

平安大华日增利货币市场基金 2016 年年度 报告

2016 年 12 月 31 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

送出日期：2017 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 3 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。

普华永道中天会计师事务所为基金财务出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 债券回购融资情况.....	43
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	44
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
8.6 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.....	45

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	46
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
8.9 投资组合报告附注.....	46
§9 基金份额持有人信息.....	47
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
9.3 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的情况	48
§10 开放式基金份额变动.....	48
§11 重大事件揭示.....	48
11.1 基金份额持有人大会决议	48
11.2 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	48
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
11.4 基金投资策略的改变.....	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	50
11.9 其他重大事件.....	50
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§13 备查文件目录.....	56
13.1 备查文件目录.....	56
13.2 存放地点.....	56
13.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华日增利货币市场基金
基金简称	平安大华日增利货币
基金主代码	000379
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
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
报告期末基金份额总额	49,997,751,000.87 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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	平安大华基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正
	联系电话	0755-22626828
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn
客户服务电话	400-800-4800	95511-3
传真	0755-23997878	0755-82080387
注册地址	深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦酒店 01: 419	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码	518048	518001

法定代表人	罗春风	谢永林
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

§ 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	960,775,958.68	587,645,988.15	221,946,586.89
本期利润	960,775,958.68	587,645,988.15	221,946,586.89
本期净值收益率	2.5646%	3.8081%	4.9068%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末基金资产净值	49,997,751,000.87	29,947,660,176.13	9,981,075,007.97
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
累计净值收益率	12.1482%	9.3440%	5.3328%

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

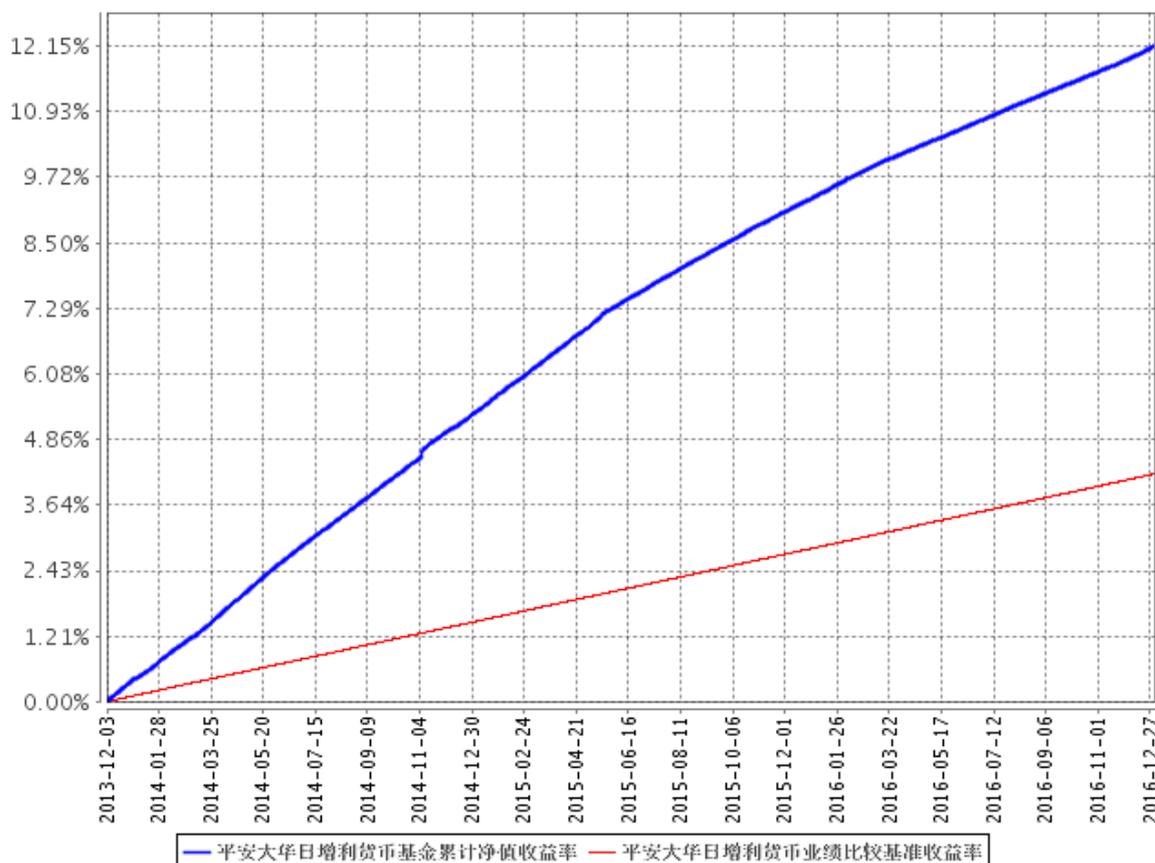
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	0.6300%	0.0008%	0.3450%	0.0000%	0.2850%	0.0008%
过去六个月	1.2323%	0.0007%	0.6900%	0.0000%	0.5423%	0.0007%
过去一年	2.5646%	0.0011%	1.3725%	0.0000%	1.1921%	0.0011%
过去三年	11.6946%	0.0045%	4.1100%	0.0000%	7.5846%	0.0045%
自基金合同生效起至今	12.1482%	0.0045%	4.2187%	0.0000%	7.9295%	0.0045%

