

# 永赢货币市场基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022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2022年01月01日起至2022年6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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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	14
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	14
§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 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 债券回购融资情况	48
7.3 基金投资组合平均剩余期限	48
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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	50
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	50
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	51
7.9 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§9 开放式基金份额变动	53

§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	55
10.9 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢货币市场基金	
基金简称	永赢货币	
基金主代码	000533	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年02月27日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,248,416,373.39份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢货币A	永赢货币E
下属分级基金的交易代码	000533	012104
报告期末下属分级基金的份额总额	1,246,272,056.31份	2,144,317.08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	本基金主要通过货币市场利率研判与管理策略、期限配置策略、类属和品种配置策略及灵活的交易策略，追求超过基准的较高收益。
业绩比较基准	同期7天通知存款利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	永赢基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	汪成杰
	联系电话	021-20430340
		李申
		021-60637102

人	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-805-8888	021-60637111
传真		021-51690177	021-60635778
注册地址		浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦21、22、23、27层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		马宇晖	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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号二十一世纪大厦21、22、23、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号二十一世纪大厦21、22、23、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 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	永赢货币A	永赢货币E
本期已实现收益	12,470,548.25	12,824.90
本期利润	12,470,548.25	12,824.90

本期净值收益率	1.1128%	1.0378%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
期末基金资产净值	1,246,272,056.31	2,144,317.08
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2022年06月30日)	
累计净值收益率	30.2241%	2.6127%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，固定净值型货币市场基金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。

### 3.2 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	0.1868%	0.0061%	0.1110%	0.0000%	0.0758%	0.0061%
过去三个月	0.5541%	0.0048%	0.3366%	0.0000%	0.2175%	0.0048%
过去六个月	1.1128%	0.0036%	0.6695%	0.0000%	0.4433%	0.0036%
过去一年	2.4102%	0.0051%	1.3500%	0.0000%	1.0602%	0.0051%
过去三年	7.4731%	0.0035%	4.0500%	0.0000%	3.4231%	0.0035%
自基金合同 生效起至今	30.2241%	0.0042%	11.2586%	0.0000%	18.9655%	0.0042%

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）。

永赢货币E

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	0.1749%	0.0061%	0.1110%	0.0000%	0.0639%	0.0061%
过去三个月	0.5166%	0.0048%	0.3366%	0.0000%	0.1800%	0.0048%
过去六个月	1.0378%	0.0036%	0.6695%	0.0000%	0.3683%	0.0036%
过去一年	2.2559%	0.0051%	1.3500%	0.0000%	0.9059%	0.0051%
自基金合同生效起至今	2.6127%	0.0049%	1.5867%	0.0000%	1.0260%	0.0049%

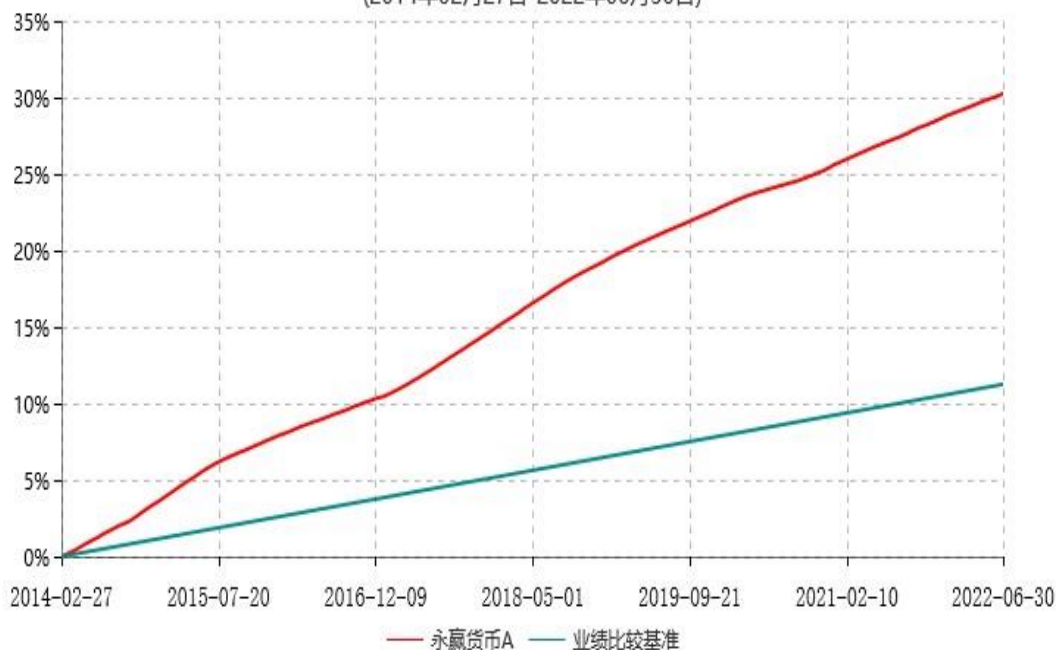
注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本基金业绩比较基准为：同期 7 天通知存款利率（税后）。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

