

**永赢货币市场基金2016年年度报告**

**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：中国建设银行股份有限公司**

**送出日期：2017年03月31日**

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国建设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。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自2016年01月01日起至2016年12月31日止。

§1	重要提示及目录	2
§2	基金简介	5
	2.1 基金基本情况	5
	2.2 基金产品说明	5
	2.3 基金管理人和基金托管人	6
	2.4 信息披露方式	7
	2.5 其他相关资料	7
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
	3.1 主要会计数据和财务指标	7
	3.2 基金净值表现	8
	3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4	管理人报告	9
	4.1 基金管理人及基金经理情况	9
	4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
	4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
	4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
	4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
	4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
	4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
	4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
	4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
§5	托管人报告	14
	5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
	5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算等情况的说明	14
	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	14
§6	审计报告	14
	6.1 审计报告基本信息	14
	6.2 审计报告的基本内容	15
§7	年度财务报表	16
	7.1 资产负债表	16
	7.2 利润表	17
	7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
	7.4 报表附注	20
§8	投资组合报告	44
	8.1 期末基金资产组合情况	44
	8.2 债券回购融资情况	45
	8.3 基金投资组合平均剩余期限	47
	8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
	8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	48
	8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	49
	8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	51
	8.9 投资组合报告附注	51
§9	基金份额持有人信息	52
	9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
	9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
	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	52
§10	开放式基金份额变动	52
§11	重大事件揭示	53
	11.1 基金份额持有人大会决议	53
	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	53
	11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54

---

11.4	基金投资策略的改变.....	54
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	54
11.9	其他重大事件.....	54
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§13	备查文件目录.....	56
13.1	备查文件目录.....	56
13.2	存放地点.....	57
13.3	查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢货币市场基金
基金简称	永赢货币
基金主代码	000533
交易代码	
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年02月27日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	836,576,267.70
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持安全性和高流动性的前提下，追求超过基准的较高收益。
投资策略	<p>1、货币市场利率研判与管理策略</p> <p>货币市场利率研判与管理策略是本基金的基本投资策略。根据对宏观经济指标、财政与货币政策和市场资金供求等因素的研究与分析，对未来一段时期的货币市场利率进行研究判断，并根据研究结论制定和调整组合的期限和品种配置，追求更高收益。</p> <p>2、期限配置策略</p> <p>根据对货币市场利率与投资人流动性需求的判断，确定并调整组合的平均期限。在预期货币市场利率上升时或投资人赎回需求提高时，缩短组合的平均期限，以规避资本损失或获得较高的再投资收益和满足投资人流动性需求；在预期短期利率下降时或投资人申购意愿提高时，延长组合的平均期限，以获得资本利得或锁定较高的利率水平和为投资人潜在投资需求提前做准备。</p> <p>3、类属和品种配置策略</p>

	<p>本基金的投资工具包括在交易所的短期国债、企业债和债券回购，在银行间市场交易的短期国债、金融债、央行票据和债券回购，以及同业存款、定期存款等品种。由于上述工具具有不同的流动性特征和收益特征，本基金统筹兼顾投资人的流动性与收益率要求，制定并调整类属和品种配置策略，在保证组合的流动性要求的基础上，提高组合的收益性。</p> <p>4、灵活的交易策略</p> <p>由于新股、新债发行以及年末、季末效应等因素，以及投资人对信息可能产生的过度反应都会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过研究其动因，可以更有效地获得市场失衡带来的投资收益。</p>
业绩比较基准	7天通知存款利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
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	010-67595096
传真	021-51690177	010-66275853
注册地址	浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码	200120	100033
法定代表人	马宇晖	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	永赢基金管理有限公司登记注册中心	上海市世纪大道210号21世纪中心大厦27楼

## § 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	2014年
本期已实现收益	64,572,289.41	80,776,322.56	11,190,196.28
本期利润	64,572,289.41	80,776,322.56	11,190,196.28
本期净值收益率	2.5830%	3.9839%	3.5286%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金资产净值	836,576,267.70	2,843,010,618.05	365,234,583.90
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016年末	2015年末	2014年末
累计净值收益率	10.4336%	7.6530%	3.5286%

