

太平日日金货币市场基金
2017 年半年度报告
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十八日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§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遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	38
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.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	41
7.8 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.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	42
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43

10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息	45
§12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平日日金货币市场基金	
基金简称	太平日日金货币	
基金主代码	003398	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 4 日	
基金管理人	太平基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,111,585,521.52 份	
下属分级基金的基金简称	太平日日金 A	太平日日金 B
下属分级基金的交易代码	003398	003399
报告期末下属分级基金的份额总额	52,683,105.46 份	11,058,902,416.06 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求保持基金资产安全性和高流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对短期金融工具的积极投资管理，在有效控制投资风险和保持流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：人民币七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益和预期风险水平低于债券型、混合型和股票型基金，属于预期收益和预期风险偏低的基金品种。

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		太平基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈吟绮	张志永
	联系电话	021-38556782	021-62677777-212004
	电子邮箱	disclosure@taipingfund.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn

客户服务电话	021-38874600	95561
传真	021-38556677	021-62159217
注册地址	上海市虹口区邯郸路135号5幢101室	福州市湖东路154号
办公地址	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室	上海江宁路168号兴业大厦20楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	汤海涛	高建平

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	太平基金管理有限公司	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

§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日至2017年6月30日）	
	太平日日金 A	太平日日金 B
本期已实现收益	247,178.37	117,491,766.92
本期利润	247,178.37	117,491,766.92
本期净值收益率	1.6886%	1.8139%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	

	太平日日金 A	太平日日金 B
期末基金资产净值	52,683,105.46	11,058,902,416.06
期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	太平日日金 A	太平日日金 B
累计净值收益率	2.1029%	2.2674%

注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 4 日，至本报告期末不满一年。

2、本基金收益分配是按日结转份额。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）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收益，由于货币市场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。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

1. 太平日日金 A:

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	0.2989%	0.0038%	0.1110%	0.0000%	0.1879%	0.0038%
过去三个月	0.9062%	0.0023%	0.3366%	0.0000%	0.5696%	0.0023%
过去六个月	1.6886%	0.0020%	0.6695%	0.0000%	1.0191%	0.0020%
自基金合同生效起至今	2.1029%	0.0023%	0.8840%	0.0000%	1.2189%	0.0023%

注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 4 日，至本报告期末不满一年。

2、本基金的收益分配是按日结转份额。

2. 太平日日金 B:

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	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去一个月	0.3178%	0.0038%	0.1110%	0.0000%	0.2068%	0.0038%
过去三个月	0.9675%	0.0023%	0.3366%	0.0000%	0.6309%	0.0023%
过去六个月	1.8139%	0.0019%	0.6695%	0.0000%	1.1444%	0.0019%
自基金合同生效起至今	2.2674%	0.0022%	0.8840%	0.0000%	1.3834%	0.0022%

