

# 永赢天天利货币市场基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 26 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3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。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	20
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	20
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
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	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	21
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息	21
6.2 审计报告的基本内容	21
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	27
7.4 报表附注	29
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 债券回购融资情况	58
8.3 基金投资组合平均剩余期限	58
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	60
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	61
8.8 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	61
8.9 投资组合报告附注	61

§9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
9.4 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	63
§10 开放式基金份额变动	64
§11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	66
11.9 其他重大事件	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息	71
12.1 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	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录	71
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	72

## § 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	55,025,953,399.75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	55,025,639,540.91份	313,858.84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	汪成杰
	联系电话	021-20430340
	电子邮箱	wangcj@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	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	永赢基金管理有限公司	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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2021年		2020年		2019年	
	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E

本期已实现收益	1,473,854,905.34	3,554.32	949,273,581.69	-	941,930,644.53	-
本期利润	1,473,854,905.34	3,554.32	949,273,581.69	-	941,930,644.53	-
本期净值收益率	2.5311%	1.4241%	2.5569%	-	2.9526%	-
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
期末基金资产净值	55,025,639,540.91	313,858.84	51,771,884,554.50	-	44,148,382,855.97	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	-	1.0000	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
累计净值收益率	16.2285%	1.4241%	13.1484%	-	10.6518%	-

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
过去三个月	0.6101%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.269 8%	0.000 7%
过去六个月	1.2208%	0.0007%	0.6805%	0.0000%	0.540 3%	0.000 7%
过去一年	2.5311%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	1.181 1%	0.000 8%
过去三年	8.1413%	0.0017%	4.0500%	0.0000%	4.091 3%	0.001 7%
自基金合同 生效起至今	16.2285%	0.0027%	6.3468%	0.0000%	9.881 7%	0.002 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
过去三个月	0.5495%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.209 2%	0.000 7%
过去六个月	1.0985%	0.0007%	0.6805%	0.0000%	0.418 0%	0.000 7%
自基金合同 生效起至今	1.4241%	0.0015%	0.9173%	0.0000%	0.506 8%	0.001 5%

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

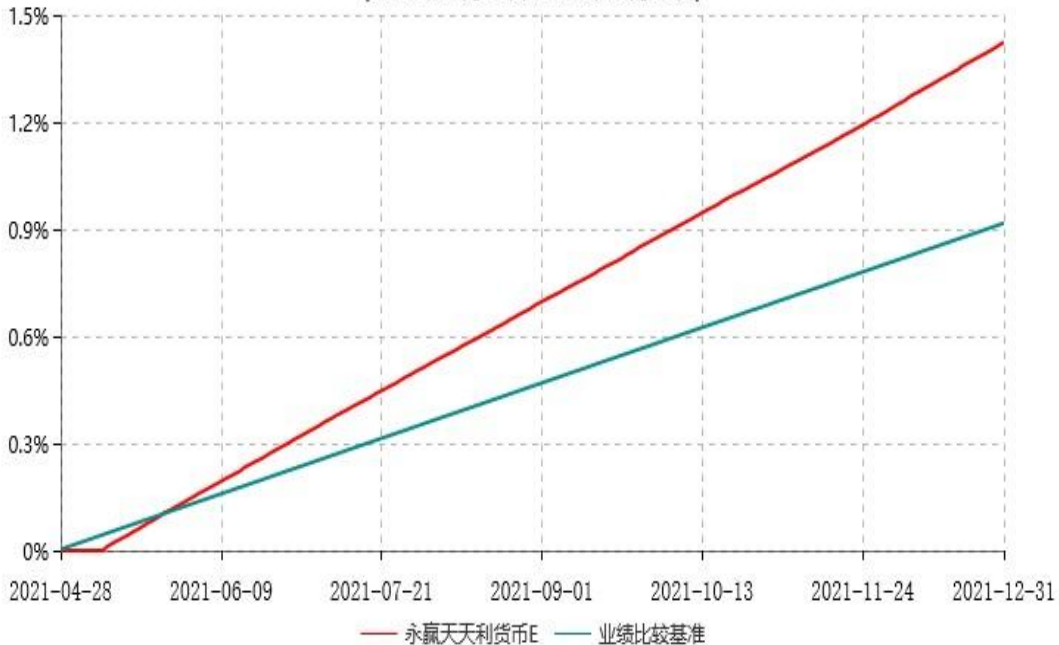
(2017年04月20日-2021年12月31日)