永赢货币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

(2014年02月27日-2022年06月30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：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

永赢基金管理有限公司（以下简称“公司”）于2013年10月8日取得了中国证监会《关于核准设立永赢基金管理有限公司的批复》（证监许可[2013]1280号），随后，公司于2013年10月11日取得商务部《中华人民共和国外商投资企业批准证书》（商外资资审字[2013]008号），并于2013年11月7日在国家工商行政管理总局注册成立，此后，于2013年11月12日取得中国证监会核发的《基金管理资格证书》（编号A087），并于2017年3月14日获得中国证监会颁发的信用代码为913302007178854322的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014年8月18日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018年1月25日，公司完成增资，注册资本由人民币贰亿元增至人民币玖亿元。目前，公司的股权结构为宁波银行股份有限公司持股71.49%，华侨银行有限公司持股28.51%。

截止2022年6月30日，本基金管理人共管理97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、永赢优质精选混合型发起式证券投资基金、永赢添添欣12个月持有期混合型证券投资基金、永赢养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、永赢卓越臻选股票型发起式证券投资基金及永赢新能源智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	-	7	卢绮婷女士，上海交通大学金融学硕士，7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	-	8	胡雪骥先生，硕士，8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。
俞灏	基金经理助理	2021-03-01	-	5	俞灏先生，硕士，5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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 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

2022年上半年，在经历一季度短暂的开门红效应后，疫情冲击主导了后续市场走势。一方面，疫情冲击加剧了房地产产业链的下行趋势，除一线城市外全国大部分城市的房地产销售和土地拍卖额同比均大幅下降，民营地产债务违约现象逐步加剧；另一方面，对于经济形势的不确定预期使得企业和居民主体的行为转向资产负债表收缩，增加储蓄，降低投资和消费，狭义流动性向广义流动性传导不畅，社融-M2进入负值区间。

政策方面，去年末中央经济工作会议强调，要“加强和改善宏观调控，加大宏观政策跨周期调节力度，提高宏观调控的前瞻性针对性”和“政策发力适当靠前”。货币政策方面，2022年1月和4月央行分别进行了降息和降准操作，并引导银行下调存款利率和LPR报价，降低全社会广谱利率水平。银行间市场流动性水平维持在合理充裕略高水平，4月以来DR007利率中枢长期维持在较OMO利率明显偏低水平。财政政策方面，针对企业主体在上半年实施了总量超过1.8万亿的增值税留抵退税，并加快地方政府专项债的发行进度，在6月底之前完成了全年3.4万亿新增专项债额度的发行，并持续保持较高的支出强度。

市场方面，一季度央行靠前发力，降息后无风险利率快速下行，在社融和经济数据开门红效应下利率有所反弹，随后从3月中旬开始进入震荡下行阶段，短端利率受益于持续宽松的资金面下行幅度较大，1年国股存单从年初的2.60%下行至6月的2.30%，1年国开从年初的2.30%下行至6月的2.00%水平，同期中长端利率相对谨慎，10年国开震荡区间在2.90%-3.10%，期限利差走阔。信用利差方面，由于银行理财产品的类储蓄效应，总规模在年初的净值波动后仍然持续增加，广义基金的配置压力使得信用利差持续压缩至历史极值，随着绝对收益率水平走低，利差压缩逐渐从年初的高等级信用向短久期弱资产信用主体传导。

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，根据各类资产的比价关系灵活调整资产比例。一季度，1月降息和社融数据超预期后，经济复苏预期加强，净值型理财产品规模出现负反馈效应，市场利率上行，本基金逐步提高久期至偏高水平。二季度，货币政策宽松取向不变，4月开始银行间市场回购利率中枢持续下行，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力争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1.1128%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；截至报告期末永赢货币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1.0378%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，5月以来整体处于经济重启带来的自然修复过程，7月疫情反复、地产风波导致经济修复斜率与预期边际转弱，但修复态势尚未终结。三季度中后期，修复的持续性将切换到需求周期，核心看地产周期能否企稳回升。在疫情冲击、地产行业低景气度影响下，地方财力承压，预计不同区域城投信用资质维持分化趋势；房地产行业

