

太平日日鑫货币市场基金 2018 年半年度 报告（摘要）

2018 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 日

重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 08 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	太平日日鑫货币	
基金主代码	004330	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 15 日	
基金管理人	太平基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,512,945,552.87 份	
下属分级基金的基金简称	太平日日鑫 A	太平日日鑫 B
下属分级基金的交易代码	004330	004331
报告期末下属分级基金的份额总额	6,577,968.80 份	3,506,367,584.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在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投资收益。
投资策略	<p>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。</p> <p>1、资产配置策略 本基金通过对货币政策、宏观经济运行状况、利率走势、资金供求变化情况进行深入研究，评估各类投资品种的流动性和风险收益特征，确定各类投资品种的配置比例及期限组合，并适时进行动态调整。</p> <p>2、利率预期策略 本基金通过跟踪和分析各类宏观经济指标、资金供求状况等因素，对短期利率变化趋势进行评估并形成合理预期，动态配置货币资产。</p> <p>3、期限配置策略 本基金在短期利率期限结构分析的基础上，分析和评估各类投资品种的收益性和流动性，构建合理期限结构的投资组合。如预期市场利率水平上升，适度缩短投资组合的平均剩余期限；如预期市场利率水平下降，适度延长投资组合的平均剩余期限。</p> <p>4、流动性管理策略 本基金将会紧密关注申购/赎回现金流变化情况、市场资金流动状况等影响货币市场基金流动性管理的因素，动态调整并有效分配本基金</p>

	<p>的现金流，以满足基金资产的日常流动性需求。</p> <p>5、套利策略</p> <p>本基金根据对货币市场变动趋势、各市场和品种之间的风险收益差异的充分研究和论证，适当进行跨市场或跨品种套利操作，力争提高资产收益率，具体策略包括跨市场套利和跨期限套利等。</p> <p>6、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>7、非金融企业债务融资工具的投资策略</p> <p>本基金将通过宏观经济、中观产业、微观个券等综合判断，并结合资金面变化进行非金融企业债务融资工具的投资，严格遵守法律法规和基金合同的约定，兼顾安全性、流动性和收益性。</p> <p>8、同业存单的投资策略</p> <p>本基金将结合商业银行的不同资质和同业存单剩余期限进行同业存单的投资，注重同业存单的安全性、交易的流动性和收益率的比较，严格恪守法律法规和基金合同的约定。</p>
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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		太平基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈吟绮	罗菲菲
	联系电话	021-38556782	010-58560666
	电子邮箱	disclosure@taipingfund.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		021-61560999	95568
传真		021-38556677	010-58560798

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	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

§ 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（2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日）	
	太平日日鑫 A	太平日日鑫 B

本期已实现收益	266,527.42	74,348,704.27
本期利润	266,527.42	74,348,704.27
本期净值收益率	1.9770%	2.0989%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年6月30日）	
	太平日日鑫 A	太平日日鑫 B
期末基金资产净值	6,577,968.80	3,506,367,584.07
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1、本基金收益分配是按日结转份额

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。

3、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

太平日日鑫 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	0.3093%	0.0009%	0.1110%	0.0000%	0.1983%	0.0009%
过去三个月	0.9595%	0.0028%	0.3366%	0.0000%	0.6229%	0.0028%
过去六个月	1.9769%	0.0027%	0.6695%	0.0000%	1.3074%	0.0027%
过去一年	4.0171%	0.0029%	1.3500%	0.0000%	2.6671%	0.0029%
自基金合同生效起至今	5.1757%	0.0026%	1.7495%	0.0000%	3.4262%	0.0026%

