波市江东区中山东路 466 号

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

设立日期：2013 年 11 月 7 日

法定代表人：罗维开

联系电话：(021)5169 0188

传真：(021)5169 0177

联系人：周良子

永赢基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2013]1280 号文件批准，于 2013 年 11 月 7 日成立的合资基金管理公司，初始注册资本为人民币 1.5 亿元，经工商变更登记，公司于 2014 年 8 月 21 日公告注册资本增加至人民币 2 亿元。

目前，公司的股权结构为：

宁波银行股份有限公司出资人民币 135,000,000 元，占公司注册资本的 67.5%；

利安资金管理公司（Lion Global Investors Limited）出资人民币 20,000,000 元，占公司注册资本的 10%；

宋宜农出资人民币 9,990,000 元，占公司注册资本的 4.995%；

赵楠出资人民币 6,010,000 元，占公司注册资本的 3.005%；

田中甲出资人民币 5,550,000 元，占公司注册资本的 2.775%；

赵鹏出资人民币 5,500,000 元，占公司注册资本的 2.750%；

毛慧出资人民币 3,000,000 元，占公司注册资本的 1.500%；

李峻出资人民币 3,300,000 元，占公司注册资本的 1.650%；

徐蔓青出资人民币 3,750,000 元，占公司注册资本的 1.875%；

祁洁萍出资人民币 1,000,000 元，占公司注册资本的 0.500%；

钟菊秀出资人民币 700,000 元，占公司注册资本的 0.350%；

陈遥出资人民币 600,000 元，占公司注册资本的 0.300%；

周良子出资人民币 450,000 元，占公司注册资本的 0.225%；

宋聿飞出资人民币 700,000 元，占公司注册资本的 0.350%；

姜灵灵出资人民币 300,000 元，占公司注册资本的 0.150%；

张文博出资人民币 500,000 元，占公司注册资本的 0.250%；

陈晟出资人民币 700,000 元，占公司注册资本的 0.350%；

张哲出资人民币 100,000 元，占公司注册资本的 0.050%；

狄泽出资人民币 450,000 元，占公司注册资本的 0.225%；

洪幼叶出资人民币 300,000 元，占公司注册资本的 0.150%；

徐一出资人民币 300,000 元，占公司注册资本的 0.150%；

孟祥宝出资人民币 300,000 元，占公司注册资本的 0.150%；

周华睿出资人民币 300,000 元，占公司注册资本的 0.150%；

陈佶出资人民币 200,000 元，占公司注册资本的 0.100%；

刘硕出资人民币 200,000 元，占公司注册资本的 0.100%；

余帅出资人民币 200,000 元，占公司注册资本的 0.100%；

沈望琦出资人民币 100,000 元，占公司注册资本的 0.050%；

蔡霖出资人民币 200,000 元，占公司注册资本的 0.100%；

安福廷出资人民币 100,000 元，占公司注册资本的 0.050%；

华靓出资人民币 200,000 元，占公司注册资本的 0.100%。

基金管理人无任何受处罚记录。

（二）主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员

罗维开先生，董事长，硕士，经济师。24 年金融业从业经验，曾任宁波银行股份有限公司天源支行业务科科长、天源支

行副行长、财务会计部总经理、行长助理、副行长；现任宁波银行副行长。

陈友良先生，董事，硕士，马来西亚籍。曾任职新加坡华侨银行集团风险部风险分析师；巴克莱资本操作风险管理部经理；新加坡华侨银行集团风险部业务经理；新加坡华侨银行集团主席办公室主席特别助理；新加坡华侨银行集团资金部副总裁；新加坡华侨银行集团风险部资产负债管理总经理。现任华侨银行（中国）有限公司风险管理部首席风险官。

宋宜农先生，董事，硕士。22年金融业从业经验，曾任长盛基金管理有限公司市场发展部总监；光大保德信基金管理有限公司首席市场营销官；景顺长城基金管理有限公司副总经理兼市场总监；方正富邦基金管理有限公司总经理。现任永赢基金管理有限公司总经理，兼永赢资产管理有限公司董事、总经理。

