永赢货币市场基金

2015 年度报告摘要

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:2016年03月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月23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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自2015年01月01日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	永赢货币
基金主代码	000533
交易代码	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	2,843,010,618.05
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持安全性和高流动性的前提下,追求超过基准的较高收益。
投资策略	1、货币市场利率研判与管理策略 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。 2、期限配置策略 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将在投资需求期前做准备。 3、类属机品种配置策略 本基金的投资工具包括在交易所的短期国债、企业债和债券回购,在银行间市场交易的短期国债、金融债、央行票据和债券回购,以及同业存款、定期存款等品种。由于上述工具具有不同的流动性特征和收益特征,本基金统筹兼顾投资人的流动性与收益率要求,制定并调整类属机品种配置策略,在保证组合的流动性要求的基础上,提高组合的收益性。 4、灵活的交易策略 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。
业绩比较基准	7天通知存款利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		永赢基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧	田青
	联系电话	021-51690145	010-67595096
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com	tianqing12zh@ccb.com
客户服务电话		021-51690111	010-67595096
传真		021-51690177	010-66275853

2.4 信息披露方式

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	基金管理人、基金托管人处

§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	2015年	2014年
本期已实现收益	80,776,322.56	11,190,196.28
本期利润	80,776,322.56	11,190,196.28
本期净值收益率	3.9839%	3.5296%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末基金资产净值	2,843,010,618.05	365,234,583.90
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

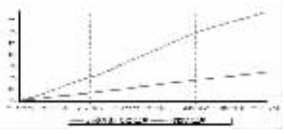
2、本基金利润分配按月结转份额。

3.2 基金净值表现

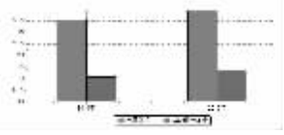
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7535%	0.0042%	0.3403%	0.0000%	0.4132%	0.0042%
过去六个月	1.5963%	0.0046%	0.6805%	0.0000%	0.9148%	0.0046%
过去一年	3.9839%	0.0058%	1.3500%	0.0000%	2.6339%	0.0058%
自基金合同生效日起至今(2014年02月27日-2015年12月31日)	7.6530%	0.0058%	2.4892%	0.0000%	5.1638%	0.0058%

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:图中列示的2014年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期2月27日(基金合同生效日)起至12月31日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2015年	70,295,030.98	7,573,535.49	2,947,756.09	80,776,322.56	
2014年	11,190,196.28	-	-	11,190,196.28	
合计	81,445,227.26	7,573,535.49	2,947,756.09	91,966,518.84	

§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

本基金管理人----永赢基金管理有限公司于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,本基金管理人于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)0008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)。

截止2015年12月31日,本基金管理人共管理4只开放式证券投资基金,即永赢货币市场基金、永赢量化混合型发起式证券投资基金、永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金、永赢稳益债券型证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈晟	基金经理	2014年08月29日	2015年11月09日	6	硕士研究生,曾任上海甫瀚投资管理咨询有限公司咨询顾问;2009年10月起,加入华宝兴业基金管理有限公司担任研究员;2014年6月起,担任永赢基金管理有限公司研究员。
韩聪	基金经理	2014年12月16日	2015年04月09日	3	博士研究生,2011年11月到2014年8月,先后在光大证券股份有限公司担任研究所固定收益分析师、金融市场总部高级投资经理等职。2014年8月起加盟永赢基金管理有限公司,任投资部固定收益总监助理一职。
祁洁萍	基金经理	2015年05月20日	-		硕士,CFA、7年固定收益研究投资经验,曾任平安证券研究所债券分析师;光大证券证券投资总部投资经理、执行董事;现任永赢基金管理有限公司固定收益投资总监。

注:1、任职时间和离任日期一般情况下指本基金管理人作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日期即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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为,本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》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投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资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,不同投资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投资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事宜。

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、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易,各投资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,并由监察稽核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审核,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,投资经理须提出申请并阐明具体原因,交由交易总监及监察稽核总监进行严格的公平性审核;(4)严格禁止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的不同投资组合之间的同日反向交易,相关投资经理须向风险管理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,监察稽核部开展日内和定期的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日内不定点对交易系统的抽查监控;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;以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上,监察稽核部在每个季度的《公平交易报告》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权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,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监察稽核部进行日常投资交易行为监控,监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度分别对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。本报告期内,公平交易制度执行情况良好。