注：业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方可支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资范围、投资目标及流动性特征，选取同期七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

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

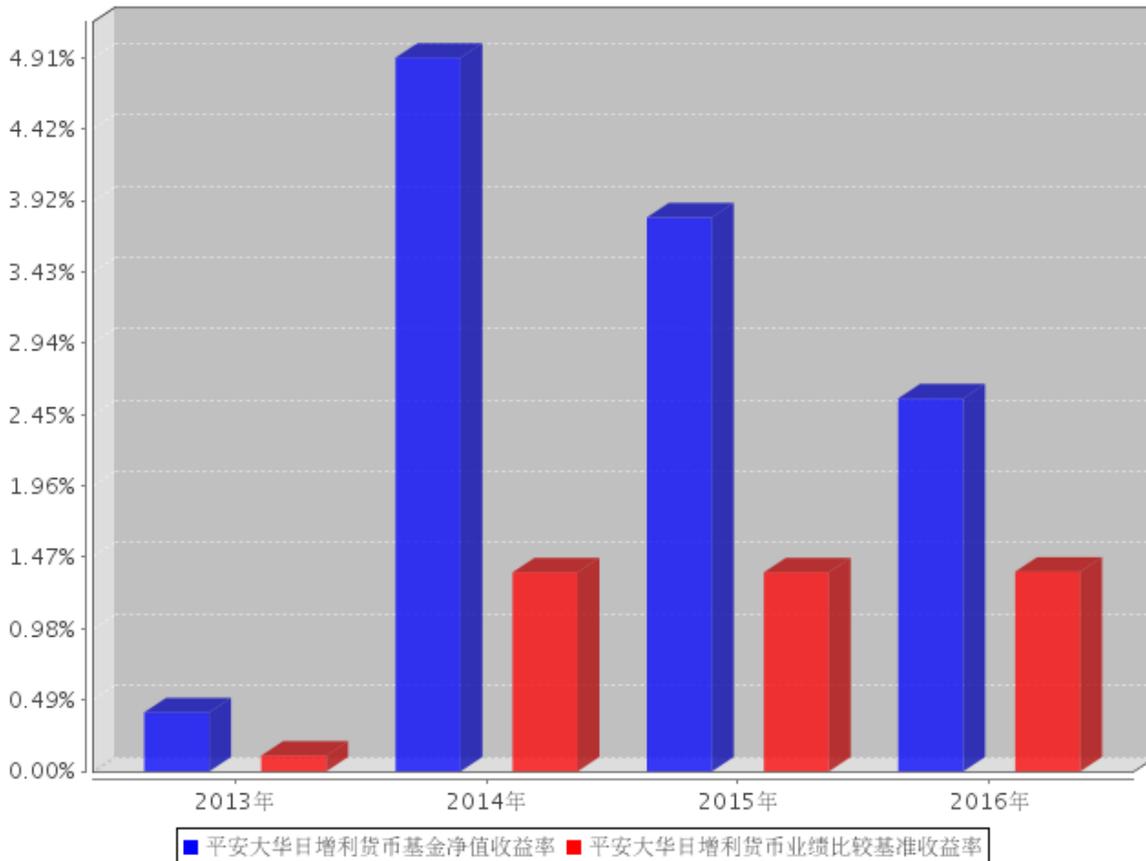
平安大华日增利货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效，截至报告期已满三年；
- 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。

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

平安大华日增利货币自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



1. 本基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效，截止报告期末已满三年。
2. 2013 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

3.4 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
2016	958,368,622.21	-	2,407,336.47	960,775,958.68	-
2015	586,701,266.65	-	944,721.50	587,645,988.15	-
2014	220,794,400.23	-	1,152,186.66	221,946,586.89	-

