

永赢货币市场基金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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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1月1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	9
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	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	36
7.4 报告期内投资组合平均剩余年限超过 240 天情况说明	36
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.....	44
§12	备查文件目录.....	44
12.1	备查文件目录.....	44
12.2	存放地点.....	45
12.3	查阅方式.....	45

§ 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	000533
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	28,729,107,540.04
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。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	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01月01日-2017年06月30日）
本期已实现收益	230,213,021.62
本期利润	230,213,021.62
本期净值收益率	1.8755%
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	28,729,107,540.04
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	12.5046%

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

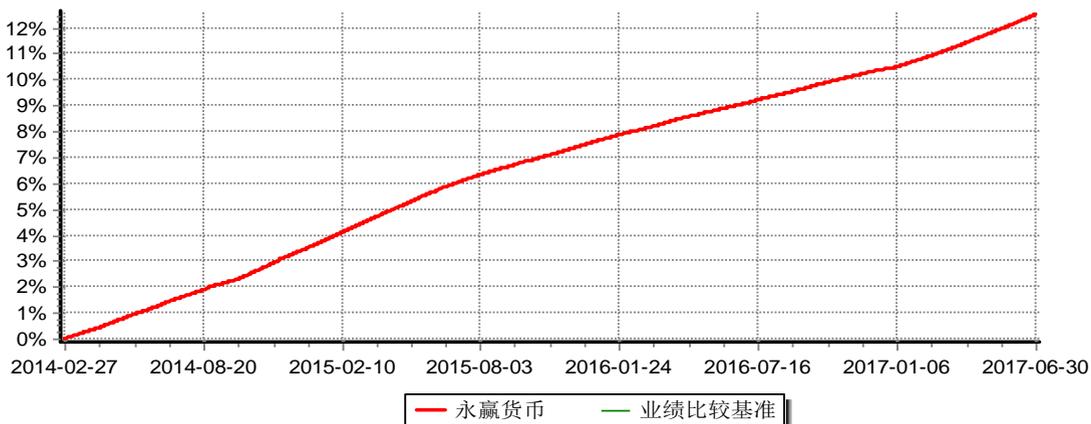
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.3525 %	0.0005 %	0.1110 %	0.0000 %	0.2415 %	0.0005 %
过去三个月	1.0229 %	0.0006 %	0.3366 %	0.0000 %	0.6863 %	0.0006 %
过去六个月	1.8755 %	0.0017 %	0.6695 %	0.0000 %	1.2060 %	0.0017 %
过去一年	3.1504 %	0.0029 %	1.3481 %	0.0000 %	1.8023 %	0.0029 %
过去三年	11.0461 %	0.0052 %	4.0500 %	0.0000 %	6.9961 %	0.0052 %
自基金合同生效日起 至今（2014年02月27 日-2017年06月30日）	12.5046 %	0.0050 %	4.5086 %	0.0000 %	7.9960 %	0.0050 %

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：7天通知存款利率

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



§ 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	2015年05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。

注：1.任职日期与离任日期一般情况下指公司作出决定之日；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，份额净值收益率为1.8755%，业绩比较基准年化收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、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

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并分配，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230,213,021.62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

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合规守信、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230,213,021.62元。

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 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	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,807,655,219.87	8,896,497.05
结算备付金		16,425,896.68	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	6,579,758,573.20	571,198,026.66
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		6,555,202,573.20	569,948,023.60
资产支持证券投资		24,556,000.00	1,250,003.06
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	9,216,242,103.48	509,600,179.40

应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	112,839,935.47	9,135,029.67
应收股利		—	—
应收申购款		37,692,099.79	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	21,009.01	—
资产总计		28,770,634,837.50	1,098,829,732.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
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
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		3,785,652.82	491,535.39
应付托管费		946,413.21	148,950.13
应付销售服务费		1,892,826.45	372,375.34
应付交易费用	6.4.7.7	97,141.99	41,791.52
应交税费		—	—
应付利息		—	156,959.48
应付利润		34,486,792.40	543,803.53
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	318,470.59	299,000.00
负债合计		41,527,297.46	262,253,465.08
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	28,729,107,540.04	836,576,267.70
未分配利润	6.4.7.10	—	—
所有者权益合计		28,729,107,540.04	836,576,267.70

