

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日获得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,通过灵活运用多种对收益策略,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能否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存在引发的基差风险、移仓风险、对手方风险、盯市结算风险等。此外,在本基金开放申购、赎回业务期间,基金份额持有人还面临不能赎回基金份额的风险。

本基金为股票基金,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,基金管理人不能保证基金一定盈利,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,根据自身的投资目标,投资决策,资产配置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本基金。

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,由投资者自行承担。

本招募说明书自基金合同生效之日起,每十二个月进行一次更新,自2016年2月6日,投资说明书公告之日起,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数据未经审计)。

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
成立时间:2013年11月7日

法定代表人:罗维开
联系电话:(021) 5169 0188
传真:(021) 5167 1177
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%;
利安资产管理公司(Lion Global Investors Limited)出资人民币20,000,000元,占公司注册资本的10%;

宋庆良出资人民币9,990,000元,占公司注册资本的4.995%;
田旭出资人民币76,010,000元,占公司注册资本的38.005%;
冯甲申出资人民币5,550,000元,占公司注册资本的2.775%;
毛贻愚出资人民币5,500,000元,占公司注册资本的2.750%;
陈惠出资人民币3,000,000元,占公司注册资本的1.500%;
李俊出资人民币3,300,000元,占公司注册资本的1.650%;
徐睿青出资人民币3,300,000元,占公司注册资本的1.650%;
褚泽秀出资人民币1,000,000元,占公司注册资本的0.500%;
郭泽秀出资人民币700,000元,占公司注册资本的0.350%;
周良子出资人民币600,000元,占公司注册资本的0.300%;
宋庆丰出资人民币450,000元,占公司注册资本的0.225%;
陈南飞出资人民币700,000元,占公司注册资本的0.350%;
姜文灵出资人民币300,000元,占公司注册资本的0.150%;
张灵博出资人民币 500,000元,占公司注册资本的0.250%;
陈汉源出资人民币700,000元,占公司注册资本的0.350%;
刘斌出资人民币450,000元,占公司注册资本的0.225%;
解天锐出资人民币450,000元,占公司注册资本的0.225%;
洪洪均出资人民币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%;
孟祥辉出资人民币300,000元,占公司注册资本的0.150%;
周华出资人民币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%;
陈浩出资人民币200,000元,占公司注册资本的0.100%;
刘顺出资人民币200,000元,占公司注册资本的0.100%;
余润出资人民币200,000元,占公司注册资本的0.100%;
沈望出资人民币100,000元,占公司注册资本的0.050%;
蔡露出资人民币200,000元,占公司注册资本的0.100%;
华霞出资人民币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年金融从业经验,曾任宁波银行股份有限公司天津支行业务科科长、天津支行副行长、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,曾任新加坡华商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管理部经理;新加坡华商银行集团主席办公室主任特别助理,新加坡华商银行集团副总裁,新加坡华商银行集团国际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。

宋宜先生,董事,硕士,20年金融从业经验,曾任长城基金管理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经理;景顺长城基金管理有限公司副总经理兼市场部总监;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长。

魏福生先生,董事,硕士,18年证券基金研究经验,曾任中信基金管理有限公司研究总监、投委会委员;中信建投证券公募自营部执行总经理,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副总裁,景顺长城基金管理有限公司董事,现任华侨资产管理集团有限公司副董事长。陈忠阳先生,独立董事,博士,教授,曾任中国人民大学计划经济系党总支书记,现任教于中国人民大学财政金融学院。

商海梁先生,独立董事,学士,曾在光大国际信托公司、北京金鹰期货资产管理公司任职,现任北京市天银新城新纪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。

陈雁先生,董事,硕士,曾任职于中国工商银行上海市分行机构业务部;金盛人寿险控股有限公司投资部主任;招商银行信托托管部经理;深圳发展银行托管部总经理助理,现任宁波银行资产托管部总经理。

徐睿青先生,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。

李俊先生,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;中信证券资产管理部交易总监;华夏基金管理有限公司融资融券研究员;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. 管理团队成员
宋宜先生,总经理,相关介绍见董事会成员部分内容。
魏福生先生,副总经理,相关介绍见董事会成员部分内容。

冯甲申先生,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监;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。

