

**永赢基金管理有限公司关于以现场方式召开  
永赢瑞益债券型证券投资基金  
基金份额持有人大会的公告**

**一、召开会议基本情况**

根据《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》和《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，永赢瑞益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人永赢基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，决定以现场方式召开本基金的基金份额持有人大会（以下简称“大会”），审议《关于永赢瑞益债券型证券投资基金调整基金赎回费率有关事项的议案》及《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、投资限制、投资策略等有关事项的议案》，会议召开的具体安排如下：

1. 会议召开方式：现场方式。
2. 会议召开时间：2017年9月11日9时00分。
3. 会议召开地点：上海市浦东新区世纪大道210号27楼（永赢基金管理有限公司总部大会议室）

**二、会议审议事项**

1. 《关于永赢瑞益债券型证券投资基金调整基金赎回费率有关事项的议案》（见附件一）；
2. 《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、投资限制、投资策略等有关事项的议案》（见附件三）。

### 三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2017年9月6日，即在2017年9月6日下午交易时间结束后，在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次基金份额持有人大会的表决（注：权益登记日当天申请申购的基金份额不享有本次会议表决权，权益登记日当天申请赎回的基金份额享有本次会议表决权）。

### 四、会议的议事程序和表决方式

1. 大会主持人宣布会议开始；
2. 大会主持人宣布出席会议的基金份额持有人和代理人人数及所持有表决权的总数、占权益登记日基金总份额的比例；
3. 大会主持人宣布会议议事程序及注意事项；
4. 大会主持人确定和公布监票人，公布公证机关和公证员姓名、见证律师；
5. 大会主持人宣读议案；
6. 享有表决权的与会人员对议案进行审议，并以提交表决票方式（附件七）进行表决；
7. 监票人在基金份额持有人或代理人表决后立即进行清点，监票人对此进行监督，公证机关对计票过程予以公证；
8. 大会主持人当场公布计票结果；
9. 公证机关宣读公证词；
10. 见证律师发表意见。

### 五、基金份额持有人出席会议需要准备的文件和材料

1. 个人基金份额持有人出席会议的，需要提交本人开立持有本基金基金份额的开放式基金账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身

份的有效证件或证明) 原件及正反面复印件。

2. 机构基金份额持有人出席会议的, 需要提交该机构开立持有本基金基金份额的开放式基金账户所使用的加盖单位公章(或基金管理人认可的其他印章, 下同)的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖单位公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)和代表单位出席会议的个人的身份证件(包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及正反面复印件及单位授权委托书(单位法定代表人出席的提供加盖单位公章的法定代表人身份证明)。

3. 委托他人出席本次大会的, 还应按照本公告第六条的规定, 提供相关资料。

4、以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等以基金管理人的认可为准。

## 六、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次基金份额持有人大会, 使基金份额持有人在本次基金份额持有人大会上充分表达其意志, 基金份额持有人除可以直接出席会议外, 还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。本基金的基金份额持有人如不能亲自出席本次大会, 可以通过纸面授权方式授权他人代为出席本次大会。

### 1. 授权所需文件

(1) 个人基金份额持有人委托他人出席会议的, 需要提交基金份额持有人签字的授权委托书(内容及格式参考本公告附件六)和基金份额持有人开立持有本基金基金份额的开放式基金账户所使用的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件。

如受托人为个人, 还需提供受托人的身份证件(包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及正反面复印件。

如受托人为机构，还需提供受托人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），和代表单位出席会议的个人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件以及单位授权委托书（受托人法定代表人出席的提供加盖单位公章的法定代表人身份证明书）。

如果受托人为本基金的基金管理人或销售机构，其将在取得基金份额持有人签署的授权委托书后统一办理授权手续（包括提供受托人上述证明文件）。

### （2）机构基金份额持有人委托他人出席会议

机构基金份额持有人委托他人出席会议的，需要提交加盖公章的授权委托书（内容及格式参考本公告附件六）和基金份额持有人开立持有本基金基金份额的开放式基金账户所使用的加盖单位公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖单位公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件。

