

**永赢天天利货币市场基金2017年半年度报告**

**2017年06月30日**

**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**

**送出日期：2017年08月29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。本半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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月25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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年4月20日(基金合同生效日)起至2017年6月30日止。

## 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	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 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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	10
4.5 管理人对对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 债券回购融资情况	36
7.3 基金投资组合平均剩余期限	37
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 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	38
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	39
7.8 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	39
7.9 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.3 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	41
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
10.2 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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42

---

10.5	基金改聘会计师事务所情况.....	42
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	42
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	42
10.9	其他重大事件.....	42
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	43
§12	备查文件目录.....	44
12.1	备查文件目录.....	44
12.2	存放地点.....	44
12.3	查阅方式.....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢天天利货币市场基金
基金简称	永赢天天利货币
基金主代码	004545
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年04月20日
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
报告期末基金份额总额	16,701,540,673.76
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>在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金</p>

	<p>融工具的不同流动性特征、收益特征和市场规模，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、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将综合运用定性方法和定量方法，基本面分析和数量化模型相结合，对资产证券化产品的基础资产质量及未来现金流进行分析，并结合发行条款、提前偿还率、风险补偿收益等个券因素以及市场利率、流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析和价值评估后进行投资。本基金将严格遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制资产支持证券的投资比例、信用等级并密切跟踪评级变化，采用分散投资方式以降低流动性风险。</p> <p>5、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	本基金业绩比较基准为同期7天通知存款利率（税后）
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。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、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	兴业银行股份有限公司
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	95561
传真	021-51690177	021-62159217

注册地址	浙江省宁波市鄞州区中山 东路466号	福州市湖东路154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	上海市江宁路168号兴业 大厦20楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	马宇晖	高建平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸 名称	《上海证券报》	
登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com	
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30 日）
本期已实现收益	22,292,591.40
本期利润	22,292,591.40
本期净值收益率	0.8641%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年06月30日）
期末基金资产净值	16,701,540,673.76
期末基金份额净值	1.000

3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017年06月30日）
累计净值收益率	0.8641%

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.本基金合同生效日为2017年4月20日，截至本报告期末本基金合同生效未满1年。

## 3.2 基金净值表现

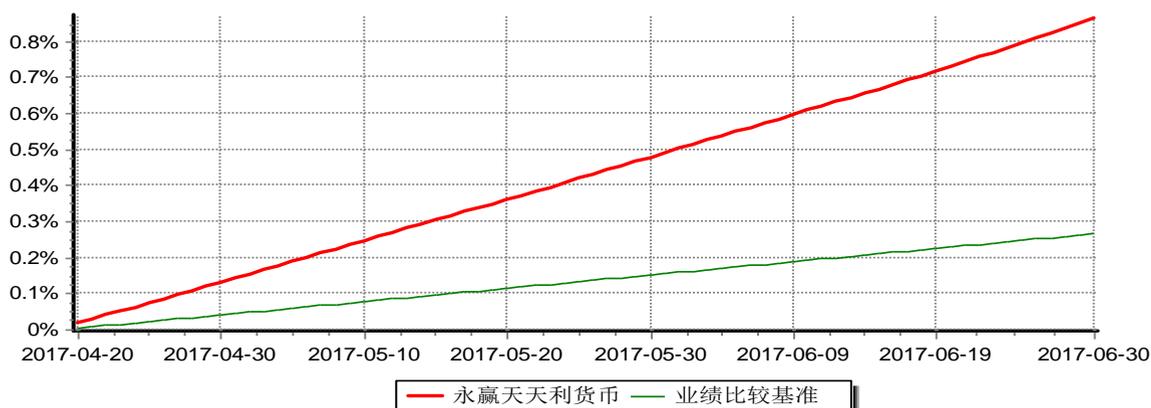
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.3732 %	0.0008 %	0.1110 %	0.0000 %	0.2622 %	0.0008 %
自基金合同生效日起至 至今（2017年04月20 日-2017年06月30日）	0.8641 %	0.0010 %	0.2663 %	0.0000 %	0.5978 %	0.0010 %

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本基金业绩比较基准为：同期7天通知存款利率（税后）。

### 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



- 注：1、本基金合同生效日为2017年4月20日，截至本报告期末本基金合同生效未满1年；  
2、本基金建仓期为本基金合同生效日起6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

