

# 永赢基金管理有限公司永赢丰利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

2018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  
二零一八年九月

## 重要提示

永赢丰利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2017年12月8日获中国证券监督管理委员会证监许可(2017)2248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《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人互联网站(www.maxwealthfund.com)进行了公开披露。本基金的基金合同于2018年1月29日正式生效。本招募说明书是对原《永赢丰利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。本基金为债券型证券投资基金,属证券投资基金中的中低风险品种,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,在有效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,从而可能给基金份额带来损失。

本基金在募集过程中(指本基金募集完成进行验资时)及成立运作后,单一投资者的持有基金份额占本基金总份额的比例不得达到或者超过50%(运作过程中,因基金份额赎回等情形导致被动超标除外),且基金管理人承诺后续不存在通过一致行动人等方式变相规避50%集中度要求的情形。

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,基金管理人并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,根据自身投资目标、投资期限、投资经验、资产状况等判断本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售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,由投资者自行承担。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2018年7月29日,投资组合报告为2018年第二季度报告,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日(本招募说明书的财务资料未经审计)。

## 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  
设立日期: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。

2018年1月25日,公司完成增资,注册资本由人民币2亿元增加至人民币9亿元。

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643,410,000元,占公司注册资本的71.49%;利安资产管理公司(Lion Global Investors Limited)出资人民币256,590,000元,占公司注册资本的28.51%;

基金管理人无任何处罚记录。

### (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,学士,12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。

章宁女士,董事,硕士。曾任宁波银行股份有限公司金融市场部总经理助理、副总经理、业务发展部高级副经理;宁波银行余姚支行行长助理(零售公司)、余姚支行副行长(零售公司)、余姚支行副行长(个人银行);宁波银行个人银行 部总经理助理;宁波银行北京分行副行长。现任宁波银行个人银行部副总经理(主持工作)。

陈首平先生,董事,学士,新加坡籍。曾任新加坡政府投资公司投资经理、货币市场主管;华侨银行有限公司资产负债管理部总经理。现任华侨银行有限公司执行副总裁、财务总监、利安资产管理公司董事。

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。现任华侨永亨银行有限公司中国区首席风险官。

卢特尔先生,董事,学士,15 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。

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。曾任职于上海建设工程、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,现任暖资产管理股份有限公司总经理、投资总监。

#### 2.监事会成员

毛隽女士,监事长,博士,21年证券相关从业经验,曾任民生银行上海分行国际部高级客户经理;上海银行外滩支行市场部副经理、黄浦支行支行风险管理部经理;宁波银行上海分行大中企业一部总经理、徐汇支行行长、上海分行行长助理、副行长;现任永赢基金管理有限公司监事会主席。

姜丽荣先生,监事,硕士,6 年相关行业从业经验,曾任宁波银行总行金融 市场部同业部销售岗、非银同业部高级经理助理、高级副经理;现任永赢基金 管理有限公司机构部副总监。

狄泽先生,监事,学士,12 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内部审计部副总监,兼风险管理部副总监,兼 合规部副总监。

#### 3.管理层成员

卢特尔先生,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,13 年相关行业从业经验,曾任职锦天城律师事务所;泰森律师事务所律师;永赢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,兼永赢资产 管理有限公司监事。

复旦大学经济学学士,硕士,9 年证券相关从业经验,曾任宁波银行金融市 场部固定收益交易员,从事债券及固定收益衍生品自营交易、自营投资管理、流 动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益总监助理。

#### 5.投资决策委员会成员

投资决策委员会由下述委员组成:公司总经理卢特尔先生担任主任委员,总经理助理徐翔先生、总经理助理兼权益投资总监李永兴先生、固定收益投资总监助理乔嘉麒先生担任执行委员。

督察长、风险管理部负责人、合规部负责人、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)基金托管人概况

名称:兴业银行股份有限公司  
住所:福建省福州市湖东路154号  
办公地址:上海市江宁路168号  
法定代表人:高建平  
成立日期: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  
基金托管资格文及文号:中国证监会证监基金字[2006]174号  
托管部门联系人:吴玉婷  
电话:021-52629999  
传真:021-62159217  
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2017年12月31日,兴业银行资产总额达6.42万亿元,实现营业收入1399.75亿元,全年实现归属于母公司股东的净利润572.00亿元。根据2017年英国《银行家》杂志“全球银行1000强”排名,兴业银行按一级资本排名第28位,按总资产排名第30位,跻身全球银行30强。按照美国《财富》杂志“世界500强”最新榜单,兴业银行以426.216亿美元总营收排名第230位。同时,过去一年在国内外权威机构组织的各项评比中,先后获得“亚洲卓越商业银行”“年度最佳股份制银行”“中国最受尊敬企业”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、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、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]174号。截至2018年6月30日,兴业银行已托管开放式基金239只,托管基金财产规模7959.6亿元。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、销售机构