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。

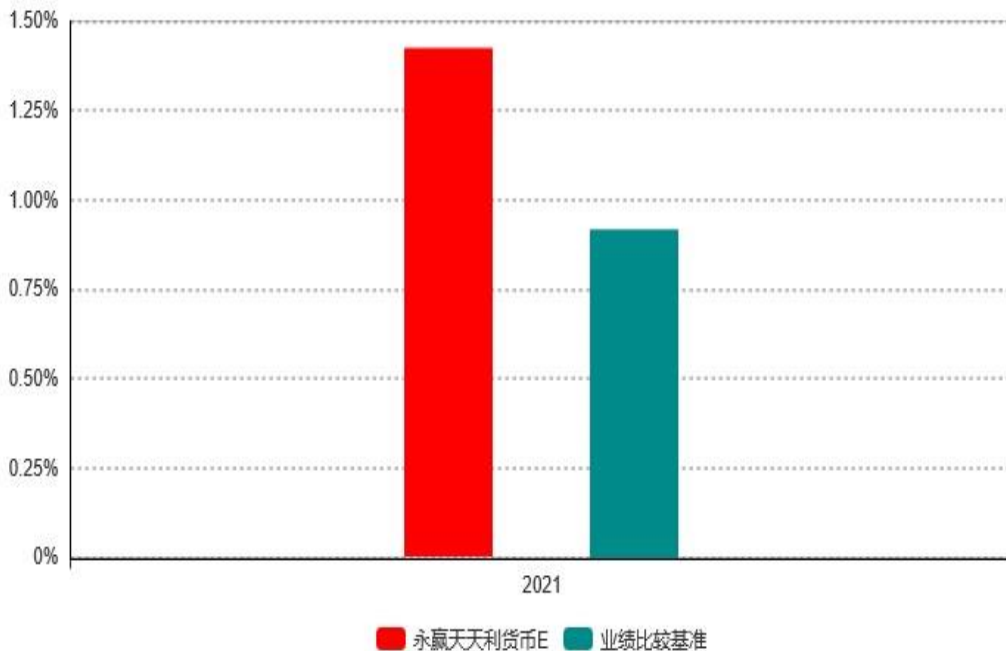
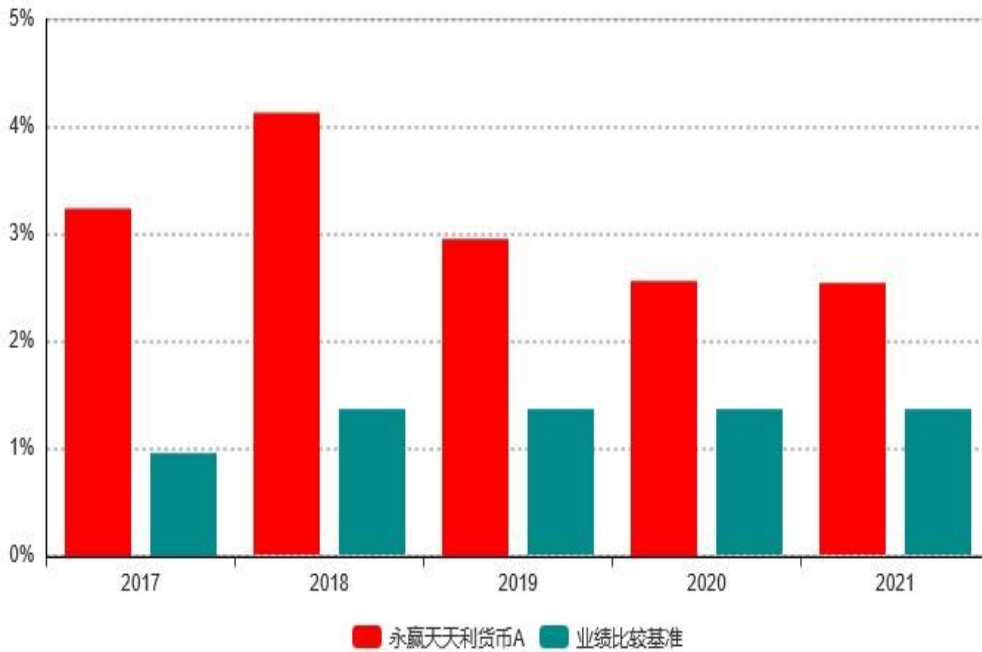
永赢天天利货币E累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年04月28日-2021年12月31日)



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一年。

### 3.2.3 自基金合同生效以来每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：（1）本基金合同于 2017 年 4 月 20 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

（2）根据《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》，本基金自 2021 年 4 月 28 日起增加 E 类基金份额类别，E 类份额自 2021 年 4 月 28 日起存续，故存续起始当年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

永赢天天利货币A

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应 付赎回款转 出金额	应付利润本年 变动	年度利润分配合 计	备注
2021 年	1,471,152,689.56	2,797,390.66	-95,174.88	1,473,854,905.34	-
2020 年	979,992,105.62	11,258,765.01	-41,977,288.94	949,273,581.69	-
2019 年	913,569,846.20	27,568,698.09	792,100.24	941,930,644.53	-
合计	3,364,714,641.38	41,624,853.76	-41,280,363.58	3,365,059,131.56	-

永赢天天利货币E

单位：人民币元

年度	已按再投资 形式转实收 基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润本年 变动	年度利润分 配合计	备注
2021年	3,488.02	46.08	20.22	3,554.32	-
合计	3,488.02	46.08	20.22	3,554.32	-

## § 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12月31日，本基金管理人共管理92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、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢嘉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、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢诚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、永赢伟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、永赢合益债券型证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、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、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、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、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基