虽然融资环境改善但民企融资依然艰难，销售修复传导滞后，行业风险依然在持续出清中。外围环境方面，由于海外经济见顶但非衰退，通胀矛盾依然凸显，因此紧缩趋势仍会延续，对于政策而言，外部环境约束仍存。

流动性方面，上半年社融同比增速受到政府债券发行节奏前置影响得以支撑，下半年实体经济内生融资需求预计仍处于弱复苏阶段，短期内难以支撑社融增速继续扩张，广义流动性增速边际回落，同时货币政策宽松取向未变，狭义流动性方面预计维持合理充裕，社融-M2缺口预计继续维持低位。由于央行政策框架未变，中期资金价格仍有回归压力，但时间节奏难以把握，跟踪应对比提前预判更加重要。

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。在利率水平极低的环境中，特别注意防范尾部的流动性冲击和中小银行信用风险外溢。

#### 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。

#### 4.7 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12,483,373.15元。

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

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：永赢货币市场基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	251,250,742.85	250,576,484.38
结算备付金		-	231,046.51
存出保证金		-	2,279.54
交易性金融资产	6.4.7.2	924,094,031.07	765,951,103.74
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		924,094,031.07	765,951,103.74
资产支持证券		-	-

投资			
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	240,289,376.58	302,616,733.93
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		16,516,752.57	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	7,096,569.11
资产总计		1,432,150,903.07	1,326,474,217.21
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		183,017,884.93	160,591,599.70
应付清算款		-	-
应付赎回款		8,992.51	2.45
应付管理人报酬		192,025.95	214,163.70
应付托管费		48,006.53	53,540.91
应付销售服务费		96,136.08	107,328.52
应付投资顾问费		-	-



应交税费		18,948.53	20,087.41
应付利润		34,764.70	77,881.29
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	317,770.45	480,854.19
负债合计		183,734,529.68	161,545,458.17
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,248,416,373.39	1,164,928,759.04
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		1,248,416,373.39	1,164,928,759.04
负债和净资产总计		1,432,150,903.07	1,326,474,217.21

注：（1）报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额1,248,416,373.39份。其中A类基金份额净值1.0000元，份额总额1,246,272,056.31份；E类基金份额净值1.0000元，份额总额2,144,317.08份。

（2）比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：永赢货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		16,046,748.87	36,830,494.89
1. 利息收入		5,171,556.68	35,887,225.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,993,312.21	2,473,111.38
债券利息收入		-	26,338,482.16

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,178,244.47	7,075,631.82
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,875,192.19	943,269.53
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	10,875,192.19	943,269.53
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		3,563,375.72	7,225,944.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,118,590.09	2,358,597.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	279,647.50	589,649.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.	560,216.36	1,180,423.56

	3		
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,477,391.81	2,926,550.10
其中：卖出回购金融资产支出		1,477,391.81	2,926,550.10
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		4,895.68	36,619.09
8. 其他费用	6.4.7.18	122,634.28	134,105.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		12,483,373.15	29,604,550.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		12,483,373.15	29,604,550.55
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		12,483,373.15	29,604,550.55

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：永赢货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,164,928,75 9.04	-	-	1,164,928,75 9.04
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	1,164,928,75 9.04	-	-	1,164,928,75 9.04
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	83,487,614.3 5	-	-	83,487,614.3 5
(一)、综合收益总额	-	-	12,483,373.1 5	12,483,373.1 5
(二)、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)	83,487,614.3 5	-	-	83,487,614.3 5
其中: 1. 基金申购款	1,022,446,28 4.55	-	-	1,022,446,28 4.55
2. 基金赎回款	-938,958,67 0.20	-	-	-938,958,67 0.20
(三)、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)	-	-	-12,483,373. 15	-12,483,373. 15
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	1,248,416,37 3.39	-	-	1,248,416,37 3.39
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	3,031,328,96 9.86	-	-	3,031,328,96 9.86