## § 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

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》（证监许可〔2013〕1280号），随后，公司于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）。2014年8月，本基金管理人完成增资扩股及员工持股计划，注册资本增加为人民币贰亿元。截至2017年6月30日，公司的股权结构为：宁波银行股份有限公司持股71.49%，利安资金管理公司持股10%，员工股东持股18.51%。

截止2017年6月30日，本基金管理人共管理9只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢天天利货币市场基金、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、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢瑞益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	基金经理	2017年04月20日	—	9	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。
乔嘉麒	基金经理	2017年05月26日	—	8	经济学硕士，8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，现任永赢基金管理有

					限公司固定收益总监助理。
--	--	--	--	--	--------------

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，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《证券业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、《永赢天天利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，于每季度和每年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。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生同日反向交易。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

2017年上半年经济延续去年四季度以来的增长态势，上半年GDP累计同比增速

6.9%，较2016年末上升0.2个百分点；固定资产投资增速上半年累计增速8.6%，较2016年末上升0.5个百分点；上半年累计出口金额1.24万亿美元，同比增速8.3%，较去年底上升16个百分点。物价水平维持稳定，上半年CPI同比增速1.5%，工业产品价格继续上涨，6月PPI同比增速5.5%，工业产品价格上升带动企业利润好转，工业企业累计利润同比增速22%，较去年末上升13.5个百分点。货币市场方面，今年以来货币政策维持稳健中性，央行通过MLF、OMO等工具向市场投放流动性，资金价格较2016年有所上涨，上半年银行间7天质押式回购利率成交均值3.22%，较去年底上行近57BP。货币基金管理人以配置短久期资产为主，同时增加配置了30天以内到期资产占比，组合流动性有所增强。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金收益率为0.8641%，业绩比较基准收益率为0.2663%。

#### 4.5 管理人对对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年上半年GDP累计同比增速6.9%，较2016年末上升0.2个百分点。投资、出口、消费均出现不同程度的好转，展望后期，高基数效应将逐步显现，房地产投资受制于销售的回落，后期面临较大的下行压力，同时上半年盈利的改善对企业支出形成支撑，制造业投资增速有望延续上半年的增长，后期经济整体趋于稳定。上半年在MPA考核、金融去杠杆政策下，资金价格出现持续上行，6月初央行超量续作了MLF，同时配合公开市场操作，维持6月整体流动性平稳，但是6月整体跨季资金价格仍旧处于高位。后期货币基金拟继续增配短久期资产，以增强组合流动性。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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、会计核算等证券投资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。

#### 4.7 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22,292,591.40元。

#### 4.8 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

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

### § 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：永赢天天利货币市场基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年06月30日
资 产：		

银行存款	6.4.7.1	11,375,124,984.82
结算备付金		20,500.00
存出保证金		1,157.80
交易性金融资产	6.4.7.2	1,263,516,923.68
其中：股票投资		—
基金投资		—
债券投资		1,263,516,923.68
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,064,845,436.25
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	29,996,067.36
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		16,733,505,069.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年06月30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		9,999,865.00
应付证券清算款		—
应付赎回款		—
应付管理人报酬		777,711.70
应付托管费		194,427.89
应付销售服务费		38,885.63

应付交易费用	6.4.7.7	21,108.02
应交税费		—
应付利息		1,224.77
应付利润		20,886,188.22
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	44,984.92
负债合计		31,964,396.15
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	16,701,540,673.76
未分配利润	6.4.7.10	—
所有者权益合计		16,701,540,673.76
负债和所有者权益总计		16,733,505,069.91

注：1.报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.000元，基金份额总额16,701,540,673.76份。

2.本财务报表实际报告期间为2017年4月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日。

## 6.2 利润表

会计主体：永赢天天利货币基金

本报告期：2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2017年04月20日(合同生效日)-2017年 06月30日
一、收入		23,486,904.91
1.利息收入		23,486,904.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,238,733.84
债券利息收入		1,261,367.80
资产支持证券利息收 入		—
买入返售金融资产收 入		4,986,803.27
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		—

