

永赢货币市场基金
2018 年半年度报告

2018 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:2018 年 08 月 28 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2018年8月24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2018年01月01日起至2018年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§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	6
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	7
§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合规守信情况的说明	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的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、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	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 债券回购融资情况	42
7.3 基金投资组合平均剩余期限	43
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	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	45
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	46
7.9 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.4 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	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	49

10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§ 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
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	16,229,502,066.61份
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</p>

	<p>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	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露	《中国证券报》
------------	---------

露报纸名称	
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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年01月01日- 2018年06月30日）
本期已实现收益	501,562,623.70
本期利润	501,562,623.70
本期净值收益率	2.0905%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年06月30日）
期末基金资产净值	16,229,502,066.61
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2018年06月30日）
累计净值收益率	17.3350%

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 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

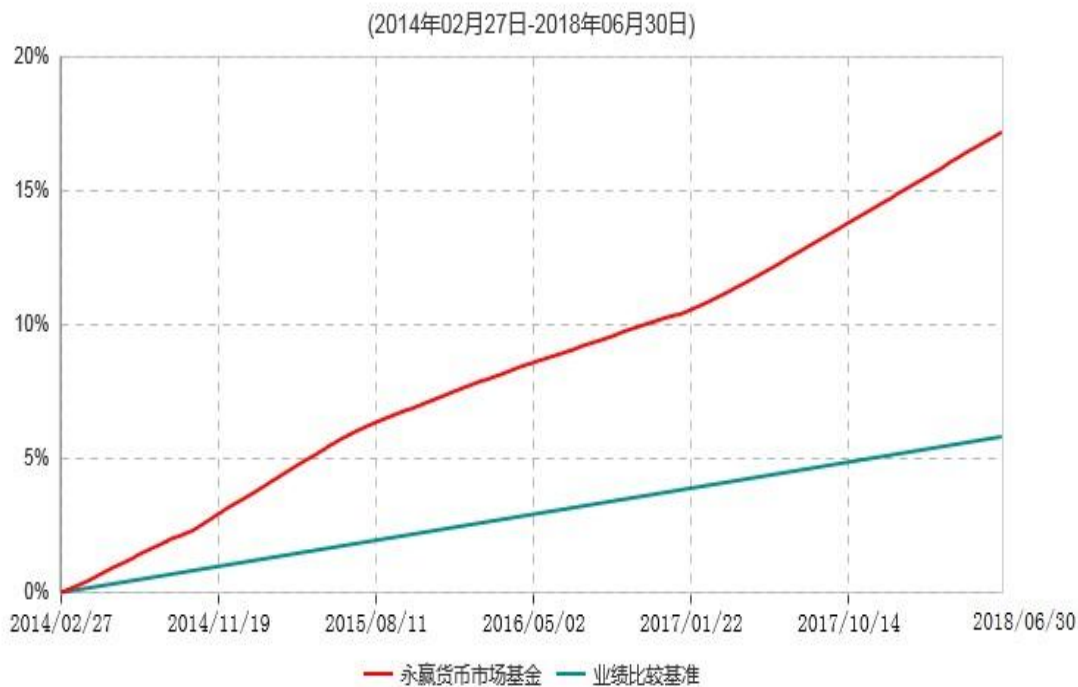
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.3420%	0.0015%	0.1110%	0.0000%	0.2310%	0.0015%
过去三个月	1.0284%	0.0014%	0.3366%	0.0000%	0.6918%	0.0014%
过去六个月	2.0905%	0.0016%	0.6695%	0.0000%	1.4210%	0.0016%
过去一年	4.2938%	0.0013%	1.3500%	0.0000%	2.9438%	0.0013%
过去三年	10.7325%	0.0033%	4.0500%	0.0000%	6.6825%	0.0033%
自基金合同 生效起至今	17.3350%	0.0045%	5.8586%	0.0000%	11.4764%	0.0045%

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收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

永赢货币市场基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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]008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），并于2017年3月14日获得中国证监会颁发的信用代码为913302007178854322的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014年8月18日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018年1月25日，公司完成增资，注册资本由人民币贰亿元增至人民币玖亿元。目前，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28.51%。