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	3,031,328.96 9.86	-	-	3,031,328.96 9.86
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,353,334.2 30.79	-	-	-1,353,334.2 30.79
(一)、综合收益总额	-	-	29,604,550.5 5	29,604,550.5 5
(二)、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)	-1,353,334.2 30.79	-	-	-1,353,334.2 30.79
其中：1. 基金申购款	2,364,385.46 8.84	-	-	2,364,385.46 8.84
2. 基金赎回款	-3,717,719.6 99.63	-	-	-3,717,719.6 99.63
(三)、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)	-	-	-29,604,550.5 55	-29,604,550.5 55
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	1,677,994.73 9.07	-	-	1,677,994.73 9.07

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

汪成杰

虞俏依

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

永赢货币市场基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2014)93号《关于核准永赢货币市场基金募集的批复》的核准,由基金管理人永赢基金管理有限公司向社会公开募集,基金合同于2014年2月27日生效,首次设立募集规模为597,140,206.43份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为永赢基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据基金管理人于2021年4月22日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢货币市场基金增设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。

本基金业绩比较基准:同期7天通知存款利率(税后)。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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2022年6月30日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 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。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 6.4.4.2 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。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，在初始确认时以公允价值计量；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险

自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 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) 债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 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。

## 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

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币250,576,484.38元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,660,780.38元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币252,237,264.76元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币231,046.51元，自应收利息转入的重分类金额为人民币114.40元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币231,160.91元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币2,279.54元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1.10元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币2,280.64元。

买入返售金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币302,616,733.93元，自应收利息转入的重分类金额为人民币151,212.96元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币302,767,946.89元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币7,096,569.11元，转出至银行存款的重分类金额为人民币1,660,780.38元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币114.40元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币1.10元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币5,284,460.27元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币151,212.96元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币765,951,103.74元，自应收利息转入的重分类金额为人民币5,284,460.27元。经上述重分类后，交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币771,235,564.01元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币160,591,599.70元，自应付利息转入的重分类金额为人民币10,263.86元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币160,601,863.56元。

应付利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币10,263.86元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币10,263.86元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 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 2022年06月30日
活期存款	351,534.28
等于：本金	351,445.43
加：应计利息	88.85
减：坏账准备	-
定期存款	250,899,208.57
等于：本金	250,000,000.00
加：应计利息	899,208.57

减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	100,231,000.00
存款期限3个月以上	150,668,208.57
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	251,250,742.85

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	924,094,031.07	925,446,300.83	1,352,269.76	0.1083
	合计	924,094,031.07	925,446,300.83	1,352,269.76	0.1083
资产支持证券		-	-	-	-
合计		924,094,031.07	925,446,300.83	1,352,269.76	0.1083

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2022年06月30日

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	240,289,376.58	-
合计	240,289,376.58	-

#### 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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.49
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	39,202.81
其中：交易所市场	-
银行间市场	39,202.81
应付利息	-
预提费用	278,560.15
合计	317,770.45

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 永赢货币A

金额单位：人民币元

项目 (永赢货币A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,163,597,925.27	1,163,597,925.27

本期申购	1,020,084,126.71	1,020,084,126.71
本期赎回（以“-”号填列）	-937,409,995.67	-937,409,995.67
本期末	1,246,272,056.31	1,246,272,056.31

#### 6.4.7.7.2 永赢货币E

金额单位：人民币元

项目 (永赢货币E)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,330,833.77	1,330,833.77
本期申购	2,362,157.84	2,362,157.84
本期赎回（以“-”号填列）	-1,548,674.53	-1,548,674.53
本期末	2,144,317.08	2,144,317.08

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 永赢货币A

单位：人民币元

项目 (永赢货币A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	12,470,548.25	-	12,470,548.25
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	-12,470,548.25	-	-12,470,548.25
本期末	-	-	-

##### 6.4.7.8.2 永赢货币E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(永赢货币E)			
本期期初	-	-	-
本期利润	12,824.90	-	12,824.90
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	-12,824.90	-	-12,824.90
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	1,209.20
定期存款利息收入	2,992,043.11
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	41.57
其他	18.33
合计	2,993,312.21

#### 6.4.7.10 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。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	9,610,830.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,264,361.48



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	10,875,192.19

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,487,980,829.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,469,692,582.13
减：应计利息总额	17,023,886.04
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	1,264,361.48

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 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。

##### 6.4.7.13.2 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。

#### 6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	15,524.13
账户维护费	17,250.00
其他	600.00
合计	122,634.28

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,118,590.09	2,358,597.03
其中：支付销售机构的客户维护费	284,473.60	256,533.52

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 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	279,647.50	589,649.30