合计	1,765,864,289.09	-	4,504,244.63	1,770,368,533.72	-
----	------------------	---	--------------	------------------	---

§ 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

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 3 亿元人民币，是目前中国内地基金业注册资本金最高的基金公司之一。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股权 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。

平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2016 年 12 月 31 日，平安基金共管理 29 只开放式基金，资产管理总规模超 836 亿元。

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		
孙健	本基金的基金经理	2013 年 12 月 3 日	-	16	孙健先生，基金经理，硕士，1975 年生。曾任湘财证券有限责任公司资产管理总部投资经理，中国太平人寿保险有限公司投资部、太平资产管理有限公司组合投资经理，摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理，银华货币市场证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金基金经理。2011 年 9 月加入平安大华基金公司，任投资研究部固定收益研究员，现担任“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”、“平安大华保本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。
--	--	--	--	--	---

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外告之日。证券从业的含义遵循协会《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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华日增利货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定并下发了《平安大华基金管理有限责任公司公平交易管理制度》、《平安大华基金管理有限责任公司异常交易监控及报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议

和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、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。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期连续四个季度期间内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

4.3.3 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 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

回顾 2016 年，上半年相对宽松；下半年随管理层加速去杠杆、外汇占款持续外流影响，市场流动性趋紧；接近年底，利率中枢不断走高。货币政策方面，今年主要组合运用逆回购和 MLF 两大工具，后者锁短放长效果明显，意在控制金融市场风险。

本基金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、在有效控制负偏离度的前提下，增加不受估值影响的协议存款的投资比例，适时增加久期、提高货币基金长期收益。

4.4.2 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 2.5646%，同期业绩基准增长率为 1.3725%。

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 2017 年，外围方面，美元走强、人民币贬值趋势仍在，资本流出压力不小。国内宏观经济是否能够企稳存在变数，通胀压力犹存。货币政策方面，此前中央经济工作会议提出维护流动性基本稳定，注重抑制资产泡沫和防范金融风险，稳健中性释放的信号是“偏紧”。央行将会采用更多的政策工具对货币市场进行数量和价格的调控，在震荡市中，波动会有所加剧。因此在 2017 年的操作中，一方面要继续做好流动性的管理，另一方面要抓住市场机会，锁定收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部门按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网络、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部、运营部及监察稽核部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理，特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同

业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金基金合同的规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人，并按照自然日结转至基金份额持有人的基金账户。本报告期内应分配收益 960,775,958.68 元，实际分配收益 960,775,958.68 元。

4.9 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 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

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华日增利货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由平安大华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 22046 号
--------	-------------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	平安大华日增利货币市场基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的平安大华日增利货币市场基金(以下简称“平安大华日增利货币基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是平安大华日增利货币基金的基金管理人平安大华基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为,上述平安大华日增利货币基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了平安大华日增利货币基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	曹翠丽	边晓红
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安大华日增利货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	22,233,533,148.83	10,819,814,238.94
结算备付金		-	8,460,476.19
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	17,298,960,304.36	14,548,069,075.97
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		16,709,960,304.36	13,997,719,765.63
资产支持证券投资		589,000,000.00	550,349,310.34
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	10,316,194,874.30	4,322,750,330.45
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	143,526,281.09	212,097,777.07
应收股利		-	-
应收申购款		59,940,895.77	53,977,154.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		50,052,155,504.35	29,965,169,052.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	148.73
应付管理人报酬		11,225,834.22	7,442,924.33
应付托管费		2,721,414.37	1,804,345.30
应付销售服务费		8,504,419.89	5,638,579.06

应付交易费用	7.4.7.7	184,530.47	111,314.46
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		4,526,899.49	2,119,563.02
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	27,241,405.04	392,001.78
负债合计		54,404,503.48	17,508,876.68
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	49,997,751,000.87	29,947,660,176.13
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		49,997,751,000.87	29,947,660,176.13
负债和所有者权益总计		50,052,155,504.35	29,965,169,052.81

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额 1.000 元，基金份额总额 49,997,751,000.87 份。

7.2 利润表

会计主体：平安大华日增利货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		1,226,515,641.20	705,136,062.70
1.利息收入		1,220,795,921.99	696,364,041.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	515,502,901.47	303,870,341.99
债券利息收入		638,118,383.22	357,895,452.89
资产支持证券利息收入		11,215,020.79	9,573,449.38
买入返售金融资产收入		55,959,616.51	25,024,797.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,719,719.21	8,772,021.06
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	5,700,119.21	8,772,021.06
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	19,600.00	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		265,739,682.52	117,490,074.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	125,239,491.88	54,070,755.80

