

永赢基金管理有限公司  
永赢丰益债券型证券投资基金  
更新招募说明书摘要

(2017年第1号)

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

二零一七年九月

## 重要提示

永赢丰益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2016年6月13日获中国证券监督管理委员会证监许可〔2016〕1281号文准予注册募集。本基金的《基金合同》和《招募说明书》已通过指定信息披露媒体进行了公开披露。本基金的基金合同于2017年2月16日正式生效。本招募说明书是对原《永赢丰益债券型证券投资基金招募说明书》的更新，原招募说明书与本招募说明书内容不一致的，以本招募说明书为准。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。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。本基金为债券型证券投资基金，属证券投资基金中的较低预期风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

本基金主要投资于债券资产，在严格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。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，基金投资对象与投资策略引致的特有风险，等等。

本基金将中小企业私募债券纳入到投资范围当中，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市的中小企业以非公开方式发行的债券。该类债券不能公开交易，可通过上海证券交易所固定收益证券综合电子平台或深圳证券交易所综合协议交易平台进行交易。一般情况下，中小企业私募债券的交易不活跃，潜在流动性风险较大；并且，当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性限制，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，从而可能给基金净值带来损失。

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，

基金管理人不能保证基金一定盈利，也不能保证最低收益。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。

基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

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，也不能保证最低收益。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，在投资者做出投资决策后，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2017年8月16日，投资组合报告为2017年第二季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日（本招募说明书财务资料未经审计）。

## 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

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：马宇晖

成立日期：2013年11月7日

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142,980,000元，占公司注册资本的71.490%；

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%；

芦特尔出资人民币20,000元，占公司注册资本的0.010%；

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%；

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%；

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%;  
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%;  
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%;  
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%;  
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

马宇晖先生, 董事长, 金融学学士。11 年金融业从业经验, 曾任宁波银行股份有限公司金融市场部产品开发副经理、经理、金融市场部总经理助理、总经理, 现任宁波银行副行长, 兼永赢资产管理有限公司董事长。

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。

芦特尔先生, 董事, 金融学学士。14 年金融业从业经验, 曾任宁波银行股份有限公司金融市场部高级经理、总经理助理、副总经理; 永赢金融租赁有限公司监事。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。

宋宜农先生, 董事, 硕士。23 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副董事长。

陈巍女士，独立董事，硕士。曾任职于中国外运大连公司、美国飞驰集团无锡公司。现任北京市通商律师事务所合伙人律师、华北高速股份有限公司独立董事。

康吉言女士，独立董事，硕士，中国注册会计师，高级会计师。历任上海基础工程公司、海南中洲会计师事务所、上海审计师事务所（上海沪港审计师事务所）、上海长江会计师事务所。现任立信会计师事务所（特殊普通合伙）（上海立信长江会计师事务所有限公司、立信会计师事务所有限公司）部门经理、合伙人；江阴农村商业银行股份有限公司独立董事。

程鹏先生，独立董事，硕士。曾任中国建设银行金融市场部交易处副处长，现任暖流资产管理股份有限公司总经理、投资总监。

## 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。

姜丽荣先生，监事，硕士。5年相关行业从业经验，曾任宁波银行总行金融市场部同业部同业销售岗、非银同业部高级副经理助理、高级副经理；现任永赢基金管理有限公司市场部副总监。

狄泽先生，监事，学士。11年相关行业从业经验，曾任职于毕马威华振会计师事务所；金元比联基金管理有限公司稽核专员；申万菱信基金管理有限公司稽核经理；现任永赢基金管理有限公司监察稽核副总监。

## 3、管理层成员

芦特尔先生，总经理，相关介绍见董事会成员部分内容。

毛慧女士，督察长，硕士。12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。现任永赢基金管理有限公司督察长。

## 4、本基金基金经理祁洁萍。

东华大学理学硕士、理学学士，CFA，9年证券从业经验。曾任光大证券股份有限公司金融市场部投资经理、执行董事，平安证券有限责任公司研究所债券

分析师。现任永赢基金管理有限公司固定收益投资总监。

#### 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：公司总经理芦特尔先生、总经理助理徐翔先生、总经理助理兼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、监察稽核部负责人、交易部负责人、各基金经理、各投资经理、研究人员可列席，但不具有投票权。

