

**永赢稳益债券型证券投资基金  
2016年年度报告摘要**

**2016年12月31日**

**基金管理人：永赢基金管理有限公司**

**基金托管人：兴业银行股份有限公司**

**送出日期：2017年3月31日**

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月29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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。本报告中财务资料经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢稳益债券型证券投资基金
基金简称	永赢稳益债券
基金主代码	002169
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月2日
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
报告期末基金份额总额	3,089,555,812.51
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券资产，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、信用债策略、回购交易套利策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态调整债券投资组合。</p> <p>1、久期策略</p> <p>本计划将通过自上而下的组合久期管理策略，以实现组合利率风险的有效控制。本计划将根据对宏观经济周期所处阶段及其它相关因素的研判调整组合久期。如果预期利率下降，本计划将增加组合的久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本计划将缩短组合的久期，以减小债券价格下降带来的风险。</p> <p>2、收益率曲线策略</p> <p>本基金将综合考察收益率曲线和信用利差曲线，通过预期收益率曲线形态变化和信用利差曲线走势来调整</p>

投资组合的头寸。

在考察收益率曲线的基础上，本基金将确定采用集中策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变和不同期限信用债券的相对价格变化中获利。一般而言，当预期收益率曲线变陡时，本基金将采用集中策略；当预期收益率曲线变平时，将采用哑铃策略；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采用梯形策略。

### 3、信用债策略

信用债策略是本基金债券投资的核心策略。本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。具体的投资策略包括：

（1）自上而下与自下而上的分析相结合的策略。自上而下即从宏观经济、债券市场、机构行为等角度分析，制定久期、类属配置策略，选择投资时点；自下而上即寻找相对有优势和评级上调概率较大的公司，制定个券选择策略；

（2）相对投资价值判断策略：根据对同类债券的相对价值判断，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的债券，减持相对高估、价格将下降的债券。由于利差水平受流动性和信用水平的影响，因此该策略也可扩展到新老券置换、流动性和信用的置换，即在相同收益率下买入近期发行的债券或是流动性更好的债券，或在相同外部信用级别和收益率下，买入内部信用评级更高的债券；

（3）信用风险评估：信用债收益率是在基准收益率基础上加上反映信用风险收益的信用利差。基准收益率主要受宏观经济政策环境的影响，而信用利差收益率主要受该信用债对应信用水平的市场信用利差曲线以及该信用债本身的信用变化的影响。债券发行人自身素质的变化，包括公司产权状况、法人治理结构、管

理水平、经营状况、财务质量、抗风险能力等的变化将对信用级别产生影响。

本基金管理人将利用内部评级系统来对信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差进行全面的分析。该系统包含定性评级、定量打分以及条款分析等多个不同层面。定性评级主要关注股权结构、股东实力、行业风险、历史违约及或有负债等；定量打分系统主要考察发债主体的财务实力。目前基金管理人共制定了包括煤炭、钢铁、电力、化工等24个行业定量财务打分方法，对不同发债主体的财务质量进行量化的分析评估；条款分析系统主要针对有担保的长期债券，通过分析担保条款、担保主体的长期信用水平，并结合担保的情况下对债项做出综合分析。

#### 4、回购套利策略

回购套利策略是本基金重要的操作策略之一，把信用产品投资和回购交易结合起来，基金管理人根据信用产品的特征，在信用风险和流动性风险可控的前提下，或者通过回购融资来博取超额收益，或者通过回购不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。

#### 5、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。

#### 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。
业绩比较基准	一年期定期存款利率（税后）+1.2%
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。

### 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	兴业银行股份有限公司
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	95561
传真	021-51690177	021-62159217

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年12月2日-2015年12月31日
本期已实现收益	167,181,134.82	9,052,275.35
本期利润	104,230,504.42	10,310,703.30
加权平均基金份额本期利润	0.0202	0.0026

本期加权平均净值利润率	2.01%	0.26%
本期基金份额净值增长率	1.49%	0.20%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	-26,041,819.69	10,051,275.78
期末可供分配基金份额利润	-0.0084	0.0017
期末基金资产净值	3,063,513,992.82	6,012,759,572.46
期末基金份额净值	0.992	1.002
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	1.70%	0.20%