注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 4 日，至本报告期末不满一年。

2、本基金的收益分配是按日结转份额。

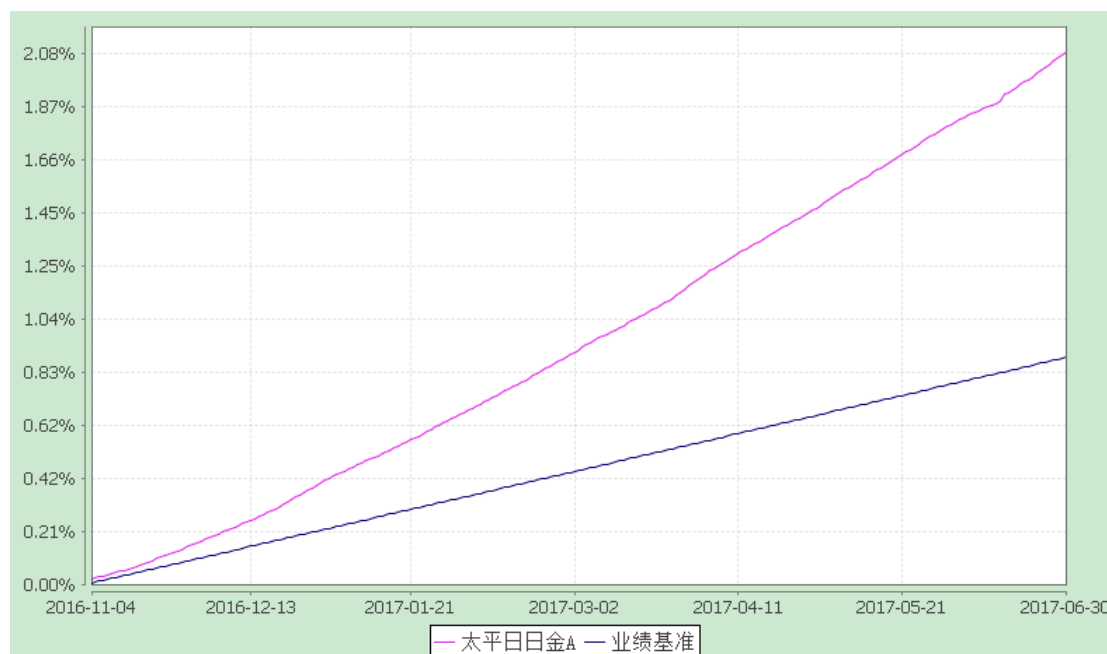
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

太平日日金货币市场基金

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

(2016 年 11 月 4 日至 2017 年 6 月 30 日)

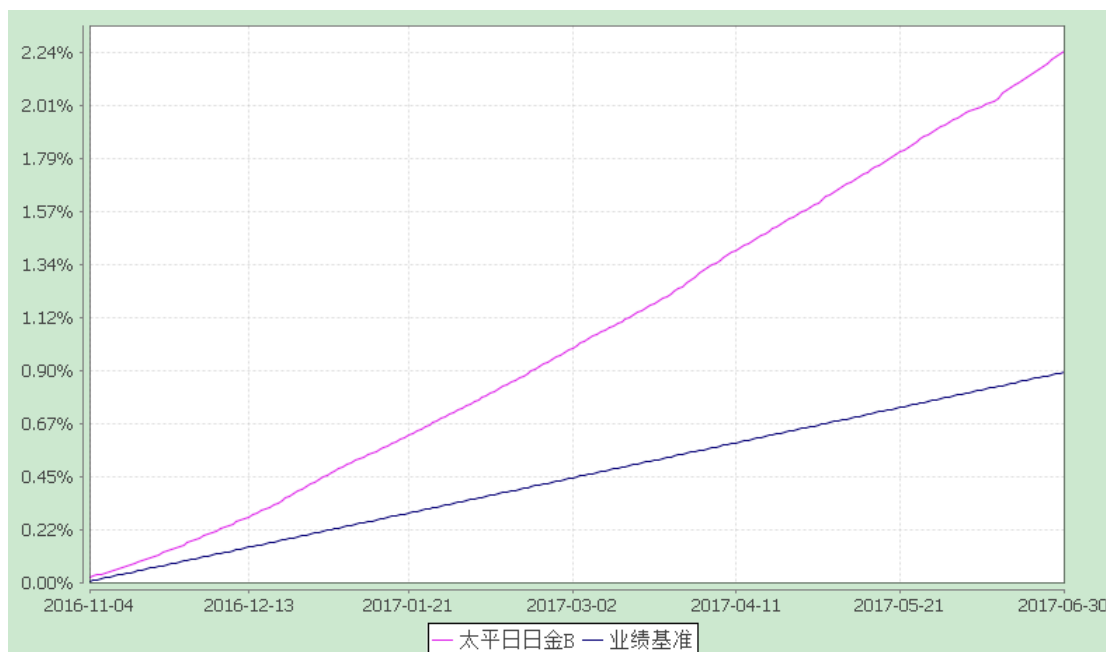
1、太平日日金 A



注：1、本基金合同于 2016 年 11 月 4 日生效，至报告期末不满一年；

2、按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

2、太平日日金 B



注：1、本基金合同于2016年11月4日生效，至报告期末不满一年；
 2、按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，建仓期结束时本基金的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

