

平安大华金管家货币市场基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 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

送出日期：2017 年 8 月 28 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。本半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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华金管家货币
场内简称	-
基金主代码	003465
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	2016 年 12 月 7 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	2, 833, 331, 066. 05 份
基金合同存续期	-
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

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	本基金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及平均剩余存续期。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	本基金的业绩比较基准为：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	方琦
	联系电话	0755-22626828	0755-22160168
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fangqi275@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	37,604,277.24
本期利润	37,604,277.24
本期净值收益率	1.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	2,833,331,066.05
期末基金份额净值	1.0000

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

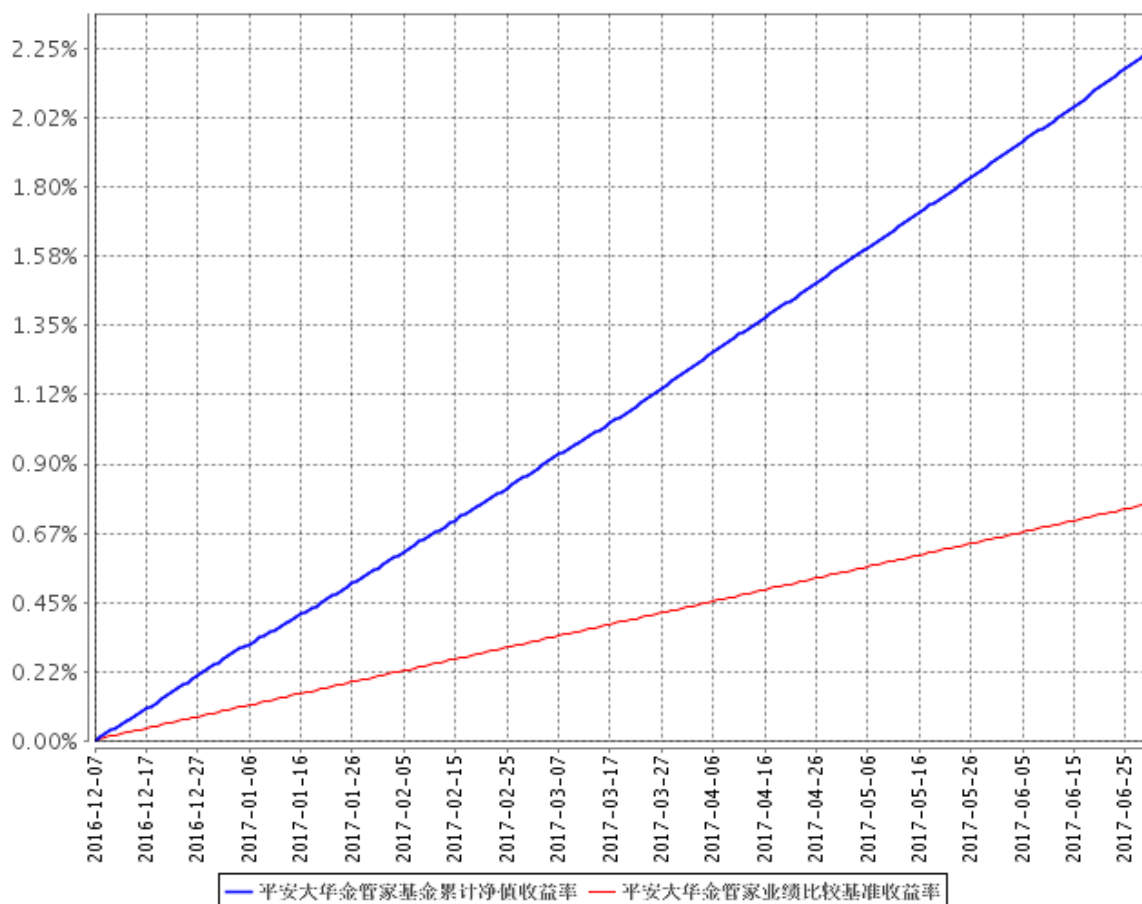
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.35%	0.00%	0.11%	0.00%	0.24%	0.00%
过去三个月	1.04%	0.00%	0.34%	0.00%	0.70%	0.00%
过去六个月	1.99%	0.00%	0.68%	0.00%	1.31%	0.00%
自基金合同 生效起至今	2.25%	0.00%	0.77%	0.00%	1.48%	0.00%