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，由于货币市场基金采

用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

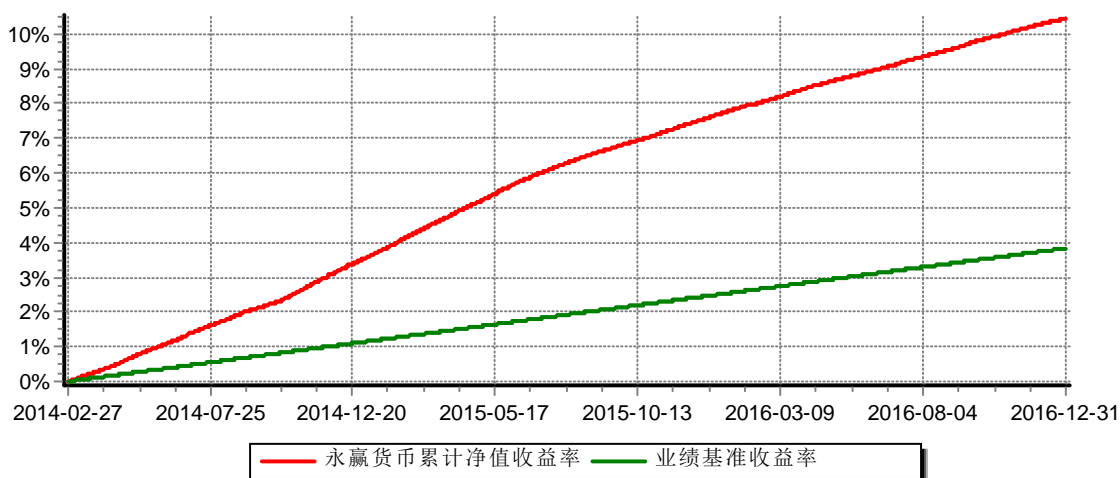
2、本基金利润分配按月结转份额。

### 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

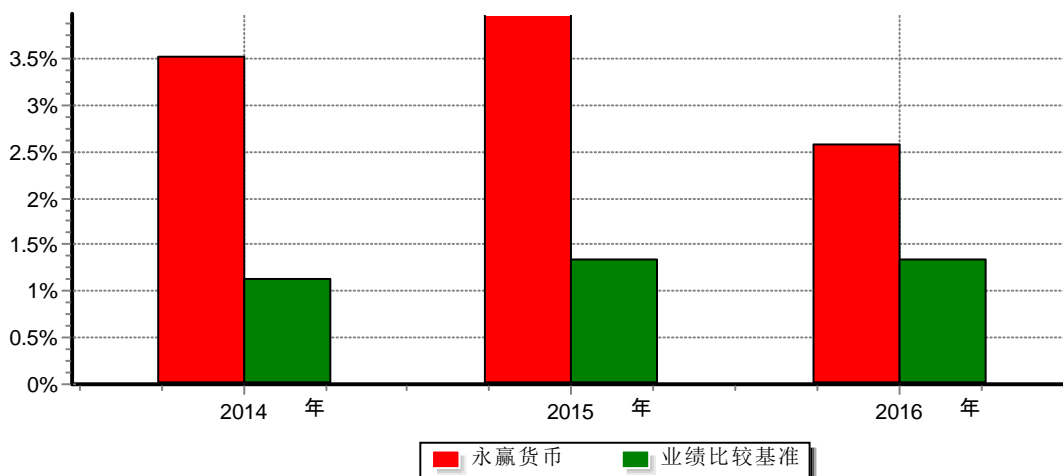
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5803 %	0.0020 %	0.3393 %	0.0000 %	0.2410 %	0.0020 %
过去六个月	1.2515 %	0.0027 %	0.6787 %	0.0000 %	0.5728 %	0.0027 %
过去一年	2.5830 %	0.0029 %	1.3500 %	0.0000 %	1.2330 %	0.0029 %
自基金合同生效日起至今（2014年02月27日-2016年12月31日）	10.4336 %	0.0054 %	3.8392 %	0.0000 %	6.5944 %	0.0054 %

#### 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



#### 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2014年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期2月27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	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016年	58,307,953.78	8,668,288.19	-2,403,952.56	64,572,289.41	
2015年	70,255,030.98	7,573,535.49	2,947,756.09	80,776,322.56	
2014年	11,190,196.28	—	—	11,190,196.28	
合计	139,753,181.04	16,241,823.68	543,803.53	156,538,808.25	