负债和所有者权益总计		28,770,634,837.50	1,098,829,732.78
------------	--	-------------------	------------------

注：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28,729,107,540.04份。

6.2 利润表

会计主体：永赢货币市场基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年01月01日-2017年06月30日	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日
一、收入		260,757,812.77	47,596,811.22
1.利息收入		259,939,465.72	41,697,737.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	141,654,507.90	13,314,097.35
债券利息收入		52,037,284.46	23,127,167.88
资产支持证券利息收入		894,836.43	310,202.43
买入返售金融资产收入		65,352,836.93	4,946,269.73
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		818,347.05	5,899,073.83
其中：股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益		818,152.61	5,899,667.76
资产支持证券投资收益	6.4.7.12.3	194.44	-593.93
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.13	—	—
股利收益	6.4.7.14	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	—	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—

5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	—	—
减：二、费用		30,544,791.15	11,138,550.41
1. 管理人报酬		13,771,800.58	4,527,701.11
2. 托管费		3,779,171.15	1,372,030.63
3. 销售服务费		8,518,973.54	3,430,076.54
4. 交易费用	6.4.7.17	—	—
5. 利息支出		4,313,870.23	1,673,325.99
其中：卖出回购金融资产支出		4,313,870.23	1,673,325.99
6. 其他费用	6.4.7.18	160,975.65	135,416.14
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		230,213,021.62	36,458,260.81
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		230,213,021.62	36,458,260.81

6.3 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：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01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)	836,576,267.70	—	836,576,267.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	230,213,021.62	230,213,021.62
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)	27,892,531,272.34	—	27,892,531,272.34
其中：1.基金申购款	45,860,191,475.13	—	45,860,191,475.13

2.基金赎回款	-17,967,660,20 2.79	—	-17,967,660,202.79
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)	—	-230,213,021.6 2	-230,213,021.62
五、期末所有者权益 (基金净值)	28,729,107,540. 04	—	28,729,107,540.04
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日-2016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)	2,843,010,618.0 5	—	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)	—	36,458,260.81	36,458,260.81
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)	-858,754,547.2 7	—	-858,754,547.27
其中：1.基金申购款	5,311,178,846.1 9	—	5,311,178,846.19
2.基金赎回款	-6,169,933,393. 46	—	-6,169,933,393.46
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)	—	-36,458,260.81	-36,458,260.81
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,984,256,070.7 8	—	1,984,256,070.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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于2014年2月10日到2014年2月25日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014)验字第61090672_B01号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年2月27日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币597,106,025.00元,在募集期间产生的存款利息为人民币34,181.43元,以上实收基金(本息)合计为人民币597,140,206.43元,折合597,140,206.43份基金份额。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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年06月30日止期间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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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]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。

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。

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。

6.4.7 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	22,655,219.87
定期存款	12,785,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	1,190,000,000.00
存款期限1个月以内	2,000,000,000.00
存款期限3个月以上	9,595,000,000.00
其他存款	—
合计	12,807,655,219.87

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

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	673,447,341.49	673,361,830.00	-85,511.49	-0.0003
	银行间市场	5,881,755,231.7 1	5,886,846,000.0 0	5,090,768.29	0.0177
	合计	6,555,202,573.2 0	6,560,207,830.0 0	5,005,256.80	0.0174

注：2017年6月30日，银行间市场资产支持证券摊余成本为24,556,000.00元，影子定价为24,549,000.00元，偏离金额为-7,000.00元，偏离度为0.0000%。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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	4,620,552,000.00	—
银行间市场	4,595,690,103.48	—
合计	9,216,242,103.48	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无通过买断式回购交易取得的债券。

