

平安大华日增利货币市场基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：平安大华基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华日增利货币
场内简称	-
交易代码	000379
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 3 日
报告期末基金份额总额	39,621,734,580.09 份
投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（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。

基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	224,419,693.88
2. 本期利润	224,419,693.88
3. 期末基金资产净值	39,621,734,580.09

注：1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益，由于本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。

3、本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

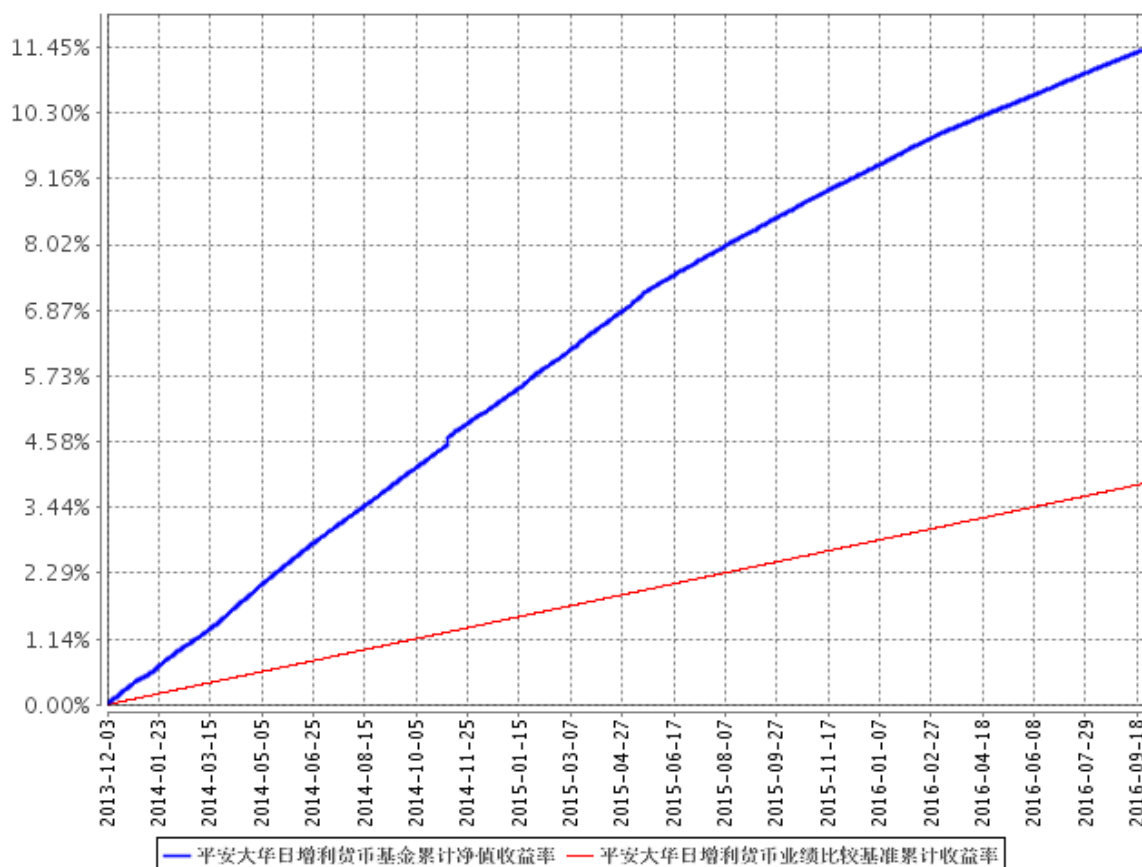
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	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	0.5985%	0.0004%	0.3450%	0.0000%	0.2535%	0.0004%

业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

平安大华日增利货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效，截至报告期末已满两年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓。

§4 管理人报告

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙健	本基金的基金经理	2013 年 12 月 3 日	-	15	自 2001 年起，先后在湘财证券资产管理部、中国太平人寿保险公司投资部/太平资产管理公司从事投资工作，2006 年起，分别在摩根士丹利华鑫基金公司、银华基金公司担任基金

				<p>经理。2011 年 9 月加入平安基金，现担任平安大华保本混合型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华日增利货币市场基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

- 1、此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。
- 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 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、《平安大华日增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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过