## § 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05月20日	—		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、《永赢货币市场基金基金合同》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，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。报告期间永赢货币万份收益均值0.86，7日年化收益率均值2.57%。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。基金管理人自此开始调整长期限资产仓位占比，降低组合久期，货币基金平均剩余期限由二季度75天，逐步降低至四季度50天。12月底货币基金虽连续遭遇大额赎回，但由于基金资产剩余期限较短且前期配置大比例现金类资产，永赢货币保持了良好的流动性。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，份额净值收益率为2.5830%，业绩比较基准收益率为1.35%。

## 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，货币市场资金价格中枢难以有效下降。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障合规运作和投资者合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，持续开展了系列检查、合规培训、制度修订等工作。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

1.内部检查。2016年内，开展了业务部门的例行内审，针对投研人员行为操守的专项检查和其他专项审查。

2.合规培训。2016年是我国资管市场充满挑战的一年，各类新的法律法规监管要求层出不穷。在这样的背景下本基金管理人在本年度内共组织了多次不同内容的合规培训。培训内容包含最新法律法规以及监管精神的解读、核心业务条线所面临的主要风险点及其防范等内容,加深了员工合规意识，深化员工对于法律法规的理解。

本报告期内，本基金管理人未发现本基金在投资运作等方面存在与法律法规或基金合同约定相违背的情况。本基金管理人将继续坚持确保基金份额持有人的利益不受损害的原则，以科学的风险管理为基础，积极有效的开展监察稽核工作。

#### 4.7 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。

报告期内，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

#### 4.8 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，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益，每月集中支付，每月累计收益支付方式采用红利再投资方式。报告期内本基金向份额持有人分配利润64,572,289.41元。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，未发生会计师事务所出具非标准审计报告的情形。

#### 4.10 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

本报告期内，本基金未发生基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

### § 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为64,572,289.41元。

#### 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

本托管人复核审查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。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2017）审字第61090672_B01号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	永赢货币市场基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的永赢货币市场基金财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表和2016年度的利润表及所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人永赢基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了永赢货币市场基金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。

注册会计师的姓名	郭杭翔 濮晓达
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
审计报告日期	2017-03-27

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：永赢货币市场基金

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	8,896,497.05	412,742,430.79
结算备付金			
存出保证金		—	—
交易性金融资产	7.4.7.2	571,198,026.66	1,936,370,004.87
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		569,948,023.60	1,936,370,004.87
资产支持证券投资		1,250,003.06	—
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	509,600,179.40	494,001,861.00
应收证券清算款		—	121,395,026.01
应收利息	7.4.7.5	9,135,029.67	33,361,181.83
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		1,098,829,732.78	2,997,870,504.50
<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		—	—
卖出回购金融资产款		260,199,049.69	149,899,455.15
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		491,535.39	747,773.52
应付托管费		148,950.13	226,598.03
应付销售服务费		372,375.34	566,495.10
应付交易费用	7.4.7.7	41,791.52	62,432.70
应交税费		—	—
应付利息		156,959.48	210,375.86
应付利润		543,803.53	2,947,756.09
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	299,000.00	199,000.00
负债合计		262,253,465.08	154,859,886.45
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	836,576,267.70	2,843,010,618.05
未分配利润	7.4.7.10	—	—
所有者权益合计		836,576,267.70	2,843,010,618.05
负债和所有者权益总计		1,098,829,732.78	2,997,870,504.50

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.000元，基金份额总额836,576,267.70份。

## 7.2 利润表

会计主体：永赢货币市场基金

本报告期：2016年01月01日-2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年01月01日-2016 年12月31日	上年度可比期间2015 年01月01日-2015年12 月31日
<b>一、收入</b>		84,750,568.97	100,812,101.76
1.利息收入		77,767,164.35	73,516,000.60
其中：存款利息收入	7.4.7 .11	14,995,797.76	23,954,445.36
债券利息收入		40,375,721.36	43,702,990.47
资产支持证券利息收入		701,098.58	—
买入返售金融资产收入		21,694,546.65	5,858,564.77
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,983,404.62	27,296,101.16
其中：股票投资收益	7.4.7 .12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7 .13	6,985,132.32	27,296,101.16
资产支持证券投资收益	7.4.7 .13.3	-1,727.70	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7 .14	—	—
股利收益	7.4.7 .15	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7 .16	—	—
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 .17	—	—
<b>减：二、费用</b>		20,178,279.56	20,035,779.20

1. 管理人报酬		8,286,796.71	7,961,707.83
2. 托管费		2,511,150.45	2,412,638.70
3. 销售服务费		6,277,876.34	6,031,596.80
4. 交易费用	7.47 .18	—	—
5. 利息支出		2,830,876.00	3,332,282.38
其中：卖出回购金融资产支出		2,830,876.00	3,332,282.38
6. 其他费用	7.47 .19	271,580.06	297,553.49
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		64,572,289.41	80,776,322.56
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		64,572,289.41	80,776,322.56