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	20,112.18
应收定期存款利息	85,199,388.82
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	7,919.20
应收债券利息	13,854,394.47
应收买入返售证券利息	13,746,818.31
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	11,302.49
合计	112,839,935.47

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
其他应收款	—
待摊费用	21,009.01
合计	21,009.01

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	97,141.99
合计	97,141.99

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	318,470.59
合计	318,470.59

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	836,576,267.70	836,576,267.70
本期申购	45,860,191,475.13	45,860,191,475.13
本期赎回	-17,967,660,202.79	-17,967,660,202.79
期末数	28,729,107,540.04	28,729,107,540.04

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	230,213,021.62	—	230,213,021.62
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	-230,213,021.62	—	-230,213,021.62

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01月01日-2017年06月30日
活期存款利息收入	82,397.63
定期存款利息收入	141,533,489.93
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	38,620.34
其他	—
合计	141,654,507.90

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**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 (2017年01月01日-2017年06月30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	818,152.61
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	818,152.61

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2017年01月01日-2017年06月30日)
----	---------------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,541,382,684.65
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,515,102,060.92
减：应收利息总额	25,462,471.12
买卖债券差价收入	818,152.61

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	1,259,804.02
减：卖出资产支持证券成本总额	1,250,000.00
减：应收利息总额	9,609.58
资产支持证券投资收益	194.44

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日-2017年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
其他	200.00
帐户维护费	18,129.24
汇划手续费	55,914.07
持有人大会费	6,990.99
开户费	400.00
合计	160,975.65

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
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、基金销售机构
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
永赢资产-新三板一期分级专项资产管理计划	基金管理人控制的结构化主体

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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**

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。

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01月01日 -2017年06月30日	上年度可比期间2016年01月 01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,771,800.58	4,527,701.11
其中：支付销售机构的客户维护费	104,760.58	55,225.58

注：1.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 × 0.20% / 当年天数。

2.本报告期初至2017年4月24日管理费率为0.33%，自2017年4月25日起至本报告期末管理费率为0.20%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日 -2017年06月30日	上年度可比期间2016年01月 01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,779,171.15	1,372,030.63

注：1.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0.05%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 × 0.05% / 当年天数。

2.本报告期初至2017年4月24日托管费率为0.10%，自2017年4月25日起至本报告期末托管费率为0.05%。

6.4.10.2.3 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2017年01月01日-2017年06月30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	8,195,326.47
宁波银行股份有限公司	322,982.64
合计	8,518,309.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30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	3,224,893.86
宁波银行股份有限公司	202,434.69
合计	3,427,328.55

注：1.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0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给永赢基金管理有限公司TA清算账户，再由永赢基金管理有限公司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 × 0.10% / 当年天数。

2.本报告期初至2017年4月24日销售服务费率为0.25%，自2017年4月25日起至本报告期末销售服务费率为0.10%。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）的交易。

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01月01日-2017年06月30日	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日
基金合同生效日(2014年02月27日)持有的基金份额	—	—

报告期初持有的基金份额	117,726,173.53	107,120,331.35
报告期间申购/买入总份额	34,297,221.30	47,167,332.82
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	33,000,000.00	62,000,000.00
报告期末持有的基金份额	119,023,394.83	92,287,664.17
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.41%	4.65%

注：期间申购总份额含红利再投份额。

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		上年度末 2016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
永赢资产管理有限公司	106156205.43	0.37%	66446042.41	7.94%
员工股东	1649.24	0.00%	3580.45	0.00%
宁波银行	11885638133.55	41.37%	1.01	0.00%
永赢资产-新三板一期 分级专项资产管理计 划	21098848.13	0.07%	—	0.00%
永鑫八期	—	—	11649486.07	1.39%