金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫享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、永赢成长领航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、永赢惠添益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、永赢乾益债券型证券投资基金、永赢鑫辰混合型证券投资基金、永赢中债-3-5年政策性金融债指数证券投资基金、永赢长远价值混合型证券投资基金、永赢信利碳中和主题一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢惠添盈一年持有期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发起式联接基金、永赢轩益债券型证券投资基金、永赢深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢合享混合型发起式证券投资基金、永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、永赢安盈90天滚动持有债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增强债券型证券投资基金以及永赢优质精选混合型发起式证券投资基金。

#### 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	-	6	卢绮婷女士，上海交通大学金融学硕士，6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，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。
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 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交

易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限；投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预；基金经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同基金经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。另外，本基金管理人还建立机制要求公募基金经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行业股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各基金经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后分析，确保交易得到公平和公允的执行；对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，基金经理须提出申请并阐明具体原因，交由投资决策委员会进行严格的公平性审核；（4）严格控制同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外），确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生同日反向交易的，相关基金经理须向风险控制委员会提供决策依据并留存记录备查。



在日常监控和事后分析评估方面，风险管理部开展定期分析工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了对非公开发行股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，以及对非连续竞价交易的价格公允性进行审查；事后分析评估上，风险管理部在每个季度的公平交易与异常交易稽核中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资授权管理制度、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合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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年，在纷繁复杂的国内外环境下，中国经济在高经济总量的基础上仍然实现了高质量发展，全年GDP同比增长8.1%，在全球主要经济体中保持领先，同时在稳增长、调结构和疫情防控中实现了多目标平衡。从全年节奏来看，同比环比均呈前高后低走势，从疫情后持续复苏到稳增长压力逐步显现。一季度房地产和基建投资仍然保持惯性，但疫情防控影响消费复苏；二季度在房地产调控趋严背景下，出口表现强劲对冲了内需不足；三季度能耗政策的供给侧约束使得工业品原材料价格持续攀升，“类滞胀”影响下经济下行压力显现；四季度供给侧影响趋弱但房地产投资进入负增长区间，需求收缩态势进一步体现。

货币政策方面，经历了年初1月份市场预期混乱引发的短暂收紧之后，央行的公开市场操作形式有所变化，每个交易日开展逆回购操作，并在预期资金收紧时点及时加量操作对冲缺口，短端利率中枢的稳定性提高，货币市场传统的季节性波动大幅下降。整体的政策方向也由逆周期调节转向跨周期调节，7月份和12月份两次降准，12月1年期LPR下调，流动性保持合理充裕。广义流动性方面，随着实体融资需求由强转弱，叠加基数影响，融资增速全年呈下行趋势，年末受财政后置、债券发行的支撑有所企稳。

债券市场方面，全年利率走势震荡下行，全年的主线是资金面预期的变化和资产荒，主要可以划分为四个阶段：（1）第一阶段（年初至春节前），央行小额投放等因素导致市场对于央行货币政策取向持观望态度，债市调整但幅度有限；（2）第二阶段（春节后至8月上旬），尽管宏观环境整体对债市利空，PPI持续上行，但资金面宽松的背景下，收益率缓慢下行，随后在央行超预期降准的驱动下，债市收益率快速下行，出现短期低点；（3）第三阶段（8月中旬至10月下旬），资金面宽松预期边际变化，债市调整；（4）第四阶段（10月下旬至年末），配置行情驱动债市收益率再度下行，叠加降准驱动下，债市收益率创年内新低，10年期国债到期收益率在12月30日达到2.76%，全年累计下行近37bp。

报告期内本基金抓住货币市场利率的季节性高点，主要配置同业存款、同业存单、回购以及高等级短期融资债券。回顾全年操作，市场利率整体保持窄幅震荡格局，在1月底市场对于货币政策预期存在误判，利率快速上行，小钱荒局面下同类产品均出现较大规模赎回，月初投资资产大幅负偏离，但组合整体保持了偏低久期和高逆回购占比，春节以后货币市场维持宽松，利率恢复下行，存单-逆回购利差维持高位，等待成本过高，开始加大配置力度，组合久期和杠杆开始拉升。进入3月末和4月初，流动性保持宽松，货基规模持续增长，提前配置有效提高了组合此后半年的静态收益。6月末理财和货基遭遇季节性赎回使得短端利率升高。三季度走势类似于二季度，季末仍然面临了较大程度的赎回冲击，7月降准后市场利率向下冲击动力不足，在9月初开始反弹。进入四季度由于年末因素在季度初保持谨慎，而市场走势与以往季节性规律相背离，在10月底11月初存单利率即达到年内高点，此时并未拘泥于传统季节性规律，而是在央行10月底超量逆回购平抑流动性波动后逐步拉长久期积极配置，随后直至年底最后两周在理财缩表冲击下应对季节性赎回后抓住跨年时点完成配置。总体来说，通过对各季度内流动性的预判积极把握市场交易性机会，在确保组合流动性安全的同时也为投资者提供了稳定收益。

