永赢基金管理有限公司永赢量化混合型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

（2016年第1号）

基金管理人：永赢基金管理有限公司
基金托管人：中信证券股份有限公司
二〇一六年三月

重要提示

永赢量化混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）于2015年6月17日获中国证券监督管理委员会证监许可（2015）1273号文准予注册募集。

本招募说明书是对原《永赢量化混合型发起式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。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为混合型证券投资基金，通过灵活应用多种绝对收益策略，对冲市场系统性风险，因此除面临普通混合型基金风险外还包括本基金所特有的风险。首先，本基金的市场中性投资策略是否能对冲市场系统性风险具有不确定性；其次，本基金的主要投资工具股指期货还可能引发的基差风险、杠杆风险、对手方风险、盯市结算风险等。此外，在本基金开放申购、赎回业务前，基金份额持有人还面临不能赎回基金份额的风险。

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。

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，在投资者作出投资决策后，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2016年2月6日，投资组合报告为2015年4季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31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

住所：浙江省宁波市江东区中山东路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

设立日期：2013年11月7日

法定代表人：罗维开

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，公司的股权结构调整为：

宁波银行股份有限公司出资人民币135,000,000元，占公司注册资本的67.5%；

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%；

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%；

赵鹏出资人民币5,500,000元，占公司注册资本的2.750%；

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3,300,000元，占公司注册资本的1.650%；

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%；

宋聿飞出资人民币700,000元，占公司注册资本的0.350%；

姜灵灵出资人民币300,000元，占公司注册资本的0.150%；

张文博出资人民币 500,000元，占公司注册资本的0.250%

陈晟出资人民币700,000元，占公司注册资本的0.350%；

狄泽出资人民币450,000元，占公司注册资本的0.225%；

解天骁出资人民币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%；

徐一出资人民币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%；

张振出资人民币200,000元，占公司注册资本的0.100%；

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%；

蔡霖出资人民币200,000元，占公司注册资本的0.100%；

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

罗维开先生，董事长，硕士，经济师。21年金融业从业经验，曾任宁波银行股份有限公司天源支行业务科科长、天源支行副行长、财务会计部总经理、行长助理、副行长；现任宁波银行副行长。

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。

宋宜农先生，董事，硕士。20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总经理，兼永赢资产管理有限公司董事、总经理。

赵楠先生，董事，硕士。18年证券基金研究投资经验，曾任中信基金管理有限公司研究总监、投委会委员；中信建投证券公司自营部执行总经理；方正富邦基金管理有限公司投资总监。现任永赢基金管理有限公司副总经理，兼永赢资产管理有限公司副总经理。

徐英女士，独立董事，学士。曾任海南汇通国际信托投资公司副总裁、董事长；长城证券有限责任公司总裁；景顺长城基金管理有限公司董事长。现任新华资产管理有限公司副董事长。

陈忠阳先生，独立董事，博士，教授。曾任人民大学计划经济系团总支书记，现任教于人民大学财政金融学院。

商海粟先生，独立董事，学士。曾在光大国信旅游公司、北京金融街物业管理公司任职。现任北京市世联新纪元律师事务所合伙人律师，主要从事公司、不动产相关法律事务。

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。

徐蔓青先生，监事，硕士。13年相关行业从业经验，曾任景顺长城基金管理有限公司IT经理；方正富邦基金管理有限公司信息技术总监。现任永赢基金管理有限公司信息技术总监，兼永赢资产管理有限公司副总经理。

李峻先生，监事，硕士。19年金融行业从业经验，曾任职中保信期货公司、中信证券股份有限公司；中关村证券股份有限公司投资经理；中信证券管理有限公司交易总监；华夏基金管理有限公司数量研究员；方正富邦基金管理有限公司交易总监。现任永赢基金管理有限公司交易总监。

3、管理层成员

宋宜农先生，总经理，相关介绍见董事会成员部分内容。

赵楠先生，副总经理，相关介绍见董事会成员部分内容。

田中甲先生，副总经理，硕士。14年金融行业从业经验，曾任中信证券股份有限公司财务会计；中信基金管理有限公司基金会计；天弘基金管理有限公司基金运营部总经理兼公司财务部总经理；方正富邦基金管理有限公司职工监事、基金运营部总监。现任永赢基金管理有限公司副总经理，兼永赢资产管理有限公司董事、副总经理。