4.3.3 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

2015年在经济增速换档,产业结构转型的大环境下,货币政策处于相对偏宽松状态。央行通过连续5次降准,释放基础货币超3.8万亿,公开市场逆回购利率由年初的3.85%下调至2.25%。债券市场收益率在央行的引导下逐步走低,1年期国债由年初的3.26%至2.29%,收益率下行将近100BP。报告期间永赢货币万份收益均值1.31,7日年化收益率均值3.94%,远超一年期定期存款基准利率。货币基金规模由年初3.65亿增长至28.43亿,增长24.78亿,尤其是三季度在市场避险情绪的推动下,货币基金规模增长至42.40亿,规模的快速增长加大了对流动性管理的难度,因此我们加大了对现金类资产的配置规模,现金类资产由年中8.13%增加至三季度34.76%。四季度IPO重启后,部分避险资金赎回,四季度货币基金规模也由42.40亿降至28.43亿,由于前期配置大比例现金类资产,永赢货币保持了很好的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,份额净值收益率为3.9839%,业绩比较基准收益率为1.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,供给侧改革逐步深入,整个市场仍处于产能出清的过程,国内产能的去化程度会影响长期的经济增长路径。短期内,政府加杠杆托底经济的态度愈发明显,财政政策的宽松往往需要宽松的货币政策来配合,因此,我们判断整体的货币环境仍会偏向宽松,央行利率市场化正逐步进入尾声,利率走廊的构建将大大稳定投资者对资金面的预期,因此回购利率的波动将大大降低。

同时,随着经济下行,债市刚兑逐渐打破,信用风险逐步凸显,个券收益率受企业和行业资质波动影响越来越大,信用债研究将会更加地精细化,我们会高度关注持仓债券的信用风险,密切关注持仓债券可能出现的资质变化,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。

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银行进行复核。本基金管理人估值委员会由分管运营副总经理负责,成员包括总经理、督察长、分管投资的副总经理、分管运营的副总经理、基金运营部负责人、监察稽核部负责人,均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议,但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

报告期内,本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定,本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资者每日计算当日收益,每月集中支付,每月累计收益支付方式采用红利再投资方式。报告期内本基金向份额持有人分配利润80,776,322.56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,本基金未发生基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

§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、净值计算等情况的说明

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

报告期内,本基金实施利润分配的金额为80,776,322.56元。

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 审计报告

本基金2015年年度财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:永赢货币市场基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	412,742,430.79	51,366,016.42
结算备付金			
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,936,370,004.87	270,905,045.16
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,936,370,004.87	270,905,045.16
资产支持证券投资		-	-
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	494,001,861.00	70,000,545.00
应收证券清算款		121,395,026.01	-
应收利息	7.4.7.5	33,361,181.83	5,884,271.77
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,997,870,504.50	398,155,878.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
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		149,899,455.15	32,569,471.14
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		747,773.52	90,627.39
应付托管费		226,598.03	27,462.84
应付销售服务费		566,495.10	68,657.11
应付交易费用	7.4.7.7	62,432.70	28,977.09
应交税费		-	-
应付利息		210,375.86	7,098.88
应付利润		2,947,756.09	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	199,000.00	129,000.00
负债合计		154,859,886.45	32,921,294.45
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,843,010,618.05	365,234,583.90
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,843,010,618.05	365,234,583.90
负债和所有者权益总计		2,997,870,504.50	398,155,878.35

注:1、报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额2,843,010,618.05份。

2、本基金合同于2014年2月27日生效,上年度可比期间自2014年2月27日至2014年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:永赢货币市场基金

本报告期:2015年01月01日-2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年01月01日-2015年12月31日	上年度可比期间2014年02月27日(基金合同生效日)-2014年12月31日
一、收入		100,812,101.76	13,419,767.86
1.利息收入		73,516,000.60	11,985,176.25
其中:存款利息收入	7.4.7.11	23,954,445.36	7,737,139.21
债券利息收入		43,702,990.47	3,475,340.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,858,564.77	772,696.31
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		27,296,101.16	1,434,591.61
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	27,296,101.16	1,434,591.61
资产支持证券投资收益		-	-
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	-	-
减:二、费用		20,035,779.20	2,229,571.58
1. 管理人报酬		7,961,707.83	922,738.41
2. 托管费		2,412,638.70	279,617.62
3. 销售服务费		6,031,596.80	699,044.17
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		3,332,282.38	149,764.09
其中:卖出回购金融资产支出		3,332,282.38	149,764.09
6. 其他费用	7.4.7.18	297,553.49	178,407.29
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		80,776,322.56	11,190,196.28
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		80,776,322.56	11,190,196.28

