

永赢天天利货币市场基金

2021 年中期报告

2021 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:2021 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。本中期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2021年8月26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2021年01月01日起至2021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	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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 债券回购融资情况	45
7.3 基金投资组合平均剩余期限	45
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	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	47
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	47
7.8 期末按摊余成本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	48
7.9 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§9 开放式基金份额变动	50

§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	52
10.9 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 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	55,854,253,164.41份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E
下属分级基金的交易代码	004545	012105
报告期末下属分级基金的份额总额	55,854,034,893.55份	218,270.86份

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</p>

	<p>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	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	400-805-8888	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21世纪大厦21、22、27层	上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码	200120	200120
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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层

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	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪大厦21、22、27层

§ 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 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E
本期已实现收益	743,983,864.93	1,036.18
本期利润	743,983,864.93	1,036.18
本期净值收益率	1.2944%	0.3220%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末基金资产净值	55,854,034,893.55	218,270.86
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
累计净值收益率	14.4670%	0.3220%

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、本基金利润分配按日结转份额。

3、自2021年4月28日起，永赢天天利货币市场基金增设E类份额类别，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

永赢天天利货币A

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	0.2018%	0.0008%	0.1110%	0.0000%	0.0908%	0.0008%
过去三个月	0.6341%	0.0011%	0.3366%	0.0000%	0.2975%	0.0011%
过去六个月	1.2944%	0.0008%	0.6695%	0.0000%	0.6249%	0.0008%
过去一年	2.5370%	0.0015%	1.3481%	0.0000%	1.1889%	0.0015%
过去三年	8.8521%	0.0021%	4.0500%	0.0000%	4.8021%	0.0021%
自基金合同	14.4670%	0.0027%	5.6663%	0.0000%	8.8007%	0.0027%

生效起至今					7%	7%
-------	--	--	--	--	----	----

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）。

永赢天天利货币E

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	0.1819%	0.0008%	0.1110%	0.0000%	0.0709%	0.0008%
自基金合同 生效起至今	0.3220%	0.0010%	0.2367%	0.0000%	0.0853%	0.0010%

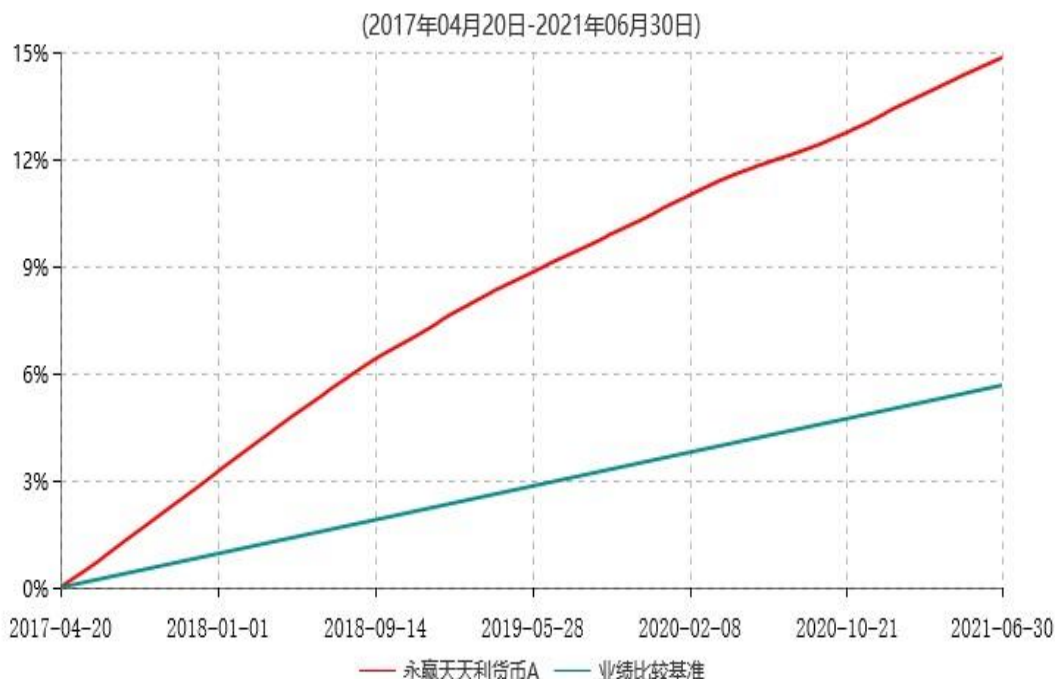
注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本基金业绩比较基准为：同期 7 天通知存款利率（税后）。