2. 托管费	7.4.10.2.2	30,361,089.02	13,108,062.01
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	94,878,402.95	40,962,693.85
4. 交易费用	7.4.7.19	891.72	-
5. 利息支出		14,659,406.95	8,929,168.79
其中：卖出回购金融资产支出		14,659,406.95	8,929,168.79
6. 其他费用	7.4.7.20	600,400.00	419,394.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		960,775,958.68	587,645,988.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		960,775,958.68	587,645,988.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华日增利货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	29,947,660,176.13	-	29,947,660,176.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	960,775,958.68	960,775,958.68
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）	20,050,090,824.74	-	20,050,090,824.74
其中：1. 基金申购款	366,190,151,338.27	-	366,190,151,338.27
2. 基金赎回款	-346,140,060,513.53	-	-346,140,060,513.53
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）	-	-960,775,958.68	-960,775,958.68
五、期末所有者权益（基金净值）	49,997,751,000.87	-	49,997,751,000.87
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华日增利货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金，期限一年以内(含一年)的银行存款、同业存单，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，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。本基金的业绩比较基准为：税后同期七天通知存款利率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安大华日增利货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表

中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。(2) 本基金收益分配方式约定为红利再投资，不收取再投资费用。(3) “每日分配、按月支付”。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，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益。(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除。(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的分配权益。(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其

配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	503,533,148.83	104,814,238.94
定期存款	21,730,000,000.00	10,715,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	12,500,000,000.00	800,000,000.00
存款期限三个月以上	8,630,000,000.00	9,415,000,000.00
存款期限 1 个月内	600,000,000.00	500,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	22,233,533,148.83	10,819,814,238.94

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	16,709,960,304.36	16,676,871,405.04	-33,088,899.32	-0.0662%
	合计	16,709,960,304.36	16,676,871,405.04	-33,088,899.32	-0.0662%
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市	13,997,719,765.63	14,055,277,000.00	57,557,234.37	0.1922%

	场				
	合计	13,997,719,765.63	14,055,277,000.00	57,557,234.37	0.1922%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	10,316,194,874.30	-
合计	10,316,194,874.30	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	4,322,750,330.45	-
合计	4,322,750,330.45	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,045,657.04	75,500.24
应收定期存款利息	56,691,958.06	74,331,256.82
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	3,807.30
应收债券利息	72,431,713.67	134,944,641.81
应收买入返售证券利息	13,356,952.32	2,742,570.90
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-

其他	-	-
合计	143,526,281.09	212,097,777.07

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	184,530.47	111,314.46
合计	184,530.47	111,314.46

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	1.78
预提费用	262,000.00	392,000.00
应付管理人款	26,979,405.04	-
合计	27,241,405.04	392,001.78

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	29,947,660,176.13	29,947,660,176.13
本期申购	366,190,151,338.27	366,190,151,338.27
本期赎回(以“-”号填列)	-346,140,060,513.53	-346,140,060,513.53
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	49,997,751,000.87	49,997,751,000.87

注： 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	960,775,958.68	-	960,775,958.68
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	-960,775,958.68	-	-960,775,958.68
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	2,083,608.86	2,453,320.56
定期存款利息收入	511,774,270.54	300,222,500.99
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	13,494.28	131,973.07
其他	1,631,527.79	1,062,547.37
合计	515,502,901.47	303,870,341.99

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金于本期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,700,119.21	8,772,021.06
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	5,700,119.21	8,772,021.06

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	55,214,250,177.63	12,571,662,827.63
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	55,016,196,074.70	12,279,594,334.87
减：应收利息总额	192,353,983.72	283,296,471.70
买卖债券差价收入	5,700,119.21	8,772,021.06

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末及上年度末均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末及上年度末均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出资产支持证券成交总额	554,460,584.21	-
减：卖出资产支持证券成本总额	550,366,600.00	-
减：应收利息总额	4,074,384.21	-
资产支持证券投资收益	19,600.00	-

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益/损失。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益/损失。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资产生的股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无公允价值变动损益。

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
交易所市场交易费用	161.47	-
银行间市场交易费用	730.25	-
合计	891.72	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年
----	----------------------	----------------------------

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
审计费用	153,000.00	153,000.00
信息披露费	400,000.00	230,000.00
账户维护费	36,800.00	36,200.00
其他	10,600.00	194.10
合计	600,400.00	419,394.10

7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 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，为投资人每日计算当日收益并分配，按月支付。

2. 财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理有限公司(“平安大华”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东