其中：股票投资收益		—
基金投资收益		—
债券投资收益		—
资产支持证券投资收益	6.4.7.12.2	—
贵金属投资收益	6.4.7.13	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	—
<b>减：二、费用</b>		1,194,313.51
1. 管理人报酬		822,714.06
2. 托管费		205,678.43
3. 销售服务费		41,135.79
4. 交易费用	6.4.7.18	—
5. 利息支出		77,950.31
其中：卖出回购金融资产支出		77,950.31
6. 其他费用	6.4.7.19	46,834.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		22,292,591.40
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		22,292,591.40

注：本财务报表实际报告期间为2017年4月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢天天利货币市场基金

本报告期：2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30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)	200,011,783.59	—	200,011,783.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	22,292,591.40	22,292,591.40
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)	16,501,528,890.17	—	16,501,528,890.17
其中：1.基金申购款	16,501,685,301.30	—	16,501,685,301.30
2.基金赎回款	-156,411.13	—	-156,411.13
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)	—	-22,292,591.40	-22,292,591.40
五、期末所有者权益(基金净值)	16,701,540,673.76	—	16,701,540,673.76

注：本财务报表实际报告期间为2017年4月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.4至6.1财务报表由下列负责人签署：

芦特尔

高利民

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

永赢天天利货币市场基金(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(2017)428号《关于准予永赢天天利货币市场基金注册的批复》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2017年4月20日生效,首次设立募集规模为200,011,783.89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,

基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；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8月29日批准报出。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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。

##### 6.4.4.1 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。

#### 6.4.4.2 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。

#### 6.4.4.3 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。

#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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

基金持有的附息债券、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。

### 6.4.4.6 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。

### 6.4.4.7 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。

### 6.4.4.8 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。

#### 6.4.4.9 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0.20%年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.05%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0.01%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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。

### 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的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 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]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1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。

#### 6.4.6.2 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。

#### 6.4.6.3 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。

**6.4.7 重要财务报表项目的说明****6.4.7.1 银行存款**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
活期存款	6,124,984.82
定期存款	11,369,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	4,419,000,000.00
存款期限3个月-1年	6,950,000,000.00
其他存款	—
合计	11,375,124,984.82

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2017年06月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	199,887,289.50	199,951,063.90	63,774.40	0.0004
	银行间市场	1,063,629,634.18	1,064,172,000.00	542,365.82	0.0032
	合计	1,263,516,923.68	1,264,123,063.90	606,140.22	0.0036

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期内无衍生金融资产/负债余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 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2017年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,947,342,000.00	—
银行间市场	1,117,503,436.25	—

合计	4,064,845,436.25	—
----	------------------	---

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期内未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应收活期存款利息	5,875.73
应收其他存款利息	16,194,836.02
应收结算备付金利息	12.01
应收债券利息	9,096,986.48
应收买入返售证券利息	4,698,356.62
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	0.50
合计	29,996,067.36

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产金额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所交易应付佣金	—
银行间交易应付交易费用	21,108.02
合计	21,108.02

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—

预提费用	36,737.78
其他应付	8,247.14
合计	44,984.92

注：其他应付款为计提的应付银行汇划手续费。

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	200,011,783.59	200,011,783.59
本期申购	16,501,685,301.30	16,501,685,301.30
本期赎回	-156,411.13	-156,411.13
期末数	16,701,540,673.76	16,701,540,673.76

注：申购含红利再投资份额。

#### 6.4.7.10 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	22,292,591.40	—	22,292,591.40
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	-22,292,591.40	—	-22,292,591.40
本期末	—	—	—

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30日
活期存款利息收入	45,795.37

定期存款利息收入	17,192,799.91
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	135.37
其他	3.19
合计	17,238,733.84

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动损益。

#### 6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.20 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30日
审计费用	14,062.32
信息披露费	19,687.68
帐户维护费	2,987.78
汇划手续费	9,697.14
开户费	400.00
合计	46,834.92

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构、基金注册登记机构
兴业银行股份有限公司 ("兴业银行")	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
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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期末应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	822,714.06
其中：支付销售机构的客户维护费	—

注：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0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，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 × 0.20% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	205,678.43

注：注：应支付基金托管人兴业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30日
----------	----------------------------------

各关联方名称	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	41,135.79

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0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月末，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 × 0.01% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30日
基金合同生效日(2017年04月20日)持有的基金份额	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	70,275.65
报告期间因拆分变动份额	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—
报告期末持有的基金份额	10,070,275.65
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.06%