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立。目前公司注册资本为人民币 2.27 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 70.04%，中原证券股份有限公司的出资占注册资本的 14.98%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 14.98%。

目前公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等，在投资管理、策略设计、产品设计、客户服务等方面配置了专业团队及集中了优势资源，力求为客户创造长期持续稳健的回报。截至本报告期末，公司共管理 3 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
翁锡赞	本基金	2016-11-04	-	12	复旦大学金融学硕士，具

	的基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理、固定收益部总监				有证券投资基金从业资格。2004 年 1 月起曾在兴业基金管理有限公司（现兴业全球基金管理有限公司）任首席交易员和债券研究员，万家基金管理有限公司任基金经理助理，国泰基金管理有限公司任国泰货币市场证券投资基金基金经理（任职期间：2008 年 8 月 23 日至 2011 年 6 月 15 日）、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金经理（任职期间：2010 年 6 月 10 日至 2011 年 6 月 15 日）、社保 409、709 组合投资经理，东吴证券股份有限公司任债券投资部副总经理，国泰君安（香港）有限公司任国泰君安巨龙中国固定收益基金（RQFII）基金经理（任职期间：2012 年 3 月 9 日至 2013 年 11 月 22 日）、高级副总裁，在本公司任中原英石货币市场基金基金经理（任职期间：2014 年 9 月 11 日至 2015 年 10 月 21 日该基金合同已终止），太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理（任职期间：2016 年 3 月 8 日至 2017 年 5 月 9 日）。2016 年 11 月 4 日起担任太平日日金货币市场基金基金经理，2017 年 3 月 15 日起担任太平日日鑫货币市场基金基金经理。中国国籍。
吴素涵	本基金的基金经理、太平日日	2017-06-21	-	3	韩国淑明女子大学学士，具有证券投资基金从业资格。2014 年 6 月起曾任汇丰晋信基金管理有

	鑫货币 市场基 金基金 经理				限公司固定收益交易员。2016年6月加入本公司，现任基金经理。2017年6月21日起担任太平日日金货币市场基金基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理。中国国籍。
--	-------------------------	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------

注: 1、基金经理的任职日期和离职离任日期一般情况下指为公司对外公告之日；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

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有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，未发生违法违规或未履行基金合同的情形。

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》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本基金管理人管理的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超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2017 年上半年，在宏观经济较为平稳，长期来看经济“L”型走势的基本面展望

下，一季度和二季度 GDP 均为 6.9%，上半年经济增速稳健；在经历了春节期间 CPI 的波动后，CPI 同比从 2 月的 0.8% 缓步回升至 1.5%，PPI 则是从 2 月冲高回落至 5.5%，主要是由于国内农产品价格下滑导致的，上游原材料价格也在上半年有所回落；中采制造业 PMI 连续 11 个月保持在扩张区间，新订单分项在 6 月突破 53，在相对乐观的的经济增长的背景下，固定资产投资增速较 2016 年下半年也是延续了相对较稳定的态势；就进出口而言，中国的出口对全球经济的拉动作用更为明朗，2017 年上半年的进出口数据也是频频超出市场预期；社会消费品零售总额同比也在上半年出现了缓步的上升，消费结构的升级使得消费对经济的影响将更为显著。

就货币政策来看，上半年前 5 个月的货币政策实际上中性收紧，在 MPA 考核以及金融去杠杆环境下，1 月至 5 月的月度末均出现了不同程度的资金面紧张，短期资金利率显著上行，但自 6 月中旬之后市场对监管政策出台的预期有所回落，央行维稳的态度坚定，公开市场操作的净投放使市场平稳度过二季度末。