#### 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2.5311%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%；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1.4241%，同期业绩比较基准收益率为0.9173%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年，我国经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力。从中央经济工作会议定调可以看出稳增长将成为政策主线，并且要求政策发力适当靠前。进入2022年，财政政策方面，1月地方政府专项债发行提前，财政支出保持较快节奏；货币政策方面，央行在2021年12月降准，并在1月下调OMO和MLF等政策利率10bp，LPR 1Y和5Y报价相应下调，继续引导社会融资成本下行，并推动信贷需求保持内生增长。流动性合理充裕仍然是全年货币市场的基调。

从货币政策对流动性的影响来看，政策利率下调带动央行合意资金中枢下调10bp，在经济增速有明显起色前流动性宽松预期仍将保持，存单利率预计继续保持在MLF利率以下较大区间。更大幅度的波动仍然来自机构行为，包括各季度末理财和银行表内存款替代效应的冲击、现金理财和货币基金的赎回冲击等。财政政策方面，地方政府专项债发行节奏前置，但财政支出的力度也保持高位，两者的速度和力度差异将决定财政存款对流动性的实际影响，总体效果预计中性，但节奏上可能产生预期差。

在一季度经济数据逐步明朗之前，市场预计仍然会在宽信用预期逐步落地和托底经济的宏观政策继续加码之间反复摇摆。考虑到目前的收益率曲线绝对水平，短端基于政策利率对于资金中枢的定价较为乐观，曲线陡峭化形态预计继续维持，但资金中枢的波动性可能带来短端的进一步波动。在方向明朗之前建议从绝对收益角度出发看待资产价格，不盲目追低，但在月末、季末、税期等关键时点收益率反弹时点果断配置。在关键时点到来前的耐心等待，以及根据负债端合理摆布到期资产分布将是组合超额收益的重要来源。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障合规运作和投资者合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，持续健全、完善内控建设，提升风险管理水平，确保基金管理业务规范运作。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

1、持续加强制度建设。报告期内，公司根据法律法规、监管政策及业务开展实际情况，对公司制度进行了全面梳理、评估与更新，确保制度的合规性、有效性和可操作性，进一步完善公司制度体系。

2、新规解读及监管要求的落实。2021年，公司持续密切关注各项最新法律法规、监管政策，及时开展新规新政的传达和解读、并拟定落实方案，由各相关部门进行具体落实，同时定期对落实情况进行跟踪检查。

3、强化合规培训。为进一步提升员工合规意识，强化员工执业行为的合规性，合规部组织多次面向不同对象，针对不同主题的合规培训，包括针对新员工的合规培训，面向全员的合规宣导以及邀请外部律师开展专项培训等，并通过多样化的方式提高员工在合规培训中的参与度以及积极性。

4、深入开展内部审计工作。公司建立了全面的内部审计体系和流程，并设置审计部作为公司风险防控机制中的一道重要防线独立履行内部审计检查职责。2021年，公司有序开展各类专项审计、离任审查、年度/季度监察稽核项目、即时通讯工具例行检查、风险事件调查等内审工作，并聘请外部机构独立开展合规有效性评估、年度内控评价等项目。针对上述审计检查发现的问题，审计部牵头推进整改，促进制度体系及业务流程不断完善，为公司防范风险、完善内控管理提供有力支持。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。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；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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以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1,473,858,459.66元。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，未发生会计师事务所出具非标准审计报告的情形。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第61090672_B07号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	永赢天天利货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了永赢天天利货币市场基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的永赢天天利货币市场基金的财务报表在所有重大方

	面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了永赢天天利货币市场基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于永赢天天利货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	永赢天天利货币市场基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估永赢天天利货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督永赢天天利货币市场基金的财务报告过程。

## 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对永赢天天利货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致永赢天天利货币市场基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事

	项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	蒋燕华	费泽旭
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼	
审计报告日期	2022-03-24	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	19,801,251,413.79	11,150,518,926.06
结算备付金		62,650,458.11	29,509,769.10
存出保证金		34,304.04	32,420.08
交易性金融资产	7.4.7.2	30,650,785,539.45	31,151,538,585.73
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		30,470,829,086.48	31,051,538,585.73
资产支持证券投资		179,956,452.97	100,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	8,646,335,051.52	11,070,623,064.93
应收证券清算款		-	18,871.23
应收利息	7.4.7.5	226,062,459.61	151,231,996.43
应收股利		-	-
应收申购款		-	3,769,985.92



递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		59,387,119,226.52	53,557,243,619.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,322,711,550.84	1,769,986,545.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20,152,490.25	-
应付管理人报酬		9,351,209.22	7,601,802.56
应付托管费		2,337,802.29	1,900,450.61
应付销售服务费		467,615.73	380,090.12
应付交易费用	7.4.7.7	542,319.22	464,298.00
应交税费		383,202.98	454,714.45
应付利息		1,049,879.22	301,534.42
应付利润		3,907,028.83	4,002,183.49
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	262,728.19	267,446.33
负债合计		4,361,165,826.77	1,785,359,064.98
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	55,025,953,399.75	51,771,884,554.50
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		55,025,953,399.75	51,771,884,554.50
负债和所有者权益总计		59,387,119,226.52	53,557,243,619.48

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额55,025,953,399.75份。其中A类基金份额净值1.0000元，份额总额55,025,639,540.91份；E类基金份额净值1.0000元，份额总额313,858.84份。