3、永赢天天利货币市场基金 E 类份额合同生效日为 2021 年 4 月 28 日。

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

永赢天天利货币A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约定。

永赢天天利货币E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：本基金自 2021 年 4 月 28 日增设 E 类基金份额，截至本报告期末，本类基金份额生效未满 1 年。

§ 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%，华侨银行有限公司持股28.51%。

截止2021年6月30日，本基金管理人共管理78只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、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、永

永赢天天利货币市场基金、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、永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢嘉益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢裕益债券型证券投资基金、永赢祥益债券型证券投资基金、永赢通益债券型证券投资基金、永赢诚益债券型证券投资基金、永赢伟益债券型证券投资基金、永赢昌益债券型证券投资基金、永赢宏益债券型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢智益纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢沪深300指数型发起式证券投资基金、永赢众利债券型证券投资基金、永赢同利债券型证券投资基金、永赢昌利债券型证券投资基金、永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢乾元三年定期开放混合型证券投资基金、永赢科技驱动混合型证券投资基金、永赢元利债券型证券投资基金、永赢易弘债券型证券投资基金、永赢股息优选混合型证券投资基金、永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金、永赢中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金、永赢医药健康股票型证券投资基金、永赢邦利债券型证券投资基金、永赢中证500交易型开放式指数证券投资基金、永赢瑞宁87个月定期开放债券型证券投资基金、永赢成长领航混合型证券投资基金、永赢鼎利债券型证券投资基金、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金、永赢泰宁63个月定期开放债券型证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢鑫享混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫欣混合型证券投资基金、永赢稳健增利18个月持有期混合型证券投资基金、永赢鑫盛混合型证券投资基金、永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、永赢惠添益混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢港股通优质成长一年持有期混合型证券投资基金、永赢深证创新100交易型开放式指数证券投资基金。

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		
卢绮婷	基金经理	2018-08-24	-	5	卢绮婷女士，上海交通大学金融学硕士，5年证券相关从业经验。曾任宁波银行金融市场部流动性管理岗，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。
胡雪骥	基金经理	2021-02-02	-	7	胡雪骥先生，硕士，7年证券相关从业经验。曾任交通银行资产管理业务中心投资经理，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。
胡雪骥	基金经理助理	2019-08-12	2021-01-22	7	胡雪骥先生，硕士，7年证券相关从业经验。曾任交通银行资产管理业务中心投资经理，永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理助理，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。
俞灏	基金经理助理	2021-03-01	-	4	俞灏先生，硕士，4年证券相关从业经验。曾任东海基金管理有限公司助理债券研究员，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理助理。

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授权管理制度、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、比例分配”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，分别于每季度和每年度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进行分析，每季度对连续四个季度期间内、不同时间窗下不同投资组合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，未发现显著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

上半年经济数据受基数效应驱动，显著的前高后低，一、二季度GDP增速分别录得18.3%、7.9%；但剔除基数后，经济表现恰好相反，一季度受就地过年等影响，第三产业产值有明显回落，经济2年复合增速5%左右，二季度经济各产业均全面好转，经济2年

复合增速回弹至5.5%。经济结构上，出口、生产和投资都比较旺盛，消费、服务业虽有复苏，但速度较慢，经济呈现出结构性失衡。

物价水平方面，工业品价格不断攀升，迭创新高，PPI同比上探9%，显著超过前一轮周期高点且并没呈现出明显的回落迹象；与之相对应，随着猪瘟影响的消退，猪肉为代表的农产品价格受供需两方面影响，显著回落，CPI上行但幅度偏弱，核心CPI则依然位于1%以下，核心消费动能回弹较慢。