该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年三季度货币市场流动性月末季末波动特征较为明显，7 天回购利率季度平均维持在 2.48% 附近，较 2 季度略有上行。3 季度本基金在存款和存单报价偏低的情况下，适度增加了短期债券的配置比例，并对月末季末保有一定的流动性留存，以扑捉阶段性投资机会。

中国经济目前正经历低速增长阶段，基本面不好不坏，季度波幅较小。对于 2016 年 4 季度而言，需要警惕流动性边际收紧带来的影响，一方面来自于人民币贬值预期造成的流动性外流，另一方面全球央行对持续宽松政策的反思和中国央行的按兵不动都会对市场资金面形成收紧预期。同时，4 季度也是传统资金季节性波动高峰期。因此对未来的投资操作，以加强流动性管理为主要原则，增加类现金比例的投资，适度增加杠杆，增加波段性操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 0.5985%，同期业绩基准增长率为 0.3450%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万的情形。

§5 投资组合报告

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	固定收益投资	31,532,793,264.58	76.23
	其中：债券	31,153,793,264.58	75.32
	资产支持证券	379,000,000.00	0.92
2	买入返售金融资产	289,000,633.50	0.70
	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	9,035,249,296.49	21.84
4	其他资产	506,029,833.24	1.22
5	合计	41,363,073,027.81	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.90	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,716,996,424.50	4.33
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本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

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	86

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.2 报告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	28.35	4.33
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.36	-
2	30 天(含)-60 天	25.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.81	-
3	60 天(含)-90 天	23.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.48	-
4	90 天(含)-120 天	2.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.58	-

5	120 天(含)-397 天(含)	22.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.12	4.33

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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,222,520,878.14	5.61
	其中：政策性金融债	2,222,520,878.14	5.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,847,573,156.98	12.23
6	中期票据	-	-
7	同业存单	24,083,699,229.46	60.78
8	其他	-	-
9	合计	31,153,793,264.58	78.63
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	1,670,613,100.27	4.22

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111614141	16 江苏银行 CD141	10,000,000	997,202,681.44	2.52
2	111696055	16 广州农村商业银行 CD115	10,000,000	997,107,894.62	2.52
3	111694153	16 贵州银行 CD010	8,500,000	831,270,753.42	2.10
4	111694110	16 福建海峡银行 CD025	8,000,000	782,545,196.96	1.98
5	111695460	16 广州农村商业银行	7,000,000	699,002,083.81	1.76

		CD105			
6	111693796	16 广州农村 商业银行 CD069	5,500,000	547,416,022.79	1.38
7	111614113	16 江苏银行 CD113	5,000,000	499,300,076.76	1.26
8	111697808	16 甘肃银行 CD061	5,000,000	496,500,960.29	1.25
9	111693534	16 包商银行 CD025	5,000,000	490,024,013.34	1.24
10	111693605	16 西安银行 CD017	5,000,000	489,791,329.56	1.24

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1025%
报告期内偏离度的最低值	0.0506%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0844%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)
1	116323	万科 1A1	1,300,000	130,000,000.00	0.33
2	zc16092206	万科 2A1	1,200,000	120,000,000.00	0.30
3	131801	花呗 01A1	500,000	50,000,000.00	0.13
4	142047	花呗 04A1	400,000	40,000,000.00	0.10
5	142007	花呗 03A1	390,000	39,000,000.00	0.10

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买

入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。

5.9.2

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	81,245,669.68
4	应收申购款	424,784,163.56
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	506,029,833.24

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	33,705,091,534.63
报告期期间基金总申购份额	88,079,375,950.80
报告期期间基金总赎回份额	82,162,732,905.34
报告期期末基金份额总额	39,621,734,580.09

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2016年7月 15日	128,374.89	128,374.89	-
2	红利再投	2016年8月 16日	126,493.11	126,493.11	-
3	红利再投	2016年9月 15日	136,118.29	136,118.29	-
合计			390,986.29	390,986.29	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2016 年 8 月，管理人根据《货币市场基金监督管理办法》的要求，依法对本基金的《基金合同》和《托管协议》进行了相应更新，并已公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安大华日增利货币市场基金设立的文件
- (2) 平安大华日增利货币市场基金基金合同
- (3) 平安大华日增利货币市场基金托管协议
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 报告期内平安大华日增利货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安大华基金管理有限公司
2016 年 10 月 25 日