2017 上半年的债券市场维持震荡行情，一季度市场对基本面的看好和美国加息的海外环境综合作用下使得债市经历了几番调整，随着美国加息落地的利空已出，3 月中下旬的债券市场受乐观情绪带动，收益率曲线整体下行。进入二季度，市场对监管趋严的预期使得机构操作愈发谨慎，直到 6 月中旬央行并没有跟随美国加息的脚步而上调利率，前期的金融去杠杆取得一定成效使得监管的对外态度出现了缓和，以及在公开市场操作上体现出的央行对流动性的维稳态度使得长端收益率下行，短期债券品种信用债利差快速收窄，市场情绪有所好转。

结合相对稳定向好的经济基本面和对稳健中性的货币政策的分析，太平日日金货币市场基金采取了维持组合短久期、投资高评级券种、控制中等仓位债券投资的组合管理策略，把握稳健的流动性阶梯配置，以维护组合流动性为首要目标。在资金面出现收紧和短期收益率上行的市场环境中保持较低的债券仓位，在控制风险的前提下把握市场出现的交易行情，适当调整组合久期，投资资质优秀、具有高变现能力的债券、存单等投资品种，力争为基金份额持有人带来一定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平日日金 A 净值收益率为 1.6886%，同期业绩比较基准增长率为 0.6695%；太平日日金 B 净值收益率为 1.8139%，同期业绩比较基准增长率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年的中国经济从一季度以来表现稳健，投资和消费都呈现了稳步增长的态势，而进出口的表现则是超出市场预期。展望 2017 年的下半年，经济平稳运行的态势将持续，供给侧改革也将为我国经济健康发展继续提供动力。CPI 处于“1”区间仍将会是大概率事件，生产和生活资料的价格稳中有降。从投资方面而言，当前平稳的经济运行和向好的企业盈利状况为企业提供了适当宽松的投资环境；进出口方面的势头有望保持，但仍应警惕海外贸易保护主义对进出口形势的影响；处于消费升级的中国社会应更多关注

消费 GDP 的贡献。就货币政策而言，央行保持稳健态度不改，下半年较上半年易松难紧，但下半年的财政投放以及海外货币政策的摇摆都或将会成为货币政策方向的变数。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金估值定价与评估制度》和《太平基金管理有限公司基金会计业务管理制度》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员由营运总监负责，成员包括投资组合经理、行业研究员、风控人员、金融工程研究员及基金会计等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人，分红方式为红利再投资。本报告期内本基金以红利再投资方式进行收益分配，A 级分配收益：247,178.37 元，B 级分配收益 117,491,766.92 元，符合法律法规及《基金合同》的约定。

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

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警的情况。

§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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务

会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：太平日日金货币市场基金

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	6.4.7.1	4,401,689,492.05	7,941,546,436.72
结算备付金		-	29,781,818.18
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,525,296,117.65	993,125,425.67
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,525,296,117.65	993,125,425.67
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,165,602,142.29	4,381,038,820.64
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	16,002,711.40	36,026,572.62
应收股利		-	-
应收申购款		155,968,350.00	279,191,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,264,558,813.39	13,660,710,073.83
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		-	-
应付证券清算款		150,000,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,272,695.98	2,212,888.03
应付托管费		385,665.47	670,572.15
应付销售服务费		40,995.74	72,514.28
应付交易费用	6.4.7.7	102,792.33	17,282.52
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		1,030,106.83	1,320,453.68
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	141,035.52	60,437.94
负债合计		152,973,291.87	4,354,148.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	11,111,585,521.52	13,656,355,925.23
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		11,111,585,521.52	13,656,355,925.23
负债和所有者权益总计		11,264,558,813.39	13,660,710,073.83

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 11,111,585,521.52 元。

6.2 利润表

会计主体：太平日日金货币市场基金

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
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		134,078,872.75
1.利息收入		133,603,864.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	31,055,702.35
债券利息收入		48,657,501.16
资产支持证券利息收入		-