赵楠先生，董事，硕士。18年证券基金研究投资经验，曾任中信基金管理有限公司研究总监、投委会委员；中信建投证券自营部执行总经理；方正富邦基金管理有限公司投资总监。现任永赢基金管理有限公司副总经理，兼永赢资产管理有限公司副总经理。

沈雁先生，独立董事，博士。曾任天津大学讲师，Centre Financial Products 高级衍生产品量化分析员，雷曼兄弟（Lehman Brothers）助理副总裁，Sakura Global Capital 副总裁、董事、自营交易及新产品开发部亚洲区主管，高盛（Goldman Sachs）执行董事、衍生产品分析部全球掉期主管、市场风险管理亚洲区总监，UBS（香港）董事，德意志银行（Deutsche Bank）中国区结构性产品业务总监，Shenvy International Holdings Limited 总裁。现任深圳前海汇润基金管理有限公司总裁、投资总监。

陈忠阳先生，独立董事，博士，教授。曾任中国人民大学计划经济系团总支书记，现任教于中国人民大学财政金融学院。

商海粟先生，独立董事，学士。曾在光大国信旅游公司、北京金融街物业管理公司任职。现任北京市世联新纪元律师事务所律师合伙人律师，主要从事公司、不动产相关法律事务。

2. 监事会成员

陈辰先生，监事，硕士。曾任职于中国工商银行上海市分行机构业务部；金盛人寿保险有限公司投资部主任；招商银行资产托管部经理；深圳发展银行资产托管部总经理助理。现任宁波银行资产托管部总经理。

徐蔓青先生，监事，硕士。16年金融行业从业经验，曾任景顺长城基金管理有限公司 IT 经理；方正富邦基金管理有限公司信息技术总监。现任永赢基金管理有限公司信息技术总监，兼永赢资产管理有限公司副总经理。

李峻先生，监事，硕士。22年金融行业从业经验，曾任职中保信期货公司、中信证券股份有限公司；中关村证券股份有限公司投资经理；中信基金管理有限公司交易总监；华夏基金管理有限公司数量研究员；方正富邦基金管理有限公司交易总监。现任永赢基金管理有限公司交易总监。

3. 管理层成员

宋宜农先生，总经理，相关介绍见董事会成员部分内容。

赵楠先生，副总经理，相关介绍见董事会成员部分内容。

田中甲先生，副总经理，硕士。14年金融行业从业经验，曾任中信证券股份有限公司财务会计；中信基金管理有限公司基金会计；天弘基金管理有限公司基金运营部总经理兼公司财务部总经理；方正富邦基金管理有限公司职工监事、基金运营部总监。现任永赢基金管理有限公司副总经理，兼永赢资产管理有限公司董事、副总经理。

毛慧女士，督察长，学士。10年相关行业从业经验，曾任职锦天城律师事务所；源泰律师事务所律师；申万菱信基金管理有限公司高级监察经理；永赢基金管理有限公司监察稽核总监。

4. 本基金基金经理

张大木先生。美国 Villanova 大学计算机研究生。13年证券从业经验。曾任美国沃顿商学院高级数据分析师，美国巴克莱国际资产管理公司（BGI）投资分析师，博时基金管理有限公司量化分析师，投资经理，现任永赢基金管理有限公司总经理助理兼量化投资总监。

5. 投资决策委员会成员

投资决策委员会由下述执行委员组成：公司总经理宋宜农先生、分管投资的副总经理赵楠先生、量化投资总监张大木先生、固定收益投资总监祁洁萍女士等。

督察长、监察稽核总监、交易总监、研究人员可列席，不具有投票权。

分管投资的副总经理为主任委员，负责召集、协调并主持会议。

议案通过需经 2/3 以上委员同意，主任委员有一票否决权。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

（一）基金托管人简况

名称：华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

联系人：陈雁

联系电话：025-83387218

成立时间：1991 年 4 月 9 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行银复[1990]497 号文