## 7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		1,690,596,505.56	1,095,706,547.93
1. 利息收入		1,673,783,666.66	1,083,480,074.37
其中：存款利息收入	7.4.7.11	478,607,635.17	266,480,141.49
债券利息收入		972,500,571.92	636,104,206.06
资产支持证券利息收入		1,659,050.32	7,102,613.41
买入返售金融资产收入		221,016,409.25	173,793,113.41
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,812,838.90	12,226,473.56
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	16,812,838.90	12,222,579.56
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	3,894.00
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		216,738,045.90	146,432,966.24
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	118,166,484.13	78,113,941.89
2. 托管费	7.4.10.2.2	29,541,621.10	19,528,485.31
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	5,908,710.89	3,905,697.16
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		62,307,255.26	44,299,118.47
其中：卖出回购金融资产支出		62,307,255.26	44,299,118.47
6. 税金及附加		403,303.49	193,677.67
7. 其他费用	7.4.7.19	410,671.03	392,045.74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,473,858,459.66	949,273,581.69
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,473,858,459.66	949,273,581.69

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	51,771,884,554.50	-	51,771,884,554.50
二、本期经营活动产生的基金净值	-	1,473,858,459.66	1,473,858,459.66

变动数(本期利润)			
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)	3,254,068,845.25	-	3,254,068,845.25
其中: 1. 基金申购款	92,954,440,778.59	-	92,954,440,778.59
2. 基金赎回款	-89,700,371,933.34	-	-89,700,371,933.34
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)	-	-1,473,858,459.66	-1,473,858,459.66
五、期末所有者权益(基金净值)	55,025,953,399.75	-	55,025,953,399.75
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	949,273,581.69	949,273,581.69
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)	7,623,501,698.53	-	7,623,501,698.53
其中: 1. 基金申购	65,444,689,264.87	-	65,444,689,264.87

款			
2. 基金赎回款	-57,821,187,566.34	-	-57,821,187,566.34
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）	-	-949,273,581.69	-949,273,581.69
五、期末所有者权益（基金净值）	51,771,884,554.50	-	51,771,884,554.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

芦特尔

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

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）。

#### 7.4.2 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（以下统称“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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

本基金的金融资产于初始确认时分类为交易性金融资产及贷款和应收款项。本基金持有的交易性金融资产主要包括债券投资等。

本基金的金融负债于初始确认时分类为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

##### (2) 回购协议

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金持有的金融工具的估值方法具体如下：

(1) 银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

(2) 债券投资

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

(3) 回购协议

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

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

(4) 其他

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

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

3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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



#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

(5) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日支付”。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。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后两位，小数点后第三位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

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

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，收益支付方式只采用红利再投资（即红利转为同一类别基金份额）方式，投资人可通过赎回相应类别的基金份额获得现金收益；若当日已实现收益大于零时，则为投资人增加相应的基金份额；若当日已实现收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；若当日已实现收益小于零时，则缩减投资人基金份额。若投资人全部赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

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

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在遵守法律法规且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、注册登记机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告，且不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.11 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 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。

### 7.4.6.2 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。

### 7.4.6.3 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。

## 7.4.6.4 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	1,251,413.79	518,926.06
定期存款	19,800,000,000.00	11,150,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	500,000,000.00	-
存款期限1-3个月	400,000,000.00	300,000,000.00
存款期限3个月以上	18,900,000,000.00	10,850,000,000.00
其他存款	-	-
合计	19,801,251,413.79	11,150,518,926.06

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	30,470,829.08 6.48	30,489,748.00 0.00	18,918,913. 52	0.0344
	合计	30,470,829.08 6.48	30,489,748.00 0.00	18,918,913. 52	0.0344
资产支持证券		179,956,452.97	180,154,000.00	197,547.03	0.0004
合计		30,650,785.53 9.45	30,669,902.00 0.00	19,116,460. 55	0.0347

项目		上年度末 2020年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	31,051,538.58 5.73	31,100,239.00 0.00	48,700,414.27	0.0941
	合计	31,051,538.58 5.73	31,100,239.00 0.00	48,700,414.27	0.0941
资产支持证券		100,000,000.00	100,060,000.00	60,000.00	0.0001
合计		31,151,538.58 5.73	31,200,299.00 0.00	48,760,414.27	0.0942

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,012,000,000.00	-
银行间市场	5,634,335,051.52	-
合计	8,646,335,051.52	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	942,000,000.00	-
银行间市场	10,128,623,064.93	-
合计	11,070,623,064.93	-

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	3,683.59	11,318.78
应收定期存款利息	114,072,152.87	42,244,778.69
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	31,011.97	14,607.34
应收债券利息	105,775,328.32	100,994,450.14
应收资产支持证券利息	937,363.29	8,263.01
应收买入返售证券利息	5,242,902.63	7,958,562.41
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	16.94	16.06
合计	226,062,459.61	151,231,996.43

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	542,319.22	464,298.00
合计	542,319.22	464,298.00

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,000.00	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	249,300.00	249,300.00
其他	12,428.19	18,146.33
合计	262,728.19	267,446.33