大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司 （“平安大华汇通”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”）	基金管理人的最终控股母公司
深圳平安综合金融服务有限公司（“平安综合金融”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安金融科技咨询有限公司（“平安金融科技”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安国际融资租赁有限公司（“平安国际租赁”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳万里通网络信息技术有限公司（“万里通”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安不动产有限公司（“平安不动产”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安人寿保险股份有限公司（“中国平安人寿”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	125,239,491.88	54,070,755.80
其中：支付销售机构的客户维护费	2,317,451.17	2,694,023.53

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,361,089.02	13,108,062.01

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 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 × 0.08% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
平安证券	24,743.50
平安银行	3,096,545.24
平安大华	87,462,201.01
合计	90,583,489.75
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
平安证券	89,337.09
平安银行	3,540,527.53
平安大华	33,128,510.07
合计	36,758,374.69

注：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，按月支付给平安大华，再由平安大华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。

7.4.10.3 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

本期 2016年1月1日至2016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
平安证券	4,447,218,120.90	4,445,218,714.19	-	-	-	-
上年度可比期间 2015年1月1日至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
平安证券	-	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
基金合同生效日（2013年12月3日）持有的基金份额	0.00	-
期初持有的基金份额	60,758,102.11	449,246.98
期间申购/买入总份额	2,000,000.00	60,000,000.00
期间因拆分变动份额	1,442,965.92	758,102.11
减：期间赎回/卖出总份额	64,201,068.03	449,246.98
期末持有的基金份额	0.00	60,758,102.11
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.2029%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转出份额。

2. 基金管理人平安大华基金管理有限公司在本年度申购/赎回本基金的交易委托平安大华基金管理有限公司直销柜台办理，适用费率为0%。

7.4.10.4.2 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 2016年12月31日		上年度末 2015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
深圳平安金融科技咨询有限公司	1,874,192,776.17	3.7500%	-	-
平安国际融资租赁有限公司	101,459,446.15	0.2000%	-	-
平安不动产有限公司	704,853,735.93	1.4100%	-	-
深圳平安综合金融服务有限公司	532,030,686.70	1.0600%	-	-
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	301,641,416.37	0.6000%	-	-
深圳万里通网络信息技术有限公司	1,408,793,339.73	2.8200%	-	-
中国平安保险（集团）股份有限公司	-	-	879,041,122.03	2.9400%

7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
平安银行-活期	503,533,148.83	2,083,608.86	104,814,238.94	2,453,320.56
平安银行-定期	920,000,000.00	29,479,902.79	450,000,000.00	32,907,318.15
合计	1,423,533,148.83	31,563,511.65	554,814,238.94	35,360,638.71

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息，定期存款按协议利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
平安证券	116323	万科 1A1	私募	1,300,000	130,000,000.00

平安证券	116384	万科 2A1	私募	1,200,000	120,000,000.00
平安证券	116418	万科 3A1	私募	1,000,000	100,000,000.00
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：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
958,368,622.21	-	2,407,336.47	960,775,958.68	-

注：本基金在本年度累计分配收益 960,775,958.68 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 956,249,059.19 元，无包含于赎回款的已分配未支付收益，计入应付收益科目 4,526,899.49 元。

7.4.12 (2016 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

-

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 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。本基金的活期银行存款和部分定期存款存放在本基金的托管行平安银行；其他定期存款存放在资信状况良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；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，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。

于本报告期末，本基金持有的资产支持证券余额为 589,000,000.00 元，均为长期信用评级 AAA 级(2015 年 12 月 31 日：550,349,310.34 元，均为长期信用评级 AAA 级)。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	959,303,322.50	1,540,320,117.56
A-1 以下	-	-
未评级	13,838,719,917.40	11,117,839,970.11
合计	14,798,023,239.90	12,658,160,087.67

注：以上按短期信用评级的债券投资未评级债券为国债、政策性金融债、同业存单及超短期融资券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,911,937,064.46	1,339,559,677.96
合计	1,911,937,064.46	1,339,559,677.96

注：以上按长期信用评级的债券投资未评级债券为政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

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，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模式带来的流动性风险，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主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过资产净值的 20%。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,623,533,148.83	15,510,000,000.00	2,100,000,000.00	-	-	-	-22,233,533,148.83
交易性金融资产	1,386,175,951.73	4,242,696,359.11	11,670,087,993.52	-	-	-	-17,298,960,304.36
买入返售金融资产	10,316,194,874.30	-	-	-	-	-	-10,316,194,874.30
应收利息	-	-	-	-	-	-143,526,281.09	143,526,281.09
应收申购款	-	-	-	-	-	-59,940,895.77	59,940,895.77
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,325,903,974.86	19,752,696,359.11	13,770,087,993.52	-	-	-203,467,176.86	50,052,155,504.35
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-11,225,834.22	11,225,834.22
应付托管费	-	-	-	-	-	-2,721,414.37	2,721,414.37