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：人民币柒拾壹亿陆仟贰佰柒拾陆万捌仟捌佰圆整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：《关于核准华泰证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（中国证监会证监许可[2014]1007 号）

1、托管人公司介绍

华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）于 1991 年成立，是中国证监会首批批准的综合类券商，也是中国证券业协会较早评审通过的创新试点证券公司，于 2010 年 2 月 26 日在上海证券交易所成功挂牌上市交易，注册资本增加到 56 亿元。于 2015 年 6 月 1 日在香港联交所主板挂牌并开始上市交易，注册资本变更为：716276.88 万元人民币。自上市以来，华泰证券始终秉承“高效、诚信、稳健、创新”的核心价值观，坚持“以客户服务为中心、以客户需求为导向、以客户满意为目的”的经营理念，逐步塑造了公司的核心竞争力，在市场上形成了较高的知名度和影响力。监管部门对公司的分类结果：2014、2015 年，公司在证券公司分类评价的结果为 A 类 AA 级，2016 年为 B 类 BBB 级。

2、主要人员情况

华泰证券资产托管部充分发挥作为新兴托管券商的证券市场专业化优势，搭建了由高素质人才组成的专业化托管团队。现有员工具有多年金融从业经历，丰富的证券相关业务经验，均具备基金从业资格，其中本科以上学历占比 100%，硕士研究生人员占比超过 85%，专业分布合理，是一支诚实勤勉，开拓创新的资产托管从业人员团队。

3、基金托管业务经营情况

华泰证券于 2014 年 9 月 29 日经中国证监会核准取得证券投资基金托管资格，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。华泰证券始终坚持稳健的经营理念，“严格管理、审慎经营、规范运作”，注重风险管理，保持良好的资本结构，严格遵守国家有关基金托管业务的法律法规、行业监管规章和公司有关管理规定，规范运作、严格管理，确保基金托管业务的稳健运行。

华泰证券资产托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时披露，为基金份额持有人利益履行基金托管职责，保证基金份额持有人的合法权益。

二、托管业务的内部控制制度

1、内部控制目标

遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规则和公司有关管理规定，秉持稳健经营、规范运作的理念，在组织体系、决策授权、制度流程等方面进一步完善风险控制措施，防范和化解风险，保证托管资产的安全完整；维护基金份额持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、风险治理组织架构

华泰证券风险管理组织架构包括四个主要部分：董事会及合规与风险管理委员会、总裁室及风险控制委员会、首席风险官、各职能部门以及各业务部门。

董事会是风险管理的最高决策机构，并对公司全面风险管理体系的有效性承担最终责任。董事会设合规与风险管理委员会，对风险管理的总体目标、基本政策、风险评估报告进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见。总裁室是风险管理的最高执行机构，根据董事会的授权和批准，结合公司经营目标，具体负责实施风险管理工作，并下设风险控制委员会。公司设首席风险官，负责全面风险管理工作。在主要业务部门都设立了一线的风险控制组织，各级组织和人员需在授权范围内履行风险管理的职责，分工明晰，强调相互协作。公司指定风险管理部履行风险管理职责，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议。合规法律部是华泰证券合规管理的核心职能部门，主要负责对公司经营管理活动和员工执业行为进行合规管理，以及管理公司的法律事务工作。稽核部负责对公司各级部门的风险管理、内部控制及经营管理绩效进行独立、客观地检查、监督、评价，并督促其改进。各部门分工协作，各有侧重，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价三道防线功能。资产托管部通过设立稽核内控专岗、建立复核机制、内控检查机制、报告机制等方式，实现对各类风险的全面有效管理，保证在合法合规、稳健规范的基础上开展基金托管业务。