业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。本基金为货币市场型基金，主要投资于各类固定收益类金融工具，强调基金资产的稳定增值，以同期七天通知存款利率（税后）作为业绩比较基准，符合本基金的风险收益特征，能比较贴切体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

平安大华金管家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 2016 年 12 月 07 日正式生效，截至报告期末未满一年；
- 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，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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“平安大华”）经中国证监会证监许可

【2010】1917 号文批准设立。平安大华总部位于深圳，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，持有股份 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股份 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份 14.3%。

平安大华秉承“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。截至到 2017 年二季度末，公司旗下共有 39 只公募基金，公募基金管理规模突破 1200 亿元人民币。

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		
申俊华	平安大华金管家货币市场基金基金经理	2016 年 12 月 7 日	-	8 年	申俊华女士，湖南大学金融学博士，8 年证券基金从业经验，曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员。2012 年加入平安大华基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员。现担任平安大华财富宝货币市场基金、平安大华交易型货币市场基金、平安大华惠享纯债债券型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、平安大华金管家货币市场基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、平安大华惠元纯债债券型证券投资基金基金经理。
段玮婧	平安大华金管家货币市场基金基金经理	2017 年 1 月 5 日	-	10 年	段玮婧女士，中山大学硕士，10 年证券基金从业经验，曾担任中国中投证券有限责任公司投资经理。2016 年 9 月加入平安大华基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益组投资经理。2017 年 1 月起担任平安大华交易型货币市场基金、平安大华金管家货币市场基金基金经理。

1、此处的“任职日期”和“离任日期”均指公司作出决定后正式对外公告之日。

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》、《公开募集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、《平安大华金管家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。

4.3.2 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 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

2017 年上半年，债券市场先震荡后调整，收益率整体上行。年初市场延续去杠杆的态势，期间美联储意外加息，央行连续上调公开市场操作、SLF、MLF 等政策利率，四月份监管趋严直接导致了市场下跌，直到六月初，央行出手呵护资金面，超量续作 MLF，市场情绪有所好转，宽松局面维持至季末。

货币政策方面，当前央行通过公开市场操作工具与创新型货币市场工具的灵活搭配调节市场流动性，逆回购以 7 天操作为主，MLF 操作以 1 年期为主。临近半年末为呵护资金面，重启

28 天逆回购稳定市场情绪，减小季末考核带来的资金波动。

报告期内，本基金密切跟踪货币市场各类资产价格的变动，把握了重要时点的投资机会，管理好流动性的同时，为投资者获取了较好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 1.99%，业绩比较基准收益率为 0.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，“稳健中性”依旧是主基调，但央行会维持市场流动性处于“不松不紧”的一个状态。金融监管由严厉转向多部门协调，改善了市场预期，有利于市场的平稳。本基金认为，流动性相对宽松一定程度上增加了投资的难度，本基金的投资操作仍以加强流动性管理为主要原则，在有效控制负偏离度的前提下，适当增加债券比例的投资、同时通过优选存款交易对手，提升协议存款的收益，适时增加久期、提高货币基金长期收益。

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、运营部及法律合规监察部相关人员组成。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、程序及方法的科学性合理性，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。

4.7 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 37,604,277.24 元，实际分配收益 37,604,277.24 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 万人民币的情形。