政策方面，上半年货币政策保持了常态化的OMO投放和等量MLF续作，政策态度中性偏呵护；财政行为则明显后置，债券供给速度持续慢于市场预期，利率资产供应偏少，导致整个债券市场供需力量偏向于欠配。

报告期内本基金根据货币市场利率的波动情况，主要配置同业存款、同业存单、逆回购以及高等级短期融资债券。一季度，1月末货币市场利率短暂冲高后逐步企稳下行，本基金逐步提高久期至偏高水平。二季度，货币政策态度趋稳，利率水平继续下行，本基金维持中高久期并采取灵活的杠杆策略，季度末增加组合流动性妥善应对赎回冲击，确保流动性安全的同时为投资者提供稳定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢天天利货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.2944%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；截至报告期末永赢天天利货币E基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.3220%，同期业绩比较基准收益率为0.2367%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后续展望来看，6月的经济数据表明经济动能并没有明显的走弱，而且目前来看，工业生产、出口、投资都面临了供给干扰约束，需求动能并没有完全释放，下半年经济总体上可能处于一个平缓磨顶的状态，难以出现明显失速，核心还是消费等板块复苏状态能否持续。物价同比表现预计也将类似，总体上斜率陡峭向上的时期已过，但并不会快速下滑，而是震荡磨顶状态。

政策方面，7月初全面降准后货币政策基调难言全面转向，但流动性预期明显改善，预计货币市场利率以政策利率为锚在目前水平上窄幅波动。本基金将保持中高久期及灵活杠杆，以配置资质较好的银行存款、同业存单、回购及高等级短期融资债券为主，以流动性安全为首要目标的同时追求相对稳定的投资收益。

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/研究的分管领导、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，以各类基金份额的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，每日进行支付。报告期内本基金向份额持有人分配利润743,984,901.11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、利润分配等情况的说明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、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 中期财务会计报告(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：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	16,301,157,055.03	11,150,518,926.06
结算备付金		70,267,369.41	29,509,769.10
存出保证金		39,141.08	32,420.08
交易性金融资产	6.4.7.2	35,263,247,946.76	31,151,538,585.73
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		35,246,857,946.76	31,051,538,585.73
资产支持证券投资		16,390,000.00	100,000,000.00
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	8,028,753,822.16	11,070,623,064.93
应收证券清算款		-	18,871.23
应收利息	6.4.7.5	268,577,105.95	151,231,996.43
应收股利		-	-
应收申购款		14,187,423.57	3,769,985.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		59,946,229,863.96	53,557,243,619.48

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		4,073,164,432.69	1,769,986,545.00
应付证券清算款		8,931.51	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,368,399.38	7,601,802.56
应付托管费		2,592,099.88	1,900,450.61
应付销售服务费		518,465.66	380,090.12
应付交易费用	6.4.7.7	461,409.28	464,298.00
应交税费		284,979.51	454,714.45
应付利息		848,967.54	301,534.42
应付利润		3,587,616.46	4,002,183.49
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	141,397.64	267,446.33
负债合计		4,091,976,699.55	1,785,359,064.98
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	55,854,253,164.41	51,771,884,554.50
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		55,854,253,164.41	51,771,884,554.50
负债和所有者权益总计		59,946,229,863.96	53,557,243,619.48

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额55,854,253,164.41份。其中A类基金份额净值1.0000元，份额总额55,854,034,893.55份；E类基金份额净值1.0000元，份额总额218,270.86份。

6.2 利润表

会计主体：永赢天天利货币市场基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		849,340,185.67	590,045,534.16
1. 利息收入		842,757,912.30	579,642,399.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	235,940,498.73	151,579,294.51
债券利息收入		508,866,043.56	350,126,033.63
资产支持证券利息 收入		783,881.81	2,350,643.21
买入返售金融资产 收入		97,167,488.20	75,586,427.67
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		6,582,273.37	10,403,135.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,582,273.37	10,399,241.14
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	3,894.00
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）		-	-
减：二、费用		105,355,284.56	81,589,978.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.	57,470,510.38	42,293,354.55