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：永赢货币市场基金

本报告期：2016年01月01日-2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日-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)	2,843,010,618.05	—	2,843,010,618.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	64,572,289.41	64,572,289.41
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)	-2,006,434,350.35	—	-2,006,434,350.35
其中：1.基金申购款	14,482,809,030.81	—	14,482,809,030.81
2.基金赎回款	-16,489,243,381.16	—	-16,489,243,381.16
四、本期向基金份额持有人分	—	-64,572,289	-64,572,289.41

配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)		.41	
五、期末所有者权益(基金净值)	836,576,267.70	—	836,576,267.70
项 目	上年度可比期间2015年01月01日-2015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)	365,234,583.90	—	365,234,583.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	80,776,322.56	80,776,322.56
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)	2,477,776,034.15	—	2,477,776,034.15
其中：1.基金申购款	13,606,370,435.36	—	13,606,370,435.36
2.基金赎回款	-11,128,594,401.21	—	-11,128,594,401.21
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)	—	-80,776,322.56	-80,776,322.56
五、期末所有者权益(基金净值)	2,843,010,618.05	—	2,843,010,618.05

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

永赢货币市场基金(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(2014)93号《关于核准永赢货币市场基金募集的批复》的核准,由永赢基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集,基金合同于2014年2月27日生效,首次设立募集规模为597,140,206.43份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为永赢基金管理有限公司,基金托管人为

中国建设银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性货币市场工具，主要包括以下：现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准：同期7天通知存款利率（税后）。

本财务报表由本基金的基金管理人永赢基金管理有限公司于2017年3月31日批准报出。

#### 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编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

##### (2) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

#### 1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

#### 2) 债券投资

基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

#### 3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

#### 4) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值；

(3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第120号《货币市场基金监督管理办法》的规定，自2016年2月1日起，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用自有资金予以弥补；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益/损失于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) "每日分配、按月支付"。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后两位，小数点后第三位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再



次分配，直到分完为止；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人全部赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

(6) 本日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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。

#### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	8,896,497.05	2,742,430.79
定期存款	—	410,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	—	310,000,000.00
存款期限1个月以内		100,000,000.00
其他存款	—	—
合计	8,896,497.05	412,742,430.79

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2016年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	569,948,023.60	569,103,000.00	-845,023.60	-0.0010
	合计	569,948,023.60	569,103,000.00	-845,023.60	-0.0010
项目		上年度末2015年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	1,936,370,004.87	1,938,943,207.84	2,573,202.97	0.0009
	合计	1,936,370,004.87	1,938,943,207.84	2,573,202.97	0.0009

注：2016年12月31日，银行间市场资产支持证券摊余成本为1,250,003.06元，影子定价为1,250,000.00元，偏离金额为-3.06元，偏离度为0.0000%；2015年12月31日，本基金未持有资产支持证券。

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	470,000,000.00	—
银行间市场	39,600,179.40	—
合计	509,600,179.40	—
项目	上年度末2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	494,001,861.00	—
合计	494,001,861.00	—

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	11,842.41	643.43
应收定期存款利息	—	392,027.78
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	8.15	—
应收债券利息	7,990,028.93	32,252,994.84
应收买入返售证券利息	1,126,381.69	715,515.78
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	6,768.49	—

合计	9,135,029.67	33,361,181.83
----	--------------	---------------

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日	上年度末2015年12月31日
其他应收款	—	—
待摊费用	—	—
合计	—	—

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	—	—
银行间市场应付交易费用	41,791.52	62,432.70
合计	41,791.52	62,432.70

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	—	—
预提费用	299,000.00	199,000.00
合计	299,000.00	199,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年01月01日-2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,843,010,618.0500	2,843,010,618.0500

本期申购	14,482,809,030.8100	14,482,809,030.8100
本期赎回（以“-”号填列）	-16,489,243,381.1600	-16,489,243,381.1600
_年_月_日基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	836,576,267.7000	836,576,267.7000

申购含红利再投、转换入份额、赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	64,572,289.41	—	64,572,289.41
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-64,572,289.41	—	-64,572,289.41
本期末	—	—	—

