

永赢天天利货币市场基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2023 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月28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2023年01月01日起至2023年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 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	47
7.3 基金投资组合平均剩余期限	47
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	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49
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	50
7.9 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
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	52
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	53
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	53
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	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§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	56,830,443,204.11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	56,795,153,621.22份	35,289,582.89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	本基金主要采用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、资产支持证券投资策略、灵活的交易策略。
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	姓名	汪成杰	龚小武
	联系电话	021-20430340	021-52629999-212056

人	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com	gongxiaowu@cib.com.cn
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	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路167号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 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E
本期已实现收益	614,599,365.85	33,418.74

本期利润	614,599,365.85	33,418.74
本期净值收益率	1.1100%	0.9810%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末基金资产净值	56,795,153,621.22	35,289,582.89
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
累计净值收益率	19.9896%	4.3210%

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

永赢天天利货币A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1871%	0.0008%	0.1110%	0.0000%	0.0761%	0.0008%
过去三个月	0.5673%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.2307%	0.0007%
过去六个月	1.1100%	0.0007%	0.6695%	0.0000%	0.4405%	0.0007%
过去一年	2.0823%	0.0009%	1.3500%	0.0000%	0.7323%	0.0009%
过去三年	7.1473%	0.0012%	4.0481%	0.0000%	3.0992%	0.0012%
自基金合同生效起至今	19.9896%	0.0027%	8.3663%	0.0000%	11.6233%	0.0027%

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

2、本基金业绩比较基准为：同期7天通知存款利率（税后）。

永赢天天利货币E

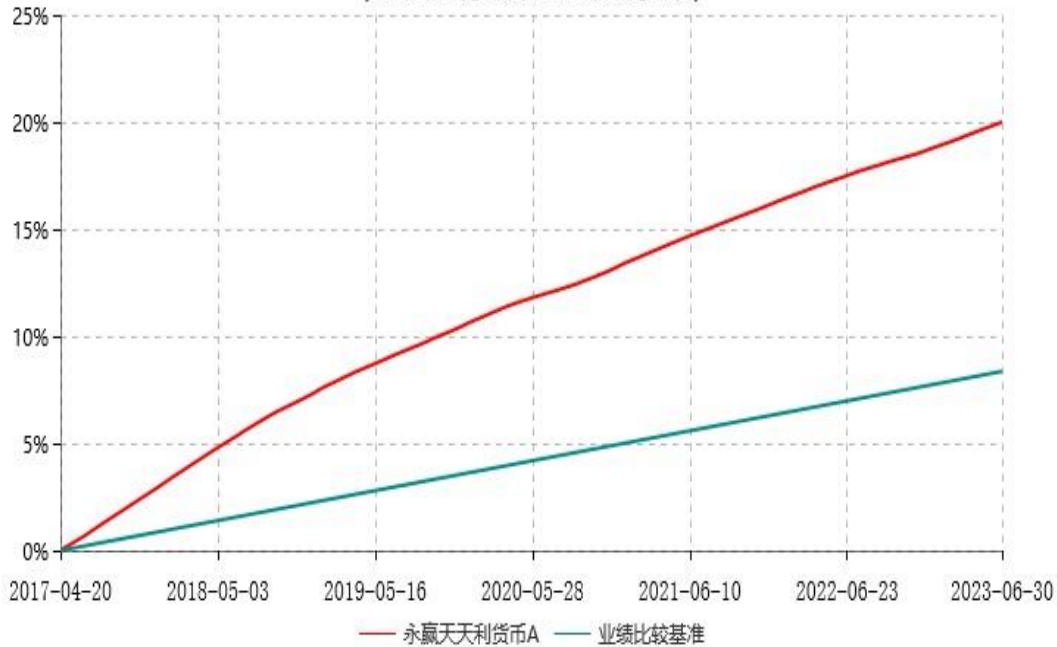
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.1581%	0.0012%	0.1110%	0.0000%	0.0471%	0.0012%
过去三个月	0.4985%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.1619%	0.0008%
过去六个月	0.9810%	0.0008%	0.6695%	0.0000%	0.3115%	0.0008%
过去一年	1.8298%	0.0009%	1.3500%	0.0000%	0.4798%	0.0009%
自基金合同 生效起至今	4.3210%	0.0012%	2.9367%	0.0000%	1.3843%	0.0012%