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。

## 3.2 基金净值表现

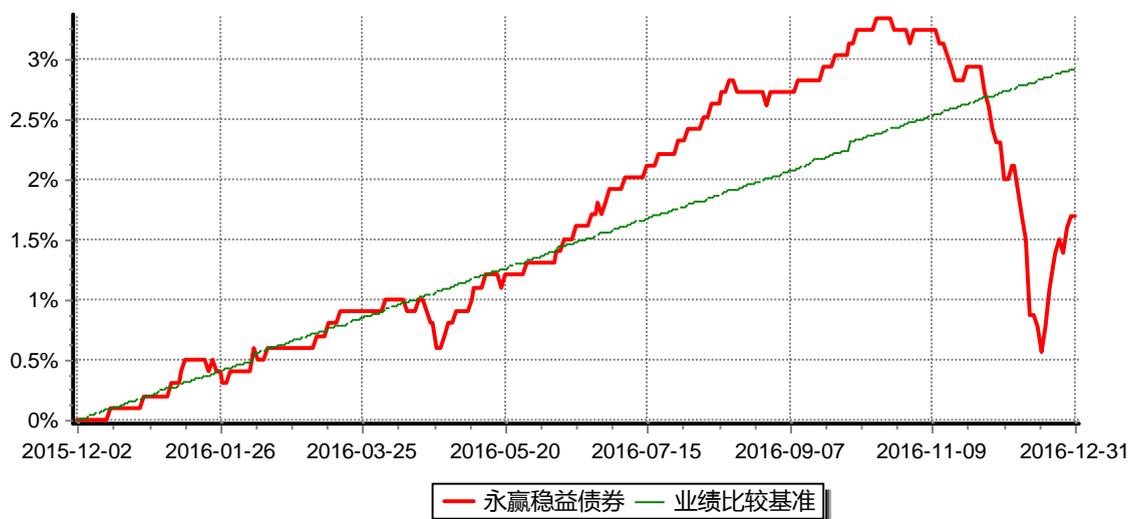
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-1.29%	0.13%	0.68%	—	-1.97%	0.13%
过去六个月	-0.11%	0.10%	1.36%	—	-1.47%	0.10%
过去一年	1.49%	0.08%	2.70%	—	-1.21%	0.08%
自基金合同生效日起至今（2015年12月02日-2016年12月31日）	1.70%	0.08%	2.92%	—	-1.22%	0.08%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

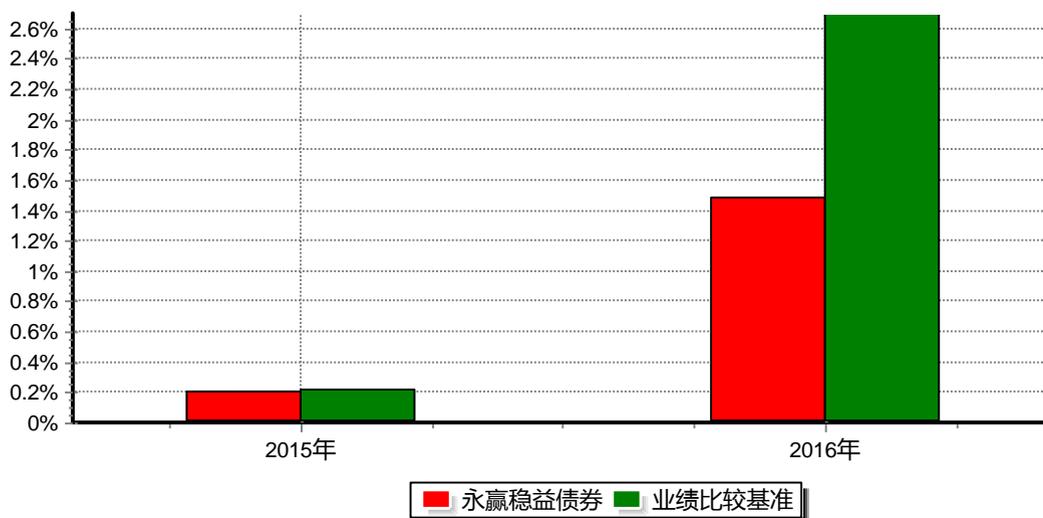
2、本基金业绩比较基准为一年期定期存款利率（税后）+1.2%。

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



注：本基金在六个月建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：图中列示的2015年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期12月2日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	0.250	20,158.78	140,712,871.07	140,733,029.85	

2015年	—	—	—	—	
合计	0.250	20,158.78	140,712,871.07	140,733,029.85	

## § 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

本基金管理人---永赢基金管理有限公司于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，本基金管理人于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）。

截止2016年12月31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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
祁洁萍	固定收益总监	2015年12月2日	—	9	硕士，CFA，9年固定收益研究投资经验，曾任平安证券研究所债券分析师；光大证券证券投资总部投资经理、执行董事；现任永赢基金管理有限公司固定收益投资总监。