如受托人为机构，还需提供受托人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），和代表受托机构出席会议的个人的身份证件（包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件以及单位授权委托书（受托人法定代表人出席的提供加盖单位公章的法定代表人身份证明书）。

如果受托人为本基金的基金管理人或销售机构，其将在取得基金份额持有人签署的授权委托书后统一办理授权手续（包括提供受托人上述证明文件）。

（3）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等以基金管理人的认可为准。

## 2. 授权效力确定原则

（1）本基金的基金份额持有人仅可通过纸面方式授权受托人代为行使表决

权。

(2) 如基金份额持有人授权他人出席本次大会后，又亲自出席本次大会进行投票表决的，以其本人亲自投票的表决意见为准。

(3) 如果同一基金份额存在多次有效纸面授权的，以受托人收到的最后一次纸面授权为准；不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，授权相同的，按照该相同的授权计票；授权不一致的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

(4) 如果委托人在授权委托书中明确其表决意见的，将以委托人的表决意见为准；如果授权委托书中未明确委托人的表决意见的，即视为授权受托人按照受托人的意志全权行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

### 3. 纸面授权资料的送交

基金份额持有人授权基金管理人出席大会并行使表决权的，可选择直接送交、邮寄 2 种方式送交纸面授权文件。

基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为：2017 年 9 月 8 日 15:00。

纸面授权资料应在授权截止时间之前送达，具体地址及联系方式如下：

地址：永赢基金管理有限公司

上海市浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪中心大厦 27 楼（邮编：200120）；

收件人：乔琪；

联系电话：021-51690111；

封面请注明：“永赢瑞益份额持有人大会授权”。

基金份额持有人授权他人或机构出席大会并行使表决权的，也可由代理人携带纸面授权文件出席大会。

## 七、会议出席对象

1. 本次大会的权益登记日为 2017 年 9 月 6 日，权益登记日当天交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人或其代理人。

2. 基金管理人代表。
3. 基金托管人代表。
4. 基金管理人聘请的公证机关人员。
5. 基金管理人聘请的见证律师。

## 八、基金份额持有人大会预登记

### 1. 预登记方式

#### (1) 邮件方式预登记

在预登记时间内，基金份额持有人或代理人可将“五、基金份额持有人出席会议需要准备的文件和材料”及“六、授权”规定的文件以照片或扫描件形式，通过电子邮件发送给本基金管理人进行预登记。

具体联系方式如下：

电子邮箱：[fund@maxwealthfund.com](mailto:fund@maxwealthfund.com)

邮件主题：永赢瑞益份额持有人大会预登记

#### (2) 传真方式预登记

在预登记时间内，基金份额持有人或代理人可将“五、基金份额持有人出席会议需要准备的文件和材料”及“六、授权”规定的文件传真给基金管理人进行预登记。

具体联系方式如下：

传真号码：021-51690178

确认电话：021-51690111

## 2. 预登记时间

2017年8月11日—2017年9月6日，每天上午9:00-下午5:00（周六、周日及法定节假日除外），基金管理人将为基金份额持有人办理邮件方式预登记或传真方式预登记。

## 3. 关于预登记的说明

基金管理人可以通过预登记情况估计基金份额持有人或代理人到会情况，以便为基金份额持有人大会召开进行相应准备。已办理预登记的基金份额持有人或代理人在持有人大会会议入场前仍需按照本公告“五、基金份额持有人出席会议需要准备的文件和材料”及“六、授权”的规定提供相应资料办理现场会议登记，请各基金份额持有人或代理人予以积极配合。

## 九、会议召开的条件

1. 到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的二分之一以上；

2. 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

## 十、计票

1. 大会主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人。

2. 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场

公布计票结果。

3. 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4. 计票过程由公证机关予以公证。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

### 十一、形成基金份额持有人大会决议的条件

1. 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

2. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

3. 基金份额持有人或代理人在表决票上填写“同意”、“反对”或者“弃权”。表决意见模糊不清或相互矛盾的、未填或未投的表决票视为投票人放弃表决权利,其所持份数的表决结果均计为“弃权”。