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）。

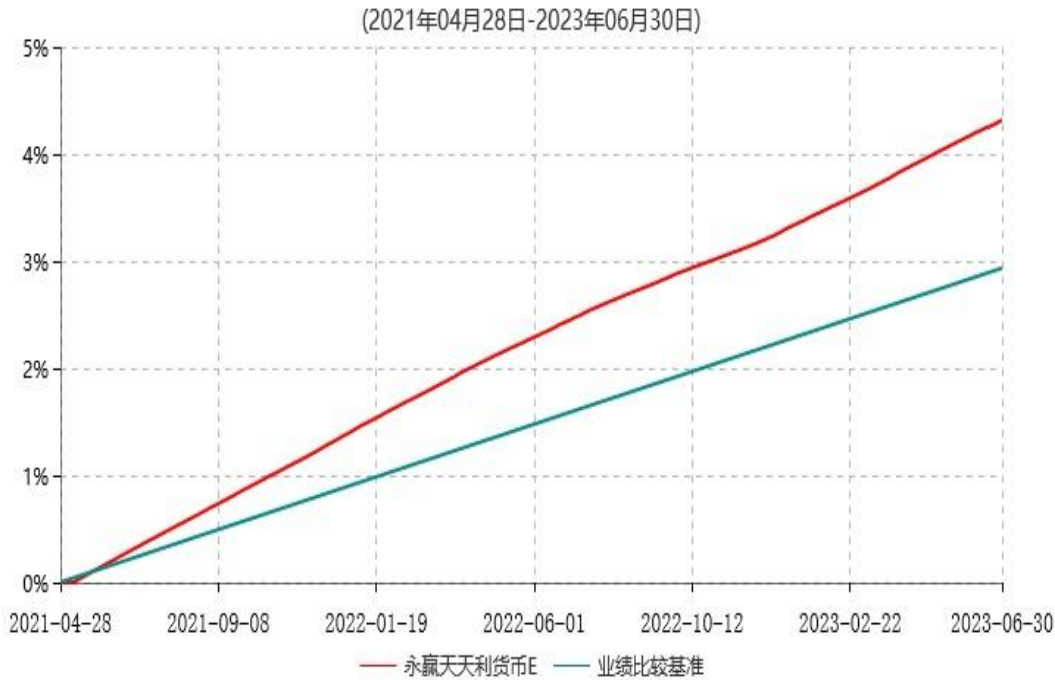
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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-2023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。

永赢天天利货币E累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金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%，Oversea-Chinese Banking Corporation Limited持股28.51%。

截止2023年6月30日，本基金管理人共管理117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、永赢中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、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、永赢新能源智选混合型发起式证券投资基金、永赢坤益债券型证券投资基金、永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金、永赢宏泰短债债券型证券投资基金、永赢添添悦6个月持有期混合型证券投资基金、永赢优质生活混合型证券投资基金、永赢安悦60天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢湖北国有企业债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、永赢半导体产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢低碳环保智选混合型发起式证券投资基金、永赢安泰中短债债券型证券投资基金、永赢医药创新智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费鑫选6个月持有期混合型证券投资基金、永赢消费龙头智选混合型发起式证券投资基金、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基金、永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金、永赢季季享90天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢昭利债券型证券投资基金、永赢恒欣稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金、永赢数字经济智选混合型发起式证券投资基金、永赢月月享30天持有期短债债券型证券投资基金、永赢先进制造智选混合型发起式证券投资基金、永赢浩益一年定期开放债券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	-	8	卢绮婷女士，上海交通大学金融学硕士，8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	基金经理	2021-02-02	-	9	胡雪骥先生，硕士，9年证

骥					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	-	6	俞灏先生，硕士，6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，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。

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。
- 3、俞灏先生已于2023-07-12卸任永赢天天利货币市场基金的基金经理助理职务。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资授权管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先、比例分配”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，分别于每季度和每年度对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，每季度对连续四个季度期间内、不同时间窗下不同投资组合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