注：本基金的收益分配是按日结转份额。

太平日日鑫 B

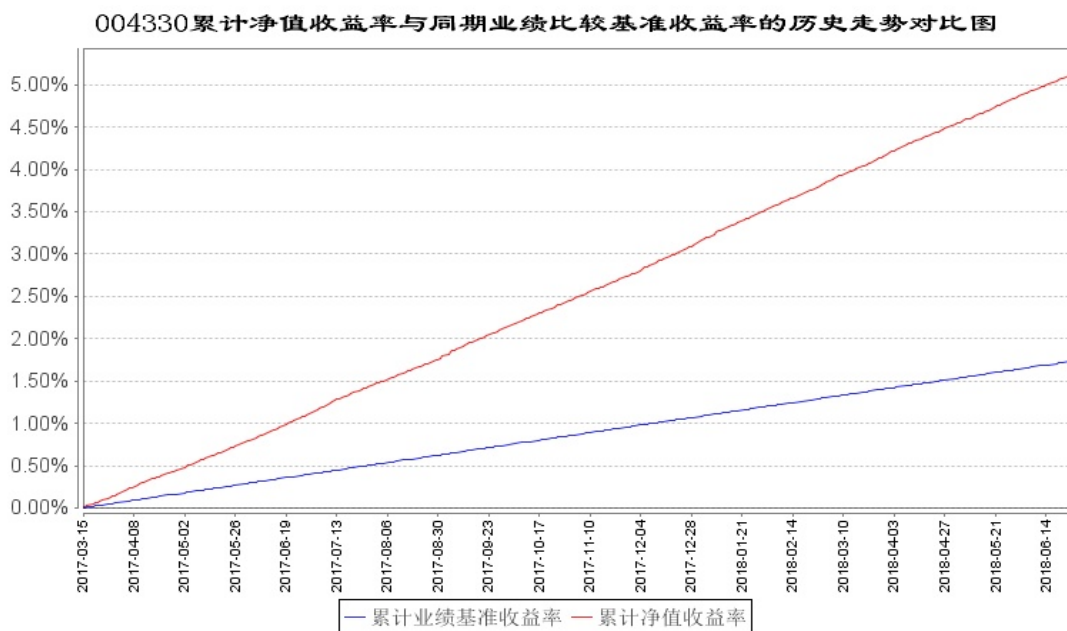
阶段	份额净值收	份额净值收	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	益率①	益率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	0.3299%	0.0009%	0.1110%	0.0000%	0.2189%	0.0009%
过去三个月	1.0210%	0.0029%	0.3366%	0.0000%	0.6844%	0.0029%
过去六个月	2.0989%	0.0027%	0.6695%	0.0000%	1.4294%	0.0027%
过去一年	4.2681%	0.0029%	1.3500%	0.0000%	2.9181%	0.0029%
自基金合同生 效起至今	5.5061%	0.0026%	1.7495%	0.0000%	3.7566%	0.0026%

注：本基金的收益分配是按日结转份额。

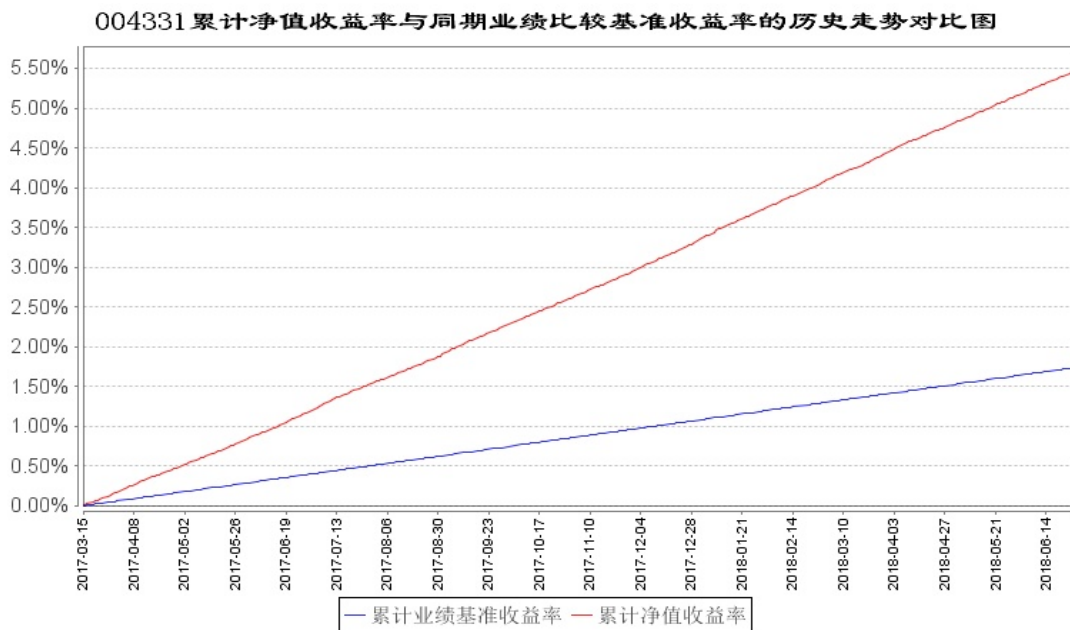
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、太平日日鑫 A