	1		
2. 托管费	6.4.10.2. 2	14,367,627.63	10,573,338.64
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	2,873,634.62	2,114,667.80
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		30,231,686.48	26,378,937.83
其中：卖出回购金融资产支出		30,231,686.48	26,378,937.83
6. 税金及附加		205,303.58	45,774.22
7. 其他费用	6.4.7.19	206,521.87	183,905.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		743,984,901.11	508,455,556.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		743,984,901.11	508,455,556.09

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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021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）	51,771,884,554.50	-	51,771,884,554.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	743,984,901.11	743,984,901.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	4,082,368,609.91	-	4,082,368,609.91

“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	39,936,603,900.26	-	39,936,603,900.26
2. 基金赎回款	-35,854,235,290.35	-	-35,854,235,290.35
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)	-	-743,984,901.11	-743,984,901.11
五、期末所有者权益(基金净值)	55,854,253,164.41	-	55,854,253,164.41
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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)	44,148,382,855.97	-	44,148,382,855.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	508,455,556.09	508,455,556.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,935,606,463.69	-	-2,935,606,463.69
其中: 1. 基金申购款	18,212,252,693.78	-	18,212,252,693.78
2. 基金赎回款	-21,147,859,157.47	-	-21,147,859,157.47
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)	-	-508,455,556.09	-508,455,556.09
五、期末所有者权益(基金净值)	41,212,776,392.28	-	41,212,776,392.28

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

黄庆

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，由基金管理人永赢基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2017年4月20日生效，首次设立募集规模为200,011,783.59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和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。

根据基金管理人于2021年4月22日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢天天利货币市场基金增设E类基金份额并修改基金合同及托管协议部分条款的公告》，自2021年4月28日起，对永赢天天利货币市场基金在现有份额的基础上增设E类基金份额，原基金份额转为A类基金份额。

两类基金份额单独设置基金代码，按照不同的费率计提销售服务费用，并分别公布各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率。投资人可自行选择申购的基金份额类别。除非基金管理人在未来另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

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397天以内（含397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。

本基金的业绩比较基准为：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》、《公开募集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3号《半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〈年度报告和中期报告〉》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2021年6月30日的财务状况以及自2021年1月1日起至2021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 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。

6.4.6.2 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事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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
----	-----

	2021年06月30日
活期存款	1,157,055.03
定期存款	16,300,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	1,000,000,000.00
存款期限3个月以上	15,300,000,000.00
其他存款	-
合计	16,301,157,055.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021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	501,798,417.52	500,340,000.00	-1,458,417.52	-0.0026
	银行间市场	34,745,059,529.24	34,765,760,000.00	20,700,470.76	0.0371
	合计	35,246,857,946.76	35,266,100,000.00	19,242,053.24	0.0345
资产支持证券		16,390,000.00	16,420,000.00	30,000.00	0.0001
合计		35,263,247,946.76	35,282,520,000.00	19,272,053.24	0.0345

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
----	-----

	2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,467,300,000.00	-
银行间市场	5,561,453,822.16	-
合计	8,028,753,822.16	-

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 2021年06月30日
应收活期存款利息	277.27
应收定期存款利息	123,593,531.12
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	31,620.30
应收债券利息	140,186,156.90
应收资产支持证券利息	89,384.32
应收买入返售证券利息	4,676,118.44
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	17.60
合计	268,577,105.95

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末

	2021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	461,409.28
合计	461,409.28

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	128,162.26
其他	13,235.38
合计	141,397.64

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 永赢天天利货币A

金额单位：人民币元

项目 (永赢天天利货币A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	51,771,884,554.50	51,771,884,554.50
本期申购	39,935,871,056.54	39,935,871,056.54
本期赎回(以“-”号填列)	-35,853,720,717.49	-35,853,720,717.49
本期末	55,854,034,893.55	55,854,034,893.55

6.4.7.9.2 永赢天天利货币E

金额单位：人民币元

项目 (永赢天天利货币E)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	-	-
本期申购	732,843.72	732,843.72
本期赎回（以“-”号填列）	-514,572.86	-514,572.86
本期末	218,270.86	218,270.86