2023年上半年，宏观交易主线逐步从疫后“强复苏”转向“弱复苏”，板块上消费表现强于投资、服务业表现强于制造业。具体节奏上，年初伴随疫情解封、消费场景快速复苏，工业企业生产回补，地产销售迅速回暖，信贷开门红表现强劲。3月地产销售景气度仍维持高位，但产业端开始出现需求不及预期的迹象，经济修复斜率开始放缓。进入二季度，年初的经济脉冲效应进一步退潮，地产销售转弱、信贷投放回落，经济内生性需求偏弱的症结显现。

政策方面，以3月降准为时间节点，上半年货币环境经历了先紧后松的过程。年初伴随信贷大量投放，资金面延续去年末以来的边际收敛态势，DR007价格上行到政策利率附近。3月降准之后，资金价格和波动率双双回落，资金面进入实质偏松环境，DR007长期波动在政策利率以下。6月央行降息落地，在操作时点上相对靠前，体现了货币政策对于稳经济、稳预期的紧迫性。货币宽松先行后，市场对稳增长政策出台预期升温，政策博弈成为阶段性主线。

市场方面，债市收益率整体陡峭化下行，半年末10年国债收益率相比去年末下降近20BP，1年国股存单从最高2.75%附近下行近50bp。节奏上，年初进入疫后修复期，市场对经济复苏预期偏强，叠加资金面边际收敛，债市利率出现小幅调整。3月开始伴随经济修复动能开始转弱，内生性需求不足逐渐成为市场共识，“资产荒”逻辑继续演绎，债市收益率呈现阶梯式下行，整数关口利率往往出现横盘震荡状态，一致预期变化后则迅速突破点位至下一区间。信用债收益率整体下行，信用利差和等级利差均有不同幅度的压缩，期限方面，低等级陡峭化，中高等级则被压平。

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，信贷投放开门红导致资金面波动加大，本基金维持中低久期和杠杆的防御策略。二季度，

市场利率转向，4月开始银行间市场回购利率中枢持续下行，本基金逐步提升久期和杠杆，季度末增加组合流动性妥善应对赎回冲击，确保流动性安全的同时为投资者提供稳定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢天天利货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.1100%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；截至报告期末永赢天天利货币E基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.9810%，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

宏观方面，在内生性需求偏弱的背景下，经济整体处于磨底状态，以PMI趋势值为代表的经济周期指标上升斜率偏缓，物价、融资数据低位震荡。政策方面，货币政策基调预计维持宽松，进一步宽松动作亦可期待；财政政策边际加码，三季度债券发行节奏明显加快。在高质量发展的核心诉求下，政策基调仍旧维持定力，政策出台大概率呈现节奏密集、幅度克制、侧重中长效的组合拳特征。外围环境方面，下半年经济浅衰退、就业偏韧性、通胀有粘性仍然是基准预期，对应着政策越过最鹰派的加息阶段，但不会就此打开宽松空间，始终保留再紧缩的选择权。

流动性方面，资金利率内生于宏观经济，二季度以来DR007长期运行在政策利率以下，如果宏观组合拳政策能够带动社会融资需求的回归，资金利率有均值回归的可能。短期来看，我们会密切跟踪银行资产端动向包括信贷投放节奏和政策债券发行节奏，防范资金中枢波动带来的负反馈冲击。

本基金将根据市场环境灵活调整久期及杠杆，以配置资质较好的银行存款、同业存单、回购及高等级短期融资债券为主，以流动性安全为首要目标的同时追求相对稳定的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。本基金管理人估值委员会成员包括公司总经理、督察长、固定收益投资/研究的分管领导、权益投资的分管领导、基金运营的分管领导、基金运营部负责人、合规部负责人和风险管理部负责人。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券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614,632,784.59元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：永赢天天利货币市场基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,870,365,005.28	14,323,320,080.66
结算备付金		135,060,750.00	259,688,386.75
存出保证金		18,318.78	96,223.78
交易性金融资产	6.4.7.2	40,845,757,201.47	28,917,842,204.88
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		40,795,166,078.18	28,807,512,903.84
资产支持证券投资		50,591,123.29	110,329,301.04
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	7,985,888,282.05	8,586,906,458.93
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		332,597,311.37	155,595,663.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	400.00	400.00
资产总计		64,169,687,268.95	52,243,449,418.52