4. 《关于永赢瑞益债券型证券投资基金调整基金赎回费率有关事项的议案》及《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、投资限制、投资策略等有关事项的议案》应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效。

5. 基金份额持有人大会决议通过的事项自表决通过之日起生效,基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案。法律法规另有规定的,从其规定。

### 十二、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金合同》的规定,本次持有人大会出席的有效基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)方可进行基金份额持有人大会议程。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记

日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。重新召开基金份额持有人大会时（以最多两次重新召开持有人大会为限），除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

### 十三、本次大会相关机构

1、召集人：永赢基金管理有限公司

联系人：周良子

联系电话：021-51690105

传真：021-51690178

网址：<http://www.maxwealthfund.com>

2、监督人：兴业银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系电话：（021）62154848

4、见证律师事务所：远闻（上海）律师事务所

### 十四、重要提示

1. 本次会议将于2017年9月11日9时00分召开，届时基金管理人、基金托管人、基金管理人聘请的公证机关人员以及见证律师将对与会人员资格的合法性进行

审查并予以登记，请出席会议人员务必按照本公告的要求，携带必需的文件提前半小时至会议地点，以便验证入场。主持人宣布会议开始后，不再对未登记的基金份额持有人进行登记，未登记的持有人不得入场参加会议。

2. 基金份额持有人应当保持会议秩序，服从召集人的引导，除出席会议的基金份额持有人（或代理人）、会务人员、聘任律师和公证机构及召集人邀请的人员以外，召集人有权依法拒绝其他人士入场，对于干扰基金份额持有人大会秩序、寻衅滋事和侵犯其他基金份额持有人合法权益的行为，召集人有权采取措施加以制止并及时报告有关部门查处。

3. 特别提醒各位基金份额持有人在预登记及会议现场登记时，需要提供的是开立持有本基金基金份额的开放式基金账户所使用的身份证件及正反面复印件，如若开立有多个账户且使用的是不同的身份证件，需要分别提供各账户对应的身份证件及（或）其复印件。

4. 本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站（<http://www.maxwealthfund.com>）查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话021-51690111咨询。

5. 本公告的有关内容由永赢基金管理有限公司负责解释。

永赢基金管理有限公司

2017年8月11日

附件一：《关于永赢瑞益债券型证券投资基金调整基金赎回费率有关事项的议案》

附件二：《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金赎回费率的说明》

附件三：《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、投资限制、投资策略等有关事项的议案》

附件四：《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、投资限制、投资策略等有关事项的说明》

附件五：《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》修改条款前后文对照表

附件六：《授权委托书》

附件七：《永赢瑞益债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件一：

## 关于永赢瑞益债券型证券投资基金 调整基金赎回费率有关事项的议案

永赢瑞益债券型证券投资基金基金份额持有人：

为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，根据《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》等法律法规的规定和《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《永赢添益瑞益债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的有关约定，本基金管理人提议对永赢瑞益债券型证券投资基金的基金赎回费率进行调整。

具体调整安排可参见附件二《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金赎回费率的说明》。

以上议案，请予审议。

基金管理人：永赢基金管理有限公司

2017年9月11日

附件二：

## 关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金赎回费率的说明

为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，根据《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》等法律法规的规定和《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《永赢瑞益债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的有关约定，永赢基金管理有限公司（以下简称“本公司”）提议调整永赢瑞益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金赎回费率进行调整。具体方案说明如下：

### 一、方案要点

#### （一）本基金原赎回费率如下：

持有基金时间 T	赎回费率
T < 30 天	1.00%
30 天 ≤ T < 90 天	0.20%
90 天 ≤ T < 180 天	0.10%
180 天 ≤ T < 1 年	0.05%
T ≥ 1 年	0