魏福生先生,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长兼秘书长;长城证券经纪法律部总经理;汉唐证券有限责任公司法律部副经理,现任永赢基金管理有限公司法律合规部负责人;南海产业投资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。

毛贻愚先生,督察长,学士,10年相关行业从业经验,曾任深圳天城律师事务所;源泰律师事务所律师;中广证券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本先生,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)投资分析师,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:公司总经理宋宜先生、分管投资的副总经理赵楠先生、量化投资总监张大本先生、固定收益投资总监祁斌涛女士等。
董事长、监察稽核总监、交易总监、研究、风控、合规等部门,没有投票权。

分管投资的副总经理为主任委员,负责召集、协调,并主持决议。
上述人员均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

证券代码:603188 证券简称:亚邦股份 公告编号:2016-016

江苏亚邦染料股份有限公司
关于控股股东信息冻结的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

江苏亚邦染料股份有限公司(以下简称“亚邦股份”或“公司”)于近日收到上海证券交易所通知,公司控股股东亚邦控股集团集团有限公司(以下简称“亚邦集团”)持有公司的股份被冻结,具体如下:

一、股份冻结的具体情况
公司控股亚邦集团、新疆源生生物工程有限公司(以下简称“源生生物”)与交通银行股份有限公司新疆维吾尔自治区分行(以下简称“交通银行”)发生金融借款合同纠纷,亚邦集团作为源生生物借款担保人被同时起诉,现因起诉保全需要,新疆维吾尔自治区高级人民法院作出《协助执行通知书》,对亚邦集团持有公司的15,900,000股(限售流通股,已质押)及募集资金(含投资收益、转股款、现金红利)进行司法冻结,冻结期限从2016年3月17日起至2018年3月16日,冻结期限为2年,由亚邦集团持有公司的10,622,000股(限售流通股,未质押)进行轮候冻结,冻结期限为两年,自转为正式冻结之日起计算。本次冻结股份占公司总股本的27%,轮候冻结股份占公司总股本的1.84%。

截止本公告日,亚邦集团持有公司股份总数为166,112,000股,占公司总股本的28.84%,此次股份冻结后累计股份冻结的数量为166,112,000股,占其持有亚邦股份总数的100%,占亚邦股份总数的28.84%。

二、被冻结股份的冻结情况
控股股东亚邦集团持有公司股份,本次冻结原因是亚邦集团为源生生物向交通银行新发生总额1亿元贷款提供连带责任担保,因源生生物未按借款合同约定,向交通银行支付源生生物及保证人亚邦集团,经向亚邦集团了解,亚邦集团目前尚未收到新疆维吾尔自治区高级人民法院的书面裁决书,同时亚邦集团已督促源生生物履行其对交通银行的还款义务。本次冻结

不会对公司的生产经营产生影响,不会影响公司的生产经营。

公司将密切关注上述冻结事项的进展并及时履行信息披露义务。
特此公告。

证券代码:603188 证券简称:亚邦股份 公告编号:2016-015

江苏亚邦染料股份有限公司
重大资产重组进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

江苏亚邦染料股份有限公司(以下简称“公司”)于2016年2月27日发布了《亚邦股份重大资产重组停牌公告》(公告编号:2016-009),因公司正在筹划重大资产重组事项,根据上海证券交易所的有关规定,经公司申请,公司股票于2016年2月29日起停牌不超过一个月。公司于2016年3月1日、2016年3月2日分别披露了《亚邦股份重大资产重组进展公告》(公告编号:2016-011、2016-012)。

截止本公告日,公司及各方相关工作正在积极推进本次重大资产重组事项所涉及的各项工,因相关事项尚存在不确定性,为保证公平信息披露,维护投资者利益,在停牌期间,公司将按照《上市公司重大资产重组管理办法》及其他有关规定,根据重大资产重组的进展情况,及时履行信息披露义务,每五个交易日发布一次有关事项的进展公告,待相关工作完成后召开董事会审议重大资产重组预案,及时公告复牌,如公司未能在规定期限内披露重大资产重组预案,公司将根据项目推进情况决定是否向上交所申请延期复牌。特此公告。