负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		7,124,822,564.36	4,927,581,151.97
应付清算款		-	-
应付赎回款		196,000,000.00	-
应付管理人报酬		10,158,486.05	8,661,136.73
应付托管费		2,539,621.50	2,165,284.20
应付销售服务费		509,050.74	433,381.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		515,462.17	547,356.65
应付利润		3,915,002.28	6,190,209.48
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	783,877.74	833,244.02
负债合计		7,339,244,064.84	4,946,411,764.75
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	56,830,443,204.11	47,297,037,653.77
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		56,830,443,204.11	47,297,037,653.77
负债和净资产总计		64,169,687,268.95	52,243,449,418.52

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额56,830,443,204.11份。其中A类基金份额净值1.0000元，份额总额56,795,153,621.22份；E类基金份额净值1.0000元，份额总额35,289,582.89份。

6.2 利润表

会计主体：永赢天天利货币市场基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		714,952,705.99	812,456,702.79
1.利息收入		336,272,282.73	393,144,266.74
其中：存款利息收入	6.4.7.9	190,042,694.18	280,281,052.08
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		146,229,588.55	112,863,214.66
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		378,678,348.26	419,312,436.05
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	377,752,112.94	415,666,421.62
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	926,235.32	3,646,014.43
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“-”	6.4.7.16	2,075.00	-

号填列)			
减：二、营业总支出		100,319,921.40	118,000,290.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	55,254,851.64	61,385,288.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,813,712.88	15,346,322.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,766,497.03	3,072,274.39
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		28,058,350.47	37,728,339.05
其中：卖出回购金融资产支出		28,058,350.47	37,728,339.05
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		224,865.91	270,844.86
8. 其他费用	6.4.7.18	201,643.47	197,221.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		614,632,784.59	694,456,412.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		614,632,784.59	694,456,412.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		614,632,784.59	694,456,412.39

6.3 净资产（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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023年01月01日至2023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）	47,297,037,653.77	-	-	47,297,037,653.77
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）	47,297,037,653.77	-	-	47,297,037,653.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,533,405,550.34	-	-	9,533,405,550.34
（一）、综合收益总额	-	-	614,632,784.59	614,632,784.59
（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）	9,533,405,550.34	-	-	9,533,405,550.34
其中：1.基金申购款	76,671,255,341.46	-	-	76,671,255,341.46
2.基金赎回款	-67,137,849,791.12	-	-	-67,137,849,791.12
（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）	-	-	-614,632,784.59	-614,632,784.59
（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）	56,830,443,204.11	-	-	56,830,443,204.11

值)				
项目	上年度可比期间 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）	55,025,953,399.75	-	-	55,025,953,399.75
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）	55,025,953,399.75	-	-	55,025,953,399.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-161,838,085.05	-	-	-161,838,085.05
（一）、综合收益总额	-	-	694,456,412.39	694,456,412.39
（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）	-161,838,085.05	-	-	-161,838,085.05
其中：1.基金申购款	60,133,889,778.14	-	-	60,133,889,778.14
2.基金赎回款	-60,295,727,863.19	-	-	-60,295,727,863.19
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产	-	-	-694,456,412.39	-694,456,412.39

生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（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）	54,864,115,314.70	-	-	54,864,115,314.70

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）。

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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2023年6月30日的财务状况以及自2023年1月1日起至2023年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封

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法》、《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发展费附加的单位外）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 2023年06月30日
活期存款	809,810.11
等于：本金	805,342.95
加：应计利息	4,467.16
减：坏账准备	-
定期存款	14,869,555,195.17
等于：本金	14,800,000,000.00
加：应计利息	69,555,195.17
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	3,704,588,805.32
存款期限3个月以上	11,164,966,389.85
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	14,870,365,005.28

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023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	225,419,823.59	225,324,675.07	-95,148.52	-0.0002
	银行间市场	40,569,746,254.59	40,598,447,992.49	28,701,737.90	0.0505