截止2018年6月30日，本基金管理人共管理16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、永赢天天利货币市场基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢永益债券型证券投资基金、永赢丰利债券型证券投资基金、永赢增益债券型证券投资基金、永赢恒益债券型证券投资基金、永赢惠益债券型证券投资基金、永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金、永赢泰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（助理）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	2015-05-20	2018-03-13	9	祁洁萍女士，东华大学应用数学硕士，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	2018-01-	-	9	乔嘉麒先生，复旦大学经济学

		03			学士、硕士，9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，从事债券及固定收益衍生品自营交易、自营投资管理、流动性管理等工作。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风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理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。

4.3.2 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年二季度国内宏观经济仍表现出较强的韧性，4月和5月的工业增加值增速分别为7.0%和6.8%，处于2017年下半年以来的高位，1-5月的出口增速达到13.3%，处于12年以来同期最高水平，房地产销售和新开工增速也在5月出现反弹，供需两方面的因素使得上半年GDP增速有望维持在6.8%附近。然而在实体去杠杆、金融严监管推进的过程中，融资从表外转回表内不顺畅，社会融资估摸增速逐步下滑，民企再融资出现严重困难，同时中美贸易摩擦不断升级、中国经济面临的外部不确定性也明显上升。在这一背景下，经济政策及时微调，其中货币政策方面，二季度先后在4月使用降准替换MLF并增量投放降准、在6月份宣布定向降准措施。

二季度资金价格呈震荡走势，同业存单价格先下后上、临近季末又快速回落，而短期资金价格较为平稳，银行间7天质押式回购加权利率均值3.39%，较一季度上行18bp，永赢货币基金配置高流动性资产为主，7日年化收益率基本保持平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢货币基金份额净值为1.0000元，本报告期内，基金份额净值收益率为2.0905%，同期业绩比较基准收益率为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

7月2日，新一届国务院金融稳定发展委员会成立并召开会议，会议强调“结构性去杠杆”，研究了“保持货币政策稳健中性、维护金融市场流动性合理充裕、把握好监管工作节奏和力度”等五项重点工作。我们认为在外部风险加大、经济和金融政策基调有所微调的情况下，社会融资增速下滑的势头将得到一定抑制，但由于融资对经济增长的影响存在滞后，并且出口增速下半年将有所走低，下半年经济增速将较上半年边际下降。不过宏观政策对冲手段将起到托底作用，下半年财政支出增速有提高的空间，基建增速有望从低位回升。三季度货币市场流动性充裕程度预计好于二季度，货币市场利率将继续走低，货币基金收益率中枢预计继续有所下行。

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人进行复核。本基金管理人估值委员会成员包括公司总经理、督察长、固定收益投资的分管领导、权益投资的分管领导、基金运营的分管领导、基金运营部负责人、合规部负责人和风险管理部负责人。以上成员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；本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

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501,562,623.70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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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501,562,623.70元。

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

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：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,254,563,287.53	14,973,326,976.70
结算备付金		-	11,827,588.23
存出保证金		-	3,893.54
交易性金融资产	6.4.7.2	11,316,609,487.32	7,511,157,194.57
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		11,186,609,487.32	7,504,678,894.57
资产支持证券投资		130,000,000.00	6,478,300.00
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	2,393,942,870.92	7,465,215,441.89
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	139,770,052.41	302,748,234.04
应收股利		-	-
应收申购款		75,286,253.22	120,572,889.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		18,180,171,951.40	30,384,852,218.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,921,285,218.03	299,999,350.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		2,885,046.38	5,614,737.04
应付托管费		721,261.57	1,403,684.27
应付销售服务费		1,442,523.18	2,807,368.47
应付交易费用	6.4.7.7	236,734.00	175,968.29
应交税费		119,497.11	-
应付利息		790,329.03	152,519.10
应付利润		22,685,989.62	49,437,716.89
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	503,285.87	399,300.00
负债合计		1,950,669,884.79	359,990,644.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	16,229,502,066.61	30,024,861,574.25
未分配利润	6.4.7.1 0	-	-
所有者权益合计		16,229,502,066.61	30,024,861,574.25
负债和所有者权益总计		18,180,171,951.40	30,384,852,218.31