§ 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”）在对平安大华金管家货币市场基金（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，对本基金管理人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的复核，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安大华金管家货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		1,601,281,160.78	786,288,157.15
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		831,955,208.06	139,067,306.90
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		826,699,637.41	139,067,306.90
资产支持证券投资		5,255,570.65	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		479,651,859.49	561,642,747.46
应收证券清算款		-	-
应收利息		10,628,630.00	3,516,541.17
应收股利		-	-
应收申购款		155,046.26	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,923,671,904.59	1,490,514,752.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		89,199,546.20	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		396,890.21	195,156.46
应付托管费		99,222.57	48,789.11
应付销售服务费		99,222.57	48,789.11
应付交易费用		18,871.16	1,547.46
应交税费		-	-

应付利息		21,050.20	-
应付利润		348,765.86	166,823.57
递延所得税负债		-	-
其他负债		157,269.77	-
负债合计		90,340,838.54	461,105.71
所有者权益：			
实收基金		2,833,331,066.05	1,490,053,646.97
未分配利润		-	-
所有者权益合计		2,833,331,066.05	1,490,053,646.97
负债和所有者权益总计		2,923,671,904.59	1,490,514,752.68

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 2,833,331,066.05 份。

6.2 利润表

会计主体：平安大华金管家货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		41,142,968.50	-
1.利息收入		41,142,968.50	-
其中：存款利息收入		24,246,592.28	-
债券利息收入		11,176,759.88	-
资产支持证券利息收入		172,625.57	-
买入返售金融资产收入		5,546,990.77	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-

减：二、费用		3,538,691.26	-
1. 管理人报酬		1,870,726.16	-
2. 托管费		467,681.60	-
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	467,681.60	-
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		566,032.13	-
其中：卖出回购金融资产支出		566,032.13	-
6. 其他费用		166,569.77	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,604,277.24	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,604,277.24	-

注：本基金于 2016 年 12 月 7 日成立，故无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华金管家货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	1,490,053,646.97	-	1,490,053,646.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	37,604,277.24	37,604,277.24
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）	1,343,277,419.08	-	1,343,277,419.08
其中：1.基金申购款	6,060,429,915.96	-	6,060,429,915.96
2.基金赎回款	-4,717,152,496.88	-	-4,717,152,496.88
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）	-	-37,604,277.24	-37,604,277.24
五、期末所有者权益（基金净值）	2,833,331,066.05	-	2,833,331,066.05

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	-	-	-

本基金于 2016 年 12 月 7 日成立，故无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗春风	_____ 林婉文	_____ 胡明
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安大华金管家货币市场基金(以下简称“本基金”)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[2016]2152号《关于核准平安大华金管家货币市场基金募集的批复》核准，由平安大华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华金管家货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,486,372,865.79 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1598 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华金管家货币市场基金基金合同》于 2016 年 12 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份

额总额为 1,486,415,142.41 份基金份额，其中认购资金利息折合 42,276.62 份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华金管家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：同期七天通知存款利率（税后）。

6.4.2 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》、《平安大华金管家货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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(“平安信托”)	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	基金管理人的子公司
平安证券有限责任公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司

平安人寿保险股份有限公司	与基金管理人受同一最终控制公司控制的公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期末未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期末无通过关联方进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末无应支付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,870,726.16	-
其中：支付销售机构的客户维护费	10,114.54	-

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人管理费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

日管理人管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	467,681.60	-

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 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
平安大华基金管理有限公司	458,685.02
平安银行股份有限公司	804.24
中国平安人寿保险股份有限公司	2,223.62
合计	461,712.88
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

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 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
基金合同生效日（ 2016年12月7日）持有的 基金份额	-	-
期初持有的基金份额	60,142,542.14	-
期间申购/买入总份额	1,201,342.40	-

期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	61,343,884.54	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.1700%	-

6.4.8.4.2 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

本基金于本期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年6月 30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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-定期存款	150,000,000.00	654,194.44	-
平安银行-活期存款	20,281,160.78	184,183.26		

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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流通受限证券。

6.4.9.2 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股票。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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 89,199,546.20 元，是以如下债券作为抵押：

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
------	------	-------	--------	-------	--------