注：1 年指 365 天

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费 100% 计入基金财产。

#### （二）调整后的本基金赎回费率

持有基金时间 T	赎回费率
T < 30 天	0.10%
T ≥ 30 天	0%

注：1 年指 365 天

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费 100% 计入基金财产。

## 二、调整基金赎回费率的可行性

### 1、法律方面

由于本基金的赎回费全额计入基金财产，赎回费率的降低，有可能对基金持有人的收益造成实质影响。根据《基金合同》的规定，对投资者权利产生重大影响的事项需召开基金份额持有人大会进行表决。

本次基金份额持有人大会决议属于一般决议，经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50%以上（含 50%）通过后，决议即可生效。

因此，本基金调整赎回费率不存在法律层面的障碍。

### 2、技术运作方面

本基金的注册登记机构仍然为本公司，本公司具有较为丰富的运行经验，业务流程和保障机制完善。

因此，本基金调整赎回费率不存在技术运作层面的障碍。

### 3、投资运作方面

本公司已对调整本基金赎回费率的运作进行了充分的分析与论证，通过严格的风险控制以及流动性管理措施，确保本基金投资的平稳运作。

## 三、调整基金赎回费率的主要风险及预备措施

### 1、议案被基金份额持有人大会否决的风险及预备措施

本次调整基金赎回费率的主要风险是议案被持有人大会否决的风险。

在提议调整本基金赎回费率并确定具体方案之前，基金管理人已与基金份额持有人进行了沟通，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询基金份额持有人意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对方案进行适当的修订，并重新公

告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果本方案未获得持有人大会批准，基金管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向持有人大会提交调整本基金赎回费率的议案。

## 2、运作风险及预备措施

本次调整赎回费率的目的是更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，由于本基金的赎回费全额归入基金财产，可能造成本基金或有的收益减少。同时，赎回费率的下降，将可能提高基金规模的波动性。

本基金主要通过基金管理人的主动管理操作来增加投资收益，因此，赎回费对基金资产的收益增厚贡献极不显著。本基金赎回费率调整后，基金管理人将根据公司严格的风险内部控制和风险管理制度，管理好投资组合的久期风险和流动性风险。此外，投资者承担的费用成本降低，更有利于吸引新增资金，提高本基金投资运作的规模效应。

附件三：

## 关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、 投资限制、投资策略等有关事项的议案

永赢瑞益债券型证券投资基金基金份额持有人：

由于市场环境变化，为进一步丰富本基金投资品种、完善投资策略同时确保风险控制，更好地满足投资者需求，根据《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》和《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定，本基金管理人提议对永赢瑞益债券型证券投资基金的投资范围、投资限制、投资策略等进行修改。

具体说明见附件四《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、投资限制、投资策略等有关事项的说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对基金合同进行修改。本基金的托管协议及招募说明书也将进行相应的修改或补充。

同时，根据中国证监会《机构监管情况通报（2017年第2期 总第15期）》的相关要求，本基金管理人与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，将对基金合同的部分条款进行相应的修改或补充，具体详见附件五《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》修改条款前后文对照表。

上述议案，请予审议。

基金管理人：永赢基金管理有限公司

2017年9月11日

附件四：

## 关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、 投资限制、投资策略等有关事项的说明

### 一、声明

由于市场环境变化，为进一步丰富本基金投资品种、完善投资策略同时确保风险控制，更好地满足投资者需求，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与基金托管人协议一致，决定以现场方式召开基金份额持有人大会，审议变更本基金的投资范围、投资限制、投资策略等相关事项。

本次永赢瑞益债券型证券投资基金修改投资范围、投资限制、投资策略等相关事项的方案需经参加基金份额持有人大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过，因此修改投资范围、投资限制、投资策略等相关事项的方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。参加基金份额持有人大会表决的基金份额持有人为权益登记日登记在册的永赢瑞益债券型证券投资基金基金份额持有人，出席的基金份额持有人（或代理人）在权益登记日所代表的有效基金份额须占权益登记日基金总份额50%以上（含50%）。

基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且自本次基金份额持有人大会表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。中国证监会对本次永赢瑞益债券型证券投资基金调整投资范围、投资限制、投资策略等相关事项的方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次改造方案或本基金的价值或投资者的权益做出实质性判断或保证。