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 根据基金管理人于2021年4月22日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢天天利货币市场基金增设E类基金份额并修改基金合同及托管协议部分条款的公告》，自2021年4月28日起，对本基金在现有份额的基础上增设E类基金份额，原基金份额转为A类基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 永赢天天利货币A

单位：人民币元

项目 (永赢天天利货币A)	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	743,983,864.93	-	743,983,864.93
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	-743,983,864.93	-	-743,983,864.93
本期末	-	-	-

6.4.7.10.2 永赢天天利货币E

单位：人民币元

项目 (永赢天天利货币E)	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	1,036.18	-	1,036.18
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	-1,036.18	-	-1,036.18
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	91,441.78
定期存款利息收入	235,317,363.55
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	531,493.83
其他	199.57
合计	235,940,498.73

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

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 2021年01月01日至2021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	6,582,273.37
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	6,582,273.37

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
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	65,241,974,235.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	64,963,280,841.92
减：应收利息总额	272,111,120.00
买卖债券差价收入	6,582,273.37

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	84,191,022.08
减：卖出资产支持证券成本总额	83,610,000.00
减：应收利息总额	581,022.08
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

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 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	70,589.61
账户维护费	16,917.52
合计	206,521.87

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

本报告期内本公司不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。

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、基金销售机构
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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债券回购交易。

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	57,470,510.38	42,293,354.55
其中：支付销售机构的客户维护费	183,707.27	152,306.32

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,367,627.63	10,573,338.64

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 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E	合计
永赢基金	2,844,643.41	0.00	2,844,643.41
宁波银行	4,380.00	0.00	4,380.00
合计	2,849,023.41	0.00	2,849,023.41
获得销售	上年度可比期间		

服务费的各关联方名称	2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E	合计
永赢基金	2,098,020.30	0.00	2,098,020.30
宁波银行	2,515.34	0.00	2,515.34
合计	2,100,535.64	0.00	2,100,535.64

注：自2021年4月28日起，本基金增加收取销售服务费的E类份额。本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.01%，销售服务费按前一日A类基金份额的基金资产净值的0.01%年费率计提，E类基金份额的销售服务费年费率为0.25%，销售服务费按前一日E类基金份额的基金资产净值的0.25%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为基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为基金份额前一日基金资产净值

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

本期 2021年01月01日至2021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
兴业银行	-	-	-	-	10,766,019,000.00	856,313.77
上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
兴业银行	395,643,560.66	-	-	-	1,022,475,000.00	51,264.14

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

永赢天天利货币A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	297,835,782.56	188,192,327.52
报告期间申购/买入总份额	22,693,737.28	101,357,312.81
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	195,000,000.00	185,000,000.00
报告期末持有的基金份额	125,529,519.84	104,549,640.33
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2247%	0.2537%

永赢天天利货币E

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00

报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.10.5.2 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

永赢天天利货币A

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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	234,981,262.97	0.4207%	123,032,119.60	0.2376%
宁波银行	0.00	0.0000%	1,793,141,084.15	3.4635%
兴业银行	1,725,814,474.73	3.0899%	11,702,117,662.52	22.6032%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资永赢天天利货币E。

6.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
兴业银行	1,157,055.03	7,208,108.39	882,395.47	8,996,964.70

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金

永赢天天利货币A

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
742,995,198.54	1,403,246.01	-414,579.62	743,983,864.9 3	-

永赢天天利货币E

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
984.78	38.81	12.59	1,036.18	-

6.4.12 期末（2021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2021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人民币3,773,164,432.69元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估 值单价	数量（张）	期末估值总额
112008282	20中信银行CD2 82	2021-07-01	99.73	1,805,000	180,020,563.74
112107031	21招商银行CDO 31	2021-07-01	99.56	323,000	32,157,624.84
112109023	21浦发银行CDO 23	2021-07-01	98.46	3,000,000	295,372,662.94

