

# 永赢货币市场基金

## 2018年第三季度报告

截至报告期末永赢货币基金份额净值为1.000元。本报告期内,基金份额净值收益率为0.9633%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。  
4.6 报告期内基金持有人权益或基金净值预警说明  
本报告期内本基金管理人无应披露的预警信息。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益资产	10,897,029.827132	62.07
2	权益类资产	10,676,237.886223	62.77
3	银行存款	199,799,340.0000	1.09
4	其他资产	3,869,941.903000	0.22
	合计	20,282,907.916355	100.00

5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家券	289,730,000.00	2.10
2	央行票据	-	-
3	金融债	1,682,944,616.37	0.80
4	企业债	1,682,944,616.37	0.80
5	地方政府债	-	-
6	中期票据	1,523,320,000.00	1.08
7	短期融资券	181,073,663.47	0.09
8	其他	7,200,000.0004	0.01
9	合计	10,676,237,886.23	50.63

注:1、本报告期末资产配置比例符合基金合同约定。  
2、本基金在六个月内建仓期末时,各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理任期	是否从基金经理中离任	说明
陈录军	基金经理	2016-01-01	否	曾任招商银行资产管理部高级经理,曾任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理,现任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理。具有多年证券从业经验,曾任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理。具有多年证券从业经验,曾任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理。
刘鹏	基金经理	2016-08-24	否	曾任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理,现任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理。具有多年证券从业经验,曾任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理。

注:1、任职日期和离任日期一般指下文报告期内做出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起任职,则以基金合同生效日为准。  
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵守信託情况说明  
在本报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢货币市场基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未有损害持有人利益的行为。  
4.3 公平交易专项说明  
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健全有纪律、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,切实防范利益冲突。本基金管理人制定了严格的授权交易管理制度,投资选择管理制度和集中交易管理制度等,并建立交易执行环节的公平交易措施,以“制度先行、系统先行”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措施,以尽可能确保公平对待各投资组合。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 报告期内基金的投资策略和运作分析  
2018年第三季度国内宏观经济呈现逐步回落趋势,9月份制造业PMI回落至50.8,为本年除二月份春节后最低月份。季度内工业增加值增速回落至6%附近,8、9月固定资产投资增速进一步下行至5.5%和5.3%的历史低位,受高房价挤出效应影响显现,随着中美贸易摩擦不断升级,中国经济面临的外需不确定性明显上升,进出口数据转弱。物价方面,受猪肉、水灾及暑期消费影响,猪肉价格继续飙升,蔬菜及教育、旅游产品价格上行,推升CPI上行至2.3%,PPI则由基数效应下行至4.1%,短期内通胀继续温和。三季度货币政策持续宽松,6月份央行宣布年内第三次降准于7月执行,7-9月份又均进行增量中期借贷便利(MLF)投放,维持流动性合理充裕。银行间7月同业拆借利率加权利率均值2.67%,较上季度下行2bp,同时存款利率整体下行,且各期限利率差收窄,曲线陡峭化下行,水债货币市场配置型固定收益资产于7、8月年化收益率随货币债利率中枢中有回落。

1.1 净值表现  
截至报告期末永赢货币基金份额净值为1.000元。本报告期内,基金份额净值收益率为0.9633%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。  
1.2 投资组合情况  
4.6 报告期内基金持有人权益或基金净值预警说明  
本报告期内本基金管理人无应披露的预警信息。

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理任期	是否从基金经理中离任	说明
陈录军	基金经理	2016-01-01	否	曾任招商银行资产管理部高级经理,曾任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理,现任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理。具有多年证券从业经验,曾任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理。
刘鹏	基金经理	2016-08-24	否	曾任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理,现任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理。具有多年证券从业经验,曾任招商证券股份有限公司资产管理部高级经理。

注:1、任职日期和离任日期一般指下文报告期内做出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起任职,则以基金合同生效日为准。  
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵守信託情况说明  
在本报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢货币市场基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未有损害持有人利益的行为。  
4.3 公平交易专项说明  
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健全有纪律、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,切实防范利益冲突。本基金管理人制定了严格的授权交易管理制度,投资选择管理制度和集中交易管理制度等,并建立交易执行环节的公平交易措施,以“制度先行、系统先行”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措施,以尽可能确保公平对待各投资组合。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 报告期内基金的投资策略和运作分析  
2018年第三季度国内宏观经济呈现逐步回落趋势,9月份制造业PMI回落至50.8,为本年除二月份春节后最低月份。季度内工业增加值增速回落至6%附近,8、9月固定资产投资增速进一步下行至5.5%和5.3%的历史低位,受高房价挤出效应影响显现,随着中美贸易摩擦不断升级,中国经济面临的外需不确定性明显上升,进出口数据转弱。物价方面,受猪肉、水灾及暑期消费影响,猪肉价格继续飙升,蔬菜及教育、旅游产品价格上行,推升CPI上行至2.3%,PPI则由基数效应下行至4.1%,短期内通胀继续温和。三季度货币政策持续宽松,6月份央行宣布年内第三次降准于7月执行,7-9月份又均进行增量中期借贷便利(MLF)投放,维持流动性合理充裕。银行间7月同业拆借利率加权利率均值2.67%,较上季度下行2bp,同时存款利率整体下行,且各期限利率差收窄,曲线陡峭化下行,水债货币市场配置型固定收益资产于7、8月年化收益率随货币债利率中枢中有回落。

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

基金管理人:兴全基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示

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  
报告送出日期:2018年10月24日  
§1 重要提示