买入返售金融资产收入		53,890,660.78
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		454,734.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	454,734.49
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
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）		20,273.97
减：二、费用		16,339,927.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,922,432.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,309,827.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	347,919.84
4. 交易费用	6.4.7.18	482.50
5. 利息支出		1,620,880.91
其中：卖出回购金融资产支出		1,620,880.91
6. 其他费用	6.4.7.19	138,384.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		117,738,945.29
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		117,738,945.29

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：太平日日金货币市场基金

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）	13,656,355,925.23	-	13,656,355,925.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	117,738,945.29	117,738,945.29
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）	-2,544,770,403.71	-	-2,544,770,403.71
其中：1.基金申购款	17,082,379,971.47	-	17,082,379,971.47
2.基金赎回款	-19,627,150,375.18	-	-19,627,150,375.18
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）	-	-117,738,945.29	-117,738,945.29
五、期末所有者权益（基金净值）	11,111,585,521.52	-	11,111,585,521.52

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 4 日，因此无上年度可比期间数据（下同）。

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：

基金管理人负责人：宋小龙，主管会计工作负责人：宋卫华，会计机构负责人：孙波

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平日日金货币市场基金(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”)《关于同意中原英石日日金货币市场基金注册的批复》(证监许可[2016]1156 号)批准，由太平基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《太平日日金货币市场基金基金合同》发售，基金合同于 2016 年 11 月 4 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 11,905,478,318.58 份基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《货币市场基金管理暂行规定》和《太平日日金货币市场基金基金合同》和《太平日日金货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、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：人民币七天通知存款利率（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》、《太平日日金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、2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当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。债券投资采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量,即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;同时于每一估值日计算影子价格,以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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。当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时,本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用金融工具的公允价值确定影子价格。当影子定价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负偏离度绝对值达到 0.25%时,基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时,基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时,基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失,将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连

续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：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。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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，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。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。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 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份额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，以及因类别调整而引起的A、B级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。债券投资收益于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 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为红利再投资,免收再投资的费用;
- 3、“每日分配、按日支付”。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,每日进行支付。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,每日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;若投资人在当日收益支付时,若当日净收益大于零时,则为投资人增加相应的基金份额;若当日净收益等于零时,则保持投资人基金份额不变;基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零,若当日净收益小于零时,则缩减投资人基金份额;
- 6、当日申购的基金份额自下一个交易日起,享有基金的收益分配权益;当日赎回

的基金份额自下一个交易日起，不享有基金的收益分配权益；

7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据《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》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于OEF]、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至

1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	581,689,492.05
定期存款	3,820,000,000.00
其中: 存款期限 1 个月以内	1,370,000,000.00
其中: 存款期限 1-3 个月	2,450,000,000.00
其他存款	-
合计	4,401,689,492.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 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	4,525,296,117.65	4,527,138,000.00	1,841,882.35	0.0166
	合计	4,525,296,117.65	4,527,138,000.00	1,841,882.35	0.0166

注: 截止 2017 年 6 月 30 日, 本基金的交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资成本。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末 (2017 年 6 月 30 日) 未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 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 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所	863,310,000.00	-
银行间	1,302,292,142.29	-
合计	2,165,602,142.29	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	33,081.20
应收定期存款利息	1,020,972.36
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	13,387,214.24
应收买入返售证券利息	1,561,443.60
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	16,002,711.40

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日

交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	102,792.33
合计	102,792.33

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	9,275.82
预提信息披露费	69,671.58
预提审计费用	51,240.60
账户维护费	10,847.52
合计	141,035.52

注：其他应付款为银行手续费。

6.4.7.9 实收基金

太平日日金 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,597,224.59	106,597,224.59
本期申购	131,821,852.54	131,821,852.54
本期赎回（以“-”号填列）	-185,735,971.67	-185,735,971.67
本期末	52,683,105.46	52,683,105.46

注：表内各级基金的申购和赎回均包括红利再投资、分级调整以及基金转入和转出数。

太平日日金 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,549,758,700.64	13,549,758,700.64

本期申购	16,950,558,118.93	16,950,558,118.93
本期赎回（以“-”号填列）	-19,441,414,403.51	-19,441,414,403.51
本期末	11,058,902,416.06	11,058,902,416.06