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 16,229,502,066.61 份。

6.2 利润表

会计主体：永赢货币市场基金

本报告期：2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		556,224,462.00	260,757,812.77
1. 利息收入		551,012,351.23	259,939,465.72
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	261,038,460.23	141,654,507.90
债券利息收入		183,197,333.50	52,037,284.46
资产支持证券利息收		1,483,632.19	894,836.43

入			
买入返售金融资产收入		105,292,925.31	65,352,836.93
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,209,777.44	818,347.05
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-	-
基金投资收益	6.4.7.1 3	-	-
债券投资收益	6.4.7.1 4	5,209,777.44	818,152.61
资产支持证券投资收益	6.4.7.1 4.3	-	194.44
贵金属投资收益	6.4.7.1 5	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 6	-	-
股利收益	6.4.7.1 7	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 9	2,333.33	-
减：二、费用		54,661,838.30	30,544,791.15
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	24,162,446.31	13,771,800.58
2. 托管费	6.4.10. 2.2	6,040,611.69	3,779,171.15
3. 销售服务费	6.4.10. 2.3	12,081,223.09	8,518,973.54

4. 交易费用	6.4.7.2 0	-	-
5. 利息支出		12,092,598.46	4,313,870.23
其中: 卖出回购金融资产支出		12,092,598.46	4,313,870.23
6. 税金及附加		101,998.19	-
7. 其他费用	6.4.7.2 1	182,960.56	160,975.65
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		501,562,623.70	230,213,021.62
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		501,562,623.70	230,213,021.62

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: 2018年01月01日至2018年06月30日

单位: 人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018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)	30,024,861,574.25	-	30,024,861,574.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	501,562,623.70	501,562,623.70
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)	-13,795,359,507.64	-	-13,795,359,507.64
其中: 1. 基金申购款	59,842,395,553.20	-	59,842,395,553.20
2. 基金赎回款	-73,637,755,060.84	-	-73,637,755,060.84
四、本期向基金份额	-	-501,562,623.70	-501,562,623.70

持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	16,229,502,066.61	-	16,229,502,066.61
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至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	-17,967,660,202.79	-	-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)	-	-230,213,021.62	-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

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

虞俏依

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,由基金管理人永赢基金管理有限公司向社会公开募集,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。

根据基金管理人永赢基金管理有限公司于2017年4月25日发布的《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》,本基金的投资范围进行如下变更。变更前,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。

变更后,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;期限在一年以内(含一年)的银行存款、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)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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的说明

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 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）及地方教育费附加。本基金的具体缴纳标准如下：

城市维护建设税 - 按实际缴纳的流转税的7%计缴。

教育费附加 - 按实际缴纳的流转税的3%计缴。

地方教育附加 - 按实际缴纳的流转税的2%计缴。

6.4.6.4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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利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 2018年06月30日
活期存款	4,563,287.53
定期存款	4,250,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	800,000,000.00
存款期限3个月以上	3,450,000,000.00
其他存款	-
合计	4,254,563,287.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2018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	-	-	-	-
	银行间市场	11,186,609,487.32	11,201,549,000.00	14,939,512.68	0.0921
	合计	11,186,609,487.32	11,201,549,000.00	14,939,512.68	0.0921
资产支持证券		130,000,000.00	130,000,000.00	-	-
合计		11,316,609,487.32	11,331,549,000.00	14,939,512.68	0.0921

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2018年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,393,942,870.92	-
合计	2,393,942,870.92	-

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 2018年06月30日
应收活期存款利息	2,318.99

应收定期存款利息	77,788,472.22
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	55,589,463.02
应收资产支持证券利息	1,503,500.27
应收买入返售证券利息	4,886,297.91
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	139,770,052.41

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	236,734.00
合计	236,734.00

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018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	503,285.87
合计	503,285.87

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,024,861,574.25	30,024,861,574.25
本期申购	59,842,395,553.20	59,842,395,553.20
本期赎回（以“-”号填列）	-73,637,755,060.84	-73,637,755,060.84
本期末	16,229,502,066.61	16,229,502,066.61

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	501,562,623.70	-	501,562,623.70
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	-501,562,623.70	-	-501,562,623.70
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	124,678.16
定期存款利息收入	260,870,068.91
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	43,702.04
其他	11.12
合计	261,038,460.23

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 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018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	5,209,777.44
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	5,209,777.44