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 (2016年01月01日-2016年 12月31日)	上年度可比期间2015年01 月01日-2015年12月31日
活期存款利息收入	85,462.85	39,575.39
定期存款利息收入	14,900,608.32	23,913,335.57
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	9,726.59	1,102.37
其他	—	432.03

合计	14,995,797.76	23,954,445.36
----	---------------	---------------

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 (2016年01月01日-2016年 12月31日)	上年度可比期间2015年01 月01日-2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	6,985,132.32	27,296,101.16
债券投资收益——赎回差价 收入	—	—
债券投资收益——申购差价 收入	—	—
合计	6,985,132.32	27,296,101.16

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2016年01月01日-2016年 12月31日)	上年度可比期间2015年01 月01日-2015年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	7,537,297,549.01	10,904,213,677.74
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	7,420,110,657.17	10,712,822,752.32
减：应收利息总额	110,201,759.52	164,094,824.26
买卖债券差价收入	6,985,132.32	27,296,101.16

##### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年01月01日-2015年 12月31日
卖出资产支持证券成交总额	69,459,586.66	—
减：卖出资产支持证券成本总额	68,751,727.70	—
减：应收利息总额	709,586.66	—
资产支持证券投资收益	-1,727.70	—

注：

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.17 其他收入

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年 12月31日	上年度可比期间2015年01 月01日-2015年12月31日
交易所市场交易费用	—	—
银行间市场交易费用	—	—
合计	—	—

本基金本报告期及上年度可比期间均无交易费用。



**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年 12月31日	上年度可比期间2015年01 月01日-2015年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	100,000.00	130,000.00
其他	200.00	200.00
帐户维护费	36,000.00	36,000.00
汇划手续费	75,380.06	71,353.49
合计	271,580.06	297,553.49

**7.4.7.20 分部报告****7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，除7.4.6.1营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

**7.4.9 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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
员工股东	基金管理人的股东
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司

利安资金管理公司	基金管理人的股东
永赢永鑫八期资产管理计划（“永鑫八期”）	基金管理人控制的结构化主体

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016 年12月31日	上年度可比期间2015年01 月01日-2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,286,796.71	7,961,707.83
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,496,044.21	104,647.23

注：应支付基金管理人永赢基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016 年12月31日	上年度可比期间2015年01 月01日-2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,511,150.45	2,412,638.70

注：应支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%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：日托管费=前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
永赢基金管理有限公司	5,833,318.59
宁波银行股份有限公司	439,944.36
合计	6,273,262.95
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间2015年01月01日-2015 年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
永赢基金管理有限公司	5,644,412.21
宁波银行股份有限公司	379,528.55
合计	6,023,940.76

注：应支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年01月01日-2016年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
中国建设银行						
上年度可比期间 2015年01月01日-2015年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
中国建设银行	50,658,7 29.45					

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年01月01日-2016年12月 31日	上年度可比期间2015年01月 01日-2015年12月31日
期初持有的基金份额	107,120,331.35	90,037,131.47
期间申购/买入总份额	97,605,842.18	161,583,199.88
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总 份额	87,000,000.00	144,500,000.00
期末持有的基金份额	117,726,173.53	107,120,331.35
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	14.07%	3.77%

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.10.4.2 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
永赢资产	66,446,042.41	7.94%	55,148,007.94	1.94%
员工股东	3,580.45	0.00%	966,653.31	0.03%
永鑫八期	11,649,486.07	1.39%	19,270,962.12	0.68%
宁波银行	1.01	0.00%	0	—

## 7.4.10.5 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01月01日-2016年12月31	上年度可比期间2015年01月01日 -2015年12月31日

	日			
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	8,896,497.05	85,462.85	2,742,430.79	39,575.39

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

#### 7.4.10.7 报告期内本基金未发生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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
58,307,953.78	8,668,288.19	-2,403,952.56	64,572,289.41	-

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：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。

##### 7.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.2.1 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260,199,049.69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
140208	14国开 08	2017-01-04	100.74	1100000	110,814,047.60
041663004	16首钢	2017-01-04	100.23	500000	50,113,852.45

	CP002				
111691498	16杭州 银行 CD038	2017-01-04	99.46	530000	52,713,091.48
111696158	16吉林 银行 CD117	2017-01-04	99.68	30000	2,990,386.54
111691491	16南京 银行 CD023	2017-01-04	99.40	500000	49,701,652.23
合计				2,660,000.0 0	266,333,030.30