第三部分 相关服务机构

一、直销机构

永赢基金管理有限公司

住所：浙江省宁波市江东区中山东路 466 号

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

法定代表人：罗维开

联系人：吴亦弓

联系电话：（021）5169 0103

传真：（021）5169 0178

客服热线：021-51690111

网址：www.maxwealthfund.com

二、代销机构

1、华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

客户服务电话：95597

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

网址：www.htsc.com.cn

2、宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

联系电话：0574-89068340

客户服务电话：95574

网址：www.nbcb.com.cn

3、上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 层

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

传真：021-64385308

网址：www.1234567.com.cn

4、上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

客户服务热线：400-8219-301

网址：www.lufunds.com

5、中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

全国统一客服电话：400-8888-108

公司网站：www.csc108.com

6、天风证券股份有限公司

住所：武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

全国统一客服电话：400-8005-000

公司网站：www.tfzq.com

7、杭州数米基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 楼

法定代表人：陈柏青

全国统一客服电话：400-0766-123

公司网站：www.fund123.cn

8、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

三、登记机构

永赢基金管理有限公司

住所：浙江省宁波市江东区中山东路 466 号

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

法定代表人：罗维开

联系电话：(021) 5169 0136

传真：(021) 5169 0179

联系人：蒲昕玮

四、出具法律意见书的律师事务所

名称：远闻（上海）律师事务所

注册地址：浦电路 438 号双鸽大厦 18 楼 G 室

办公地址：浦电路 438 号双鸽大厦 18 楼 G 室

负责人：奚正辉

电话：021-5036 6376

传真：021-5036 6733

经办律师：屠颢、孙贤

五、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼（东三办公楼）16层

办公地址：上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：(021)2228 8888

传真：(021)2228 0000

联系人：濮晓达

经办注册会计师：郭杭翔、濮晓达

第四部分 基金的名称

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

第六部分 基金的投资目标

本基金通过灵活应用多种量化策略，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。

第七部分 基金的投资范围

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（包含中小板、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）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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）。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

本基金参与股指期货交易后，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

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。

第八部分 基金的投资策略

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量化策略，力争实现稳定的绝对回报。

1、多因子选股策略

该策略以对中国股票市场较长期的回溯研究为基础，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。

（1）基本面因子

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。

4、其他投资策略

(1) 债券投资策略

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。

(2) 金融衍生工具投资策略

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。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：95%*沪深 300 指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的反映 A 股市场整体走势的指数，该指数从上海和深圳证券交易所中选取 300 只交易活跃、代表性强的 A 股作为成份股，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强且公信力较好的股票指数。本基金为灵活配置混合型基金，股票资产的投资比例最高可达基金资产的 95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金净资产的 5%。因此，本基金适宜采用该业绩比较基准。随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金，或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够代表本基金风险收益特征的指数，基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，与基金托管人协商一致后，对业绩比较基准进行相应调整，并报中国证监会备案并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

第十一部分 基金的投资组合报告

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。基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2016 年 7 月 18 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。

本组合报告所载数据截至日为 2016 年 6 月 30 日。

1、报告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 76,876,702.55 84.05

其中：股票 76,876,702.55 84.05

2 基金投资 — —

3 固定收益投资 — —

其中：债券 — —

资产支持证券 — —

4 贵金属投资 — —

5 金融衍生品投资 — —

6 买入返售金融资产 — —

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 12,771,465.50 13.96

8 其他资产 1,813,526.76 1.98

9 合计 91,461,694.81 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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 537,630.00 0.60

B 采矿业 1,232,756.00 1.37

C 制造业 29,548,853.62 32.86

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 3,468,328.22 3.86

E 建筑业 3,235,330.00 3.60

F 批发和零售业 3,742,128.00 4.16

G 交通运输、仓储和邮政业 2,951,500.00 3.28

H 住宿和餐饮业 276,930.00 0.31

I 信息传输、软件和信息技术服务业 5,268,297.04 5.86

J 金融业 19,297,453.59 21.46

K 房地产业 4,433,633.16 4.93

L 租赁和商务服务业 664,281.00 0.74

M 科学研究和技术服务业 173,978.00 0.19

N 水利、环境和公共设施管理业 457,419.00 0.51

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 1,402,664.92 1.56

S 综合 185,520.00 0.21

合计 76,876,702.55 85.48

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 601998 中信银行 682,400 3,869,208.00 4.30