## 7.4.7.9 实收基金

## 7.4.7.9.1 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12月31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	92,953,477,370.48	92,953,477,370.48
本期赎回(以“-”号填列)	-89,699,722,384.07	-89,699,722,384.07
本期末	55,025,639,540.91	55,025,639,540.91

## 7.4.7.9.2 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12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	963,408.11	963,408.11
本期赎回(以“-”号填列)	-649,549.27	-649,549.27
本期末	313,858.84	313,858.84

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。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 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	1,473,854,905.34	-	1,473,854,905.34
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	-1,473,854,905.34	-	-1,473,854,905.34
本期末	-	-	-

##### 7.4.7.10.2 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	3,554.32	-	3,554.32
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	-3,554.32	-	-3,554.32
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	144,810.14	2,357,172.88
定期存款利息收入	477,445,263.09	263,288,260.93
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,016,900.22	833,542.83
其他	661.72	1,164.85
合计	478,607,635.17	266,480,141.49

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	16,812,838.90	12,222,579.56
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	16,812,838.90	12,222,579.56

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月
----	----------------------------	---------------------------------

	31日	31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	133,833,116,990.67	96,785,714,919.93
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	133,253,110,665.84	96,152,799,439.58
减：应收利息总额	563,193,485.93	620,692,900.79
买卖债券差价收入	16,812,838.90	12,222,579.56

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	100,704,264.10	405,117,974.55
减：卖出资产支持证券成本总额	100,000,000.00	399,000,000.00
减：应收利息总额	704,264.10	6,114,080.55
资产支持证券投资收益	-	3,894.00

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.18 交易费用

本基金本报告期及上年度可比期间均无交易费用。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	120,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	135,001.03	114,845.74
账户维护费	35,670.00	37,200.00
合计	410,671.03	392,045.74

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
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
华侨银行有限公司（“华侨银行”）	基金管理人的股东（自2020年8月5日起）
利安资金管理公司（“利安资金”）	基金管理人的原股东（2020年8月5日前）

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) 永赢基金管理有限公司原股东利安资金管理公司

(Lion Global Investors Limited) 将其所持 28.51% 股权转让给华侨银行有限公司 (Oversea-Chinese Banking Corporation Limited) 已获中国证券监督管理委员会证监许可(2020)467号《关于核准永赢基金管理有限公司变更股权的批复》的核准，并于2020年8月5日完成工商变更登记。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	118,166,484.13	78,113,941.89
其中：支付销售机构的客户维护费	1,347,826.18	304,722.83

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	29,541,621.10	19,528,485.31

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年01月01日至2021年12月31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	5,752,678.59	0.00	5,752,678.59
宁波银行	11,250.99	36.60	11,287.59
合计	5,763,929.58	36.60	5,763,966.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年12月31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	3,870,331.77	0.00	3,870,331.77
宁波银行	3,369.43	0.00	3,369.43

合计	3,873,701.20	0.00	3,873,701.20
----	--------------	------	--------------

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为基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	-	-	-	-	13,715,807,000.00	1,032,549.53
上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	395,643,560.66	-	-	-	3,248,913,000.00	318,593.82

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31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	74,341,257.77	384,643,455.04
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	270,000,000.00	275,000,000.00
报告期末持有的基金份额	102,177,040.33	297,835,782.56
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1857%	0.5753%

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12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31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：1、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。

2、永赢天天利货币E类份额合同生效日为2021年4月28日。

#### 7.4.10.5.2 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12月31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	241,948,079.94	0.4397%	123,032,119.60	0.2376%
宁波银行	2,145,671,176.43	3.8994%	1,793,141,084.15	3.4635%
兴业银行	1,936,548,926.40	3.5193%	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。

#### 7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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	1,251,413.79	7,261,476.75	800,518,926.06	10,627,172.93

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况—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
1,471,152,689.56	2,797,390.66	-95,174.88	1,473,854,905.34	-

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
3,488.02	46.08	20.22	3,554.32	-

## 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
193793	明远04A1	2021-11-17	2022-01-12	认购新发证券	100.00	100.00	1,100,000	110,000.00	110,000.00	-

## 7.4.12.2 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。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币4,322,711,550.84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
012103500	21招商蛇口SCP	2022-01-04	100.02	1,500,000	150,023,814.39

	007				
012103738	21北京国资SCP006	2022-01-04	99.92	19,000	1,898,519.39
012103931	21三峡SCP004	2022-01-04	99.94	1,800,000	179,892,408.79
012104072	21国能资本SCP001	2022-01-04	99.93	1,500,000	149,890,829.41
012104090	21国开投SCP002	2022-01-04	99.91	2,000,000	199,822,453.83
012105029	21邮政SCP013	2022-01-04	99.97	2,000,000	199,935,373.65
012105126	21国能资本SCP002	2022-01-04	99.93	542,000	54,163,175.11
112109106	21浦发银行CD106	2022-01-04	99.50	1,500,000	149,252,046.14
112109157	21浦发银行CD157	2022-01-04	99.28	764,000	75,852,782.68
112118046	21华夏银行CDO46	2022-01-04	99.51	3,000,000	298,540,614.44
112185319	21南京银行CD133	2022-01-04	99.19	1,478,000	146,600,852.40
190202	19国开02	2022-01-04	100.04	5,500,000	550,206,938.15
200002	20付息国债02	2022-01-04	100.01	3,000,000	300,024,375.60
210201	21国开01	2022-01-04	100.02	10,100,000	1,010,164,851.83
210206	21国开06	2022-01-04	100.03	2,100,000	210,063,158.65
210304	21进出04	2022-01-04	99.99	2,000,000	199,987,154.05
219960	21贴现国债60	2022-01-04	99.59	4,200,000	418,269,483.13
219961	21贴现国债61	2022-01-04	99.54	2,000,000	199,087,814.40
合计				45,003,000	4,493,676,646.04

