

# 永赢天天利货币市场基金

## 2019年第二季度报告

二季度,央行连续施压货币市场,货币市场利率整体保持较高水平。受4月份降准降准影响,5月中下旬市场流动性充裕,货币市场利率出现阶段性回落,货币市场利率波动有所加大,6月份央行加大流动性投放后货币市场逐步恢复平稳。二季度,本基金以配置高流动性资产为主,7天年化收益率随货币市场整体利率水平下行。

4.5 报告期内本基金业绩表现  
截至报告期末,本基金天利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0.7023%,同期业绩比较基准收益率为0.3368%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明  
本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

5.1 投资组合报告  
5.1.1 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	固定收益投资	20,155,902.58496	61.01
	其中:债券	19,961,002.58496	61.02
	资产支持证券	194,000.00000	0.59
2	买入返售金融资产	4,946,762.02873	15.12
	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	7,297,688.04388	22.31
4	其他资产	313.6799540	0.06
5	合计	32,713,032.36706	100.00

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金总资产比例(%)
1	国债	218,794.58970	0.69
2	央行票据	-	-
3	金融债	1,561,016.19000	4.90
	其中:政策性金融债	1,561,016.19000	4.90
4	企业债	373,632.94753	1.14
5	企业短期融资券	2,407,410.21764	7.37
6	中期票据	2,161,700.86789	6.78
7	银行存款	13,348,947.77481	41.26
8	其他	-	-
9	合计	19,961,002.58496	62.04
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,中票违约的成本包括债券面值折溢价,贴现形式的成本包括债券投资成本和内在利息。

5.6 报告期内按摊余成本法基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11191030106	19华夏银行 10,000,000	301,368,028.23	3.11
2	11191030106	19华夏银行 10,000,000	696,014,571.49	2.19
3	190410	19浦发发 7,000,000	600,296,796.11	1.89
4	11191030106	19浦发发 6,000,000	597,220,216.62	1.87
5	00312	19海信注 5,600,000	560,660,176.74	1.76
6	001461	14 晋商银行 MTN003 5,490,000	552,053,520.57	1.73
7	11191301000	19浦发发 5,000,000	497,638,903.88	1.56
8	11191030106	19浦发发 5,000,000	497,029,150.64	1.56
9	11191030106	19浦发发 5,000,000	496,976,664.13	1.56
10	11191030106	19浦发发 5,000,000	496,907,084.60	1.56

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的平均值。

5.2 报告期内基金资产组合中公允价值超过基金资产净值的20%的说明  
本基金本报告期末公允价值超过基金资产净值比例超过20%的资产情况如下:

5.3 投资组合公允价值变动情况  
5.3.1 投资组合公允价值变动情况

项目	金额
报告期末投资组合公允价值余额	70
报告期末投资组合公允价值期初余额	89
报告期内投资组合公允价值变动	54
报告期内投资组合公允价值变动最高值	89
报告期内投资组合公允价值变动最低值	19

注:报告期内投资组合公允价值变动超过100天情况说明  
本基金本报告期内投资组合公允价值变动期限超过120天的情况如下:

5.3.2 报告期末投资组合公允价值余额分布情况

序号	平均余额(元)	各资产类别占基金资产净值比例(%)	各资产类别占基金资产净值比例(%)
1	30天以内	23.53	23.53
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
2	30天以上-60天	18.19	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
3	60天以上-90天	38.26	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
4	90天以上-120天	8.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
5	120天以上-397天(含)	13.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
合计	102.00	100.00	23.53

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

# 永赢天天利货币市场基金

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  
报告送出日期:2019年07月19日

1.1 重要提示  
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,也不保证基金份额持有人不受本金损失。投资者投资于本基金,须自行承担投资风险。

2.2 基金业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率(税后)。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2017-06-26	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-08-24	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《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,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2017-06-26	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-08-24	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《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,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2017-06-26	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-08-24	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《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,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2018-03-06	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-03-06	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《永赢增益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2018-03-06	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-03-06	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《永赢增益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2018-03-06	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-03-06	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《永赢增益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2018-03-06	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-03-06	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《永赢增益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2018-03-06	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-03-06	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《永赢增益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2018-03-06	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-03-06	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《永赢增益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2018-03-06	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-03-06	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《永赢增益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2018-03-06	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-03-06	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《永赢增益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2018-03-06	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-03-06	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副经理。

注:1.任职日期和离任日期一般指聘任及解聘合同生效之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

在报告期内,本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施条例、《永赢增益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施,也未发生任何违法违规、被监管机构处罚、采取风险、取消资格、取消职务等行政处罚或采取其他行政措施的情况。

3.2 基金资产配置比例  
本基金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	在本基金的基金经理任期(自)	证券从业年限	说明
乔瑞	固定收益投资部副总监/基金经理	2018-03-06	10	乔瑞先生,复旦大学经济学院学士,10年证券从业经验,曾任广发银行资产管理部固定收益部副经理,从事债券及固定收益类资产支持证券、公募债券投资、流动性管理等工作。现任永赢基金管理有限公司固定收益部副总监。
卢静	基金经理	2018-03-06	3	卢静女士,上海交通大学金融学硕士,3