注：本基金合同于 2017 年 3 月 15 日生效。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、太平日日鑫 B



注：本基金合同于 2017 年 3 月 15 日生效。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 4 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 83%，中原证券股份有限公司的出资占注册资本的 8.5%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 8.5%。

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 5 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、太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金、太平恒利纯债债券型证券投资基金。

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		
吴超	本基金的基金经理、太平日日金货币市场基金基金经理	2018 年 2 月 12 日	-	5	美国本特利商学院金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013 年 5 月起曾在西部证券股份有限公司固定收益部、上海金懿投资有限公司担任部门经理、投资总监等职。2017 年 3 月加入本公司，现任固定收益部基金经理。2018 年 2 月 12 日起任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理。中国国籍。
潘莉	本基金的基金经理、太平日日金货币市场基金基金经理、太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理	2018 年 3 月 23 日	-	6	牛津大学工商管理硕士，具有证券投资基金从业资格。2004 年 6 月起曾就职于东京海上日动火灾保险株式会社非日系部、英国皇家太阳联合保险公司大客户部担任核保和客服工作；中国人保资产管理有限公司历任集中交易室交易员、固定收益部投资经理；南通农村商业银行股份有限公司历任金融市场部固收类投资经理、投资总监。2018 年 2 月加入本公司，现任固定收益部

					基金经理。2018 年 3 月 23 日起任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理；2018 年 6 月 15 日起担任太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理中国国籍。
吴素涵	本基金的基金经理、太平日日金货币市场基金基金经理	2017 年 6 月 21 日	2018 年 3 月 2 日	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 月起曾在汇丰晋信基金管理有限公司任固定收益交易员。2016 年 6 月加入本公司，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（任职期间：2017 年 6 月 21 日至 2018 年 3 月 2 日）。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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年宏观经济基本面总体来说仍然保持相对平稳，整体维持前期增速，一季度 GDP 增速为 6.8%，二季度 GDP 增速为 6.7%。但是从趋势上看并不乐观，尤其是需求端数据显示持续走弱。

通胀方面上半年通胀压力较小，CPI 在 2 月出现 2.9% 的高峰（主要受春节影响），随后下行至 3 月份 2.1%，并在二季度保持 2% 的水平相对稳定，猪周期对于 CPI 的影响越来越小。PPI 方面与去年相比则缓步下行，上游原材料涨价压力同去年相比有所减轻，PPI 增速由去年 5%-8% 的区间回落至上半年的 3%-5% 的区间，并且下半年仍将缓步下行。

生产数据在一季度之后迎来了短暂的恢复，6 月份 PMI、发电量以及高炉开工等多项生产回暖，但需求数据回落并创出新低。生产和需求数据出现显著背离，6 月上半月生产数据相继回落，经济增速承压明显。外源风险也在不断加剧，中美贸易摩擦不断升级，美元不断走强，人民币贬值压力陡增。而在 6 月下旬，央行在公开市场操作释放流动性的同时，进行力度较大的降准，通过货币政策的边际转向来稳定市场情绪，刺激经济发展。同时，个税改革再次提上日程，进一步降低居民税负，进而提振消费、扩大内需。

货币政策方面，上半年政策实际带来的流动性局面发生了重大改变。一季度货币政策仍然中性偏紧，在 3-4 月份达到高峰，造成了流动性极其紧张的状态，短端资金价格达到上半年极值。进入 5 月份以后，货币政策出现边际转向的趋势，表现为中性稳健，银行间市场流动性得到缓解。随着去杠杆进程中不断爆出的风险事件以及社融增速下降明显，6 月之后货币政策开始明显转向，央行报告货币政策目标也从“合理稳健”转向“合理充裕”。同时由于表外资产的限制，大量资

金涌入银行间市场，造成了银行间市场流动性十分充裕，短端资金价格也创出了近两年来的新低。

2018 上半年债券市场走出了熊转牛行情，但是内部出现了明显的结构分化。利率债与高评级信用债收益率下行明显，走出了一波明显的小牛市行情。但中低评级不断受到信用违约事件的冲击，机构投资者不断降低中低评级信用债投资风险偏好，民企债券尤其严重。因此造成了市场上利率与高评级量价齐升但低评级量价齐缩的结构分化局面。由于债券投资风险偏好的降低，货基可投的短端高评级投资品种上半年收益率下降明显。

