

永赢瑞益债券型证券投资基金

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 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日期:2017年08月02日

1.1 重要提示 基金管理人的董事、监事和高级管理人员均不存在被监管机构处罚的情况... 基金管理人承诺不以基金资产为任何个人或机构提供担保...

2.1 基金基本情况 基金名称:永赢瑞益债券型证券投资基金 基金代码:004289 基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日期:2017年08月02日

2.2 基金产品说明 投资目标:本基金为债券型基金,投资于具有良好流动性的金融工具,在严格控制投资风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报...

2.3 基金管理人及基金托管人 名称: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 法定代表人:陈震

2.4 信息披露方式 基金管理人网址:www.ywyfunds.com 基金信息披露网站:www.ywyfunds.com

3.1 主要会计数据和财务指标 3.1.1 期间数据和指标 报告期:2018年06月30日

Table with columns: 指标名称, 本报告期末, 本报告期初, 本报告期末比上年末增减, 本报告期末比上年末增减幅度

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... 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 期间:2018年06月30日

Table with columns: 期间, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额

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... 3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准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。 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情况

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》... 截至2018年6月30日,本基金管理人共管理16只开放式证券投资基金...

4.1.2 基金基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1. 任职日期和离任日期一般指公告作出决定之日... 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。

4.3 管理人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...

Table with columns: 项目, 2018年06月30日, 2017年12月31日, 2018年06月30日较2017年12月31日增减

Table with columns: 项目, 2018年06月30日, 2017年12月31日, 2018年06月30日较2017年12月31日增减

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:

Table with columns: 姓名, 职务, 签字

6.4 报表附注 6.4.1 基金基本情况 永赢瑞益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证监会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2016)1822号《关于准予永赢瑞益债券型证券投资基金注册的批复》核准...

根据基金管理人永赢基金管理有限公司于2017年4月25日发布的《关于永赢瑞益债券型证券投资基金修改投资范围、调整基金赎回费率并修改基金合同及托管协议部分条款的公告》... 本基金投资于股票、债券、资产支持证券、金融衍生品、权证、股指期货、国债期货、大宗商品等金融工具...

变更后,本基金的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、政府支持债、资产支持证券、证券公司短期公司债券、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和中国证监会允许基金投资的其他金融工具... 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... 本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%...

6.4.2 会计政策的编制说明 本基金财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后续修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制... 6.4.3 遵循企业会计准则及其他相关规定的说明 本基金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2018年6月30日的财务状况以及自2018年1月1日起至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 会计估计变更的说明 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的说明 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 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更正情况。 6.4.6 税项 6.4.6.1 印花税 经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3%调整为1%...

6.4.6.2 增值税 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征增值税试点的通知》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... 6.4.6.3 企业所得税 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买入返售金融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...

6.4.6.4 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加 根据财政部、国家税务总局财税[2016]40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,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人作为增值税纳税人... 6.4.6.5 土地增值税 根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融同业往来相关增值税政策补充规定的通知》的规定,金融同业开展的买入返售金融同业业务、同业存单、同业存放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...

6.4.6.6 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加 根据财政部、国家税务总局财税[2016]40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,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人作为增值税纳税人... 6.4.6.7 房产税 根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融同业往来相关增值税政策补充规定的通知》的规定,金融同业开展的买入返售金融同业业务、同业存单、同业存放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...

6.4.6.8 印花税 根据财政部、国家税务总局财税[2008]103号文《关于股票交易印花税有关问题的通知》的规定,自2008年4月24日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变... 6.4.6.9 企业所得税 根据财政部、国家税务总局财税[2016]40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买入返售金融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...

6.4.6.10 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加 根据财政部、国家税务总局财税[2016]40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,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人作为增值税纳税人... 6.4.6.11 土地增值税 根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融同业往来相关增值税政策补充规定的通知》的规定,金融同业开展的买入返售金融同业业务、同业存单、同业存放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...

2018年半年度报告摘要

计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额... 6.1.7 关联方关系 6.1.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系关联方发生变化情况 2018年1月,本公司23名原自然人股东将其所持公司股权全部转让给利安投资管理公司(Lion Global Investors Limited)...

6.1.7.2 本报告期未持有股票 6.1.7.3 本报告期末未持有股票 6.1.7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 6.1.7.5 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 6.1.7.6 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

6.1.7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合 6.1.7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合 6.1.7.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 6.1.7.10 期末前十名未转股中存在流通受限情况的说明

6.1.8 股票买卖 6.1.8.1 股票买卖 6.1.8.2 股票买卖 6.1.8.3 股票买卖 6.1.8.4 股票买卖 6.1.8.5 股票买卖 6.1.8.6 股票买卖 6.1.8.7 股票买卖 6.1.8.8 股票买卖 6.1.8.9 股票买卖 6.1.8.10 股票买卖

6.1.9 股指期货投资 6.1.9.1 股指期货投资 6.1.9.2 股指期货投资 6.1.9.3 股指期货投资 6.1.9.4 股指期货投资 6.1.9.5 股指期货投资 6.1.9.6 股指期货投资 6.1.9.7 股指期货投资 6.1.9.8 股指期货投资 6.1.9.9 股指期货投资 6.1.9.10 股指期货投资

6.1.10 国债期货投资 6.1.10.1 国债期货投资 6.1.10.2 国债期货投资 6.1.10.3 国债期货投资 6.1.10.4 国债期货投资 6.1.10.5 国债期货投资 6.1.10.6 国债期货投资 6.1.10.7 国债期货投资 6.1.10.8 国债期货投资 6.1.10.9 国债期货投资 6.1.10.10 国债期货投资

6.1.11 权证投资 6.1.11.1 权证投资 6.1.11.2 权证投资 6.1.11.3 权证投资 6.1.11.4 权证投资 6.1.11.5 权证投资 6.1.11.6 权证投资 6.1.11.7 权证投资 6.1.11.8 权证投资 6.1.11.9 权证投资 6.1.11.10 权证投资

6.1.12 其他投资 6.1.12.1 其他投资 6.1.12.2 其他投资 6.1.12.3 其他投资 6.1.12.4 其他投资 6.1.12.5 其他投资 6.1.12.6 其他投资 6.1.12.7 其他投资 6.1.12.8 其他投资 6.1.12.9 其他投资 6.1.12.10 其他投资

6.2 投资组合报告 6.2.1 报告期末基金资产组合情况 6.2.1.1 权益类资产 6.2.1.2 固定收益类资产 6.2.1.3 货币市场工具 6.2.1.4 其他资产 6.2.1.5 负债及所有者权益

6.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 6.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 6.2.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合 6.2.2.3 报告期末按行业分类的债券投资组合 6.2.2.4 报告期末按行业分类的权证投资组合

6.2.3 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明细 6.2.3.1 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明细 6.2.3.2 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明细

6.2.4 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债券投资组合 6.2.4.1 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债券投资组合 6.2.4.2 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债券投资组合

6.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合 6.2.5.1 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权证投资组合 6.2.5.2 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权证投资组合

6.2.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 6.2.6.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 6.2.6.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细