### 二、方案要点

## （一）修改投资范围

《基金合同》“第十二部分 基金的投资”之“二、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，包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、政策性金融债、银行存款（包括同业存款、协议存款、定期存款、通知存款等各类存款）、债券回购、其他货币市场工具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的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券、可交换债券。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。”

修订为：

“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交易的国债、金融债、企业债、央行票据、中期票据、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货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的相关规定。

本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；

每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。”

## (二) 修改投资策略

《基金合同》“第十二部分 基金的投资”之“三、投资策略”,根据修改后的投资范围,相应增加类属配置策略、信用策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、国债期货投资策略。

具体增加部分如下:

### “1、类属配置策略

本基金将综合分析各类属相对收益情况、利差变化状况、信用风险评级、流动性风险管理等因素来确定各类属配置比例,发掘具有较好投资价值的投资品种,增持相对低估并能给组合带来相对较高回报的类属,减持相对高估并给组合带来相对较低回报的类属。

### 4、信用策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价,主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响,相应地采用以下两种投资策略:

1) 信用利差曲线变化策略:首先分析经济周期和相关市场变化情况,其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势,最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势,确定本基金信用债分行业投资比例。

2) 信用变化策略:信用债信用等级发生变化后,本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。

本基金将根据内、外部信用评级结果,结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

### 6、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### 7、证券公司短期公司债券投资策略

本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。

#### 8、国债期货投资策略

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

### （三）修改投资限制

《基金合同》“第十二部分 基金的投资”之“四、投资限制”中“1、组合限制”：

“基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；

（2）本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；

（3）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(4) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(5) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。”

修订为：

“ (1) 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；

(2) 本基金在任何交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券(指同一信用级别)规模的 10%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(10) 本基金投资于国债期货，还应遵循如下投资组合限制：

①在任何交易日日终，本基金持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

②本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

③本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

④本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。

（11）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（12）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（13）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（9）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。”

（四）《基金合同》中的“基金资产估值”、“基金的信息披露”等部分内容根据上述修改一并作出相应修改。

### 三、调整基金投资范围、投资限制、投资策略的可行性

#### （一）法律方面

依照《基金合同》“第八部分 基金份额持有人大会”中“一、召开事由”规定，“变更基金投资目标、范围或策略”及“对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项”应当召开基金份额持有人大会。

同时，在《基金法》第八十三条到第八十六条对基金持有人大会的召集人、召开形式以及相关事宜都作了规定与说明，这为基金份额持有人大会的召开流程

提供了法律依据。

本次基金份额持有人大会决议属于一般决议，经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过，决议即可生效。

因此，本次基金调整投资范围、投资限制、投资策略不存在法律方面的障碍。

## （二）技术运作方面

为了保障永赢瑞益债券型证券投资基金份额持有人大会的顺利召开，基金管理人成立了工作小组，筹备、执行份额持有大会相关事宜。基金管理人与基金托管人、律师事务所、公证机关、投资者进行了充分沟通，保证基金份额持有人大会可以顺利召开。

本次基金份额持有人大会决议生效并公告后，本基金将公告修订后的《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》、《永赢瑞益债券型证券投资基金托管协议》。

本基金的基金管理人、基金托管人已就本次基金调整投资范围、投资限制、投资策略的有关事项进行了充分沟通和细致准备，技术可行。

因此，本次基金调整投资范围、投资限制、投资策略不存在技术运作方面的障碍。

## （三）投资运作方面

基金管理人已对基金投资范围、投资限制、投资策略调整后的投资运作进行了充分的分析，修改后本基金将与同类产品的投资运作保持一致，鉴于基金管理人有丰富的债券型基金的管理运作经验，投资方面具有较好的可行性。

## 四、基金投资范围、投资限制、投资策略调整的主要风险及预备措施

### 1. 议案被基金份额持有人大会否决的风险及预备措施

本次基金调整投资范围、投资限制、投资策略的主要风险是议案被基金份额持有人大会否决的风险。

在提议调整本基投资范围、投资限制、投资策略并确定具体方案之前，基金

管理人已与基金份额持有人进行了沟通，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询基金份额持有人意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果本方案未获得持有人大会批准，基金管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向持有人大会提交调整本基金投资范围、投资限制、投资策略的议案。