结合相对稳定偏弱的经济基本面和中性偏松的货币政策的分析，本基金采取了维持组合短久期、投资高评级券种的组合管理策略，把握稳健的流动性阶梯配置，以维护组合流动性稳健为首要目标。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，太平日日鑫 A 净值收益率为 1.9769%，同期业绩比较基准增长率为 0.6695%；太平日日鑫 B 净值收益率为 2.0989%，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

2018 年上半年的经济基本面整体平稳，韧性较强，但下行压力较大，内忧外患倒逼政策转向以及改革深入。展望 2018 年下半年，各项货币以及财政政策可能加速出炉，对于经济的托底作用可能会有所滞后，同时寄希望于传统的宽松房地产的路线可能不会重演。经济增速可能在三季度出现一定下行，但同时由于政策改革的推进，经济并不会失速，在四季度基本面可能会出现下行减缓以及好转的迹象。下半年的通胀压力仍然较小，预计 CPI 仍将在 2%附近保持，同时 PPI 预计下半年受去年基数影响将逐渐走低，PPI-CPI 剪刀差将逐渐收敛。货币政策预计将保持实际中性偏宽松的趋势，为整体去杠杆环境做好防风险准备。财政政策方面预计将会增加部分投资以缓解固定资产投资下行带来的拖累。由于贸易战等外围因素今年以来不断恶化，国内政策受到的限制仍然较多，需要考虑的因素例如汇率等等也较去年更加复杂，在经济结构转型过程中遇到阵痛在所难免，但消费在近年来经济比重不断提升，起到了很好的中流砥柱的支撑作用。如何稳步提升消费需求以及政策力度将是影响下半年资本市场的关键所在。

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，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》

以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金经理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金经理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金经理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，本基金经理人严格按照《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：266,527.42 元，B 级分配收益 74,348,704.27 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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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基金托管人应尽的义务

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内向 A 级份额持有人分配利润：266,527.42 元，向 B 级份额持有人分配利润：74,348,704.27 元。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：太平日日鑫货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	359,812,114.12	254,825,244.71
结算备付金		9,109,090.91	11,518,181.82
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,380,806,239.77	2,403,949,744.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,380,806,239.77	2,403,949,744.00
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	736,759,505.13	442,185,289.27

应收证券清算款		20,038,489.80	-
应收利息	6.4.7.5	7,552,828.79	13,272,956.40
应收股利		-	-
应收申购款		1,010.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,514,079,278.52	3,125,751,416.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	100,979,728.53
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		768,619.61	672,498.63
应付托管费		153,723.91	134,499.72
应付销售服务费		33,455.22	28,407.15
应付交易费用	6.4.7.7	57,494.43	25,182.01
应交税费		21,872.33	-
应付利息		-	96,509.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,560.15	188,000.00
负债合计		1,133,725.65	102,124,825.56
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,512,945,552.87	3,023,626,590.64
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		3,512,945,552.87	3,023,626,590.64
负债和所有者权益总计		3,514,079,278.52	3,125,751,416.20

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3,512,945,552.87 份，其中 A 级基金份额参考净值 1.0000 元，份额总额 6,577,968.80 份；B 级基金份额参考净值 1.0000 元，份额总额 3,506,367,584.07 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：太平日日鑫货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 3 月 15 日（基 金合同生效日） 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		81,929,612.53	48,912,306.10
1. 利息收入		79,500,886.47	48,987,041.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,440,701.55	11,655,795.91
债券利息收入		56,285,025.13	18,588,850.24
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		17,775,159.79	18,742,394.92
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		2,428,726.06	-107,404.97
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	2,428,726.06	-107,404.97
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	6.4.7.18	-	32,670.00
减：二、费用		7,314,380.84	4,144,613.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,484,452.41	2,792,860.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	896,890.46	558,572.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	195,881.08	121,265.27
4. 交易费用	6.4.7.19	509.00	-
5. 利息支出		1,597,516.70	558,892.88
其中：卖出回购金融资产支 出		1,597,516.70	558,892.88
6. 税金及附加		21,921.04	-
7. 其他费用	6.4.7.20	117,210.15	113,022.15
三、利润总额(亏损总额以“- ”号填列)		74,615,231.69	44,767,693.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-		74,615,231.69	44,767,693.02