160312	16进出12	2021-07-01	100.17	1,000,000	100,169,669.77
180212	18国开12	2021-07-01	100.24	9,100,000	912,154,740.04
200010	20付息国债10	2021-07-01	99.99	1,000,000	99,992,666.75
200216	20国开16	2021-07-01	100.09	6,000,000	600,524,531.46
200309	20进出09	2021-07-01	100.01	845,000	84,510,374.39
200314	20进出14	2021-07-01	100.11	2,106,000	210,823,704.84
200314	20进出14	2021-07-02	100.11	4,094,000	409,834,875.40
200406	20农发06	2021-07-01	100.00	2,583,000	258,291,437.29
200409	20农发09	2021-07-01	100.05	2,800,000	280,146,244.90
2103677	21进出677	2021-07-01	99.68	3,000,000	299,043,644.18
2103678	21进出678	2021-07-01	99.64	815,000	81,206,835.93
2103678	21进出678	2021-07-02	99.64	1,185,000	118,073,743.03
合计				39,656,000	3,962,323,319.50

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币300,000,000.00元，于2021年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

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，使本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体系。五道防线分别为员工自律、自控和互控的第一道防线，部门内控和部门之间互相监督的第二道防线，合规管理及风险管理部门监控检查的第三道防线，公司风

风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险管理进行监督管理的第五道防线。

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，因此违约风险可能性很小；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，以控制相应的信用风险。

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。

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	470,314,746.70	50,000,566.89
A-1以下	-	-
未评级	9,071,332,323.52	7,031,183,259.09
合计	9,541,647,070.22	7,081,183,825.98

注：国债、政策性金融债或短期融资券列示为未评级。

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-

A-1以下	-	-
未评级	16,390,000.00	100,000,000.00
合计	16,390,000.00	100,000,000.00

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	25,705,210,876.54	23,970,354,759.75
合计	25,705,210,876.54	23,970,354,759.75

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》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。

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，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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受

限制的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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。

本基金主要投资于固定收益品种，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

单位：人民币元

本期末 2021年0 6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	15,801,157,055.03	500,000,000.00	-	-	-	16,301,157,055.03
结算备付金	70,267,369.41	-	-	-	-	70,267,369.41
存出保证金	39,141.08	-	-	-	-	39,141.08
交易性金融资产	32,733,410,274.00	2,529,837,672.76	-	-	-	35,263,247,946.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	8,028,753,822.16	-	-	-	-	8,028,753,822.16
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	268,577,105.95	268,577,105.95
应收股利	-	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	14,187,423.57	14,187,423.57
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	56,633,627,66 1.68	3,029,837,67 2.76	-	-	282,764,529. 52	59,946,229,86 3.96
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	4,073,164,432.6 9	-	-	-	-	4,073,164,432.6 9
应付证券清算款	-	-	-	-	8,931.51	8,931.51
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	10,368,399.3 8	10,368,399.38
应付托管费	-	-	-	-	2,592,099.88	2,592,099.88
应付销售服务费	-	-	-	-	518,465.66	518,465.66
应付交易费用	-	-	-	-	461,409.28	461,409.28
应付税费	-	-	-	-	284,979.51	284,979.51
应付利息	-	-	-	-	848,967.54	848,967.54
应付利润	-	-	-	-	3,587,616.46	3,587,616.46
其他负债	-	-	-	-	141,397.64	141,397.64
负债总计	4,073,164,432. 69	-	-	-	18,812,266.8 6	4,091,976,699. 55
利率敏感度缺口	52,560,463,22 8.99	3,029,837,67 2.76	-	-	263,952,262. 66	55,854,253,16 4.41
上年度末 2020年1 2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	9,750,518,926.0 6	1,400,000,000. 00	-	-	-	11,150,518,926. 06

结算备付金	29,509,769.10	-	-	-	-	29,509,769.10
存出保证金	32,420.08	-	-	-	-	32,420.08
交易性金融资产	30,462,143,620.20	689,394,965.53	-	-	-	31,151,538,585.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	11,070,623,064.93	-	-	-	-	11,070,623,064.93
应收证券清算款	-	-	-	-	18,871.23	18,871.23
应收利息	-	-	-	-	151,231,996.43	151,231,996.43
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	3,769,985.92	3,769,985.92
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	51,312,827,800.37	2,089,394,965.53	0.00	0.00	155,020,853.58	53,557,243,619.48
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	1,769,986,545.00	-	-	-	-	1,769,986,545.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	7,601,802.56	7,601,802.56
应付托管费	-	-	-	-	1,900,450.61	1,900,450.61
应付销售服务费	-	-	-	-	380,090.12	380,090.12
应付交易费用	-	-	-	-	464,298.00	464,298.00
应付税费	-	-	-	-	454,714.45	454,714.45