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	30,716,408,150.13
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	30,602,675,393.52
减：应收利息总额	108,522,979.17
买卖债券差价收入	5,209,777.44

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	6,501,292.26
减：卖出资产支持证券成本	6,478,300.00

总额	
减：应收利息总额	22,992.26
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	-
其他	2,333.33
合计	2,333.33

6.4.7.20 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	54,547.97

信息披露费	49,588.57
汇划手续费	60,374.69
帐户维护费	18,449.33
合计	182,960.56

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

2018年1月，本公司23名原自然人股东将其所持公司股权全部转让给利安资金管理公司（Lion Global Investors Limited）。本次股权变更完成后，本公司股权结构调整为：宁波银行持股71.49%，利安资金持股28.51%。

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“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
利安资金管理公司	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

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据中国证券监督管理委员会2017年12月27日证监许可（2017）2415号《关于核准永赢基金管理有限公司变更股权的批复》，永赢基金管理有限公司原自然人股东将其所持18.51%转让给利安资金管理公司，并于2018年1月10日完成工商变更登记。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无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 2018年01月01日至201 8年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,162,446.31	13,771,800.58
其中：支付销售机构的客户维护费	1,065,124.08	104,760.58

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年06月30日
----	-----------------------------------	--

当期发生的基金应支付的托管费	6,040,611.69	3,779,171.15
----------------	--------------	--------------

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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 2018年01月01日至2018年06月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
宁波银行	2,027,083.64	
永赢基金	9,989,818.06	
合计	12,016,901.70	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
宁波银行	322,982.64	
永赢基金	8,195,326.47	
合计	8,518,309.11	

注：基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方	本期 2018年01月01日至2018年06月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

名称	买入					
中国建设银行 股份有限公司	-	50,200,267. 12	-	-	-	-
上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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
-	-	-	-	-	-	-

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 2018年01月01日至2018年06 月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017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	50,000,000.00	50,000,000.00
报告期初持有的基金份 额	157,188,045.46	117,726,173.53
报告期间申购/买入总 份额	808,628.74	34,297,221.30
报告期间因拆分变动份 额	-	-
减：报告期间赎回/卖出 总份额	144,000,000.00	33,000,000.00
报告期末持有的基金份 额	13,996,674.20	119,023,394.83
报告期末持有的基金份 额占基金总份额比例	0.09%	0.41%

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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 2018年06月30日		上年度末 2017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	1,241,715.93	0.01%	93,389,232.54	0.31%
宁波银行	1,727,959,350.92	10.65%	6,111,203,383.12	20.35%

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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	4,563,287.53	124,678.16	22,655,219.87	82,397.63

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—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
472,635,921.36	55,678,429.61	-26,751,727.2	501,562,623.7	-

		7	0	
--	--	---	---	--

6.4.12 期末（2018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2018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证券款余额1,921,285,218.03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
130238	13国开38	2018-07-06	100.11	300,000	30,032,742.55
130325	13进出25	2018-07-06	100.12	500,000	50,062,468.92
130415	13农发15	2018-07-04	100.01	24,000	2,400,159.02
130415	13农发15	2018-07-06	100.01	176,000	17,601,166.15
150223	15国开23	2018-07-06	99.50	700,000	69,653,076.37
150418	15农发18	2018-07-04	99.98	2,000,000	199,959,267.63
170211	17国开11	2018-07-04	99.87	2,040,000	203,736,674.55
170211	17国开11	2018-07-05	99.87	60,000	5,992,255.13
170211	17国开11	2018-07-06	99.87	300,000	29,961,275.67
170311	17进出11	2018-07-05	99.88	400,000	39,951,824.10
170311	17进出11	2018-07-06	99.88	100,000	9,987,956.02
170410	17农发10	2018-07-06	99.97	3,500,000	349,901,212.01
170413	17农发13	2018-07-06	99.90	500,000	49,952,139.68
180201	18国开01	2018-07-05	100.04	465,000	46,518,555.00
180201	18国开01	2018-07-06	100.04	735,000	73,529,328.86
180407	18农发07	2018-07-06	99.96	500,000	49,979,439.66