注：1、任职时间和离任日期一般情况下指本基金管理人作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日期即任职，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、《永赢稳益债券型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 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

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

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

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，本基金管理人还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银

行间市场开展独立、公平的询价，并由监察稽核部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后审核，确保交易得到公平和公允的执行。对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，投资经理须提出申请并阐明具体原因，交由交易总监及监察稽核总监进行严格的公平性审核；（4）严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外）。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的不同投资组合之间的同日反向交易，相关投资经理须向风险管理委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面，监察稽核部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行业股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，监察稽核部在每个季度的《公平交易报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

#### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、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。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2016年GDP同比增速6.7%，较2015年同比回落0.2个百分点，经济表现整体前低后高，至2016年年底，经济已有企稳迹象。央行在一季度降准0.5个百分点，此后未有降准

降息政策，而是通过MLF、OMO等工具向市场投放流动性。全年流动性整体平稳，但存在时点性的冲击，全年7天银行间质押式回购加权利率均值2.55%，较上年下行37BP。三季度开始，央行开始注重资产泡沫，并重启14天逆回购，通过投放资金期限上的调整来开启市场自发降杠杆的过程。债券市场开始调整，尤其进入12月份，资金面异常紧张，7天回购利率一度超过8%，12月国开债收益率曲线整体上移超过30BP。永赢稳益增加短期资产配置比例，短融与同业存单合计占比由28%增加至41%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，永赢稳益净值累计单位净值增长率1.49%，同期业绩比较基准（一年期定期存款利率(税后)+1.2%）增长2.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年三季度开始，货币流动性收缩已经开始。虽然存款利率的变动尚未出现，但是货币市场利率整体的利率出现了上行。短期内，宏观经济似有企稳的迹象，四季度GDP同比增长6.8%，较上季度回升0.1个百分点。PPI同比增速连续5个月正增长，在上游产品价格带动下，工业企业利润回升明显。结合企业中长期贷款回升明显，我们判断，需求层面正在缓慢复苏，对应未来一个季度实体经济需求或将大体保持稳定。

央行四季度货币政策报告明确提出抑制资产泡沫，防止资金“以钱炒钱”，暗示央行近期重点关注金融杠杆的政策重心。未来金融行业去杠杆进度或是市场关注点，在去杠杆环境下，市场资金价格中枢难以有效下降。债券市场经过近期的快速调整，已经开始满足保险等配置户的要求，但短期难有基本面与资金面的支撑，故趋势性机会仍需等待。

#### 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，若基金合

同生效不满3个月可不进行收益分配。2016年3月18日，本基金进行了利润分配，每10份基金份额分红0.06元，共计分配利润36,006,622.51元；2016年4月21日，本基金进行了利润分配，每10份基金份额分红0.03元，共计分配利润18,110,975.70元；2016年5月31日，本基金进行了利润分配，每10份基金份额分红0.03元，共计分配利润18,159,345.83元；2016年7月8日，本基金进行了利润分配，每10份基金份额分红0.03元，共计分配利润18,063,778.10元；2016年8月18日，本基金进行了利润分配，每10份基金份额分红0.10元，共计分配利润50,392,307.71元。符合基金合同的约定。

#### **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**

自2016年6月21日至2016年8月9日期间内、2016年9月19日至2016年11月18日期间内以及2016年12月2日至2016年12月30日期间内本基金存在超过连续二十个工作日基金份额持有人数量少于二百人的情形。

### **§ 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**

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### **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**

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查、未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### **§ 6 审计报告**

本基金2016年年度财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册

会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：永赢稳益债券型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,305,039.75	4,812,908,861.64
结算备付金		19,510,017.13	—
存出保证金		24,435.04	—
交易性金融资产	7.4.7.2	3,909,333,750.00	1,187,261,000.00
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		3,544,456,000.00	1,187,261,000.00
资产支持证券投资		364,877,750.00	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	49,604,867.78	13,928,138.62
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		3,980,778,109.70	6,014,098,000.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		915,228,402.15	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		2,086.68	98.42
应付管理人报酬		884,390.06	982,782.49
应付托管费		294,796.69	327,594.19
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	29,879.53	5,225.00
应交税费		—	—
应付利息		534,561.77	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	290,000.00	22,727.70
负债合计		917,264,116.88	1,338,427.80
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,089,555,812.51	6,001,449,868.76
未分配利润	7.4.7.10	-26,041,819.69	11,309,703.70
所有者权益合计		3,063,513,992.82	6,012,759,572.46
负债和所有者权益总计		3,980,778,109.70	6,014,098,000.26