	合计	40,795,166,078. 18	40,823,772,667. 56	28,606,589.38	0.0503
	资产支持证券	50,591,123.29	50,701,123.29	110,000.00	0.0002
	合计	40,845,757,201. 47	40,874,473,790. 85	28,716,589.38	0.0505

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,100,342,806.04	-
银行间市场	4,885,545,476.01	-
合计	7,985,888,282.05	-

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应收利息	-
其他应收款	400.00
待摊费用	-
合计	400.00

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-	
应付证券出借违约金	-	
应付交易费用	640,520.87	
其中：交易所市场	-	
银行间市场	640,520.87	
应付利息	-	
预提费用	128,314.74	
其他	15,042.13	
合计	783,877.74	

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 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 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,296,603,244.75	47,296,603,244.75
本期申购	76,616,227,062.98	76,616,227,062.98
本期赎回（以“-”号填列）	-67,117,676,686.51	-67,117,676,686.51
本期末	56,795,153,621.22	56,795,153,621.22

6.4.7.7.2 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 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	434,409.02	434,409.02
本期申购	55,028,278.48	55,028,278.48

本期赎回（以“-”号填列）	-20,173,104.61	-20,173,104.61
本期末	35,289,582.89	35,289,582.89

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
本期期初	-	-	-
本期利润	614,599,365.85	-	614,599,365.85
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	-614,599,365.85	-	-614,599,365.85
本期末	-	-	-

6.4.7.8.2 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
本期期初	-	-	-
本期利润	33,418.74	-	33,418.74
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	-33,418.74	-	-33,418.74
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	32,233.14
定期存款利息收入	188,607,055.05
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,402,950.20
其他	455.79
合计	190,042,694.18

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 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	357,979,411.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	19,772,701.44
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	377,752,112.94

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 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	56,852,306,325.71

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	56,583,890,747.22
减：应计利息总额	248,642,877.05
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	19,772,701.44

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	926,235.32
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	926,235.32

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	60,353,740.28
减：卖出资产支持证券成本总额	59,000,000.00
减：应计利息总额	1,353,740.28
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

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

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	-
其他	2,075.00
合计	2,075.00

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
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	66,158.73
账户维护费	16,470.00

合计	201,643.47
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，本公司不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	55,254,851.64	61,385,288.60
其中：支付销售机构的客户维护费	4,343,569.47	2,101,887.45

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,813,712.88	15,346,322.13

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E	合计
永赢基金	2,205,171.06	0.00	2,205,171.06
宁波银行	30,388.63	47.39	30,436.02
兴业银行	21,652.88	139.97	21,792.85
合计	2,257,212.57	187.36	2,257,399.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E	合计
永赢基金	2,785,887.44	0.00	2,785,887.44
宁波银行	8,429.49	1,517.22	9,946.71
兴业银行	15.69	0.00	15.69
合计	2,794,332.62	1,517.22	2,795,849.84

注：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。

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

上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日						
银行间市场交易的	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

各关联方名称						
兴业银行	-	-	-	-	5,727,600,000.00	468,471.37

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

永赢天天利货币A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	102,177,040.33
报告期间申购/买入总份额	613,696,711.89	135,888,409.14
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	198,000,000.00	115,000,000.00
报告期末持有的基金份额	415,696,711.89	123,065,449.47
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.7315%	0.2243%

永赢天天利货币E

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至 2022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	0.0000%	0.0000%

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

永赢天天利货币A

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022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	659,399.57	0.0012%	0.00	0.0000%
宁波银行	2,215,111,115.82	3.8978%	2,190,656,084.45	4.6317%

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天天利货币E。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	809,810.11	3,348,343.09	808,820,534.44	4,371,129.82

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
614,593,589.23	2,283,351.05	-2,277,574.43	614,599,365.85	-

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
29,425.54	1,625.97	2,367.23	33,418.74	-

6.4.12 期末（2023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2023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7,124,822,564.36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
012380352	23电网SCP003	2023-07-03	100.65	2,287,000	230,188,923.40