111719357	17恒丰银行CD357	2018-07-02	98.45	1,450,000	142,747,056.78
111782595	17江苏江南农村商业银行CD120	2018-07-02	99.53	33,000	3,284,545.94
111782595	17江苏江南农村商业银行CD120	2018-07-05	99.53	210,000	20,901,655.95
111783160	17广州农村商业银行CD150	2018-07-02	99.44	1,100,000	109,383,569.13
111784385	17重庆农村商行CD168	2018-07-05	99.20	740,000	73,405,544.86
111808138	18中信银行CD138	2018-07-05	99.49	1,000,000	99,487,047.08
111808148	18中信银行CD148	2018-07-05	99.43	1,000,000	99,430,846.80
111808154	18中信银行CD154	2018-07-05	99.35	45,000	4,470,639.30
111815209	18民生银行CD209	2018-07-02	99.50	11,000	1,094,469.88
111815228	18民生银行CD228	2018-07-02	99.41	1,000,000	99,408,668.17
111897880	18上海农商银行CD041	2018-07-02	99.39	1,000,000	99,394,712.72
合计				19,889,000	1,982,228,297.93

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018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

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。

6.4.13.1 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，本基金管理人风险管理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。

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。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过对其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。

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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	160,029,556.15	30,012,802.10
A-1以下	-	-
未评级	2,519,098,657.13	2,546,350,939.13
合计	2,679,128,213.28	2,576,363,741.23

注：1、本期末，未评级的短期债券均是政策性金融债和超短期融资券；
2、上年度末，未评级的短期债券均是国债、政策性金融债和超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	130,000,000.00	6,478,300.00
合计	130,000,000.00	6,478,300.00

注：本期末及上年度末，未评级的短期资产支持证券均是信用评级为AAA的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	8,507,481,274.04	4,928,315,153.34
合计	8,507,481,274.04	4,928,315,153.34

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。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，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，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，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，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。

本期末，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。

本期末，除卖出回购金融资产款余额中有1,921,285,218.03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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018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	4,254,563,287.53	-	-	-	-	4,254,563,287.53
交易性金融资产	10,771,617,011.51	544,992,475.81	-	-	-	11,316,609,487.32
买入返售金融资产	2,393,942,870.92	-	-	-	-	2,393,942,870.92
应收利息	-	-	-	-	139,770,052.41	139,770,052.41
应收	-	-	-	-	75,286,253.	75,286,253.

申购款					53.22	22
资产总计	17,420,123,169.96	544,992,475.81	-	-	215,056,305.63	18,180,171,951.40
负债						
卖出回购金融资产款	1,921,285,218.03	-	-	-	-	1,921,285,218.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,885,046.38	2,885,046.38
应付托管费	-	-	-	-	721,261.57	721,261.57
应付销售服务费	-	-	-	-	1,442,523.18	1,442,523.18
应付交易费用	-	-	-	-	236,734.00	236,734.00
应交税费	-	-	-	-	119,497.11	119,497.11
应付利息	-	-	-	-	790,329.03	790,329.03
应付利润	-	-	-	-	22,685,989.62	22,685,989.62
其他负债	-	-	-	-	503,285.87	503,285.87
负债总计	1,921,28	-	-	-	29,384,6	1,950,669,8

	5,218.03				66.76	84.79
利率 敏感 度缺 口	15,498,83 7,951.93	544,992, 475.81	-	-	185,671, 638.87	16,229,502, 066.61
上年 度末2 017年 12月3 1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	13,273,32 6,976.70	1,700,00 0,000.00	-	-	-	14,973,326, 976.70
结算 备付 金	11,827,58 8.23	-	-	-	-	11,827,588. 23
存出 保证 金	3,893.54	-	-	-	-	3,893.54
交易 性金 融资 资产	6,944,82 5,912.01	566,331, 282.56	-	-	-	7,511,157,1 94.57
买入 返售 金融 资产	7,465,21 5,441.89	-	-	-	-	7,465,215,4 41.89
应收 利息	-	-	-	-	302,748, 234.04	302,748,23 4.04
应收 申购 款	-	-	-	-	120,572, 889.34	120,572,88 9.34
资产 总计	27,695,19 9,812.37	2,266,33 1,282.56	-	-	423,321, 123.38	30,384,852, 218.31