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 信用风险

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

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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2021年12月31日	2020年12月31日
A-1	-	50,000,566.89
A-1以下	-	-
未评级	7,736,661,133.13	7,031,183,259.09
合计	7,736,661,133.13	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。

#### 7.4.13.2.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	179,956,452.97	100,000,000.00
合计	179,956,452.97	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。

#### 7.4.13.2.3 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	22,734,167,953.35	23,970,354,759.75
合计	22,734,167,953.35	23,970,354,759.75

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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7.4.12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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	15,001,251,413.79	4,800,000,000.00	-	-	-	19,801,251,413.79
结算备付金	62,650,458.11	-	-	-	-	62,650,458.11
存出保证金	34,304.04	-	-	-	-	34,304.04
交易性金融资产	28,907,750,180.88	1,743,035,358.57	-	-	-	30,650,785,539.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	8,646,335,051.52	-	-	-	-	8,646,335,051.52
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	226,062,459.61	226,062,459.61
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	52,618,021,408.34	6,543,035,358.57	-	-	226,062,459.61	59,387,119,226.52
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	4,322,711,550.84	-	-	-	-	4,322,711,550.84
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	20,152,490.25	20,152,490.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	9,351,209.22	9,351,209.22
应付托管费	-	-	-	-	2,337,802.29	2,337,802.29
应付销售服务费	-	-	-	-	467,615.73	467,615.73
应付交易费用	-	-	-	-	542,319.22	542,319.22
应付税费	-	-	-	-	383,202.98	383,202.98
应付利息	-	-	-	-	1,049,879.22	1,049,879.22
应付利润	-	-	-	-	3,907,028.83	3,907,028.83
其他负债	-	-	-	-	262,728.19	262,728.19
负债总计	4,322,711,550.84	-	-	-	38,454,275.93	4,361,165,826.77

利率敏感 度缺口	48,295,309,857.5 0	6,543,035,358.5 7	-	-	187,608,183.6 8	55,025,953,399.7 5
上年度末 2020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	9,750,518,926.06	1,400,000,000.0 0	-	-	-	11,150,518,926.0 6
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	30,462,143,620.2 0	689,394,965.53	-	-	-	31,151,538,585.7 3
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-
买入返售 金融资产	11,070,623,064.9 3	-	-	-	-	11,070,623,064.9 3
应收证券 清算款	-	-	-	-	18,871.23	18,871.23
应收利息	-	-	-	-	151,231,996.4 3	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	51,312,827,800.3 7	2,089,394,965.5 3	0.00	0.00	155,020,853.5 8	53,557,243,619.4 8
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	-	-	-	-	464,298.00	464,298.00

费用						
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	49,542,841,255.3 7	2,089,394,965.5 3	0.00	0.00	139,648,333.6 0	51,771,884,554.5 0

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率曲线向上、向下平行移动50个基点		
假设	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产影子定价的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-39,332,697.17	-39,096,003.39
	市场利率平行下降50个基点	39,332,697.17	39,096,003.39

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具



## 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币0.00元，属于第二层次的余额为人民币30,650,785,539.45元，属于第三层次的余额为人民币0.00元（于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币0.00元，属于第二层次的余额为人民币31,151,538,585.73元，属于第三层次的余额为人民币0.00元）。

## 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次均未发生重大变动。

## 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

## 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月24日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	30,650,785,539.45	51.61
	其中：债券	30,470,829,086.48	51.31
	资产支持证券	179,956,452.97	0.30
2	买入返售金融资产	8,646,335,051.52	14.56
	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	19,863,901,871.90	33.45
4	其他各项资产	226,096,763.65	0.38

5	合计	59,387,119,226.52	100.00
---	----	-------------------	--------

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.89	
	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	4,322,711,550.84	7.86
	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

本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
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

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过120天的情况。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.57	7.86
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
2	30天(含)—60天	8.30	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	30.23	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	19.28	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	25.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	107.51	7.86

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过240天的情况。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	917,381,673.13	1.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,432,073,612.52	4.42
	其中：政策性金融债	1,970,422,102.68	3.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,509,213,196.56	6.38
6	中期票据	877,992,650.92	1.60
7	同业存单	22,734,167,953.35	41.32
8	其他	-	-
9	合计	30,470,829,086.48	55.38

10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
----	--------------------	---	---