#### (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)6887 8782、6887 8773  
联系人:吴亦弓  
客服热线:(021)5169 0111  
网址:www.maxwealthfund.com

#### (二)代销机构

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

### 二、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:曹丽娜  
三、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:屠娜、沈国兴

四、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号东方广场安永大楼16层  
办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼  
法定代表人:毛贻钧  
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:永赢丰利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,在有效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,包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、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。

本基金将综合分析各类别资产对收益情况、利率变化状况、信用风险评级、流动性风险管理等因素来确定各类资产配置比例,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。

### 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。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

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设计理念,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。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的中低风险基金品种,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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17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2018年6月30日。

### 1、报告期末基金资产组合情况

| 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            | 656,265,000.00   | 26.06        |
|    | 其中:债券             | 636,327,000.00   | 25.26        |
|    | 资产支持证券            | 19,938,000.00    | 0.79         |
| 4  | 贵金属投资             | --               | --           |
| 5  | 金融衍生品投资           | --               | --           |
| 6  | 买入返售金融资产          | 677,724,616.69   | 26.96        |
|    | 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      | 1,162,796,111.59 | 46.24        |
| 8  | 其他资产              | 19,115,904.37    | 0.76         |
| 9  | 合计                | 2,514,891,632.66 | 100.00       |

### 2、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 3、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5、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  | 国债债券      | --             | --           |
| 2  | 央行票据      | --             | --           |
| 3  | 金融债券      | 390,792,000.00 | 15.56        |
|    | 其中:政策性金融债 | 390,792,000.00 | 15.56        |
| 4  | 企业债券      | --             | --           |
| 5  | 企业短期融资券   | --             | --           |
| 6  | 中期票据      | --             | --           |
| 7  | 可转债(可交换债) | --             | --           |
| 8  | 同业存单      | 244,545,000.00 | 9.73         |
| 9  | 其他        | --             | --           |
| 10 | 合计        | 636,327,000.00 | 26.28        |

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五名债券投资明细

| 序号 | 证券代码      | 债券名称            | 数量(张)     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 170211    | 17国债11          | 2,400,000 | 240,312,000.00 | 9.56         |
| 2  | 080214    | 08国债14          | 1,000,000 | 100,330,000.00 | 3.99         |
| 3  | 111815079 | 18 民生 银行 CD309  | 1,000,000 | 97,830,000.00  | 3.89         |
| 4  | 111819106 | 18 晋 丰 银行 CD305 | 1,000,000 | 97,810,000.00  | 3.89         |
| 5  | 111819437 | 18 嘉 京 银行 CD123 | 600,000   | 48,906,000.00  | 1.96         |

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十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量(份)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 146723 | 17国债1A1 | 200,000 | 19,938,000.00 | 0.79         |

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投资。

9、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。

10、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 12. 投资组合报告附注

(1) 本报告期内本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) 本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

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | --            |
| 2  | 应收证券清算款 | --            |
| 3  | 应收利息    | --            |
| 4  | 应收申购款   | 19,115,904.37 |
| 5  | 其他应收款   | --            |
| 7  | 其他      | --            |
| 8  | 合计      | 19,115,904.37 |

(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。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十二部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2018年6 月 30 日,并经基金托管人复核。基金管理人依照恪尽职守、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。

### 永赢丰利债券A

| 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 | 业绩比较基准收益标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-----------------------|--------|-----------|------------|--------------|-------|--------|
| 2018年1月29日至2018年6月30日 | 1.14%  | 0.01%     | 1.01%      | 0.10%        | 0.13% | -0.09% |

### 永赢丰利债券C

| 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 | 业绩比较基准收益标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-----------------------|--------|-----------|------------|--------------|-------|--------|
| 2018年1月29日至2018年6月30日 | 1.08%  | 0.01%     | 1.01%      | 0.10%        | 0.07% | -0.09% |