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:永赢货币市场基金

本报告期:2015年01月01日-2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年01月01日-2015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)	365,234,583.90	-	365,234,583.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	80,776,322.56	80,776,322.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	2,477,776,034.15	-	2,477,776,034.15
其中:1.基金申购款	13,606,370,435.36	-	13,606,370,435.36
2.基金赎回款	-11,128,594,401.21	-	-11,128,594,401.21
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)	-	-80,776,322.56	-80,776,322.56
五、期末所有者权益(基金净值)	2,843,010,618.05	-	2,843,010,618.05
项 目	上年度可比期间2014年02月27日(基金合同生效日)-2014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)	597,140,206.43	-	597,140,206.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,190,196.28	11,190,196.28
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)	-231,905,622.53	-	-231,905,622.53
其中:1.基金申购款	1,268,965,703.32	-	1,268,965,703.32
2.基金赎回款	-1,500,871,325.85	-	-1,500,871,325.85
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)	-	-11,190,196.28	-11,190,196.28
五、期末所有者权益(基金净值)	365,234,583.90	-	365,234,583.90

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:

宋宜农	田中甲	田中甲
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,由永赢基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集。基金合同于2014年2月27日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集规模为597,140,206.43份基金份额。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。

本基金投资于具有良好流动性货币市场工具,主要包括以下:现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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)。

本财务报表由本基金的基金管理人永赢基金管理有限公司于2016年3月26日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 税项

7.4.5.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,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,继续免征营业税和企业所得税;

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。

7.4.5.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

7.4.6 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、基金销售机构、基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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
利安资金管理公司	基金管理人的股东
员工股东	基金管理人的股东
永赢资产管理有限公司("永赢资产")	基金管理人的子公司
永赢永鑫八期资产管理计划	基金管理人控制的结构化主体

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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年12月31日	上年度可比期间 2014年02月27日(基金合同生效日)-2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,961,707.83	922,738.41
其中:支付销售机构的客户维护费	104,647.23	114,319.88

注:应支付基金管理人永赢基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年12月31日	上年度可比期间 2014年02月27日(基金合同生效日)-2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,412,638.70	279,617.62

注:应支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

7.4.7.2.3 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 2015年01月01日-2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
永赢基金管理有限公司	5,644,412.21
宁波银行股份有限公司	379,528.55
合计	6,023,940.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年02月27日(基金合同生效日)-2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
永赢基金管理有限公司	270,098.92
宁波银行股份有限公司	428,681.47
合计	698,780.39

注:应支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给永赢基金管理有限公司TA清算账户,再由永赢基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.7.3 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 2015年01月01日-2015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
中国建设银行	50,658,729.45					
	上年度可比期间 2014年02月27日(基金合同生效日)-2014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
中国建设银行	-					

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年01月01日-2015年12月31日	上年度可比期间 2014年02月27日(基金合同生效日)-2014年12月31日
基金合同生效日持有的基金份额	-	50,000,000.00
期初持有的基金份额	90,037,131.47	-
期间申购/买入总份额	161,583,199.88	85,037,131.47
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	144,500,000.00	45,000,000.00
期末持有的基金份额	107,120,331.35	90,037,131.47
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.77%	24.65%

注:期间申购/买入总份额含红利再投份额。

7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014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
永赢资产管理有限公司	55,148,007.94	1.94%	29,961,388.40	8.20%
员工股东	966,653.31	0.03%	203.15	0.00%
永赢永鑫八期资产管理计划	19,270,962.12	0.68%	-	0.00%

7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年01月01日-2015年12月31日		上年度可比期间 2014年02月27日(基金合同生效日)-2014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
中国建设银行活期存款	2,742,430.79	39,575.39	1,366,016.42	39,737.02

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.8 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015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149,899,455.15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
011599667	15渝文资SCP002	2016-01-07