#### 7.4.12.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币型基金。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，包括债券投资、买入返售金融资产以及银行存款等。与以上金融工具有关的风险以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只货币型证券投资基金，属于低风险合理稳定收益品种，本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险控制委员会以及在董事会层面建立的审计及风险管理委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人监察稽核部负责具体落实和日常跟踪的工作机制。本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，

将风险控制在可承受的范围内。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例等来管理。于资产负债表日，由于本基金均投资于信用等级良好的债券，所以本基金管理人认为本基金与债券发行者有关的信用风险不重大。

对于交易对手的风险控制，(1)对于定期存款的银行，本基金管理人主要通过内部设立符合资格的银行库，并设立相应的最高存款限额来管理风险。本基金的银行存款目前存放在本基金的托管行—中国建设银行以及具有基金托管资格的股份制商业银行，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。(2)对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过限制交割方式、交易对手以及相应额度来管理风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	140,121,974.92	854,113,679.40
A-1以下	—	—
未评级	431,076,051.74	1,082,256,325.47
合计	571,198,026.66	1,936,370,004.87

注：未评级的债券均为政策性金融债、超短期融资券、同业存单或资产支持证券。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有以长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金管理人对于流动性风险管理的目标是监控基金组合流动性指标，确保市场出

现剧烈波动时，基金仍能应付大量赎回和其他负债，灵活调整组合结构，而且不影响组合估值。

针对兑付赎回资金和其他负债的流动性风险，本基金管理人通过对基金资产按流动性分类计算未来现金流并设立相应目标，同时对基金申购赎回状况和其他负债到期情况进行严密监控和分析预测，保持基金投资组合中的流动性资产与之相匹配。此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资交易品种变现的流动性风险，本基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易不活跃品种(企业债或短期融资券)以及基金影子价格偏离度来实现。此外，本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

于资产负债表日，本基金所持有的资产大部分是流动性良好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具，其余是银行存款，因此比较容易变现来满足投资者对于基金资产的赎回。从本基金资产和负债的情况来看，本基金管理人认为本基金面临的流动性风险较小。

于2016年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有260,199,049.69元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

于资产负债表日，本基金持有的利率敏感性金融工具主要是银行存款、债券投资与买入返售金融资产。基于本基金产品性质，生息资产占基金资产绝对比重，因此本基金存在相应的利率风险。对于固定利率类金融工具，面临由于市场利率走高而导致的债券资产的市场价格低于购买成本的风险。对于浮动利率类金融工具，主要面临两方面利率风险：第一，每个付息期间内面临由于市场利率走高而导致的债券资产的市场价格低于购买成本的风险；第二，每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金



流的影响的风险。本基金管理人主要通过定期对利率水平的预测、以及严格控制投资品种到期天数等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2016年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	8,896,497.05	—	—	—	—	8,896,497.05
交易性金融资产	541,282,908.12	29,915,118.54	—	—	—	571,198,026.66
买入返售金融资产	509,600,179.40	—	—	—	—	509,600,179.40
应收利息	—	—	—	—	9,135,029.67	9,135,029.67
资产总计	1,059,779,584.57	29,915,118.54	—	—	9,135,029.67	1,098,829,732.78
负债						
卖出回购金融资产款	260,199,049.69	—	—	—	—	260,199,049.69
应付管理人报酬	—	—	—	—	491,535.39	491,535.39
应付托管费	—	—	—	—	148,950.13	148,950.13
应付销售服务费	—	—	—	—	372,375.34	372,375.34
应付交易费用	—	—	—	—	41,791.52	41,791.52
应付利息	—	—	—	—	156,959.48	156,959.48
应付利润	—	—	—	—	543,803.53	543,803.53
其他负债	—	—	—	—	299,000.00	299,000.00

					0	0
负债总计	260,199,049.69	—	—	—	2,054,415.39	262,253,465.08
利率敏感度缺口	799,580,534.88	29,915,118.54	—	—	7,080,614.28	836,576,267.70
上年度末 2015年12月 31日	6个月以 内	6个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	412,742,430.79	—	—	—	—	412,742,430.79
交易性金融 资产	1,184,463,314.28	751,906,690.59	—	—	—	1,936,370,004.87
买入返售金 融资产	494,001,861.00	—	—	—	—	494,001,861.00
应收证券清 算款	—	—	—	—	121,395,026.01	121,395,026.01
应收利息	—	—	—	—	33,361,181.83	33,361,181.83
资产总计	2,091,207,606.07	751,906,690.59	—	—	154,756,207.84	2,997,870,504.50
负债						
卖出回购金 融资产款	149,899,455.15	—	—	—	—	149,899,455.15
应付管理人 报酬	—	—	—	—	747,773.52	747,773.52
应付托管费	—	—	—	—	226,598.03	226,598.03
应付销售服 务费	—	—	—	—	566,495.10	566,495.10
应付交易费 用	—	—	—	—	62,432.70	62,432.70
应付利息	—	—	—	—	210,375.86	210,375.86