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

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	210201	21国开01	10,100,000	1,010,164,851.83	1.84
2	190202	19国开02	5,500,000	550,206,938.15	1.00
3	112173110	21北京农商银行CD242	5,000,000	498,642,392.73	0.91
4	112114167	21江苏银行CD167	5,000,000	497,690,389.18	0.90
5	112111275	21平安银行CD275	5,000,000	496,907,492.64	0.90
6	112106128	21交通银行CD128	5,000,000	495,991,959.35	0.90
7	112185319	21南京银行CD133	5,000,000	495,943,343.70	0.90
8	112113224	21浙商银行CD224	5,000,000	495,464,872.65	0.90
9	219960	21贴现国债60	4,200,000	418,269,483.13	0.76
10	112172285	21昆仑银行CD108	4,000,000	399,219,276.16	0.73

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	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	0.0408%

#### 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。

### 8.8 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	193793	明远04A1	1,100,000	110,000,000.00	0.20
2	136427	云庐5优	700,000	69,956,452.97	0.13

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.000元。

8.9.2 本报告期内，基金投资的前十名证券的发行主体交通银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年受到行政处罚，处罚金额分别合计为：4502万元、397万元、332万元。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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	34,304.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	226,062,459.61
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	226,096,763.65

### 8.9.4 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	215, 294	255,583.71	52,734,174,65 9.97	95.83 56%	2,291,464,880. 94	4.164 4%
永赢 天天	16	19,616.18	0.00	0.000 0%	313,858.84	100.00 00%

利货币E						
合计	215,310	255,566.18	52,734,174,659.97	95.8351%	2,291,778,739.78	4.1649%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 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	4,682,635,254.35	8.51%
2	银行类机构	2,648,619,917.97	4.81%
3	银行类机构	2,145,671,176.43	3.90%
4	银行类机构	1,993,379,934.09	3.62%
5	银行类机构	1,501,433,548.82	2.73%
6	银行类机构	1,200,342,833.04	2.18%
7	银行类机构	1,127,816,951.07	2.05%
8	证券类机构	1,126,313,995.85	2.05%
9	银行类机构	1,100,730,698.87	2.00%
10	银行类机构	1,036,932,054.39	1.88%

## 9.3 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	2,041,514.19	0.00%
	永赢天天利货币E	13,046.96	4.16%
	合计	2,054,561.15	0.00%

## 9.4 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

## § 10 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	92,953,477,370.48	963,408.11
减：本报告期基金总赎回份额	89,699,722,384.07	649,549.27
本报告期末基金份额总额	55,025,639,540.91	313,858.84

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经永赢基金管理有限公司董事会审议通过，毛慧女士不再担任公司督察长职务，聘任汪成杰先生担任公司督察长职务。本基金管理人已分别于2021年9月18日、2021年9月29日在规定信息披露媒介登载了高级管理人员变更公告。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变



本报告期内，本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《基金合同》及《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为120,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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。

#### 11.7.2 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	1,282,889, 339.71	100.0 0%	159,683,60 0,000.00	100.0 0%	-	-	-	-
----------	----------------------	-------------	------------------------	-------------	---	---	---	---

### 11.8 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。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢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增聘基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2021-02-03

9	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
10	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
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、转换转入及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2021-03-30
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	中国证监会规定媒介	2021-03-31

	金代销机构的公告		
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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	永赢天天利货币市场基金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
27	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
28	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	中国证监会规定媒介	2021-05-11

	务的公告		
29	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
30	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
31	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
32	永赢天天利货币市场基金2021年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2021-07-20
33	永赢基金管理有限公司关于新增东北证券股份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	2021-08-12
34	永赢天天利货币市场基金2021年中期报告	中国证监会规定媒介	2021-08-28
35	永赢基金管理有限公司关于新增上海万得基金销售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	2021-08-31
36	永赢天天利货币市场基金2021年“中秋”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	2021-09-14
37	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021-09-18
38	永赢天天利货币市场基金20	中国证监会规定媒介	2021-09-27

	21年“国庆”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务公告		
39	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2021-09-29
40	永赢天天利货币市场基金2021年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2021-10-27
41	永赢基金管理有限公司关于新增西部证券股份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	2021-11-11
42	永赢天天利货币市场基金基金产品资料概要更新(2021年第3号)	中国证监会规定媒介	2021-11-27
43	永赢天天利货币市场基金更新招募说明书(2021年第3号)	中国证监会规定媒介	2021-11-27
44	永赢天天利货币市场基金恢复办理直销机构大额申购、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-12-08
45	永赢基金管理有限公司关于新增国金证券股份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	2021-12-13
46	永赢基金管理有限公司关于新增国联证券股份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	2021-12-24
47	永赢天天利货币市场基金暂停代销机构机构客户大额申购(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	2021-12-27
48	永赢天天利货币市场基金20	中国证监会规定媒介	2021-12-28

	22年“元旦”假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务公告		
49	永赢基金管理有限公司广州分公司成立公告	中国证监会规定媒介	2021-12-30

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	12,154,326,595.50	2,406,585,036.98	10,599,715,726.39	3,961,195,906.09	7.20%
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。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准永赢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。

### 13.2 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

### 13.3 查阅方式

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

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司  
二〇二二年三月二十六日