012381641	23苏交通SCP009	2023-07-03	100.34	1,553,000	155,825,937.23
012381641	23苏交通SCP009	2023-07-05	100.34	191,000	19,164,683.84
012381705	23苏交通SCP010	2023-07-03	100.36	1,000,000	100,356,904.10
012381814	23招商局SCP005	2023-07-03	100.33	1,961,000	196,747,974.80
012382050	23百联集SCP002	2023-07-05	100.10	3,000,000	300,307,982.47
112205127	22建设银行CD127	2023-07-03	99.82	103,000	10,280,962.31
112214166	22江苏银行CD166	2023-07-06	99.31	2,000,000	198,616,548.75
112303106	23农业银行CD106	2023-07-03	99.61	3,192,000	317,968,771.24
112304013	23中国银行CD013	2023-07-03	98.82	5,000,000	494,077,389.10
112305007	23建设银行CD007	2023-07-03	98.60	381,000	37,568,177.07
112305140	23建设银行CD140	2023-07-04	99.50	5,000,000	497,488,491.25
112311054	23平安银行CD054	2023-07-03	99.87	3,240,000	323,573,102.95
112311054	23平安银行CD054	2023-07-04	99.87	377,000	37,650,327.10
112313036	23浙商银行CD036	2023-07-06	99.08	3,398,000	336,686,465.79
112313093	23浙商银行CD093	2023-07-03	98.50	2,577,000	253,843,120.26
112316040	23上海银行CD040	2023-07-04	99.28	2,273,000	225,656,629.33
112317031	23光大银行CD031	2023-07-03	99.09	2,000,000	198,188,054.12

112380731	23台州银行CD 028	2023-07-03	99.58	3,000,000	298,737,439.31
112394408	23台州银行CD 013	2023-07-03	99.46	77,000	7,658,361.26
180211	18国开11	2023-07-03	103.48	1,000,000	103,475,654.73
190203	19国开03	2023-07-03	101.98	1,500,000	152,976,731.09
200313	20进出13	2023-07-03	103.01	3,000,000	309,026,713.20
210202	21国开02	2023-07-03	101.78	1,600,000	162,854,061.33
210322	21进出22	2023-07-03	102.02	1,500,000	153,029,072.53
2104001	21农发绿债01	2023-07-03	101.58	1,000,000	101,584,516.12
220211	22国开11	2023-07-03	101.57	8,000,000	812,568,695.14
220214	22国开14	2023-07-03	99.77	300,000	29,931,086.08
220306	22进出06	2023-07-03	101.51	2,400,000	243,618,880.69
220408	22农发08	2023-07-03	101.32	2,000,000	202,647,303.93
239919	23贴现国债19	2023-07-03	99.95	5,000,000	499,756,368.21
239922	23贴现国债22	2023-07-03	99.93	1,000,000	99,928,121.43
239929	23贴现国债29	2023-07-03	99.77	2,500,000	249,422,398.28
239932	23贴现国债32	2023-07-03	99.71	1,000,000	99,706,515.53
239936	23贴现国债36	2023-07-03	99.67	1,500,000	149,500,702.87
合计				75,910,000	7,610,613,066.84

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023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及业务部门的自控和互控的第一道防线，合规风控部门监督管理的第二道防线，审计部事后检查的第三道防线，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控制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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	10,188,100.05
A-1以下	-	-
未评级	10,154,497,204.90	9,932,227,757.44
合计	10,154,497,204.90	9,942,415,857.49

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 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	50,591,123.29	110,329,301.04
合计	50,591,123.29	110,329,301.04

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	30,640,668,873.28	18,865,097,046.35
合计	30,640,668,873.28	18,865,097,046.35

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与

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 2023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	14,369,870.33 8.71	500,494,666.57	-	-	-	14,870,365.00 5.28
结算备付金	135,060,750.00	-	-	-	-	135,060,750.00
存出保证金	18,318.78	-	-	-	-	18,318.78
交易性金融资产	35,999,151.48 0.02	4,846,605,721.45	-	-	-	40,845,757.20 1.47

衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	7,985,888,282.05	-	-	-	-	7,985,888,282.05
应收清算款	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	332,597,311.37	332,597,311.37
其他资产	-	-	-	-	400.00	400.00
资产总计	58,489,989,169.56	5,347,100,388.02	-	-	332,597,711.37	64,169,687,268.95
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	7,124,822,564.36	-	-	-	-	7,124,822,564.36
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	196,000,000.00	196,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	10,158,486.05	10,158,486.05
应付托管费	-	-	-	-	2,539,621.50	2,539,621.50
应付销售服务费	-	-	-	-	509,050.74	509,050.74
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	515,462.17	515,462.17
应付利润	-	-	-	-	3,915,002.28	3,915,002.28
其他负债	-	-	-	-	783,877.74	783,877.74
负债总计	7,124,822,564.36	-	-	-	214,421,500.48	7,339,244,064.84
利率敏感度缺口	51,365,166,605.20	5,347,100,388.02	-	-	118,176,210.89	56,830,443,204.11
上年度	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

末 2022年1 2月31 日						
资产						
银行存款	12,822,158,83 0.68	1,501,161,249. 98	-	-	-	14,323,320,08 0.66
结算备付金	259,688,386.75	-	-	-	-	259,688,386.75
存出保证金	96,223.78	-	-	-	-	96,223.78
交易性金融资产	25,093,210,46 0.80	3,824,631,744. 08	-	-	-	28,917,842,20 4.88
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	8,586,906,458. 93	-	-	-	-	8,586,906,458. 93
应收清算款	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	155,595,663. 52	155,595,663.52
其他资产	-	-	-	-	400.00	400.00
资产总计	46,762,060,36 0.94	5,325,792,994. 06	-	-	155,596,063. 52	52,243,449,41 8.52
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	4,927,581,151. 97	-	-	-	-	4,927,581,151. 97
应付清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	8,661,136.73	8,661,136.73
应付托管费	-	-	-	-	2,165,284.20	2,165,284.20
应付销售服务费	-	-	-	-	433,381.70	433,381.70
应付投	-	-	-	-	-	-

资顾问费						
应交税费	-	-	-	-	547,356.65	547,356.65
应付利润	-	-	-	-	6,190,209.48	6,190,209.48
其他负债	-	-	-	-	833,244.02	833,244.02
负债总计	4,927,581,151.97	-	-	-	18,830,612.78	4,946,411,764.75
利率敏感度缺口	41,834,479,208.97	5,325,792,994.06	-	-	136,765,450.74	47,297,037,653.77

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-58,586,840.66	-43,960,296.70
	市场利率平行下降50个基点	58,586,840.66	43,960,296.70

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	40,845,757,201.47	28,917,842,204.88
第三层次	-	-
合计	40,845,757,201.47	28,917,842,204.88

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2023年08月28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	40,845,757,201.47	63.65
	其中：债券	40,795,166,078.18	63.57
	资产支持证券	50,591,123.29	0.08
2	买入返售金融资产	7,985,888,282.05	12.44
	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	15,005,425,755.28	23.38
4	其他各项资产	332,616,030.15	0.52
5	合计	64,169,687,268.95	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	5.57	
	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	7,124,822,564.36	12.54
	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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

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	33.65	12.54
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	5.52	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	26.35	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.05	-
4	90天(含)—120天	13.55	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	33.00	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	112.06	12.54

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	1,098,314,106.32	1.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,873,113,220.04	5.06
	其中：政策性金融债	2,271,712,714.84	4.00
4	企业债券	225,419,823.59	0.40
5	企业短期融资券	5,865,416,516.09	10.32
6	中期票据	92,233,538.86	0.16
7	同业存单	30,640,668,873.28	53.92
8	其他	-	-
9	合计	40,795,166,078.18	71.78
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,931,086.08	0.05

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	112303061	23农业银行C D061	9,500,000	948,801,076.08	1.67
2	220211	22国开11	8,000,000	812,568,695.14	1.43
3	112303106	23农业银行C D106	8,000,000	796,914,213.63	1.40
4	112396894	23广州农村商 业银行CD046	7,000,000	694,819,055.09	1.22
5	112306107	23交通银行C D107	6,000,000	592,891,772.34	1.04
6	239919	23贴现国债19	5,000,000	499,756,368.21	0.88

7	112397157	23成都银行C D098	5,000,000	499,358,602.27	0.88
8	112397239	23广州农村商 业银行CD051	5,000,000	499,356,084.53	0.88
9	112311054	23平安银行C D054	5,000,000	499,341,208.25	0.88
10	112380466	23广州农村商 业银行CD068	5,000,000	498,029,579.66	0.88