”号填列)			
-------	--	--	--

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 3 月 15 日，因此上年度可比期间为 2017 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日（下同）。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：太平日日鑫货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	3,023,626,590.64	-	3,023,626,590.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	74,615,231.69	74,615,231.69
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）	489,318,962.23	-	489,318,962.23
其中：1. 基金申购款	4,856,159,829.81	-	4,856,159,829.81
2. 基金赎回款	-4,366,840,867.58	-	-4,366,840,867.58
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）	-	-74,615,231.69	-74,615,231.69
五、期末所有者权益（基金净值）	3,512,945,552.87	-	3,512,945,552.87
项目	上年度可比期间 2017 年 3 月 15 日（基金合同生效日）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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,767,693.02	44,767,693.02
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）	3,983,340,737.67	-	3,983,340,737.67
其中：1. 基金申购款	7,697,118,087.01	-	7,697,118,087.01

2. 基金赎回款	-3,713,777,349.34	-	-3,713,777,349.34
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）	-	-44,767,693.02	-44,767,693.02
五、期末所有者权益（基金净值）	3,983,340,737.67	-	3,983,340,737.67

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 3 月 15 日，因此上年度可比期间为 2017 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日（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：

<u>邱宏斌</u>	<u>宋卫华</u>	<u>孙波</u>
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

太平日日鑫货币市场基金（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]3071号《关于准予太平日日鑫货币市场基金注册的批复》核准，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》和《太平日日鑫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 5,509,836,323.34 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(2017)第 266 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《太平日日鑫货币市场基金基金合同》于 2017 年 3 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,510,097,819.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 261,495.68 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平日日鑫货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于现金，期限在一年以内(含一年)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、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，以及法律法规或中国证监会、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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》、《太平日日鑫货币市场基金 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期未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[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》、财税[2016]140 号《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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
中原证券股份有限公司（“中原证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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、登记机构
太平资产管理有限公司（“太平资管”）	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。

6.4.8 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

本基金本报告期内及上年度可比期间，未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未有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

本基金本报告期内及上年度可比期间，未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间，无支付关联方的佣金。

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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 3 月 15 日（基金合 同生效日） 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,484,452.41	2,792,860.67
其中：支付销售机构的客户维护费	30,231.83	20,529.52

注：支付基金管理人 太平基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.25% 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 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 3 月 15 日（基金合 同生效日） 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	896,890.46	558,572.11

注：支付基金托管人中国民生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 X 0.05% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平日日鑫 A	太平日日鑫 B	合计
中国民生银行股份有限公司	3,369.67	517.83	3,887.50

限公司			
太平基金管理有限公司	4,992.62	176,297.84	181,290.46
合计	8,362.29	176,815.67	185,177.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年3月15日(基金合同生效日)至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平日日鑫 A	太平日日鑫 B	合计
中国民生银行股份有限公司	110,531.75	450.72	110,982.47
太平基金管理有限公司	694.79	9,491.64	10,186.43
合计	111,226.54	9,942.36	121,168.90

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的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给太平基金管理有限公司,再由太平基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。销售服务费的计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间,未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

本报告期内,本基金的基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末,无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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年03月15日(基金合同生效日) 至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	259,812,114.12	2,870,178.03	16,891,559.12	709,490.57

注:本基金的活期银行存款及部分协议存款由基金托管人中国民生银行保管,活期存款按银行同

业利率计息，协议存款按约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年06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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

6.4.10 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 2018 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 2,380,806,239.77 元，无属于第一或第三层次的余额。

(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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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。

(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) 除上述事项外，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	2,380,806,239.77	67.75
	其中：债券	2,380,806,239.77	67.75
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	736,759,505.13	20.97
	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	368,921,205.03	10.50
4	其他各项资产	27,592,328.59	0.79
5	合计	3,514,079,278.52	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	3.17

	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银行间市场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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	65
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

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	34.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	18.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	31.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	0.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	15.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.82	-

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	190,360,320.47	5.42
	其中：政策性金融债	190,360,320.47	5.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	240,365,955.10	6.84
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,950,079,964.20	55.51
8	其他	-	-
9	合计	2,380,806,239.77	67.77
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名的前十名债券投资明细