应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,504,419.89	8,504,419.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	184,530.47	184,530.47
应付利润	-	-	-	-	-	4,526,899.49	4,526,899.49
其他负债	-	-	-	-	-	27,241,405.04	27,241,405.04
负债总计	-	-	-	-	-	54,404,503.48	54,404,503.48
利率敏感度缺口	16,325,903,974.86	19,752,696,359.11	13,770,087,993.52	-	-	-	-
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,369,814,238.94	4,050,000,000.00	3,400,000,000.00	-	-	-	-10,819,814,238.94
结算备付金	8,460,476.19	-	-	-	-	-	8,460,476.19
交易性金融资产	1,717,303,006.06	7,523,159,594.54	5,307,606,475.37	-	-	-	-14,548,069,075.97
买入返售金融资产	4,322,750,330.45	-	-	-	-	-	-4,322,750,330.45
应收利息	-	-	-	-	-	-212,097,777.07	212,097,777.07
应收申购款	-	-	-	-	-	53,977,154.19	53,977,154.19
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	9,418,328,051.64	11,573,159,594.54	8,707,606,475.37	-	-	-266,074,931.26	29,965,169,052.81
负债							
应付赎回款						148.73	148.73
应付管理人报酬						7,442,924.33	7,442,924.33
应付托管费						1,804,345.30	1,804,345.30
应付销售服务费						5,638,579.06	5,638,579.06
应付交易费用						111,314.46	111,314.46
应付利润						2,119,563.02	2,119,563.02
其他负债						392,001.78	392,001.78
负债总计						17,508,876.68	17,508,876.68
利率敏感度缺口	9,418,328,051.64	11,573,159,594.54	8,707,606,475.37	-	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其它市场变量保持不变		
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（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	14,623,462.93	10,083,509.53
	市场利率上升 25 个基点	-14,502,803.07	-10,062,487.56

7.4.13.4.2 外汇风险

由于本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 16,709,960,304.36 元，属于第三层次的余额为 589,000,000.00 元，无属于第一层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 14,528,069,075.97 元，第三层次 20,000,000.00 元，无属于第一层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产
	——资产支持证券投资
2016 年 1 月 1 日	20,000,000.00
购买	589,000,000.00
兑付	-20,000,000.00
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2016 年 12 月 31 日	<u>589,000,000.00</u>
2016 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2016 年度损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	-

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

	交易性金融资产
	——资产支持证券投资
2015 年 1 月 1 日	-
购买	20,000,000.00
出售	-
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2015 年 12 月 31 日	<u>20,000,000.00</u>

于 2015 年 12 月 31 日仍持有的第三层次金融资产中无计入 2015 年度损益的利得。

第三层次资产为在交易所挂牌转让的资产支持证券。根据中国证券投资基金业协会发布的《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》，本基金管理人认为上述资产支持证券的成本能够近似体现公允价值，因此上述资产支持证券公允价值根据成本确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	17,298,960,304.36	34.56
	其中：债券	16,709,960,304.36	33.39
	资产支持证券	589,000,000.00	1.18
2	买入返售金融资产	10,316,194,874.30	20.61
	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	22,233,533,148.83	44.42
4	其他各项资产	203,467,176.86	0.41
5	合计	50,052,155,504.35	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)
----	----	----------------

1	报告期内债券回购融资余额	1.59	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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日融资余额占基金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

本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	73
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	42

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。

8.3.2 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	32.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.91	-
2	30 天(含)—60 天	19.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.40	-
3	60 天(含)—90 天	21.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.84	-
4	90 天(含)—120 天	3.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	23.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	99.70	-
----	-------	---

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,061,916,375.46	4.12
	其中：政策性金融债	2,061,916,375.46	4.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	6,186,900,920.95	12.37
6	中期票据	-	-
7	同业存单	8,461,143,007.95	16.92
8	其他	-	-
9	合计	16,709,960,304.36	33.42
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	1,572,295,599.46	3.14