赵鹏先生，副总经理，硕士。19年金融行业从业经验，曾任深圳市南山基金管理有限公司董事会秘书兼法律事务经理；汉唐证券有限责任公司法律顾问；景顺长城基金管理有限公司律师兼信息披露负责人；渤海产业投资基金管理有限公司执行董事。现任永赢基金管理有限公司副总经理。

毛慧女士，督察长，学士。10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、本基金基金经理张大木先生。美国Villanova 大学计算机研究生。15年证券从业经验。曾任美国沃顿商学院高级数据分析师，美国巴克莱国际资产管理公司（BGI）投资分析员，博时基金管理有限公司量化分析师，投资经理，现任永赢基金管理有限公司总经理助理兼量化投资总监。

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：公司总经理宋宜农先生、分管投资的副总经理赵楠先生、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、监察稽核总监、交易总监、研究人员可列席，不具有投票权。

分管投资的副总经理为主任委员，负责召集、协调并主持会议。

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）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号

法定代表人：张佑君

成立时间：1995年10月25日

组织形式：股份有限公司（上市）

批准设立机关及批准设立文号：国家工商总局100000000018305

注册资本：人民币壹佰壹拾亿壹仟陆佰玖拾万捌仟肆佰元整

存续期间：无限期

基金托管业务批准文号：《关于核准中信证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可[2014]1044号）

联系人：吴俊文

联系电话：010-60836334

中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）成立于1995年10月25日，前身是中信证券有限责任公司。中信证券于2003年1月6日在上海证券交易所挂牌上市，并于2011年10月6日在香港联交所上市交易。截至2014年9月30日，中信证券总股本为人民币11,016,908,400.00元，第一大股东为中国中信有限公司（持股比例为20.30%）。在证券公司分类评审中，中信证券连续七年获得目前中国证券行业最高级别A类AA级。

截至2014年9月30日，中信证券拥有主要全资子公司6家，分别为中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券国际有限公司、中信期货有限公司、金石投资有限公司、中信证券投资有限公司；拥有主要控股子公司1家，即，华夏基金管理有限公司。根据中国证监会核发的经营业务许可证，公司经营范围包括：证券经纪，证券投资咨询，与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问，证券承销与保荐，证券自营，证券资产管理，融资融券，证券投资基金代销，证券投资基金托管，为期货公司提供中间介绍业务，代销金融产品。中信证券秉承创新和专业化的经营理念，在各项业务领域保持行业的领先地位。

2、主要人员情况

2014年中信证券设立托管部，管理并具体承办基金托管业务。托管部下设产品、估值核算、业务结算、监督稽核、综合等服务。部门员工均具备证券投资基金从业资格，并具有多年金融从业经历，核心业务岗人员均已具备2年以上托管业务相关从业经验。

吴俊文女士，中信证券托管部总经理；西安电子科技大学计算机及应用学学士，2000年6月至2014年6月，担任中信证券清算部执行总经理，主要负责经纪业务、资产管理业务以及自营投资业务的业务运营管理工作，2014年7月起任中信证券托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

中信证券于2014年10月经中国证监会核准获批证券投资基金托管资格。中信证券自取得证券投资基金托管资格以来，秉承“忠于所托，信于所管”的宗旨，严格遵守国家的有关法律法规和监管机构的有关规定，依靠科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的运营系统和专业的服务团队，切实履行资产托管人职责，为投资者提供安全、高效、专业的托管服务。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

中信证券保证托管业务运行严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成运作流程化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，确保托管资产的安全完整，维护基金份额持有人的合法权益，保障托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部控制原则

（1）合法合规原则：内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终；

（2）完整性原则：托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的岗位和人员；

（3）有效性原则：建立对内控制度及其执行的监督、评价、反馈和完善机制，保证内控制度有效执行；

（4）审慎性原则：托管业务各项业务活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产的安全与完整；

（5）预防性原则：必须树立“预防为主”的管理理念，控制风险发生的源头，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生；

（6）及时性原则：内部控制制度的制定应当具有前瞻性，并且随着托管部经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变进行及时的修改或完善，发现问题，要及时处理，堵塞漏洞；

（7）独立性原则：托管人托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价小组必须独立于内控制度的制定和执行小组；

（8）相互制约原则：托管部的内部机构和岗位设置应当权责分明、相互制衡；

3、内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《非银行金融机构开展证券投资基金托管业务暂行规定》等法律法规的规定，中信证券制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管业务的规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全以及高效。