金额单位：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	111783160	17 广州农村商业银行 CD150	1,500,000	149,124,279.65	4.24
2	111781896	17 徽商银行 CD125	1,000,000	99,702,829.35	2.84
3	111813086	18 浙商银行 CD086	1,000,000	99,393,364.30	2.83
4	111818145	18 华夏银行 CD145	1,000,000	99,197,871.85	2.82
5	111811070	18 平安银行 CD070	1,000,000	99,170,401.48	2.82
6	111809181	18 浦发银行 CD181	1,000,000	99,170,197.48	2.82
7	111820124	18 广发银行 CD124	1,000,000	99,170,197.48	2.82
8	111818083	18 华夏银行 CD083	1,000,000	99,113,633.96	2.82
9	111893616	18 南洋商业银 行 CD002	1,000,000	99,067,141.34	2.82
10	111894133	18 厦门国际银 行 CD052	1,000,000	98,927,527.66	2.81

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	0.1496%
报告期内偏离度的最低值	0.0078%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0681%

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%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 0.5%情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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

本基金采用摊余成本法进行估值,各估值对象的溢折价、利息收入按剩余期限摊销平均计入基金净值。本基金采用“影子定价”的方法进行估值修正,即为了避免采用摊余成本法计算的基金净值与按市场利率和交易市价计算的资产净值发生重大偏离,当此偏离度达到或超过基金资产净值的 0.50%时,适用影子定价对估值对象进行调整,调整差额于当日计入基金净值。

7.9.2

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责处罚的情况。

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	20,038,489.80
3	应收利息	7,552,828.79
4	应收申购款	1,010.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	
8	合计	27,592,328.59

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(%)
太平日日鑫 A	462	14,238.03	5,975,137.23	90.84	602,831.57	9.16
太平日日鑫 B	6584	394,597.35	3,506,367,584.07	100.00	0.00	0.00
合计	468	7,506,293.92	3,512,342,721.30	99.98	602,831.57	0.02

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	保险类机构	2637078565.27	75.07
2	券商类机构	604116475.19	17.20
3	券商类机构	200789947.46	5.72
4	保险类机构	32103708.67	0.91
5	其他机构	20870477.55	0.59
6	其他机构	10548024.12	0.30
7	个人	595902.03	0.02
8	其他机构	514827.70	0.01
9	个人	442345.52	0.01
10	个人	327118.14	0.01

8.3 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	太平日日鑫 A	215,091.65	3.2699
	太平日日鑫 B	0.00	0.0000
	合计	215,091.65	0.0061

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

	合计	0
--	----	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	太平日日鑫 A	太平日日鑫 B
基金合同生效日（2017 年 3 月 15 日）基金份额总额	69,728,252.02	5,440,369,567.00
本报告期期初基金份额总额	6,976,958.94	3,016,649,631.70
本报告期基金总申购份额	110,652,001.31	4,745,507,828.50
减：本报告期基金总赎回份额	111,050,991.45	4,255,789,876.13
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	6,577,968.80	3,506,367,584.07

§ 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

1、基金管理人的重大人事变动情况

（1）经太平基金管理有限公司 2018 年第二届董事会第七次会议审议通过，宋小龙先生由于个人原因自 2018 年 5 月 11 日起不再担任公司总经理职务；董事长汤海涛先生自 2018 年 5 月 11 日起代任公司总经理。上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会上海监管局备案，并于 2018 年 5 月 12 日发布了《太平基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

（2）经太平基金管理有限公司 2018 年第二届董事会第九次会议审议通过，原副总经理邱宏斌先生于 2018 年 6 月 28 日起转任公司总经理，董事长汤海涛先生于 2018 年 6 月 28 日起不再代任公司总经理。上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会上海监管局备案，并于 2018 年 6 月 29 日发布了《太平基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2018 年 4 月 19 日公告，根据工作需要，任命张庆

先生担任本公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金管理人、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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日（2017 年 3 月 15 日）起聘请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，本报告期内本基金未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。

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	2	-	-%	-	-%	

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		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
中国国际	-	-%	13,413,200,000.00	100.00%	-	-%

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。

§ 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	20180101-20180630	2,582,391,441.88	54,687,123.39	0.00	2,637,078,565.27	75.07

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

太平基金管理有限公司
二〇一八年八月二十七日