## 2.流动性风险及预备措施

在本基金关于以现场方式召开基金份额持有人大会的事项及《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、投资限制、投资策略等有关事项的议案》公告后，部分基金份额持有人可能选择提前赎回其持有的基金份额。

在通过《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、投资限制、投资策略等有关事项的议案》的基金份额持有人大会决议生效并公告前，本基金仍按照《基金合同》约定的运作方式进行运作。同时，基金管理人也会提前做好流动性安排，对资产进行变现以应对可能的赎回。

## 附件五:

## 《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》修改条款前后文对照表

《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》按照《中华人民共和国合同法》、《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》、《证券投资基金基金合同填报指引第3号——债券型证券投资基金基金合同填报指引（试行）》和其他有关法律法规修改拟定，具体新《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》与原《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》修改条文的对照说明如下：

页码	《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》	《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》修改条款版本
	内容	内容
1、P1-2, “前言”	五、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。	（增加） 五、本基金完成此次变更生效后，其单一投资者持有基金份额的比例不得达到或超过 50%（运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外），且基金管理人承诺后续不存在通过一致行动等方式变相规避 50%集中度的情形。 六、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。
2、P3-6, “释义”	36、《业务规则》：指《永赢基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守	36、《业务规则》：指《永赢基金管理有限公司非上市开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
3、P8, “第四部分”	第四部分 基金份额的发售	（新增）

基金的历史沿革”		<p><b>第四部分 基金的历史沿革</b></p> <p>永赢瑞益债券型证券投资基金经中国证监会《关于准予永赢瑞益债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]1827号）核准募集，基金管理人为永赢基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。</p> <p>永赢瑞益债券型证券投资基金自2017年2月9日至2017年2月27日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理基金备案手续。经中国证监会书面确认，《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》于2017年3月2日生效。</p> <p>本次变更注册后的《永赢瑞益债券型证券投资基金基金合同》自2017年X月X日起正式生效。</p>
4、P10-17, “第六部分 基金份额的申购与赎回”	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项时，申购申请即为成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项时，申购申请即为成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将</p>

<p>人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。</p> <p>基金份额持有人提交赎回申请时，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>3、证券交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停投资者的申购申请，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p>	<p>退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。</p> <p><b>投资人在提交赎回申请时，应确保账户内有足够的基金份额余额，否则提交的赎回申请无效。</b>基金份额持有人提交赎回申请时，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。<b>遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</b></p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>3、<b>证券/期货交易所</b>交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p><b>(增加)</b></p> <p><b>7、当日某笔申购申请使单个投资人累计持有的基金份额超出基金管理人公告的限额时。</b></p> <p><b>8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有本基金份额的比例达到或者超过 50%，或者通过一致行动人等方式变相使单一投资者持有本基金份额的比例达到或超过 50%的情形时。</b></p> <p>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、<b>9</b> 项暂停申购情形之一且基金管理</p>
--	---

		<p>人决定暂停投资者的申购申请,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被<b>全部或部分</b>拒绝,被拒绝<b>部分</b>的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>3、<b>证券/期货交易所</b>交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p>
<p>5、P18-24,“第七部分 基金合同当事人及权利义务”</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(二)基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:</p> <p>(14)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(二)基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:</p> <p>(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:</p> <p>(6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;</p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(二)基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:</p> <p>(14)选择、更换律师事务所、会计师事务所、<b>证券/期货</b>经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(二)基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:</p> <p>(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户等<b>投资所需账户</b>、为基金办理<b>证券、期货</b>交易资金清算。</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:</p> <p>(6)按规定开设基金财产的资金账户和<b>证券账户等投资所需账户</b>,按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;</p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持</p>