应付利润	—	—	—	—	2,947,756.09	2,947,756.09
其他负债	—	—	—	—	199,000.00	199,000.00
负债总计	149,899,455.15	—	—	—	4,960,431.30	154,859,886.45
利率敏感度缺口	1,941,308,150.92	751,906,690.59	—	—	149,795,776.54	2,843,010,618.05

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率曲线向上、向下平行移动50个基点		
假设	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
假设	市场利率平行上升50个基点	-673,573.18	-3,495,479.02
假设	市场利率平行下降50个基点	673,573.18	3,495,479.02

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 公允价值

#### 7.4.14.1.1 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。

#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 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571,198,026.66元，属于第三层次余额为人民币0.00元（于2015年12月31日，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1,936,370,004.87元，属于第三层次余额为人民币0.00元）。

##### 7.4.14.1.2.2 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。

##### 7.4.14.1.2.3 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。

#### 7.4.14.2 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。

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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	固定收益投资	571,198,026.66	51.98
	其中：债券	569,948,023.60	51.87
	资产支持证券	1,250,003.06	0.11
2	买入返售金融资产	509,600,179.40	46.38
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	8,896,497.05	0.81
4	其他各项资产	9,135,029.67	0.83
5	合计	1,098,829,732.78	100.00

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.62	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	260,199,049.69	31.10
	其中：买断式回购融资	—	—

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

金额单位：人民币元

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2016-12-29	30.96	由于发生巨额赎回,本基金持有的正回购资金余额被动超过了基金资产净值的20%,但并未违反法律法规及基金合同约定的"除发	本次被动超标情况在5个交易日内调整完毕。

			生巨额赎回的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整。”	
2	2016-12-30	31.10	由于发生巨额赎回，本基金持有的正回购资金余额被动超过了基金资产净值的20%，但并未违反法律法规及基金合同约定的“除发生巨额赎回的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整。”	本次被动超标情况在5个交易日内调整完毕。
3	2016-12-31	31.10	由于发生巨额赎回，本基金持有的正回购资金余额被动超过了基金资产净值的20%，但并未违反法律法规及基金合同约定的“除发	本次被动超标情况在5个交易日内调整完毕。

			生巨额赎回的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整。”	
--	--	--	--	--

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

注：本货币市场基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限不超过120天。”

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限违规超过120天的情况。

#### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	62.13	31.10
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	7.15	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	38.19	—

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	13.25	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天(含)	9.54	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	130.26	31.10

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本基金本报告期内无投资组合平均剩余存续期违规超过240天的情况。

#### 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	110,814,047.60	13.25
	其中：政策性金融债	110,814,047.60	13.25
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	250,165,929.76	29.90
6	中期票据	—	—
7	同业存单	208,968,046.24	24.98
8	其他	—	—
9	合计	569,948,023.60	68.13
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

#### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细



金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产净值 比例 (%)
1	140208	14国开08	1,100,000.00	110,814,047.60	13.25
2	1116914 98	16杭州银行 CD038	1,000,000.00	99,458,663.17	11.89
3	0116999 08	16三安SCP002	600,000.00	60,133,668.46	7.19
4	1116961 58	16吉林银行 CD117	600,000.00	59,807,730.84	7.15
5	0416630 04	16首钢CP002	500,000.00	50,113,852.45	5.99
6	0116982 43	16京汽股 SCP002	500,000.00	49,910,286.38	5.97
7	1116914 91	16南京银行 CD023	500,000.00	49,701,652.23	5.94
8	0416610 03	16五凌电力 CP001	300,000.00	30,054,381.18	3.59
9	0416630 02	16连城投 CP001	300,000.00	30,038,622.75	3.59
10	0416610 20	16闽电子 CP002	300,000.00	29,915,118.54	3.58

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况(%)
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	2
报告期内偏离度的最高值	0.1966
报告期内偏离度的最低值	-0.3171
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0750

### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
----	------	-----	----	-----