注：表内各级基金的申购和赎回均包括红利再投资、分级调整以及基金转入和转出数。

6.4.7.10 未分配利润

太平日日金 A

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	247,178.37	-	247,178.37
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	-247,178.37	-	-247,178.37
本期末	-	-	-

太平日日金 B

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	117,491,766.92	-	117,491,766.92
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	-117,491,766.92	-	-117,491,766.92
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	1,559,618.88
定期存款利息收入	29,438,445.07
其他存款利息收入	1,395.83
结算备付金利息收入	44,334.89
其他	11,907.68
合计	31,055,702.35

注：其他为在途申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

本报告期内本基金无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成交总额	5,117,961,038.24
减：卖出债券(债转股及债券到期 兑付)成本总额	5,096,906,534.72
减：应收利息总额	20,599,769.03
买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	454,734.49

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本报告期内本基金无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本报告期内本基金无公允价值变动收益。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	20,273.97
合计	20,273.97

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	0.00
银行间市场交易费用	482.50
合计	482.50

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	31,240.60
信息披露费	39,671.58
银行汇划费	49,024.30
账户维护费	18,447.52
合计	138,384.00

6.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
太平基金管理有限公司（太平基金）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
太平资产管理有限公司（太平资产）	基金管理人的股东
兴业银行股份有限公司（兴业银行）	基金托管人
中原证券股份有限公司（中原证券）	基金管理人的股东
安石投资管理有限公司（安石投资）	基金管理人的股东

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内，无支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	10,922,432.22
其中：支付销售机构的客户维护费	76,197.58

注：支付基金管理人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：每日应计提的基金管理费 = 前一日的基金资产净值 X 0.33% ÷ 当年天数。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	3,309,827.99

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：每日应计提的基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% ÷ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	太平日日金 A	太平日日金 B	合计
兴业银行股份有限公司	52.04	-	52.04
太平基金管理有 限公司	5,866.42	326,814.16	332,680.58
合计	5,918.46	326,814.16	332,732.62

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个交易日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个交易日起享受 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本期末（2017年6月30日）及上年度末（2016年12月31日），其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	651,689,492.05	6,915,091.25

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017年1月1日至2017年6月30日止期间获得的备付金利息收入为人民币44,334.89元，2017年6月30日无结算备付金余额。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

太平日日金 A

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
252,249.76	-	-5,071.39	247,178.37	-

太平日日金 B

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
117,777,042.38	-	-285,275.46	117,491,766.92	-

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末（2017年6月30日），本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末（2017年6月30日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资于货币市场工具，每万份基金已实现收益会因为货币市场波动等因素产生波动。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。本基金面临的主要风险是市场风险、信用风险、流动性风险。其中与本基金的市场风险主要是利率风险。本基金基金管理人风险管理的目标是通过对于短期金融工具的积极投资管理，在有效控制投资风险和保持流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门在内的多级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会主要负责确定公司风险管理总体目标、制定公司风险管理战略和风险应对策略等事项。经营管理层及其下设的风险控制委员会负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与其相关的信用风险较小。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。

6.4.13.2.1 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 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
A-1	79,943,179.73	49,738,842.14
A-1 以下	-	-
未评级	4,395,269,123.35	753,041,236.15
合计	4,475,212,303.08	802,780,078.29

注：未评级债券为国债、短期融资券和同业存单。

6.4.13.2.2 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 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	50,083,814.57	190,345,347.38
合计	50,083,814.57	190,345,347.38

注：未评级债券为国债。

6.4.13.3 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上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(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，债券正回购资金余额一般不超过基金持有的债券投资的基金资产净值的 20%。

6.4.13.4 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，与本基金相关的市场风险主要是利率风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 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	1,951,689,492.05	2,450,000,000.00	-	-	-	-	4,401,689,492.05
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
清算备付金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,277,662,261.40	1,625,437,358.57	1,622,196,497.68	-	-	-	4,525,296,117.65
买入返售金融资产	2,165,602,142.29	-	-	-	-	-	2,165,602,142.29