主要制度包括《中信证券证券投资基金托管业务管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务内部控制和风险管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务信息披露管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务保密工作管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务会计核算业务管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务清算管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务投资监督管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务资产保管管理办法》、《中信证券基金托管业务从业人员管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务档案管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。通过这些规章制度的建立和实施，做到业务分工合理、业务运行和操作流程化、技术系统完整独立、核心业务相互隔离以及有关信息披露由专人负责，以便勤勉尽责的履行托管义务。

托管业务内部控制的内容主要涉及托管项目、资产保管、资金清算、会计核算和资产估值、投资监督、信息技术系统等重要业务环节的内部控制。基金托管人通过对基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制。同时为了保证和验证内部控制的有效性、完整性，中信证券定期聘请具有证券业务资格的专业会计师事务所，针对基金托管业务的内部控制制度建设与实施情况，开展相关审查与评估，出具评估报告。

托管业务内部控制的主要措施包括：不相容职务分离控制、授权审批控制、财产保护控制、会计系统控制、预算控制、运营分析控制和绩效考评控制等。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

基金托管人依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并根据中国证监会的要求编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

（1）每工作日按时通过监控系统，对各基金投资运作比例等控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并根据具体情况及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的投资指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况以及中国证监会的要求，编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

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：浙江省宁波市江东区中山东路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：罗维开

联系电话：021-51690103

传真：021-51690178

客服热线：021-51690111

联系人：吴亦弓

网址：www.maxwealthfund.com

二、代销机构

（一）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700 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

（二）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号

法定代表人：张佑君

客户服务电话：95548

传真：010-60833799

联系人：李灏

联系电话：010-60838693

网址：www.cs.ecitic.com

（三）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222 号青岛国际金融广场1 号楼20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222 号青岛国际金融广场1 号楼20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：095548

网址：www.citicssd.com

（四）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9 号院1号楼信达金融中心

办公地址：北京市西城区闹市口大街9 号院1号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63080985

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（五）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 层

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

传真：021-64385308

网址：www.1234567.com.cn

（六）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客服热线：400-9908-826

网址：www.citicsf.com

（七）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

客户服务热线：400-8219-301

网址：www.lufunds.com

（八）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：王常青

全国统一客服电话：400-8888-108

公司网站：www.csc108.com

（九）招商证券股份有限公司

住所：深圳市益田路江苏大厦38-46层

法定代表人：宫少林

全国统一客服电话：95565

网站：www.newone.com.cn

第四部分 基金的募集

一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证监会2015年6月17日证监许可（2015）1273号文准予募集注册。

二、基金类别、运作方式及存续期限

1、基金类别：混合型发起式证券投资基金

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金存续期限：不定期

三、基金份额的认购

本基金募集期间每份基金份额的初始面值为人民币1.00元，募集期为2015年7月27日至2015年8月3日。经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的净认购金额为2,997,476,514.14元，折合2,997,476,514.14份。募集资金在募集期间产生的利息为361,313.35元，折合361,313.35份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。本基金募集期间含本息共募集2,997,837,827.49元，有效认购户数为22,799户。

第五部分 基金份额的申购和赎回

二、申购和赎回的开放日及时间

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自2015年11月6日起在相关销售机构开始办理日常申购、赎回业务。

本基金自2016年1月19日起在相关销售机构开始办理日常转换业务。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的起止时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

第六部分 基金投资组合报告

九、基金投资组合报告

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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2016年1月20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至日为2015年12月31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	1,619,183,573.07	69.54
	其中：股票	1,619,183,573.07	69.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	424,460,651.35	18.23
8	其他资产	284,670,063.72	12.23
9	合计	2,328,314,288.14	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,489,074.50	0.37
B	采矿业	39,885,203.08	1.75
C	制造业	731,284,010.24	32.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	89,947,132.26	3.96
E	建筑业	41,438,398.00	1.82
F	批发和零售业	67,366,705.89	2.96
G	交通运输、仓储和邮政业	46,010,101.67	2.02
H	住宿和餐饮业	815,988.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,075,450.66	3.70
J	金融业	300,391,033.50	13.21
K	房地产业	90,502,043.16	3.98
L	租赁和商务服务业	40,348,881.39	1.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	42,538,908.12	1.87
S	综合	36,090,642.60	1.59
	合计	1,619,183,573.07	71.21