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	0.0750%
报告期内偏离度的最低值	0.0048%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0303%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112820	葛洲坝1A	500,000	50,591,123.29	0.09

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用实际利率法计价，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农业银行股份有限公司、广州农村商业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、成都银行股份有限公司、上海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**150万元、920万元、500万元、844万元、9834万元**。

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	18,318.78
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	332,597,311.37
5	其他应收款	400.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	332,616,030.15

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例

永赢天天利货币A	85 1,7 62	66,679.60	49,401,279,199.2 7	86.98 15%	7,393,874,421.95	13.018 5%
永赢天天利货币E	499	70,720.61	34,533,463.98	97.85 74%	756,118.91	2.142 6%
合计	85 2,2 61	66,681.97	49,435,812,663.2 5	86.98 83%	7,394,630,540.86	13.011 7%

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	3,041,862,208.55	5.35%
2	银行类机构	2,464,368,947.23	4.34%
3	银行类机构	2,343,110,350.65	4.12%
4	银行类机构	2,272,284,334.67	4.00%
5	银行类机构	2,215,111,115.82	3.90%
6	银行类机构	2,172,297,972.62	3.82%
7	银行类机构	1,500,499,298.03	2.64%
8	银行类机构	1,308,075,742.63	2.30%
9	保险类机构	1,085,417,121.85	1.91%
10	银行类机构	1,057,959,779.37	1.86%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	永赢天天利货币A	1,770,926.87	0.00%

	永赢天天利货币E	3,128.88	0.01%
	合计	1,774,055.75	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	永赢天天利货币A	0~10
	永赢天天利货币E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢天天利货币A	0
	永赢天天利货币E	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢天天利货币A	永赢天天利货币E
基金合同生效日(2017年04月20日)基金份额总额	200,011,783.59	-
本报告期期初基金份额总额	47,296,603,244.75	434,409.02
本报告期基金总申购份额	76,616,227,062.98	55,028,278.48
减：本报告期基金总赎回份额	67,117,676,686.51	20,173,104.61
本报告期期末基金份额总额	56,795,153,621.22	35,289,582.89

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

自2023年4月11日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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	
国盛证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信	2	-	-	-	-	新

证券						增
----	--	--	--	--	--	---

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
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	524,233,529.85	100.00%	186,225,877,000.00	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	2023-01-04
2	永赢天天利货币市场基金2023年“春节”假期前暂停直销机构申购、转换转入及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2023-01-18
3	永赢基金管理有限公司关于新增光大期货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	2023-01-19
4	永赢天天利货币市场基金2022年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
5	永赢基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2023-02-17

	新增江苏江南农村商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		
6	永赢基金管理有限公司关于新增中国农业银行股份有限公司为永赢天天利货币市场基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-06
7	永赢基金管理有限公司关于新增中国邮政储蓄银行股份有限公司为永赢天天利货币市场基金A份额代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-09
8	永赢基金管理有限公司关于新增平安银行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	2023-03-23
9	永赢天天利货币市场基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-30
10	永赢基金管理有限公司关于广州分公司办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
11	永赢基金管理有限公司关于新增中国中金财富证券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	2023-04-04
12	永赢基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-08
13	永赢基金管理有限公司关于新增长城证券股份有限公司为公司旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公	中国证监会规定媒介	2023-04-19

	告		
14	永赢天天利货币市场基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-21
15	永赢天天利货币市场基金2023年“五一”假期前暂停直销机构申购、转换转入及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2023-04-25
16	永赢基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为永赢基金旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-22
17	永赢基金管理有限公司关于新增国信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	2023-05-31
18	永赢基金管理有限公司关于新增中信银行股份有限公司为公司旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-05
19	永赢天天利货币市场基金2023年“端午”假期前暂停直销机构申购、转换转入及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2023-06-16

§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天天利货币市场基金注册的文件；
- 2.《永赢天天利货币市场基金基金合同》；
- 3.《永赢天天利货币市场基金托管协议》；
- 4.《永赢天天利货币市场基金招募说明书》及其更新（如有）；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪大厦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。

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
二〇二三年八月三十日