应收利息	-	-	-	-	-	16,002,711.40	16,002,711.40
应收申购款	-	-	-	-	-	155,968,350.00	155,968,350.00
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,394,953,895.74	4,075,437,358.57	1,622,196,497.68	-	-	171,971,061.40	11,264,558,813.39
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,272,695.98	1,272,695.98
应付托管费	-	-	-	-	-	385,665.47	385,665.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	40,995.74	40,995.74
应付交易费用	-	-	-	-	-	102,792.33	102,792.33
应付利润	-	-	-	-	-	1,030,106.83	1,030,106.83
其他负债	-	-	-	-	-	141,035.52	141,035.52
证券清算款						150,000,000.00	150,000,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	152,973,291.87	152,973,291.87
利率敏感度缺口	5,394,953,895.74	4,075,437,358.57	1,622,196,497.68	-	-	18,997,769.53	11,111,585,521.52
上年度末 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	4,141,546,436.72	3,700,000,000.00	100,000,000.00	-	-	-	7,941,546,436.72
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
清算备付金	29,781,818.18	-	-	-	-	-	29,781,818.18
交易性金融资产	140,167,429.12	556,750,798.66	296,207,197.89	-	-	-	993,125,425.67
买入返售金融资产	4,381,038,820.64	-	-	-	-	-	4,381,038,820.64
应收利息	-	-	-	-	-	36,026,57	36,026,57

						2.62	2.62
应收申购款	-	-	-	-	-	279,191.00	279,191.00
其他应收款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	8,692,534,504.66	4,256,750,798.66	396,207,197.89	-	-	315,217,572.62	13,660,710,073.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,212,888.03	2,212,888.03
应付托管费	-	-	-	-	-	670,572.15	670,572.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	72,514.28	72,514.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	17,282.52	17,282.52
应付利润	-	-	-	-	-	1,320,453.68	1,320,453.68
其他负债	-	-	-	-	-	60,437.94	60,437.94
负债总计	-	-	-	-	-	4,354,148.60	4,354,148.60
利率敏感度缺口	8,692,534,504.66	4,256,750,798.66	396,207,197.89	-	-	310,863,424.02	13,656,355,925.23

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	2,984,126.92	658,045.80
	市场利率上升 25 个基点	-2,984,126.92	-658,045.80

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 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，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 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 2017 年 6 月 30 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 4,527,138,000.00 元，无属于第一、第三层次的余额（上年度末：第二层次 992,558,000.00 元，无属于第一、第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 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。

§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	4,525,296,117.65	40.17
	其中：债券	4,525,296,117.65	40.17
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,165,602,142.29	19.22
	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	4,401,689,492.05	39.08
4	其他各项资产	171,971,061.40	1.53
5	合计	11,264,558,813.39	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	2.30	
	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	-	-

注：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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 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	54

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金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	48.55	1.35
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	20.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	16.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天 (含)	11.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	99.83	1.35

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期限未超过 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	279,843,599.46	2.52

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	709,906,607.64	6.39
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,535,545,910.55	31.82
8	其他	-	-
9	合计	4,525,296,117.65	40.73
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	111720119	17 广发银行 CD119	4,500,000	445,345,504.25	4.01
2	111711273	17 平安银行 CD273	2,000,000	199,359,062.53	1.79
3	111711278	17 平安银行 CD278	2,000,000	199,347,513.16	1.79
4	111780219	17 徽商银行 CD096	2,000,000	197,832,266.39	1.78
5	111714125	17 江苏银行 CD125	2,000,000	195,683,678.00	1.76
6	170003	17 付息国债 03	1,500,000	149,945,622.35	1.35
7	011698753	16 海沧投资 SCP002	1,000,000	99,986,923.40	0.90
8	011762002	17 农垦 SCP002	1,000,000	99,979,898.77	0.90
9	011754005	17 华能 SCP001	1,000,000	99,950,876.18	0.90
10	111790270	17 上海农商银行	1,000,000	99,852,335.68	0.90