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

代码	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	6,252,260	74,964,597.40	3.30
2	600566	济川药业	1,572,499	43,495,322.34	1.91
3	002736	国信证券	2,134,404	42,154,479.00	1.85
4	601166	兴业银行	2,212,983	37,775,619.81	1.66
5	600116	三峡水利	1,492,601	32,389,441.70	1.42
6	600212	江泉实业	2,569,340	31,834,122.60	1.40
7	600531	豫光金铅	1,899,607	31,381,507.64	1.38
8	600562	国睿科技	500,361	31,117,450.59	1.37
9	600518	康美药业	1,804,100	30,579,495.00	1.34
10	600312	平高电气	1,550,154	30,228,003.00	1.33

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1601	IF1601	-600	-661,104,000.00	-20,859,550.63	
IC1601	IC1601	-423	-625,955,400.00	-27,466,455.97	
IC1603	IC1603	-32	-44,899,840.00	1,459,360.00	
IC1602	IC1602	-2	-2,875,040.00	93,400.00	
IC1606	IC1606	-2	-2,640,480.00	104,120.00	
公允价值变动总额合计(元)					-46,669,126.60
股指期货投资本期收益(元)					-160,521,653.40
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-48,493,606.60

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用市场中性策略，利用股指期货对冲市场系统性风险，对冲敞口控制在合同范围内。针对股灾后股指期货市场流动性明显下降，期货、现货之间长期保持贴水状态，本基金管理人密切关注市场动态，时刻跟踪流动性及基差水平，在严格控制本基金投资风险前提下对期货对冲合约进行合理选择。本基金投资于股指期货，剥离系统性风险，大幅降低净值波动率，符合既定的投资政策和投资目标。

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	270,973,626.99
2	应收证券清算款	13,578,589.98
3	应收股利	-
4	应收利息	98,389.24
5	应收申购款	19,457.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	284,670,063.72

（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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

第七部分 基金的业绩

基金业绩截止日为2015年12月31日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、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。

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
2015年8月6日至2015年12月31日	-2.30%	0.22%	0.68%	-	-2.98%	0.22%

注：2015年8月6日为基金合同生效日。

第八部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）开户及交易

投资者可以通过以下方式进行有关的开户、交易业务：

1、在永赢基金管理有限公司的直销网点进行网上或柜台交易。

2、在永赢基金管理有限公司的代销渠道进行网上或柜台交易。

（二）账户信息查询服务

投资者可以通过以下方式进行自助查询及人工咨询：

1、登录永赢基金公司网站。基金持有人可以查询个人账户资料，包括基金持有情况、基金交易明细、基金分红实施情况等。

2、致电客服热线暨自动语音查询系统（021-5169 0111），该系统提供全天候的7×24 小时自动查询服务和工作日 09:00 至 17:30 的人工咨询服务。

3、发送邮件到服务信箱（service@maxwealthfund.com）。

4、本公司的代销渠道和直销网点为投资人提供各类查询服务。

（三）对账单订阅服务

1、投资者可以通过拨打客服热线、网站申请订制（退订）免费的电子对账单。

2、投资者可以通过拨打客服热线获取纸制对账单。

（四）邮件订阅服务

投资者可拨打客服热线、网站申请订制（退订）免费的电子邮件服务。内容包括基金净值、交易确认及相关基金资讯信息等。

（五）短信订阅服务

投资者可拨打客服热线、网站申请订制（退订）免费的手机短信服务。内容包括基金净值、交易确认及相关基金资讯信息等。

（六）客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过客服热线、信函、电邮、传真等方式提出咨询、建议、投诉等需求，基金管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

（七）投资者交流活动

本公司将定期或不定期举办专业研讨会、投资者见面会或其他形式的交流活动，为投资者提供与基金公司进行直接交流的机会。

客服热线：(021)5169 0111（该电话可转人工服务）

传 真：(021)5169 0178

公司网址：htttp://www.maxwealthfund.com

服务信箱：service@maxwealthfund.com

第九部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书（更新）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》、《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》、基金合同及其他有关法律法规的要求，对本招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

(一)变更了基金管理人的部分信息；

(二)更新了基金托管人的部分信息；

(三)更新了代销机构的部分信息；

(四)更新了基金募集的部分信息

(五)更新了基金申购和赎回的部分信息；

(六)更新了投资组合报告，数据截止日期为2015年12月31日；

(七)更新了基金的业绩部分，数据截止日期为2015年12月31日；

(八)更新了对基金份额持有人的服务中部分内容；

(九)在“其他应披露事项”一章，新增了了本基金自2015年8月6日至2016年2月6日发布的有关公告。

永赢基金管理有限公司
2016年3月21日