总经理为投资决策委员会主任委员，负责召集、协调统筹投资决策委员会会议并检查投资决策委员会决议的执行情况。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、基金托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

成立时间：1988 年 8 月 22 日

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

托管部门联系人：张小燕

电话：021-52629999

传真：021-62159217

#### 2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批

股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本207.74亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2016年12月31日，兴业银行资产总额达6.09万亿元，实现营业收入1570.60亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润538.50亿元。在2016年英国《银行家》杂志全球银行1000强排名中，兴业银行按总资产排名第33位，按一级资本排名第32位；在2016年《财富》世界500强中，兴业银行排名第195位；在2016年《福布斯》全球上市企业2000强排名中，兴业银行位居第59位，稳居全球银行50强、全球上市企业100强、世界企业500强。品牌价值同步提升，根据英国《银行家》杂志联合世界知名品牌评估机构Brand Finance发布的“2017全球银行品牌500强”榜单，兴业银行排名第21位，大幅上升15位，品牌价值突破百亿美元达105.67亿美元，同比增长63.70%。在国内外权威机构组织的评奖中，兴业银行连续六年蝉联中国银行业“年度最具社会责任金融机构奖”，并先后获得“亚洲卓越商业银行”、“杰出中资银行奖”、“年度最佳股份制银行”、“卓越竞争力金融控股集团”、“卓越创新银行奖”、“年度优秀绿色金融机构”、“最佳责任企业”等多项殊荣。

## 二、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理及产品研发处、养老金管理中心等处室，共有员工100余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

## 三、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号。截止2017年6月30日，兴业银行已托管开放式基金183只，托管基金财产规模5741.64亿元。

# 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：浙江省宁波市鄞州区中山东路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：马宇晖

联系电话：(021) 5169 0103

传真：(021) 5169 0178

联系人：吴亦弓

客服热线：(021) 5169 0111

网址：[www.maxwealthfund.com](http://www.maxwealthfund.com)

## 二、代销机构

### 1、宁波银行股份有限公司

住所：宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：宁波市鄞州区宁东路 345 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：095574

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

2、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：浙江省宁波市鄞州区中山东路 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：马宇晖

联系电话：(021) 5169 0188

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：上海市浦东新区浦电路 438 号双鸽大厦 18G

办公地址：上海市浦东新区浦电路 438 号双鸽大厦 18G

负责人：奚正辉

电话：021-5036 6225

传真：021-5036 6733

经办律师：屠颢、沈国兴

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（特殊普通合伙）

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：蒋燕华

经办注册会计师：蒋燕华、石静筠

#### 第四部分 基金的名称

本基金名称：永赢丰益债券型证券投资基金

#### 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

本基金主要投资于债券资产，在严格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。

#### 第七部分 基金的投资方向

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、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、商业银行金融债、次级债、政策性金融债、中期票据、资产支持证券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、同业存单、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%。

## 第八部分 基金的投资策略

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、券种的流动性以及信用水平,综合运用类属配置策略、久期策略、收益率曲线策略、信用策略等多种投资策略,力求规避风险并实现基金资产的增值保值。

### 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。

### 2、久期策略

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。

### 3、收益率曲线策略

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。

### 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。

### 5、杠杆策略

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，并购买具有较高收益的债券，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。

### 6、中小企业私募债投资策略

本基金对中小企业私募债的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面，根据宏观经济运行状况的分析和预判，灵活调整组合的久期。信用风险控制方面，对个券信用资质进行详尽的分析，对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量，尽可能地缩小信用风险暴露。流动性控制方面，要根据中小企业私募债整体的流动性情况来调整持仓规模，在力求获取较

高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

#### 7、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。

### 第九部分 投资决策程序

（1）通过内部独立研究，并借鉴其他研究机构的研究成果，形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告，为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。

（2）投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据本基金投资目标和对市场的判断决定本计划的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。