		CD012			
--	--	-------	--	--	--

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0298%
报告期内偏离度的最低值	-0.1102%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0221%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内无正偏离度的绝对值达到0.25%的情况

7.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。

7.9.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

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	16,002,711.40
4	应收申购款	155,968,350.00

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	171,971,061.40

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

份额级别	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
太平日日金 A	478	110,215.70	5,144,495.95	9.76%	47,538,609.51	90.24%
太平日日金 B	55	201,070,953.02	11,005,541,518.79	99.52%	53,360,897.27	0.48%
合计	533	20,847,252.39	11,010,686,014.74	99.09%	100,899,506.78	0.91%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	太平日日金 A	1,945,682.26	3.69%
	太平日日金 B	9,157,163.06	0.08%
	合计	11,102,845.32	0.10%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、	太平日日金 A	10~50

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	太平日日金 B	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	太平日日金 A	0~10
	太平日日金 B	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	太平日日金 A	太平日日金 B
基金合同生效日（2016 年 11 月 4 日）基金份额总额	106,958,171.58	11,798,520,147.00
本报告期期初基金份额总额	106,597,224.59	13,549,758,700.64
本报告期基金总申购份额	131,821,852.54	16,950,558,118.93
减：本报告期基金总赎回份额	185,735,971.67	19,441,414,403.51
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	52,683,105.46	11,058,902,416.06

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、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发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

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、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
中国国际	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

- (1) 市场形象及财务状况良好。
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (3) 内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (4) 研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

根据上述标准进行考察后，由基金管理人的投资决策委员会确定租用券商的交易单元，并由基金管理人与被选择的券商签订协议。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本报告期内，基金租用证券公司交易单元无变化。

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	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
中信证券	-	-	26,501,829,000.00	100.00%	-	-
中国国际	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期本基金不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 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	关于暂停太平日日金货币市场基金大额申购业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-01-23
2	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并参加相关费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-02-07
3	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-02-28
4	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-03-28
5	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-05-10
6	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-06-15
7	太平基金管理有限公司关于增聘吴素涵女士担任太平日日金货币市场基金基金经理的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-06-23
8	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-06-26

§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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		20%的时间区间					
机构	1	20170101-20170630	5,021,380,415.08	61,626,721.86	2,500,000,000.00	2,583,007,136.94	23.25%
	2	20170104-20170110	2,500,000,000.00	3,223,373.17	2,503,223,373.17	-	-
	3	20170630	1,000,000,000.00	3,000,391,224.00	1,000,391,224.00	3,000,000,000.00	27.00%
	4	20170608	0.00	500,000,000.00	1,012,808,579.75	0.00	0.00%

产品特有风险

(1) 本基金投资于货币市场工具，可能面临较高的货币市场利率波动的系统性风险以及流动性风险。货币市场利率的波动会影响基金的再投资收益，并影响到基金资产公允价值的变动，从而影响基金的收益水平。同时为应对赎回进行资产变现时，可能会由于货币市场工具流动性不足而面临流动性风险。

(2) 本基金份额净值始终保持为1.00元，投资收益每日分配、按日支付，但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金每日分配的收益因市场情况上下波动，在极端情况下可能为负值，导致基金份额持有人的基金份额缩减的风险。

(3) 当影子定价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负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人按照公允价值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，导致基金份额持有人的基金份额缩减的风险。

(4) 在特定条件下，为保证基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人有可能对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用，本基金基金份额持有人会面临赎回份额少于预期的风险。

(5) 在极端风险发生时，基金管理人及其股东在履行内部程序后，可以使用固有资金从货币市场基金购买金融工具。基金管理人及其股东存在着无法或来不及从货币市场基金购买金融工具的可能性，基金份额持有人可能面临损失。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平日日金货币市场基金基金合同》
- 3、《太平日日金货币市场基金招募说明书》
- 4、《太平日日金货币市场基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室）

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：021-38874600

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

二〇一七年八月二十八日