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01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
中国建设银行活期存款	22,655,219.87	82,397.63	10,446,339.46	32,186.41

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。

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。

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
181,931,823.97	14,338,208.78	33,942,988.87	230,213,021.62	

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，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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	219,904,987.74	140,121,974.92
A-1以下	—	—
未评级	6,359,853,585.46	431,076,051.74
合计	6,579,758,573.20	571,198,026.66

注：本基金持有的未评级的债券均为国债、政策性金融债、超短期融资券、同业存单或资产支持证券。

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约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	11,107,65 5,219.87	1,700,000, 000.00	—	—	—	12,807,65 5,219.87
结算备付金	16,425,89 6.68	—	—	—	—	16,425,89 6.68
交易性金融 资产	5,550,586, 133.58	1,029,172, 439.62	—	—	—	6,579,758, 573.20
买入返售金 融资产	9,216,242, 103.48	—	—	—	—	9,216,242, 103.48
应收利息	—	—	—	—	112,839,9 35.47	112,839,9 35.47
应收申购款	—	—	—	—	37,692,09 9.79	37,692,09 9.79
其他资产	—	—	—	—	21,009.01	21,009.01

资产总计	25,890,909,353.61	2,729,172,439.62	—	—	150,553,044.27	28,770,634,837.50
负债						
应付管理人报酬	—	—	—	—	3,785,652.82	3,785,652.82
应付托管费	—	—	—	—	946,413.21	946,413.21
应付销售服务费	—	—	—	—	1,892,826.45	1,892,826.45
应付交易费用	—	—	—	—	97,141.99	97,141.99
应付利润	—	—	—	—	34,486,792.40	34,486,792.40
其他负债	—	—	—	—	318,470.59	318,470.59
负债总计	—	—	—	—	41,527,297.46	41,527,297.46
利率敏感度缺口	25,890,909,353.61	2,729,172,439.62	—	—	109,025,746.81	28,729,107,540.04
上年度末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	260,199,0	—	—	—	—	260,199,0
融资产款	49.69	—	—	—	—	49.69
应付管理人 报酬	—	—	—	—	491,535.3 9	491,535.3 9
应付托管费	—	—	—	—	148,950.1 3	148,950.1 3
应付销售服 务费	—	—	—	—	372,375.3 4	372,375.3 4
应付交易费 用	—	—	—	—	41,791.52	41,791.52
应付利息	—	—	—	—	156,959.4 8	156,959.4 8
应付利润	—	—	—	—	543,803.5 3	543,803.5 3
其他负债	—	—	—	—	299,000.0 0	299,000.0 0
负债总计	260,199,0 49.69	—	—	—	2,054,415. 39	262,253,4 65.08
利率敏感度 缺口	799,580,5 34.88	29,915,11 8.54	—	—	7,080,614. 28	836,576,2 67.70

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	-9,956,295.21	-673,573.18
	2、市场利率下降50个基点	9,956,295.21	673,573.18

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

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 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。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 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6,579,758,573.20元，属于第三层次余额为人民币0.00元。

6.4.14.1.2.2 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。

6.4.14.1.2.3 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。

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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	6,579,758,573.20	22.87
	其中：债券	6,555,202,573.20	22.78
	资产支持证券	24,556,000.00	0.09
2	买入返售金融资产	9,216,242,103.48	32.03
	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	12,824,081,116.55	44.57
4	其他资产	150,553,044.27	0.53
5	合计	28,770,634,837.50	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	2.49	
	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	—	—
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值20%。

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	76
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	32

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。

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	49.86	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	5.16	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	15.28	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	5.19	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天（含）	24.13	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	99.62	—