应付利息	-	-	-	-	301,534.42	301,534.42
应付利润	-	-	-	-	4,002,183.49	4,002,183.49
其他负债	-	-	-	-	267,446.33	267,446.33
负债总计	1,769,986,545.00	0.00	0.00	0.00	15,372,519.98	1,785,359,064.98
利率敏感度缺口	49,542,841,255.37	2,089,394,965.53	0.00	0.00	139,648,333.60	51,771,884,554.50

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-44,705,107.04	-39,096,003.39
	市场利率平行下降50个基点	44,705,107.04	39,096,003.39

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。本基金于上年度末及本期末均未持有股票等交易性权益投资，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2021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元，属于第二层次的余额为人民币35,263,247,946.76元，属于第三层次的余额为人民币0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2021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	35,263,247,946.76	58.82
	其中：债券	35,246,857,946.76	58.80
	资产支持证券	16,390,000.00	0.03
2	买入返售金融资产	8,028,753,822.16	13.39
	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	16,371,424,424.44	27.31
4	其他各项资产	282,803,670.60	0.47

5	合计	59,946,229,863.96	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	4.85	
	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	4,073,164,432.69	7.29
	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的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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	57

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	27.96	7.29
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
2	30天(含)—60天	16.40	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	18.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	18.05	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	25.54	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.82	7.29

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	99,992,666.75	0.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,215,472,326.32	7.55
	其中：政策性金融债	3,391,987,360.72	6.07
4	企业债券	501,798,417.52	0.90
5	企业短期融资券	3,980,447,000.98	7.13
6	中期票据	743,936,658.65	1.33
7	同业存单	25,705,210,876.54	46.02
8	其他	-	-
9	合计	35,246,857,946.76	63.11

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	180212	18国开12	9,100,000	912,154,740.04	1.63
2	112107031	21招商银行CD031	8,000,000	796,473,680.21	1.43
3	200314	20进出14	6,200,000	620,658,580.24	1.11
4	200216	20国开16	6,000,000	600,524,531.46	1.08
5	112198128	21广州银行CD029	5,000,000	495,805,213.18	0.89
6	112106063	21交通银行CD063	5,000,000	493,561,147.22	0.88
7	112103021	21农业银行CD021	5,000,000	493,561,147.22	0.88
8	112109020	21浦发银行CD020	4,500,000	442,870,434.61	0.79
9	112199798	21浙江泰隆商行CD003	4,000,000	398,804,058.60	0.71
10	112014138	20江苏银行CD138	4,000,000	398,513,415.59	0.71

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1064%
报告期内偏离度的最低值	-0.0142%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0503%
------------------------	---------

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 期末按摊余成本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）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	2089525	20海盈1A_bc	1,000,000	16,390,000.00	0.03

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，基金投资的前十名证券的发行主体招商银行、农业银行、国家开发银行、浦发银行、江苏银行、广州银行在报告编制日前一年受到行政处罚，处罚金额分别合计为：7345万元、5829万元、4940万元、3000万元、240万元、180万元。本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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	39,141.08

2	应收证券清算款	-
3	应收利息	268,577,105.95
4	应收申购款	14,187,423.57
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	282,803,670.60

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

份额 级别	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
永赢 天天 利货 币A	9,484	5,889,290.90	55,739,372,485.28	99.7947%	114,662,408.27	0.2053%
永赢 天天 利货 币E	14	15,590.78	0.00	0.0000%	218,270.86	100.0000%
合计	9,498	5,880,633.10	55,739,372,485.28	99.7943%	114,880,679.13	0.2057%