（3）在既定的投资目标与原则下，由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资。

（4）基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

（5）动态的组合管理：基金经理将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合本基金的现金流量情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态的调整，使之不断得到优化。

（6）固定收益团队根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估与监控，并授权指定专员进行日常跟踪，出具风险分析报告。同时，监察稽核部对本基金投资过程进行日常监督。

### 第十部分 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数收益率。

中国债券综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、

交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标值的时间序列更加完整,有利于更加深入地研究和分析市场。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综合全价指数收益率作为业绩比较基准。

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。

## 第十一部分 风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

## 第十二部分 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。基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7月19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止日为2017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	—	—
	其中:股票	—	—
2	基金投资	—	—

3	固定收益投资	7,549,928,800.00	74.43
	其中：债券	6,387,242,500.00	62.96
	资产支持证券	1,162,686,300.00	11.46
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	179,000,468.50	1.76
	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	2,342,064,726.93	23.09
8	其他资产	73,151,115.40	0.72
9	合计	10,144,145,110.83	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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。

本基金本报告期末未持有股票。

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	508,435,000.00	5.01
	其中：政策性金融债	508,435,000.00	5.01
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	5,878,807,500.00	57.97
9	其他	—	—
10	合计	6,387,242,500.00	62.99

#### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111798474	17成都银行CD090	5,000,000	494,250,000.00	4.87
2	111798457	17常熟农村商行CD118	5,000,000	494,150,000.00	4.87
3	111792453	17重庆银行CD027	5,000,000	489,000,000.00	4.82
4	111798439	17江苏江南农村商业银行CD080	5,000,000	488,550,000.00	4.82
5	111798306	17广东南海农商行CD022	4,000,000	390,840,000.00	3.85
5	111798323	17四川天府银行CD087	4,000,000	390,840,000.00	3.85
5	111798339	17广东顺德农商行CD090	4,000,000	390,840,000.00	3.85

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1789107	17华驭6A	3,590,000	337,711,300.00	3.33
2	142914	花呗21A1	2,000,000	199,300,000.00	1.97
3	1789113	17睿程1A	2,000,000	161,280,000.00	1.59
4	142939	借呗12A1	1,600,000	159,584,000.00	1.57
5	1789096	17速利银丰1A	1,400,000	108,388,000.00	1.07
6	1789120	17融腾2A2	1,000,000	100,310,000.00	0.99
7	1789088	17德宝天元1B	400,000	39,892,000.00	0.39
8	1789060	17臻元1B	300,000	30,036,000.00	0.30
9	1789059	17臻元1A2	500,000	26,185,000.00	0.26

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 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。

(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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	73,093,435.20
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	57,680.20
8	其他	—
9	合计	73,151,115.40

#### (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

本基金本报告期末未持有股票。

### 第十三部分 基金的业绩

基金业绩截止日为2017年6月30日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守信守、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	①-③	②-④
2017年2月16日至2017年6月30日	1.54%	0.01%	-1.14%	0.07%	2.68%	-0.06%

注：2017年2月16日为基金合同生效日。

### 第十四部分 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0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年实际天数}$$

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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年实际天数}$$

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，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，支付日期顺延。

## (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 万	0.80%
100 万 ≤ M < 300 万	0.50%
300 万 ≤ M < 500 万	0.30%
M ≥ 500 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 < 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。

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)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费、律师费和诉讼费、仲裁费；
- 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。

## 第十五部分 对招募说明书更新部分的说明

永赢丰益债券型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：

1. 更新了重要提示的部分信息;
2. 更新了基金管理人的部分信息;
3. 更新了基金托管人的部分信息;
4. 更新了相关服务机构的部分信息;
5. 更新了基金募集的部分信息;
6. 更新了基金合同生效的部分信息;
7. 更新了基金份额申购和赎回的部分信息;
8. 更新了投资组合报告, 数据截止日期为2017年6月30日;
9. 更新了基金的业绩部分, 数据截止日期为2017年6月30日;
10. 更新了基金托管协议的内容摘要的部分信息;
11. 在“其他应披露事项”一章, 新增了本基金自2016年12月6日至2017年8月16日发布的有关公告。

永赢基金管理有限公司

2017年9月30日