注：申购含红利再投份额。

##### 6.4.10.4.2 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 2017年06月30日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
宁波银行股份有限公司	6595667617.6	39.49%
员工股东	635.7	0.00%

#### 6.4.10.5 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2017年04月20日(合同生效日)-2017年06月30日	
	期末 存款余额	当期 存款利息收入
兴业银行活期存款	6,124,984.82	45,795.37

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 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
1,406,321.30	81.88	20,886,188.22	22,292,591.40	

#### 6.4.12 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

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。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30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9,999,865.00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
140220	14国开20	2017-07-07	100.10	100000	10,010,322.02

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30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。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要为各类货币市场工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现在保证本金安全和资产流动性最大化的前提下，追求超过业绩比较基准的收益的投资目标。本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会制订公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由监察稽核部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。监察稽核部由督察长分管，配置有法律、合规、风控、审计、信息披露、反洗钱等方面专业人员。

本基金的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。

#### 6.4.13.2 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。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款严格遵循《货币市场基金监督管理办法》中关于货币市场基金银行存款的管理要求，存放较为分散，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性较小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1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 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	—	—
A-1以下	—	—
未评级	1,263,516,923.68	—
合计	1,263,516,923.68	—

注：本基金持有的未评级的债券均为国债、政策性金融债或同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的

处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金份额持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于一家公司发行的短期企业债券的比例不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的短期企业债券不得超过该短期企业债券的10%。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天,且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不超过基金资产净值的40%。

于2017年6月30日,本基金所持有的全部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,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过"影子定价"对本基金面临的市场风险进行监控,定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位:人民币元

本期末 2017年06月 30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	8,775,124,	2,600,000,	—	—	—	11,375,12

	984.82	000.00				4,984.82
结算备付金	20,500.00		—	—	—	20,500.00
存出保证金	1,157.80		—	—	—	1,157.80
交易性金融资产	1,214,067,505.36	49,449,418.32	—	—	—	1,263,516,923.68
买入返售金融资产	4,064,845,436.25		—	—	—	4,064,845,436.25
应收利息			—	—	29,996,067.36	29,996,067.36
资产总计	14,054,059,584.23	2,649,449,418.32	—	—	29,996,067.36	16,733,505,069.91
负债						
卖出回购金融资产款	9,999,865.00		—	—	—	9,999,865.00
应付管理人报酬			—	—	777,711.70	777,711.70
应付托管费			—	—	194,427.89	194,427.89
应付销售服务费			—	—	38,885.63	38,885.63
应付交易费用			—	—	21,108.02	21,108.02
应付利息			—	—	1,224.77	1,224.77
应付利润			—	—	20,886,188.22	20,886,188.22
其他负债			—	—	44,984.92	44,984.92
负债总计	9,999,865.00	—	—	—	21,964,531.15	31,964,396.15
利率敏感度缺口	14,044,059,719.23	2,649,449,418.32	—	—	8,031,536.21	16,701,540,673.76

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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	上年度末
	1、市场利率上升50个基点	-1,137,148.83	—
	2、市场利率下降50个基点	1,137,148.83	—

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.13.1 公允价值

##### 6.4.13.1.1 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。

##### 6.4.13.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.13.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2017年6月30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1,263,516,923.68元，属于第三层次余额为人民币0.00元。

###### 6.4.13.1.2.2 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。

## 6.4.13.1.2.3 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。

## 6.4.13.2 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。

## 6.4.13.3 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。

## 6.4.13.4 财务报表的批准

本财务报表已于2017年8月25日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 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	1,263,516,923.68	7.55
	其中：债券	1,263,516,923.68	7.55
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	4,064,845,436.25	24.29
	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	11,375,145,484.82	67.98
4	其他资产	29,997,225.16	0.18
5	合计	16,733,505,069.91	100.00

## 7.2 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	0.14

	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	9,999,865.00	0.06
	其中：买断式回购融资	—	—

注：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

注：本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 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	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

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

注：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。

### 7.3.2 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	29.65	0.06
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	23.52	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	11.94	—
	其中：剩余存续期超过397天	—	—

	的浮动利率债		
4	90天(含)—120天	4.07	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天(含)	30.83	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	100.01	0.06

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

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。

#### 7.5 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	637,867,011.75	3.82
2	央行票据	—	—
3	金融债券	220,198,469.63	1.32
	其中：政策性金融债	220,198,469.63	1.32
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	同业存单	405,451,442.30	2.43
8	其他	—	—
9	合计	1,263,516,923.68	7.57
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。