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111694153	16 贵州银行 CD010	8,500,000	838,161,032.11	1.68
2	111694110	16 福建海峡银行 CD025	8,000,000	789,012,260.14	1.58
3	111680301	16 广东南粤银行 CD113	5,000,000	497,814,445.61	1.00
4	111693534	16 包商银行 CD025	5,000,000	493,976,728.00	0.99
5	111693605	16 西安银行 CD017	5,000,000	493,779,211.86	0.99
6	111619193	16 恒丰银行 CD193	5,000,000	493,463,697.88	0.99
7	111695017	16 广东顺德农商行 CD051	4,500,000	449,847,357.08	0.90
8	111694205	16 中德住房	4,500,000	447,410,451.19	0.89

		储蓄银行 CD010			
9	111680922	16 西安银行 CD058	3,500,000	348,085,465.70	0.70
10	130234	13 国开 34	3,300,000	329,218,931.68	0.66

8.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.2247%
报告期内偏离度的最低值	-0.2490%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0785%

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%。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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	116323	万科 1A1	1,300,000	130,000,000.00	0.26
2	116384	万科 2A1	1,200,000	120,000,000.00	0.24
3	142274	花呗 10A1	1,100,000	110,000,000.00	0.22
4	116418	万科 3A1	1,000,000	100,000,000.00	0.20
5	131801	花呗 01A1	500,000	50,000,000.00	0.10
6	142047	花呗 04A1	400,000	40,000,000.00	0.08
7	142007	花呗 03A1	390,000	39,000,000.00	0.08

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

本基金目前投资工具的估值方法如下：

(1) 基金持有的债券（包括票据）购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入，每日计提收益；

(2) 基金持有的回购以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；合同利率与

实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；

(3) 基金持有的银行存款以成本列示，按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

8.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	143,526,281.09
4	应收申购款	59,940,895.77
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	203,467,176.86

8.9.4 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
8,591,346	5,819.55	19,755,495,215.35	39.51%	30,242,255,785.52	60.49%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	5,173,888.19	0.0103%

9.3 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的情况

项目	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年12月3日）基金份额总额	525,531,640.49
本报告期期初基金份额总额	29,947,660,176.13
本报告期基金总申购份额	366,190,151,338.27
减：本报告期基金总赎回份额	346,140,060,513.53
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	49,997,751,000.87

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

1、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十三次会议审议通过，由陈特正先生接替肖宇鹏先生任职公司督察长职务，任职日期为2016年1月21日，该事项已于2016年1月22日公告。

2、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十六次会议审议通过，由肖宇鹏先生接替罗春风先生任职公司总经理职务，任职日期为2016年1月22日，该事项已于2016年1月23日

公告。

3、经平安大华基金管理有限公司 2016 年第三次股东大会审议通过《关于更换第二届董事会会议的议案》，同意由叶杨诗明女士代替王世荣先生出任董事。

4、2016 年 12 月，谢永林先生担任平安银行股份有限公司董事、董事长。上述人事变动已按规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 3 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 153,000.00 元。

11.6 管理人、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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国信证券	2	-	-	-	-	-

1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

3、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

11.7.2 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	
	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
国信证券	10,098,000.00	100.00%	1,200,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 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	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金在指数熔断期间调整开放时间的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 1 月 4 日
2	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金在指数熔断期间调整开放时间的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 1 月 7 日
3	平安大华日增利货币市场基金招募说明书（更新）2015 年第 2 期	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 1 月 15 日
4	平安大华日增利货币市场基金招募说明书（更新）摘要 2015 年第 2 期	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 1 月 15 日
5	平安大华日增利货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 1 月 21 日
6	平安大华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 1 月 22 日
7	平安大华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 1 月 23 日
8	关于旗下部分基金新增北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 3 月 4 日
9	关于旗下部分基金新增奕丰金融为销售机构及开通转换和定	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基	2016 年 3 月 11 日

	投业务并参与其费率优惠的公告	金管理人官网	
10	关于旗下部分基金新增中经北证（北京）资产管理有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 3 月 25 日
11	平安大华日增利货币市场基金 2015 年年度报告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 3 月 30 日
12	平安大华日增利货币市场基金 2015 年年度报告 摘要	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 3 月 30 日
13	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大证券为销售机构的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 3 月 31 日
14	关于旗下部分基金新增南粤银行为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 4 月 6 日
15	关于旗下部分基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 4 月 15 日
16	平安大华日增利货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 4 月 20 日
17	关于旗下部分基金新增深圳市华融金融服务有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 4 月 22 日
18	关于旗下部分基金新增华融湘江银行为销售机构及开通定投业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 4 月 27 日
19	关于旗下部分基金新增上海中正达广投资管理有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 4 月 28 日
20	关于旗下部分基金新增北京微动利投资管理有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016 年 5 月 27 日
21	关于旗下部分基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为销	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基	2016 年 6 月 6 日