	<p>(1) 认真阅读并遵守基金合同;</p>	<p>有人的义务包括但不限于: (1) 认真阅读并遵守基金合同、<b>招募说明书等信息披露文件;</b></p>
<p><b>6、P39-44, “第十二部分 基金的投资”</b></p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、政策性金融债、银行存款(包括同业存款、协议存款、定期存款、通知存款等各类存款)、债券回购、其他货币市场工具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的相关规定)。</p> <p>本基金不投资于股票、权证等权益类资产, 也不投资于可转换债券、可交换债券。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为: 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%; 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>三、投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策及资本市场资金环境的研究, 积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性等因素, 综合运用久期策略、收益率曲线策略、杠杆策略, 力求实现基金资产的增值保值。</p> <p>1、久期策略</p> <p>本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势, 判断债</p>	<p>二、投资范围</p> <p>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交易的国债、<b>金融债、企业债</b>、央行票据、<b>中期票据、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债、资产支持证券</b>、债券回购、<b>协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单</b>、货币市场工具、<b>国债期货</b>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的相关规定。</p> <p>本基金不投资于股票、权证, 也不投资于可转换债券(<b>可分离交易可转债的纯债部分除外</b>)、可交换债券。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为: 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%; <b>每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 应保持</b>现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>三、投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策及资本市场资金环境的研究, 积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性等因素, 综合运用<b>类属配置策略、久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、国债期货投资策略</b>, 力求实现基金资产的增值保值。</p>

	<p>券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。</p> <p>2、收益率曲线策略</p> <p>本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。</p> <p>3、杠杆策略</p> <p>杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买相对较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。</p>	<p><b>1、类属配置策略</b></p> <p>本基金将综合分析各类属相对收益情况、利差变化状况、信用风险评级、流动性风险管理等因素来确定各类属配置比例，发掘具有较好投资价值的投资品种，增持相对低估并能给组合带来相对较高回报的类属，减持相对高估并给组合带来相对较低回报的类属。</p> <p>2、久期策略</p> <p>本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。</p> <p>3、收益率曲线策略</p> <p>本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。</p> <p><b>4、信用策略</b></p> <p>本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响，相应地采用以下两种投资策略：</p> <p>1) 信用利差曲线变化策略：首先分析经济周期和相关市场变化情况，其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势，最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定本基金信用债分行业投资比例。</p> <p>2) 信用变化策略：信用债信用等级发生变化后，本基金将采用</p>
--	--	--

		<p>最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。</p> <p>本基金将根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。</p> <p><b>5、杠杆策略</b></p> <p>杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买相对较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。</p> <p><b>6、资产支持证券投资策略</b></p> <p>资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p><b>7、证券公司短期公司债券投资策略</b></p> <p>本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p><b>8、国债期货投资策略</b></p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。</p>
--	--	--

	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；</p> <p>(2) 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>(3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(4) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</p> <p>(5) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。</p> <p>因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p> <p>法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。</p>	<p>构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；</p> <p>(2) 本基金在任何交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券(指同一信用级别)规模的 10%；</p> <p>(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>(10) 本基金投资于国债期货，还应遵循如下投资组合限制：</p>
--	---	--

		<p>①在任何交易日日终，本基金持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；</p> <p>②本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；</p> <p>③本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；</p> <p>④本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。</p> <p>（11）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>（12）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</p> <p>（13）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。</p> <p><b>除上述第（9）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</b></p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p> <p>法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。</p>
--	--	--