011755014	17 镇城投 SCP002	2017 年 7 月 6 日	100.15	400,000	40,060,000.00
011755024	17 粤广业 SCP001	2017 年 7 月 6 日	100.16	20,000	2,003,200.00
111793255	17 中原银 行 CD046	2017 年 7 月 6 日	99.18	500,000	49,590,000.00
合计				920,000	91,653,200.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.10.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.10.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 8 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	831,955,208.06	28.46
	其中: 债券	826,699,637.41	28.28
	资产支持证券	5,255,570.65	0.18
2	买入返售金融资产	479,651,859.49	16.41
	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	1,601,281,160.78	54.77
4	其他各项资产	10,783,676.26	0.37
5	合计	2,923,671,904.59	100.00

7.2 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	1.89	
	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	89,199,546.20	3.15
	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

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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.2 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	18.54	3.15
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	17.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	33.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	32.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	102.81	3.15

7.4 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。

7.5 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	129,986,043.85	4.59
	其中：政策性金融债	129,986,043.85	4.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	349,808,824.70	12.35
6	中期票据	-	-
7	同业存单	346,904,768.86	12.24
8	其他	-	-
9	合计	826,699,637.41	29.18
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	111793227	17 郑州银行 CD039	500,000	49,578,431.01	1.75
1	111793255	17 中原银行 CD046	500,000	49,578,431.01	1.75
2	111793647	17 长沙银行 CD027	500,000	49,546,043.97	1.75
3	011755014	17 镇城投 SCP002	400,000	39,991,035.72	1.41
4	170203	17 国开 03	400,000	39,973,692.08	1.41
5	140220	14 国开 20	300,000	30,051,081.94	1.06
6	011761011	17 三安 SCP001	300,000	29,992,303.38	1.06
7	011762033	17 大北农 SCP001	300,000	29,985,938.48	1.06
8	111797883	17 重庆农村商业银行 CD111	300,000	29,820,150.92	1.05
9	111798052	17 九江银行 CD095	300,000	29,809,254.46	1.05
10	111792491	17 广州农村商业银行 CD022	300,000	29,800,963.94	1.05

7.7 “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	0.03%
报告期内偏离度的最低值	-0.05%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.01%

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%。

7.8 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

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	1789035	17 湘元 1A1(总价)	200,000	5,255,570.65	0.19

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

7.9.2

基金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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 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	10,628,630.00
4	应收申购款	155,046.26
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	10,783,676.26

7.9.4 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
68,533	41,342.58	1,048,421,732.23	37.00%	1,784,909,333.82	63.00%

8.2 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	0.00	0.0000%

8.3 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年12月7日）基金份额总额	1,486,415,142.41
本报告期期初基金份额总额	1,490,053,646.97
本报告期基金总申购份额	6,060,429,915.96
减：本报告期基金总赎回份额	4,717,152,496.88

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	2,833,331,066.05

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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三十八次会议审议通过，由付强先生任职公司副总经理，任职日期为 2017 年 1 月 20 日。

2、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由李兆良先生、李娟娟女士、刘雪生先生、潘汉腾先生接替曹勇先生、刘茂山先生、郑学定先生、黄士林先生任职公司第三届董事会董事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

3、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由巢傲文先生、李峥女士接替张云平、毛晴峰先生为第三届监事会监事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
平安证券	2	-	-	-	-	新增
银河证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	新增
东北证券	1	-	-	-	-	新增
兴业证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	新增
英大证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-

安信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

1、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

2、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。

10.7.2 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
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

本基金租用的证券公司交易单元本期无其他证券投资。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内本基金偏离度绝对值未出现超过 0.5%的情况。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170112-20170419	200,475,140.44	308,447,844.94	508,922,985.38	0.00	0.00
	2	20170421-20170426	200,475,140.44	308,447,844.94	508,922,985.38	0.00	0.00
	3	20170525-20170531	200,475,140.44	308,447,844.94	508,922,985.38	0.00	0.00
产品特有风险							
流动性风险							

平安大华基金管理有限公司
2017 年 8 月 28 日