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢货币A	永赢货币E	合计
宁波银行	239,471.03	1.88	239,472.91
永赢基金	182,084.64	0.00	182,084.64
合计	421,555.67	1.88	421,557.55
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 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		
	永赢货币A	永赢货币E	合计
宁波银行	268,359.48	0.00	268,359.48
永赢基金	843,175.23	0.00	843,175.23
合计	1,111,534.71	0.00	1,111,534.71

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0.10%，销售服务费按前一日A类基金份额的基金资产净值的

0.10%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。

#### 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 2022年01月01日至2022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
建设银行	-	-	-	-	652,935,000.00	53,241.59
上年度可比期间 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
建设银行	-	-	-	-	744,792,000.00	123,869.05

#### 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

永赢货币A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	14,199,767.45
报告期间申购/买入总份额	0.00	178,190.79
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	14,377,958.24
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.8569%

永赢货币E

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021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

## 永赢货币A

关联方名称	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021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
宁波银行	0.26	0.0000%	0.26	0.0000%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资永赢货币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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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
建设银行	351,534.28	1,209.20	759,547.67	4,666.21

## 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——固定净值型货币市场基金

## 永赢货币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
12,489,395.62	24,242.13	-43,089.50	12,470,548.25	-

## 永赢货币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

12,812.32	39.67	-27.09	12,824.90	-
-----------	-------	--------	-----------	---

#### 6.4.12 期末（2022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2022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183,017,884.93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
112206008	22交通银行CDO08	2022-07-01	98.86	794,000	78,497,567.81
190308	19进出08	2022-07-01	102.54	700,000	71,778,384.03
220201	22国开01	2022-07-01	101.03	500,000	50,513,671.64
合计				1,994,000	200,789,623.48

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	437,635,488.57	250,998,969.23
合计	437,635,488.57	250,998,969.23

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

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	486,458,542.50	514,952,134.51
合计	486,458,542.50	514,952,134.51

#### 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 2022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	251,250,742.85	-	-	-	-	251,250,742.85
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	626,624,695.83	297,469,335.24	-	-	-	924,094,031.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	240,289,376.58	-	-	-	-	240,289,376.58
应收清算款	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申	-	-	-	-	16,516,752.5	16,516,752.57

购款					7	
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,118,164,815.26	297,469,335.24	-	-	16,516,752.57	1,432,150,903.07
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	183,017,884.93	-	-	-	-	183,017,884.93
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	8,992.51	8,992.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	192,025.95	192,025.95
应付托管费	-	-	-	-	48,006.53	48,006.53
应付销售服务费	-	-	-	-	96,136.08	96,136.08
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	18,948.53	18,948.53
应付利润	-	-	-	-	34,764.70	34,764.70
其他负债	-	-	-	-	317,770.45	317,770.45
负债总计	183,017,884.93	-	-	-	716,644.75	183,734,529.68
利率敏感度缺口	935,146,930.33	297,469,335.24	-	-	15,800,107.82	1,248,416,373.39
上年度末 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	250,576,484.38	-	-	-	-	250,576,484.38
结算备付金	231,046.51	-	-	-	-	231,046.51
存出保	2,279.54	-	-	-	-	2,279.54

证金						
交易性金融资产	647,717,833.09	118,233,270.65	-	-	-	765,951,103.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	302,616,733.93	-	-	-	-	302,616,733.93
应收清算款	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	7,096,569.11	7,096,569.11
资产总计	1,201,144,377.45	118,233,270.65	-	-	7,096,569.11	1,326,474,217.21
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	160,591,599.70	-	-	-	-	160,591,599.70
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	2.45	2.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	214,163.70	214,163.70
应付托管费	-	-	-	-	53,540.91	53,540.91
应付销售服务费	-	-	-	-	107,328.52	107,328.52
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	20,087.41	20,087.41
应付利润	-	-	-	-	77,881.29	77,881.29
其他负债	-	-	-	-	480,854.19	480,854.19
负债总计	160,591,599.70	-	-	-	953,858.47	161,545,458.17
利率敏	1,040,552,777.7	118,233,270.6	-	-	6,142,710.64	1,164,928,759.0

敏感度缺口	5	5				4
-------	---	---	--	--	--	---

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-1,423,106.80	-1,195,273.90
	市场利率平行下降50个基点	1,423,106.80	1,195,273.90

#### 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 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	924,094,031.07	765,951,103.74
第三层次	-	-
合计	924,094,031.07	765,951,103.74

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 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。

##### 6.4.15.2 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。

##### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2022年8月29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	924,094,031.07	64.52