	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中国债券总全价指数。</p> <p>中国债券总全价指数是中央国债登记结算公司编制的综合反映银行间债券市场、上海证券交易所债券市场、深圳证券交易所债券市场和柜台债券市场的跨市场债券指数。该指数样本券涵盖央行票据、国债和政策性金融债。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中国债券总全价指数作为业绩比较基准。</p> <p>若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并在更新的招募说明书中列示，而无需召开基金份额持有人大会。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中国债券总全价指数<b>收益率</b>。</p> <p>中国债券总全价指数是中央国债登记结算公司编制的综合反映银行间债券市场、上海证券交易所债券市场、深圳证券交易所债券市场和柜台债券市场的跨市场债券指数。该指数样本券涵盖央行票据、国债和政策性金融债。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中国债券总全价指数<b>收益率</b>作为业绩比较基准。</p> <p>若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并在更新的招募说明书中列示，而无需召开基金份额持有人大会。</p>
<p>7、P45，“第十三部分 基金的财产”</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指购买的各类证券、<b>期货合约</b>及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。</p>
<p>8、P46-50，“第十四部分 基金资产估值”</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项其它投资等资产及负债。</p> <p>三、估值方法</p> <p>6、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。</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的债券和银行存款本息、<b>国债期货合约</b>、应收款项、<b>资产支持证券</b>、其它投资等资产及负债。</p> <p>三、估值方法</p> <p><b>(增加)</b></p> <p><b>6、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近</b></p>

	<p>7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按法律法规以及监管部门最新规定估值。</p> <p>五、估值错误的处理</p> <p>5、特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p> <p>(2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p>	<p><b>交易日结算价估值。</b></p> <p>7、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。</p> <p>8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按法律法规以及监管部门最新规定估值。</p> <p>五、估值错误的处理</p> <p>5、特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p> <p>(2) 由于不可抗力原因，或由于证券、<b>期货</b>交易所及登记结算公司发送的数据错误等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、<b>期货</b>交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p>
<p>9、P51，“第十五部分 基金费用与税收”</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>6、基金的证券交易费用；</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>6、基金的证券、<b>期货</b>交易费用；</p>
<p>10、P56-61，“第十八部分 基金的信息披露”</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>(九) 基金份额持有人大会决议</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>(增加)</p>

	<p>基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。</p> <p>(十) 中国证监会规定的其他信息。</p>	<p>报告期内出现单一投资者持有基金份额占本基金总份额的比例达到或者超过 20% 的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险。</p> <p>(九) 基金份额持有人大会决议</p> <p>基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。</p> <p>(增加)</p> <p>(十) 投资资产支持证券信息披露</p> <p>基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。</p> <p>基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。</p> <p>(十一) 投资证券公司短期公司债券的信息披露</p> <p>本基金投资证券公司短期公司债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资证券公司短期公司债券的相关信息，并在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露证券公司短期公司债券的投资情况。</p> <p>(十二) 投资国债期货的信息披露</p> <p>基金管理人在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p>
--	--	--

	<p>八、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</li> <li>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</li> <li>3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。</li> </ol>	<p>(十三) 中国证监会规定的其他信息。</p> <p>八、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金投资所涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</li> <li>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</li> <li>3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。</li> </ol>
--	--	---

附件六:

## 授权委托书

兹委托            先生/女士/机构代表本人(或本机构)出席于    年    月    日召开的永赢瑞益债券型证券投资基金份额持有人大会,并代为全权行使本人/本机构于权益登记日所持有的永赢瑞益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)全部基金份额对所有议案的表决权。本授权委托书的有效期为委托人签字或盖章之日起至本基金基金份额持有人大会结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的持有人大会的,以最多两次重新召开持有人大会为限,本授权继续有效。本人(或本机构)同意被授权人转授权,转授权仅限一次。

委托人(签字/盖章):

委托人证件号码:

开放式基金账户:

受托人:

受托人证件号码:

委托日期:        年    月    日

附件七:

### 永赢瑞益债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名/名称:			
证件号码(身份证件号/营业执照注册号):			
基金账户号:			
<b>表决事项</b>	同意	反对	弃权
《关于永赢瑞益债券型证券投资基金调整基金赎回费率有关事项的议案》			
《关于调整永赢瑞益债券型证券投资基金投资范围、投资限制、投资策略等有关事项的议案》			
机构基金份额持有人/代理人签章栏  单位公章:  日期:			
个人基金份额持有人/代理人签字栏  签字:  日期:			
说明:  请以打“√”方式在表决事项后注明表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持有的全部基金份额的表决意见。“基金账户号”处空白、多填、错填、无			

法识别等情况的，将被默认为代表持有人所持有的本基金所有份额。

如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决。