负债						
卖出回购金融资产款	299,999,350.00	-	-	-	-	299,999,350.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,614,737.04	5,614,737.04
应付托管费	-	-	-	-	1,403,684.27	1,403,684.27
应付销售服务费	-	-	-	-	2,807,368.47	2,807,368.47
应付交易费用	-	-	-	-	175,968.29	175,968.29
应付利息	-	-	-	-	152,519.10	152,519.10
应付利润	-	-	-	-	49,437,716.89	49,437,716.89
其他负债	-	-	-	-	399,300.00	399,300.00
负债总计	299,999,350.00	-	-	-	59,991,294.06	359,990,644.06
利率敏感度缺口	27,395,200,462.37	2,266,331,282.56	-	-	363,329,829.32	30,024,861,574.25

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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-14,481,877.41	-7,405,746.54
	市场利率平行下降50个基点	14,481,877.41	7,405,746.54

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2018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金额11,316,609,487.32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2018年8月27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	11,316,609,487.32	62.25
	其中：债券	11,186,609,487.32	61.53
	资产支持证券	130,000,000.00	0.72
2	买入返售金融资产	2,393,942,870.92	13.17
	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	4,254,563,287.53	23.40
4	其他各项资产	215,056,305.63	1.18
5	合计	18,180,171,951.40	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)
----	----	---------------

1	报告期内债券回购融资余额	3.50	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,921,285,218.03	11.84
	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	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

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	25.74	11.84
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	15.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	33.01	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
4	90天(含)—120天	8.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	27.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		110.69	11.84

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,628,368,436.05	10.03
	其中：政策性金融债	1,628,368,436.05	10.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,050,759,777.23	6.47
6	中期票据	-	-
7	同业存单	8,507,481,274.04	52.42
8	其他	-	-
9	合计	11,186,609,487.32	68.93
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	111810263	18兴业银行C D263	5,500,000	545,826,38 3.49	3.36
2	111895168	18盛京银行C D135	4,000,000	399,526,12 8.35	2.46
3	170410	17农发10	3,500,000	349,901,21 2.01	2.16
4	111896580	18南京银行C D069	3,000,000	298,710,63 3.86	1.84
5	111895752	18郑州银行C D054	3,000,000	296,076,85 5.72	1.82
6	170211	17国开11	2,400,000	239,690,20 5.35	1.48
7	150418	15农发18	2,000,000	199,959,26 7.63	1.23
8	111806130	18交通银行C D130	2,000,000	199,128,53 5.97	1.23
9	150223	15国开23	2,000,000	199,008,78 9.64	1.23
10	111820110	18广发银行C D110	2,000,000	198,780,88 3.47	1.22
11	111810238	18兴业银行C D238	2,000,000	198,780,88 3.47	1.22
12	111809147	18浦发银行C D147	2,000,000	198,780,88 3.47	1.22

注：本基金本报告期末持有的债券中有三只债券的摊余成本相等，按照摊余成本的大小排名并列第十位，故本基金本报告期末前十名债券明细中实际填列了十二只债券。

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	0.0983%

报告期内偏离度的最低值	0.0074%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0423%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

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	149086	借呗49A1	800,000	80,000,000.00	0.49
2	149417	宁远03A1	500,000	50,000,000.00	0.31

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1.0000元。

7.9.2 1、本报告期内，本基金持有的18浦发银行CD074，其发行人上海浦东发展银行股份有限公司于2018年1月19日发布了《上海浦东发展银行股份有限公司关于成都分行处罚事项的公告》公告，公告披露了上海浦东发展银行股份有限公司成都分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书（川银监罚字【2018】2号）的相关情况，并表示相关罚款金额以全额计入2017年度公司损益，对公司的业务开展及持续经营无重大不利影响。

2、本报告期内，本基金持有的18南京银行CD069，其发行人南京银行股份有限公司于2018年1月30日发布了《南京银行股份有限公司关于镇江分行行政处罚事项公告》，公告披露了南京银行股份有限公司镇江分行收到中国银行业监督管理委员会江苏监管

局行政处罚决定书（苏银监罚决字【2018】1号）的相关情况，并表示相关处罚对公司业务和财务状况无重大不利影响。

3、本报告期内，本基金持有的18浦发银行CD147，其发行人上海浦东发展银行股份有限公司于2018年1月19日发布了《上海浦东发展银行股份有限公司关于成都分行处罚事项的公告》，公告披露了上海浦东发展银行股份有限公司成都分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书（川银监罚字【2018】2号）的相关情况，并表示相关罚款金额以全额计入2017年度公司损益，对公司的业务开展及持续经营无重大不利影响。