	其中：债券	924,094,031.07	64.52
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	240,289,376.58	16.78
	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	251,250,742.85	17.54
4	其他各项资产	16,516,752.57	1.15
5	合计	1,432,150,903.07	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	13.82	
	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	183,017,884.93	14.66
	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	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	61

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。

### 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	37.66	14.66
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.43	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	20.82	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.40	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	37.48	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	112.78	14.66

### 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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	255,625,770.42	20.48
	其中：政策性金融债	122,292,055.67	9.80

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	151,081,312.61	12.10
6	中期票据	30,928,405.54	2.48
7	同业存单	486,458,542.50	38.97
8	其他	-	-
9	合计	924,094,031.07	74.02
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值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)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112185315	21杭州银行CD140	1,000,000	99,857,340.21	8.00
2	112206008	22交通银行CD008	1,000,000	98,863,435.53	7.92
3	112211013	22平安银行CD013	1,000,000	98,832,296.30	7.92
4	190308	19进出08	700,000	71,778,384.03	5.75
5	1928037	19交通银行02	500,000	51,146,499.99	4.10
6	012105342	21中铝集SCP010	500,000	50,635,392.66	4.06
7	220201	22国开01	500,000	50,513,671.64	4.05
8	012280798	22招商局港SCP002	500,000	50,265,982.71	4.03
9	012281282	22越秀金融SCP002	500,000	50,179,937.24	4.02
10	112103101	21农业银行CD101	500,000	49,930,405.67	4.00

#### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.1638%
报告期内偏离度的最低值	0.0692%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值

0.1109%

**报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明**

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

**报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明**

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.9 投资组合报告附注****7.9.1 基金计价方法说明**

本基金采用实际利率法计价，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中国进出口银行、交通银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、国家开发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7766万元、4922万元、680万元、630万元、587万元、580万元、440万元。**

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	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	16,516,752.57
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

8	合计	16,516,752.57
---	----	---------------

#### 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 货币A	84,678	14,717.78	511,623,873.42	41.05 23%	734,648,182.89	58.947 7%
永赢 货币E	126	17,018.39	750,000.00	34.97 62%	1,394,317.08	65.023 8%
合计	84,804	14,721.20	512,373,873.42	41.04 19%	736,042,499.97	58.958 1%

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）。

#### 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	169,649,866.22	13.59%
2	保险类机构	55,406,624.34	4.44%
3	证券类机构	51,510,144.23	4.13%
4	银行类机构	30,999,922.62	2.48%
5	其他机构	24,268,788.95	1.94%
6	其他机构	15,285,505.17	1.22%
7	其他机构	10,370,955.67	0.83%

8	其他机构	9,553,232.76	0.77%
9	其他机构	7,996,970.15	0.64%
10	其他机构	6,875,495.68	0.55%

### 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	永赢货币A	1,171,585.16	0.09%
	永赢货币E	1,035.89	0.05%
	合计	1,172,621.05	0.09%

### 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	永赢货币A	0~10
	永赢货币E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	永赢货币A	0
	永赢货币E	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢货币A	永赢货币E
基金合同生效日(2014年02月27 日)基金份额总额	597,140,206.43	-
本报告期期初基金份额总额	1,163,597,925.27	1,330,833.77
本报告期基金总申购份额	1,020,084,126.71	2,362,157.84
减：本报告期基金总赎回份额	937,409,995.67	1,548,674.53
本报告期期末基金份额总额	1,246,272,056.31	2,144,317.08

## § 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、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	
渤海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内的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	永赢基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-01
2	永赢货币市场基金2021年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-22
3	永赢货币市场基金2022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	2022-01-25
4	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-08
5	永赢货币市场基金2021年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-26
6	永赢货币市场基金2022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	2022-03-29
7	永赢基金管理有限公司关于新增交通银行股份有限公司为永赢基金旗下部分基金代销机构	中国证监会规定媒介	2022-04-19

	并参加费率优惠活动的公告		
8	永赢基金管理有限公司关于新增兴业银行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	2022-04-20
9	永赢货币市场基金2022年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
10	永赢货币市场基金2022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	2022-04-26
11	永赢货币市场基金2022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	2022-05-30

## § 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 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. 中国证监会准予永赢货币市场基金注册的文件；
2. 《永赢货币市场基金基金合同》；
3. 《永赢货币市场基金托管协议》；
4. 《永赢货币市场基金招募说明书》及其更新(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号二十一世纪大厦21、22、23、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](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  
二〇二二年八月三十日