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值0.992元，基金份额总额3,089,555,812.51份。

2、本基金合同于2015年12月2日生效，上年度可比期间自2015年12月2日至2015年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：永赢稳益债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至	上年度可比期间 2015年12月2日(基金
-----	-----	------------------	--------------------------

## 永赢稳益债券型证券投资基金2016年年度报告摘要

		2016年12月31日	合同生效日)至2015年 12月31日
<b>一、收入</b>		135,795,824.82	11,649,432.68
1.利息收入		178,321,605.12	10,390,993.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,529,551.21	9,283,435.87
债券利息收入		143,416,867.51	1,010,544.08
资产支持证券利息收入		22,258,564.08	—
买入返售金融资产收入		1,116,622.32	97,013.88
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,366,009.23	—
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—	—
基金投资收益	7.4.7.13	—	—
债券投资收益	7.4.7.14	20,479,180.24	—
资产支持证券投资收益		-1,113,171.01	—
贵金属投资收益	7.4.7.15	—	—
衍生工具收益	7.4.7.16	—	—
股利收益	7.4.7.17	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-62,950,630.40	1,258,427.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,058,840.87	10.90
<b>减：二、费用</b>		31,565,320.40	1,338,729.38
1. 管理人报酬		15,595,878.12	982,782.49
2. 托管费		5,198,626.02	327,594.19
3. 销售服务费		—	—

4. 交易费用	7.4.7.20	78,432.17	5,225.00
5. 利息支出		10,206,251.68	—
其中: 卖出回购金融资产支出		10,206,251.68	—
6. 其他费用	7.4.7.21	486,132.41	23,127.70
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		104,230,504.42	10,310,703.30
减: 所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		104,230,504.42	10,310,703.30

注: 本基金合同于2015年12月2日生效, 上年度可比期间自2015年12月2日至2015年12月31日。

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 永赢稳益债券型证券投资基金

本报告期: 2016年1月1日至2016年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31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)	6,001,449,868.76	11,309,703.70	6,012,759,572.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	104,230,504.42	104,230,504.42
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)	-2,911,894,056.25	-848,997.96	-2,912,743,054.21
其中: 1.基金申购款	140,794,999.73	299,072.20	141,094,071.93
2.基金赎回款	-3,052,689,055.98	-1,148,070.16	-3,053,837,126.14
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)	—	-140,733,029.85	-140,733,029.85
五、期末所有者权益	3,089,555,812.51	-26,041,819.69	3,063,513,992.82

项目	上年度可比期间		
	2015年12月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
（基金净值）			
一、期初所有者权益(基金净值)	202,152,537.84	—	202,152,537.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	10,310,703.30	10,310,703.30
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)	5,799,297,330.92	999,000.40	5,800,296,331.32
其中：1.基金申购款	5,799,298,422.19	999,001.00	5,800,297,423.19
2.基金赎回款	-1,091.27	-0.60	-1,091.87
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)	6,001,449,868.76	11,309,703.70	6,012,759,572.46

注：本基金合同于2015年12月2日生效，上年度可比期间自2015年12月2日至2015年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

芦特尔

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

永赢稳益债券型证券投资基金（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）2594号《关于准予永赢稳益债券型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11月25日到2015年11月30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\_B12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12月2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202,152,348.81元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币189.03元，以上收到的实收基金(本息)共计人民币202,152,537.84元，折合202,152,537.84份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、中小企业私募债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、央行票据、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、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%；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%。

本基金的业绩比较基准为：一年期定期存款利率（税后）+1.2%。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 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。

## 7.4.5 税项

### 7.4.5.1 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以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017年7月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金管理人的股东、基金代销机构
利安资金管理公司（“利安资金”）	基金管理人的股东
员工股东	基金管理人的股东

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。

### 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

#### 7.4.7.2 关联方报酬

##### 7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年12月2日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支 付的管理费	15,595,878.12	982,782.49
其中：支付销售机构的 客户维护费	646.78	141.15

注：应支付基金管理人永赢基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值的0.30%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：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.30%/当年实际天数

##### 7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年12月2日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支 付的托管费	5,198,626.02	327,594.19

注：应支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日的基金资产净值的0.10%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：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.10%/当年实际天数

#### 7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.7.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
宁波银行	3,089,415,270.1 2	100.00%	5,999,000,999.0 0	99.96%
员工股东	2,917.72	0.00%	4,067.49	0.00%

##### 7.4.7.5 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12月31日	上年度可比期间 2015年12月2日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
-------	-----------------------------	--