#### 7.6 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	111715195	17民生银行CD195	4,000,000	395,841,609.10	2.37
2	020181	17贴债25	1,100,000	109,379,074.75	0.65
3	179924	17贴现国债24	1,000,000	99,516,385.50	0.60
4	179912	17贴现国债12	1,000,000	99,309,896.85	0.59
5	179920	17贴现国债20	700,000	69,795,266.66	0.42
6	140220	14国开20	600,000	60,061,932.12	0.36
7	140347	14进出47	500,000	50,049,274.44	0.30
8	150417	15农发17	500,000	49,998,087.85	0.30
9	179919	17贴现国债19	500,000	49,891,750.15	0.30
10	179907	17贴现国债07	500,000	49,814,147.92	0.30

### 7.7 “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	—
报告期内偏离度的最高值	0.0038%
报告期内偏离度的最低值	-0.0013%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0012%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 7.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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。

7.9.2 本报告期内，本基金投资前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.9.3 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	1,157.80
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	29,996,067.36
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	29,997,225.16

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
232	71,989,399. 46	16,701,405, 510.85	100.00 %	135,162.91	0.00%

### 8.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	41,330.65	0.00%

### 8.3 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年04月20日)基金份额总额	200,011,783.59
本报告期期初基金份额总额	200,011,783.59
本报告期基金总申购份额	16,501,685,301.30
减：本报告期基金总赎回份额	156,411.13
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	16,701,540,673.76

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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董事会2017年书面决议审议通过，至2017年6月30日起，赵楠先生、田中甲先生不再担任永赢基金副总经理职务。本基金管理人已于2017年7月1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情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

### 10.5 基金改聘会计师事务所情况

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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

### 10.7 本期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	债券成交金额	债券交易占当期成交总额的比例	债券回购成交金额	债券回购交易占当期成交总额的比例	权证交易成交金额	权证交易占当期成交总额的比例	应支付券商的佣金	应支付券商的佣金占当期佣金总量的比例	备注说明
信达证券	2	50,611,985.11	100.00	29,900,000.00	100.00	—	—	—	—	

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。

### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	永赢天天利货币市场基金基金合同	上海证券报、公司网站	2017-04-08
2	永赢天天利货币市场基金基金合	上海证券报、公司网站	2017-04-08

	同摘要		
3	永赢天天利货币市场基金招募说明书	上海证券报、公司网站	2017-04-08
4	永赢天天利货币市场基金托管协议	上海证券报、公司网站	2017-04-08
5	永赢天天利货币市场基金份额发售公告	上海证券报、公司网站	2017-04-08
6	永赢基金管理有限公司关于永赢天天利货币市场基金网上交易系统认申购单笔最低限额的公告	上海证券报、公司网站	2017-04-08
7	永赢天天利货币市场基金基金合同生效公告	上海证券报、公司网站	2017-04-21
8	永赢天天利货币市场基金开放日常申购、赎回业务公告	上海证券报、公司网站	2017-04-21
9	永赢天天利货币市场基金2017年"五一"假期前暂停申购业务公告	上海证券报、公司网站	2017-04-26
10	永赢天天利货币市场基金2017年"端午"假期前暂停申购业务公告	上海证券报、公司网站	2017-05-24
11	永赢天天利货币市场基金增聘基金经理的公告	上海证券报、公司网站	2017-05-27

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年4月14日-2017年6月19日	95,000,000.00	2,000,000.00	0	2,095,667,617.60	12.55%
机构	2	2017年4月14	95,000	6,500,	0	6,595,667,	39.49%

		日-2017年6月 30日	,000.0 0	000,00 0.00		617.60	
机构	3	2017年6月20 日-2017年6月 27日	0	3,000, 000,00 0.00	0	3,000,000, 000.00	17.96%
产品特有风险							
本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，存在可能因投资者的大额申购或赎回造成基金份额波动的风险。							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准永赢天天利货币市场基金募集的文件；
- 2.《永赢天天利货币市场基金基金合同》；
- 3.《永赢天天利货币市场基金招募说明书》及其更新；
- 4.《永赢天天利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。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 12.3 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，也可按工本费购买复印件。

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。

永赢基金管理有限公司

二〇一七年八月二十九日