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	5,166,024,561.51	9.25%
2	银行类机构	2,119,805,632.49	3.80%
3	银行类机构	1,969,350,224.09	3.53%
4	银行类机构	1,725,814,474.73	3.09%
5	银行类机构	1,700,243,174.06	3.04%
6	银行类机构	1,518,404,712.46	2.72%
7	银行类机构	1,517,102,150.65	2.72%
8	银行类机构	1,411,798,120.96	2.53%
9	银行类机构	1,197,181,586.84	2.14%
10	银行类机构	1,123,107,990.07	2.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	永赢天天利货币A	4,845,659.91	0.01%
	永赢天天利货币E	3,009.15	1.38%
	合计	4,848,669.06	0.01%

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	份额级别	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	永赢天天利货币A	0~10
	永赢天天利货币E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	永赢天天利货币A	0
	永赢天天利货币E	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E
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	51,771,884,554.50	-
本报告期基金总申购份额	39,935,871,056.54	732,843.72
减：本报告期基金总赎回份额	35,853,720,717.49	514,572.86
本报告期期末基金份额总额	55,854,034,893.55	218,270.86

§ 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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，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，未发生涉及基金管理人、基金财产、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等情况。

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	
信达证券	2	-	-	-	-	-

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
信达证券	1,011,367,955.88	100.00%	86,856,600,000.00	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	永赢天天利货币市场基金暂停大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-05
2	永赢天天利货币市场基金暂停代销机构大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-08
3	永赢基金管理有限公司关于新增招商证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-15

4	永赢天天利货币市场基金2020年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-22
5	永赢基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-26
6	永赢天天利货币市场基金暂停直销机构大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-28
7	永赢基金管理有限公司关于新增甬兴证券有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-29
8	永赢天天利货币市场基金更新招募说明书（2021年第1号）	中国证监会规定媒介	2021-02-03
9	永赢天天利货币市场基金基金产品资料概要更新（2021年第1号）	中国证监会规定媒介	2021-02-03
10	永赢天天利货币市场基金增聘基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2021-02-03
11	永赢天天利货币市场基金2021年春节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2021-02-06
12	永赢天天利货币市场基金暂停直销机构大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-02-22
13	永赢基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-06
14	永赢基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的声明	中国证监会规定媒介	2021-03-08
15	永赢天天利货币市场基金暂停直销机构大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-20
16	永赢天天利货币市场基金2020年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-27
17	永赢天天利货币市场基金2021年“清明”假期前暂停申购、转换转	中国证监会规定媒介	2021-03-30

	入及定期定额投资业务公告		
18	永赢基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为永赢基金旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-31
19	永赢天天利货币市场基金暂停直销机构大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-02
20	永赢天天利货币市场基金2021年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
21	永赢天天利货币市场基金托管协议	中国证监会规定媒介	2021-04-22
22	永赢天天利货币市场基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021-04-22
23	永赢基金管理有限公司关于永赢天天利货币市场基金增设E类基金份额并修改基金合同及托管协议部分条款的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-22
24	永赢天天利货币市场基金（A份额）基金产品资料概要更新（2021年第2号）	中国证监会规定媒介	2021-04-27
25	永赢天天利货币市场基金（E份额）基金产品资料概要更新（2021年第2号）	中国证监会规定媒介	2021-04-27
26	永赢基金管理有限公司永赢天天利货币市场基金更新招募说明书（2021年第2号）	中国证监会规定媒介	2021-04-27
27	永赢天天利货币市场基金2021年“五一”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2021-04-27
28	永赢天天利货币市场基金E类份额开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2021-04-27
29	永赢天天利货币市场基金暂停代销机构大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-11

30	永赢天天利货币市场基金暂停直销机构大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-13
31	永赢天天利货币市场基金2021年“端午”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2021-06-08
32	永赢天天利货币市场基金暂停直销机构大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-06-22

§ 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	20210101 - 20210303	12,154,326.59	1,293,239.93	2,408,702.77	11,038,863.75	19.76%
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，存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。							

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托管协议》；
4. 《永赢天天利货币市场基金招募说明书》及其更新（如有）；
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21世纪大厦21、22、27层

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：400-805-8888

永赢基金管理有限公司
二〇二一年八月二十八日