	售机构的公告	金管理人官网	
22	关于旗下部分基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年6月15日
23	关于旗下部分基金新增东北证券为销售机构及开通定投与转换业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年6月17日
24	关于旗下部分基金新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年6月22日
25	平安大华基金管理有限公司2016年6月30日基金净值公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年6月30日
26	关于旗下部分基金新增深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年7月6日
27	关于旗下部分基金新增泰诚财富基金销售(大连)有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年7月12日
28	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券为销售机构及开通定投业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年7月12日
29	关于旗下部分基金新增乾道金融信息服务(北京)有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年7月15日
30	平安大华日增利货币市场基金招募说明书(更新)摘要2016年第1期	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年7月16日
31	平安大华日增利货币市场基金招募说明书(更新)2016年第1期	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年7月16日
32	平安大华基金管理有限公司关于网上直销客户发起日增利货币基金份额赎回转认/申购及定投基金业务实行一折费率优惠	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年7月19日

	活动的公告		
33	关于旗下部分基金新增西南证券为销售机构及开通定投与转换业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年7月20日
34	平安大华日增利货币市场基金2016年第2季度报告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年7月21日
35	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年7月27日
36	关于旗下部分基金新增京西票号为销售机构及开通定投与转换业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年8月1日
37	关于旗下部分基金新增首创证券为销售机构及开通定投与转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年8月8日
38	关于修改平安大华日增利货币市场基金基金合同和托管协议的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年8月12日
39	平安大华日增利货币市场基金基金合同	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年8月12日
40	平安大华日增利货币市场基金托管协议	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年8月12日
41	关于旗下部分基金新增大同证券为销售机构及开通转换和定投业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年8月24日
42	关于旗下部分基金新增德邦证券为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年8月26日
43	关于旗下部分基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司有限公司为销售机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年8月29日
44	关于旗下部分基金新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金管理人官网	2016年8月29日
45	平安大华日增利货币市场基金	证券时报、证券日报、上海	2016年8月29日

	2016 年半年度报告	证券报、中国证券报及本基金经理人官网	
46	平安大华日增利货币市场基金 2016 年半年度报告 摘要	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 8 月 29 日
47	关于旗下部分基金新增渤海证券为销售机构及开通转换业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 8 月 29 日
48	关于旗下部分基金新增小牛投资咨询公司为销售机构及开通转换业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 8 月 29 日
49	关于旗下部分基金新增华泰证券为销售机构及开通转换和定投业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 8 月 31 日
50	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 9 月 2 日
51	关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 9 月 5 日
52	关于旗下部分基金新增北京格上富信投资顾问有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 9 月 7 日
53	关于旗下部分基金新增武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构及开通转换业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 9 月 9 日
54	关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构及开通转换业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 9 月 21 日
55	关于旗下部分基金新增北京汇成基金销售有限公司为销售机构及开通转换业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 9 月 27 日
56	平安大华日增利货币市场基金 2016 年第 3 季度报告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 10 月 25 日
57	关于平安大华日增利货币市场基金恢复大额申购业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 10 月 28 日
58	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 11 月 4 日
59	关于开展通联支付费率优惠基	证券时报、证券日报、上海	2016 年 11 月 8 日

	金理财平台交易公告	证券报、中国证券报及本基金经理人官网	
60	关于旗下部分基金新增基煜基金为销售机构及开通转换业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 11 月 9 日
61	关于旗下部分基金新增云湾投资为销售机构的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 11 月 11 日
62	关于旗下部分基金新增华信证券为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 11 月 30 日
63	关于旗下部分基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司有限公司开通定投业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 12 月 1 日
64	关于旗下部分基金新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为销售机构及开通定投业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 12 月 6 日
65	关于旗下部分基金新增国美基金为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 12 月 13 日
66	平安大华基金管理有限公司开通快付通支付-快付通基金网上交易业务的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 12 月 14 日
67	关于旗下部分基金新增北京懒猫金融信息服务有限公司为销售机构的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 12 月 26 日
68	关于旗下部分基金新增鑫鼎盛控股为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 12 月 26 日
69	平安大华基金管理有限公司 2016 年 12 月 31 日基金净值公告	证券时报、证券日报、上海证券报、中国证券报及本基金经理人官网	2016 年 12 月 31 日

§ 12 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，自公告之日起正式生效。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华日增利货币市场基金的文件；
- 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、平安大华日增利货币市场基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安大华基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内平安大华日增利货币市场基金公告的各项原稿。

13.2 存放地点

深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>

平安大华基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日