注：本基金本报告期内无投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

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	1,231,062,544.74	4.29
2	央行票据	—	—
3	金融债券	200,349,021.04	0.70
	其中：政策性金融债	200,349,021.04	0.70
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	789,821,112.19	2.75
6	中期票据	—	—
7	同业存单	4,333,969,895.23	15.09
8	其他	—	—
9	合计	6,555,202,573.20	22.82
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	111709221	17浦发银行CD221	5,000,000	489,397,073.88	1.70
2	111780474	17慈溪农商银行CD008	5,000,000	488,368,157.90	1.70
3	111780374	17广东南粤银行CD092	5,000,000	482,685,971.14	1.68
4	111713057	17浙商银行CD057	4,000,000	386,597,225.27	1.35

5	0117610 26	17柯桥国资 SCP002	2,000,000	199,955,618.35	0.70
6	020172	17贴债16	2,000,000	199,858,651.28	0.70
7	1117958 76	17湖北银行 CD043	2,000,000	199,603,720.23	0.69
8	1117201 02	17广发银行 CD102	2,000,000	198,137,553.40	0.69
9	1117121 26	17北京银行 CD126	2,000,000	198,130,180.42	0.69
10	1116105 70	16兴业CD570	2,000,000	197,232,348.64	0.69

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	0.0200%
报告期内偏离度的最低值	-0.0757%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0079%

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

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	1789005	17金诚1A1	700,000.00	24,556,000.00	0.09

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。

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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	112,839,935.47
5	应收申购款	37,692,099.79
6	其他应收款	—
7	待摊费用	21,009.01
8	其他	—
9	合计	150,553,044.27

§ 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
14,280	2,011,842.26	27,795,675,501.85	96.75%	933,432,038.19	3.25%

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	185,867.21	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
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(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	836,576,267.70
本报告期基金总申购份额	45,860,191,475.13
减：本报告期基金总赎回份额	17,967,660,202.79
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	28,729,107,540.04

§ 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，本基金以现场方式召开了永赢货币市场基金基金份额持有人大会，并于2017年4月24日表决通过了《关于永赢货币市场基金调整基金管理费率、托管费率、销售服务费率的议案》及《关于根据证监会令第120号〈货币市场基金监督管理办法〉的规定修改永赢货币市场基金基金合同有关事项的议案》。

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，自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
银河证券	1	55,549,786.00	100.00	7,724,500.00	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	永赢货币市场基金2016年第4季度报告	中国证券报、公司网站	2017-01-20
2	永赢货币市场基金2017年"春节"假期前暂停申购、转换转入业务公告	中国证券报、公司网站	2017-01-23
3	永赢基金管理有限公司关于调整网上直销平台申购起点金额及申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2017-03-04
4	关于以现场方式召开永赢货币市场基金份额持有人大会的公告	中国证券报、公司网站	2017-03-24
5	永赢货币市场基金2017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	2017-03-29
6	永赢货币市场基金2016年年度报告	中国证券报、公司网站	2017-03-31
7	永赢货币市场基金2016年年度报告摘要	中国证券报、公司网站	2017-03-31
8	永赢货币市场基金更新招募说明书(2017年第1号)	中国证券报、公司网站	2017-04-11
9	永赢货币市场基金更新招募说明书摘要(2017年第1号)	中国证券报、公司网站	2017-04-11
10	永赢货币市场基金2017年第1季度报告	中国证券报、公司网站	2017-04-21
11	永赢货币市场基金基金合同(20170424持有人大会版)	中国证券报、公司网站	2017-04-25
12	永赢货币市场基金基金合同摘要(20170424持有人大会版)	中国证券报、公司网站	2017-04-25
13	永赢货币市场基金托管协议(20170424持有人大会版)	中国证券报、公司网站	2017-04-25
14	关于永赢货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报、公司网站	2017-04-25

15	关于修改永赢货币市场基金基金合同、托管协议部分条款的公告	中国证券报、公司网站	2017-04-25
16	永赢货币市场基金2017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	2017-04-26
17	永赢货币市场基金2017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	2017-05-24

§ 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1月3日-2017年6月30日	0	11,817,955,559.09	0	11,885,638,132.54	41.37%
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。

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