1	2016-12-16	-0.002959	<p>由于证券市场波动以及赎回的原因,本基金"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值负偏离度超过了0.25%,但并不违反法规规定"当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时,基金管理人应在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。"</p>	<p>本次超标情况在3个工作日内调整完毕</p>
2	2016-12-19	-0.003171	<p>由于证券市场波动以及赎回的原因,本基金"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值负偏离度超过了0.25%,但并不违反法规规定"当影子定价确定的基金资产净值与</p>	<p>本次超标情况在3个工作日内调整完毕</p>

			摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，基金管理人应在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。"	
--	--	--	--	--

### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本报告期内本基金未发生负偏离度绝对值达到0.5%的情况。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	1689062	16开元1A1	500,000.00	1,250,003.06	0.15

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明。

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.000元。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—

2	应收证券清算款	—
3	应收利息	9,135,029.67
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	9,135,029.67

## § 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 份额	占总份 额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
6,732	124,268.61	716,731,863 .82	85.67%	119,844,403 .88	14.33%

### 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	1,996,072.17	0.24%

### 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
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(2014年02月27日)基金份额总额	597,140,206.43
本报告期期初基金份额总额	2,843,010,618.05
本报告期基金总申购份额	14,482,809,030.81
减：本报告期基金总赎回份额	16,489,243,381.16
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	836,576,267.70

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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，基金托管人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，本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60,000.00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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1		—	—	—		—	备注

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。

### 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过0.5%的情况。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	永赢基金关于旗下开放式基金开通基金转换业务的公告	中国证券报、公司网站	2016-01-16
2	永赢货币市场基金2015年第4季度报告	中国证券报、公司网站	2016-01-22
3	永赢货币市场基金2016年春节假期前暂停申购业务公告	中国证券报、公司网站	2016-02-02
4	永赢货币市场基金2015年年度报告	中国证券报、公司网站	2016-03-26
5	永赢货币市场基金2015年年度报告摘要	中国证券报、公司网站	2016-03-26
6	永赢货币市场基金2016年"清明"假期前暂停申购、转换转入业务公告	中国证券报、公司网站	2016-03-29
7	永赢货币市场基金更新招募说明书（2016年第1号）	中国证券报、公司网站	2016-04-11
8	永赢货币市场基金更新招募说明书摘要（2016年第1号）	中国证券报、公司网站	2016-04-11
9	永赢基金关于新增申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司为永赢货币市场基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016-04-21
10	永赢货币市场基金2016年第1季度报告	中国证券报、公司网站	2016-04-21
11	永赢基金关于新增天风证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016-04-26
12	永赢货币市场基金2016年"五一"假期前暂停申购、转换转入业务公告	中国证券报、公司网站	2016-04-26
13	永赢货币市场基金2016年"端午"假期前暂停申购、转换转入业务公告	中国证券报、公司网站	2016-06-03
14	永赢货币市场基金2016年第2季度报告	中国证券报、公司网站	2016-07-19

15	永赢货币市场基金2016年半年度报告	中国证券报、公司网站	2016-08-25
16	永赢货币市场基金2016年半年度报告摘要	中国证券报、公司网站	2016-08-25
17	永赢货币市场基金2016年"中秋"假期前暂停申购、转换转入业务公告	中国证券报、公司网站	2016-09-09
18	永赢基金管理有限公司关于基金经理祁洁萍职务代理的公告	中国证券报、公司网站	2016-09-19
19	永赢货币市场基金2016年"国庆"假期前暂停申购、转换转入业务公告	中国证券报、公司网站	2016-09-27
20	永赢货币市场基金更新招募说明书（2016年第2号）	中国证券报、公司网站	2016-10-11
21	永赢货币市场基金更新招募说明书摘要（2016年第2号）	中国证券报、公司网站	2016-10-11
22	永赢货币市场基金2016年第三季度报告	中国证券报、公司网站	2016-10-26
23	永赢货币市场基金2017年"元旦"假期前暂停申购、转换转入业务公告	中国证券报、公司网站	2016-12-27

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准永赢货币市场基金募集的文件；
- 2.《永赢货币市场基金基金合同》；
- 3.《永赢货币市场基金招募说明书》及其更新；
- 4.《永赢货币市场基金托管协议》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照；



6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

### **13.2 存放地点**

基金管理人、基金托管人处。

### **13.3 查阅方式**

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：[www.maxwealthfund.com](http://www.maxwealthfund.com)。

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：021-51690111