江苏亚邦染料股份有限公司
2016年3月18日

证券代码:000669 证券简称:金鸿能源 公告编号:2016-019

中油金鸿能源投资股份有限公司关于重大资产重组停牌进展公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中油金鸿能源投资股份有限公司(以下简称“公司”)因筹划重大资产重组事项,公司股票已于2016年1月18日开市起停牌,具体内容详见公司于2016年1月19日-3月14日在巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)披露的《关于重大资产重组停牌的公告》(公告编号:2016-006)、《关于重大资产重组停牌进展公告》(公告编号:2016-008、2016-009、2016-010、2016-012、2016-013、2016-014、2016-015)。

截至本公告披露之日,公司积极高效推进本次重组的各项工,确定审计机构为:立信会计师事务所,评估机构为:北京天健兴业资产评估有限公司。本次重组具体方案的相关内容仍需进一步商讨、论证和完善,因有关事项尚存在不确定性,为保证信息披露的公平性,维护广大投资者的利益,避免公司股票价格异常波动,经公司申请,公司股票(证券简称:金鸿能源,证券代码:000669)自2016年3月21日开市起继续停牌。

停牌期间,公司将根据法律法规及监管部门的相关规定,结合停牌期间重组事项的进展情况,及时履行信息披露义务,每五个交易日发布一次重大资产重组事项进展公告。《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》和巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)为公司指定信息披露媒体,公司发布的公告以上述信息披露平台刊登的公告为准。

敬请广大投资者理性投资,注意投资风险。
特此公告。

中油金鸿能源投资股份有限公司
董事会
2016年3月18日

证券代码:000582 证券简称:北部湾港 公告编号:2016006

北部湾港股份有限公司关于重大资产重组进展暨续停牌公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、停牌事项和工作安排
本公司正在筹划注入控股股东广西北部湾国际港务集团有限公司所附属公司经营性资产,涉及重大资产重组事项,因有关事项尚存在不确定性,为了维护投资者利益,避免对公司股价造成重大影响,根据相关规定,公司拟将(证券简称:北部湾港,证券代码:000582)已于2016年2月29日起停牌,自2016年3月1日、3月5日、3月12日披露了重大资产重组停牌和相关进展公告。停牌期间,公司已初步拟定资产重组、相关中介机构正在开展尽职调查和审计、资产评估等工作,经公司申请,公司股票(证券代码:000582)自2016年3月1日起继续停牌。

二、停牌期间安排
公司将按照相关规定,积极组织协调广西北部湾港务集团和中介机构开展各项工作,

尽快完成尽职调查、审计、资产评估及履行必要的报批和审议程序,按照承诺的期限向交易所提交并披露符合规定要求的重组文件,及办理股票停牌。
本公司筹划的重大资产重组事项,尚存在较大不确定性,敬请广大投资者注意投资风险。
四、备查文件
1、经公司董事长签字的停牌申请;
2、深圳证券交易所要求的其他文件。

北部湾港股份有限公司
董事会
2016年3月18日

证券代码:000582 证券简称:北部湾港 公告编号:2016006

北部湾港股份有限公司关于重大资产重组进展暨续停牌公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、停牌事项和工作安排
本公司正在筹划注入控股股东广西北部湾国际港务集团有限公司所附属公司经营性资产,涉及重大资产重组事项,因有关事项尚存在不确定性,为了维护投资者利益,避免对公司股价造成重大影响,根据相关规定,公司拟将(证券简称:北部湾港,证券代码:000582)已于2016年2月29日起停牌,自2016年3月1日、3月5日、3月12日披露了重大资产重组停牌和相关进展公告。停牌期间,公司已初步拟定资产重组、相关中介机构正在开展尽职调查和审计、资产评估等工作,经公司申请,公司股票(证券代码:000582)自2016年3月1日起继续停牌。

二、停牌期间安排
公司将按照相关规定,积极组织协调广西北部湾港务集团和中介机构开展各项工作,

尽快完成尽职调查、审计、资产评估及履行必要的报批和审议程序,按照承诺的期限向交易所提交并披露符合规定要求的重组文件,及办理股票停牌。
本公司筹划的重大资产重组事项,尚存在较大不确定性,敬请广大投资者注意投资风险。
二、停牌期间安排
公司将按照相关规定,积极组织协调广西北部湾港务集团和中介机构开展各项工作,

尽快完成尽职调查、审计、资产评估及履行必要的报批和审议程序,按照承诺的期限向交易所提交并披露符合规定要求的重组