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行活期存款	2,305,039.75	1,167,523.50	262,908,861.64	399,408.22

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.8 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额665,228,402.15元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150210	15国开10	2017-01-05	102.55	2,000,000	205,100,000.00
111680808	16邯郸银行CD210	2017-01-05	98.95	2,290,000	226,595,500.00
111696376	16台州银行CD007	2017-01-04	98.34	2,090,000	205,530,600.00
150221	15国开21	2017-01-06	99.03	480,000	47,534,400.00

合计				6,860,000	684,760,500.00
----	--	--	--	-----------	----------------

#### 7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额250,000,000.00元，于2017年1月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.9.1 公允价值

###### 7.4.9.1.1 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。

###### 7.4.9.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.9.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2016年12月31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0.00元，属于第二层次的余额为人民币3,909,333,750.00元，属于第三层次余额为人民币0.00元（于2015年12月31日，第一层次的余额为人民币0.00元，属于第二层次的余额为人民币1,187,261,000.00元，属于第三层次余额为人民币0.00元）。

###### 7.4.9.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### 7.4.9.1.2.3 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。

##### 7.4.9.2 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。

##### 7.4.9.3 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。

#### 7.4.9.4 财务报表的批准

本财务报表已于2017年3月27日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	3,909,333,750.00	98.21
	其中：债券	3,544,456,000.00	89.04
	资产支持证券	364,877,750.00	9.17
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	21,815,056.88	0.55
7	其他各项资产	49,629,302.82	1.25
8	合计	3,980,778,109.70	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	160,000,000.00	5.22
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,666,011,000.00	54.38
	其中：政策性金融债	919,391,000.00	30.01
4	企业债券	303,294,000.00	9.90
5	企业短期融资券	189,927,000.00	6.20
6	中期票据	142,622,000.00	4.66
7	可转债	—	—
8	同业存单	1,082,602,000.00	35.34
9	其他	—	—
10	合计	3,544,456,000.00	115.70

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111680808	16邯郸银行CD210	3,800,000	376,010,000.00	12.27
2	1520073	15盛京银行二级	3,000,000	299,400,000.00	9.77
3	111696858	16鹿城农商银行CD070	3,000,000	287,970,000.00	9.40
4	1620003	16杭州银行债	2,500,000	245,800,000.00	8.02
5	111696376	16台州银行	2,300,000	226,182,000.00	7.38

		CD007			
--	--	-------	--	--	--

### 8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	权证名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1689128	16旭越2A2	675,000	67,088,250.00	2.19
2	1689180	16开元2A3	500,000	49,730,000.00	1.62
3	1689179	16开元2A2	500,000	48,465,000.00	1.58
4	1689171	16居融1A	500,000	40,310,000.00	1.32
5	1689188	16金信1A2	500,000	38,540,000.00	1.26
6	061607001	16湖南公积金1A	400000	27,852,000.00	0.91
7	1689189	16金信1A3	200,000	19,816,000.00	0.65
8	1589209	15京诚1B	160,000	15,996,800.00	0.52
9	1589260	15龙元1B	150,000	14,989,500.00	0.49
10	1589282	15湘元3B	130,000	12,979,200.00	0.42

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

**8.12.2**

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。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	24,435.04
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	49,604,867.78
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	49,629,302.82

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

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	占总份	持有	占总份

		份额	额比例	份额	额比例
187	16,521,688.84	3,089,415,270.1 2	100.00 %	140,542.39	—

## 9.2 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	3,312.89	0.00%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年12月2日)基金份额总额	202,152,537.84
本报告期期初基金份额总额	6,001,449,868.76
本报告期基金总申购份额	140,794,999.73
减：本报告期基金总赎回份额	3,052,689,055.98
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	3,089,555,812.51

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金的基金份额持有人大会已于2016年9月1日在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）以现场方式召开。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本基金基金份额持有人大会于2016年9月1日通过了《关于调整永赢稳益债券型证券投资基金赎回费率的议案》，本次大会决议自该日起生效。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### (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。

经永赢基金管理有限公司第二届董事会第一次会议审议通过，聘任马宇晖先生担任永赢基金董事长职务。本基金管理人已于2016年12月16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二届董事会第二次会议审议通过，聘任芦特尔先生担任永赢基金总经理职务。本基金管理人已于2016年12月8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

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。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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。

## 11.5 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。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为90,000.00元。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
信达证券	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。

#### 11.7.2 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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
信达证券	202,142,089.04	100.00%	15,239,300,000.00	100.00%	—	—

永赢基金管理有限公司  
二〇一七年三月三十一日