除此之外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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	应收利息	139,770,052.41
4	应收申购款	75,286,253.22
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	215,056,305.63

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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	持有份额	占总份

			额比例		额比例
61,623	263,367.61	12,709,280,823.92	78.31%	3,520,221,242.69	21.69%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	1,727,959,349.63	10.65%
2	基金类机构	1,004,195,725.28	6.19%
3	银行类机构	729,299,886.63	4.49%
4	银行类机构	605,804,867.75	3.73%
5	银行类机构	602,172,872.11	3.71%
6	银行类机构	601,644,877.89	3.71%
7	银行类机构	517,470,634.56	3.19%
8	银行类机构	509,571,101.92	3.14%
9	银行类机构	504,687,122.56	3.11%
10	基金类机构	434,553,792.64	2.68%

8.3 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	132,467.05	-

8.4 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、基金投资和研发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	0~10

§ 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	30,024,861,574.25

本报告期基金总申购份额	59,842,395,553.20
减：本报告期基金总赎回份额	73,637,755,060.84
本报告期期末基金份额总额	16,229,502,066.61

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金管理人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

本报告期内，本基金管理人没有发生重大人事变动。

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。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河	1	-	-	-	-	-

证券						
----	--	--	--	--	--	--

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
银河证券	-	-	8,548,640,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢货币市场基金增聘基金经理的公告	中国证券报、公司网站	2018-01-04
2	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-01-04
3	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-01-05
4	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-01-09
5	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-01-17
6	永赢货币市场基金2017年第四季度报告	中国证券报、公司网站	2018-01-19
7	永赢基金管理有限公司关于	中国证券报、公司网站	2018-01-27

	新增南京苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告		
8	永赢基金管理有限公司关于参加南京苏宁基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2018-02-03
9	永赢货币市场基金2018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	2018-02-12
10	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-03-07
11	永赢货币市场基金的基金经理变更公告	中国证券报、公司网站	2018-03-14
12	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-03-15
13	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-03-17
14	永赢货币市场基金基金合同（《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改版本）	中国证券报、公司网站	2018-03-23
15	永赢基金管理有限公司关于永赢货币市场基金根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同及托管协议的公告	中国证券报、公司网站	2018-03-23
16	永赢货币市场基金托管协议（《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改版本）	中国证券报、公司网站	2018-03-23
17	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-03-28
18	永赢货币市场基金2017年年度报告	中国证券报、公司网站	2018-03-30

19	永赢货币市场基金2017年年度报告摘要	中国证券报、公司网站	2018-03-30
20	永赢货币市场基金2018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	2018-04-02
21	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-04-04
22	永赢货币市场基金更新招募说明书（2018年第1号）	中国证券报、公司网站	2018-04-13
23	永赢货币市场基金更新招募说明书摘要（2018年第1号）	中国证券报、公司网站	2018-04-13
24	永赢货币市场基金2018年第一季度报告	中国证券报、公司网站	2018-04-23
25	永赢货币市场基金2018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	2018-04-25
26	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-05-02
27	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-05-22
28	永赢货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-06-05
29	永赢货币市场基金2018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	2018-06-13
30	永赢货币市场基金恢复办理大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、公司网站	2018-06-20
31	关于永赢货币市场基金在宁波银行股份有限公司提供的快速赎回业务限额调整的公告	中国证券报、公司网站	2018-06-27

§ 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	2018年1月1日 - 2018年1月2日	6,197,959,349.63	230,000,000.00	4,700,000,000.00	1,727,959,349.63	10.65%
	2	2018年1月25日 - 2018年2月7日	6,197,959,349.63	230,000,000.00	4,700,000,000.00	1,727,959,349.63	10.65%
	3	2018年2月13日 - 2018年3月25日	6,197,959,349.63	230,000,000.00	4,700,000,000.00	1,727,959,349.63	10.65%
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. 《永赢货币市场基金托管协议》；
4. 《永赢货币市场基金招募说明书》及其更新
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

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦27楼

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，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：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

永赢基金管理有限公司
二〇一八年八月二十八日