2 601328 交通银行 485,100 2,731,113.00 3.04

3 601211 国泰君安 134,100 2,385,639.00 2.65

4 600816 安信信托 134,400 2,267,328.00 2.52

5 601009 南京银行 205,961 1,933,973.79 2.15

6 000563 陕国投A 266,500 1,463,085.00 1.63

7 000166 申万宏源 142,000 1,194,220.00 1.33

8 601318 中国平安 36,800 1,179,072.00 1.31

9 601818 光大银行 219,600 825,696.00 0.92

10 600369 西南证券 102,300 742,698.00 0.83

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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

IF1612 沪深300股指期货 1612 合约 6 5,366,520.00 139,635.00

公允价值变动总额合计(元) 139,635.00

股指期货投资本期收益(元) -496,115.00

股指期货投资本期公允价值变动(元) 62,895.00

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用灵活配置策略,可利用股指期货调节系统性风险。

在报告期内,本基金管理人密切关注市场动态,针对当前股指期货基差贴水状态进行现货替代操作,优化资金利用效率,合理管理产品系统性风险,符合既定的投资政策和投资目标。

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。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券中的西南证券股份有限公司(股票代码:600369)于2016年6月23日收到《中国证券监督管理委员会调查通知书》(编号:深专调查通字2016975号),因公司涉嫌未按规定履行职责,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证券监督管理委员会决定对公司立案调查。

本基金投资该公司是根据量化模型打分系统作出的决策,符合既定投资策略与合规流程。

除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

(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。

(3) 其他资产构成

单位:人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 1,446,635.25

2 应收证券清算款 317,968.66

3 应收股利 —

4 应收利息 7,447.49

5 应收申购款 —

6 其他应收款 —

7 待摊费用 41,475.36

8 其他 —

9 合计 1,813,526.76

(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) 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。

第十二部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、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，也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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绩比 ②绩比

2015 年 9 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 6.80% 0.85% 10.33% 1.71% -3.53% -0.86%

2016 年 1 月 1 日-2016 年 6 月 30 日 -13.30% 2.05% -14.66% 1.75% 1.36% 0.30%

2015 年 9 月 1 日-2016 年 6 月 30 日 -7.40% 1.67% -5.84% 1.74% -1.56% -0.07%

注：2015 年 9 月 1 日为基金合同生效日。

第十三部分 费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.50\% \div \text{当年实际天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年实际天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，次月初由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，则支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（二）与基金销售有关的费用

1、本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金基金份额前端申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

单次申购金额（含申购费）M 申购费率

$M < 100 \text{ 万}$ 1.50%

$100 \text{ 万} \leq M < 200 \text{ 万}$ 1.00%

$200 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$ 0.80%

$M \geq 500 \text{ 万}$ 按笔收取，每笔 1,000 元

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

2、本基金对基金份额收取赎回费，在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。本基金基金份额的具体赎回费率具体如下：

持有基金时间 T 赎回费率

T < 7 天 1.50%

7 天 ≤ T < 30 天 0.75%

30 天 ≤ T < 1 年 0.50%

T ≥ 1 年 0

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率。

(三) 其他费用

- 1、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 2、基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 3、基金份额持有人大会费用；
- 4、基金的证券交易费用；
- 5、基金的银行汇划费用；
- 6、基金的开户费用、账户维护费用；
- 7、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(四) 不列入基金费用的项目

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书本次更新依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

更新了重要提示中的部分信息；

更新了释义中的部分信息；

更新了基金管理人的部分信息；

更新了基金托管人的部分信息；

更新了相关服务机构的部分信息；

更新了投资组合报告，数据截止日期为 2016 年 6 月 30 日；

更新了基金的业绩部分，数据截止日期为 2016 年 6 月 30 日；

在“其他应披露事项”一章，新增了本基金自 2015 年 3 月 2 日至 2016 年 9 月 1 日发布的有关公告。

更新了备查文件的部分信息。

永赢基金管理有限公司

2016年10月15日