

# 平安大华交易型货币市场基金 2018 年半年度报告

2018 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：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 债券回购融资情况.....	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	42
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.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	44
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.....	44
7.9 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	46
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
8.5 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
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>

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 .....	52
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华交易型货币市场基金	
基金简称	平安大华货币 ETF	
场内简称	场内货币	
基金主代码	511700	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 23 日	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	232,885,911.35 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2016 年 10 月 17 日	
下属分级基金的基金简称:	平安日鑫 A	场内货币
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	003034	511700
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	229,768,742.53 份	3,117,168.82 份

本基金 A 类份额（平安日鑫 A）净值为 1.00 元，E 类份额（场内货币）净值为 100.00 元。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
	平安日鑫 A	场内货币
下属分级基金的风险收益特征	-	-

## 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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	王健
	联系电话	0755-22626828	021-38676252
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		400-800-4800	95521
传真		0755-23997878	021-38677819
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	上海市浦东新区银城中路 68 号 32 层
邮政编码		518048	200120
法定代表人		罗春风	杨德红

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 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

基金级别	平安大华交易型货币市场 A 级	平安大华交易型货币市场 E 级
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 )	报告期( 2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	66,387,023.42	18,574,459.75
本期利润	66,387,023.42	18,574,459.75
本期净值收益率	2.1322%	2.1323%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2018 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	229,768,742.53	311,716,881.74
期末基金份额净值	-	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2018 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	7.0519%	7.0519%

注： 1、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。

2、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

平安大华交易型货币市场 A 级

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	0.3402%	0.0014%	0.1125%	0.0000%	0.2277%	0.0014%
过去三个月	1.0398%	0.0010%	0.3412%	0.0000%	0.6986%	0.0010%
过去六个月	2.1322%	0.0010%	0.6788%	0.0000%	1.4534%	0.0010%
过去一年	4.4598%	0.0010%	1.3687%	0.0000%	3.0911%	0.0010%
自基金合同生效起至今	7.0519%	0.0022%	2.4225%	0.0000%	4.6294%	0.0022%



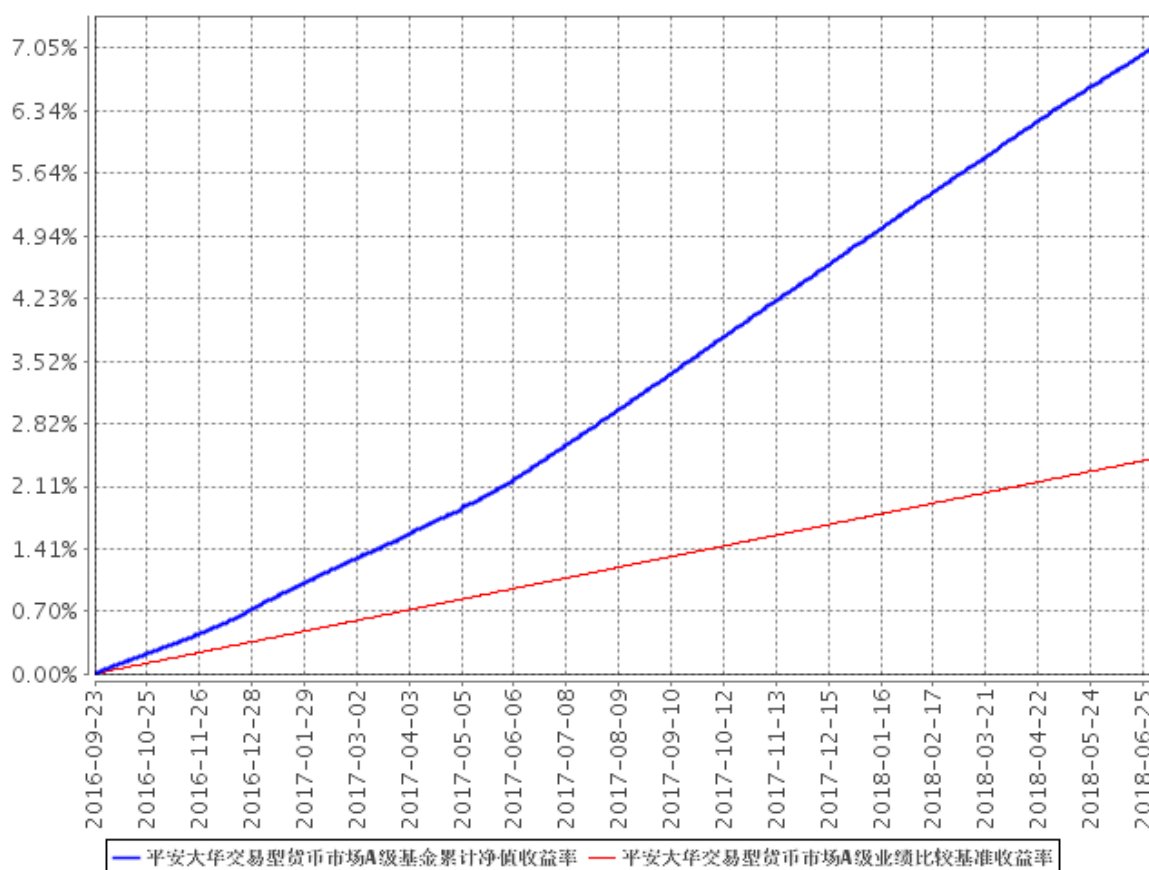
平安大华交易型货币市场 E 级

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	0.3403%	0.0014%	0.1125%	0.0000%	0.2278%	0.0014%
过去三个月	1.0399%	0.0010%	0.3412%	0.0000%	0.6987%	0.0010%
过去六个月	2.1323%	0.0010%	0.6788%	0.0000%	1.4535%	0.0010%
过去一年	4.4599%	0.0010%	1.3687%	0.0000%	3.0912%	0.0010%
自基金合同 生效起至今	7.0519%	0.0022%	2.4225%	0.0000%	4.6294%	0.0022%

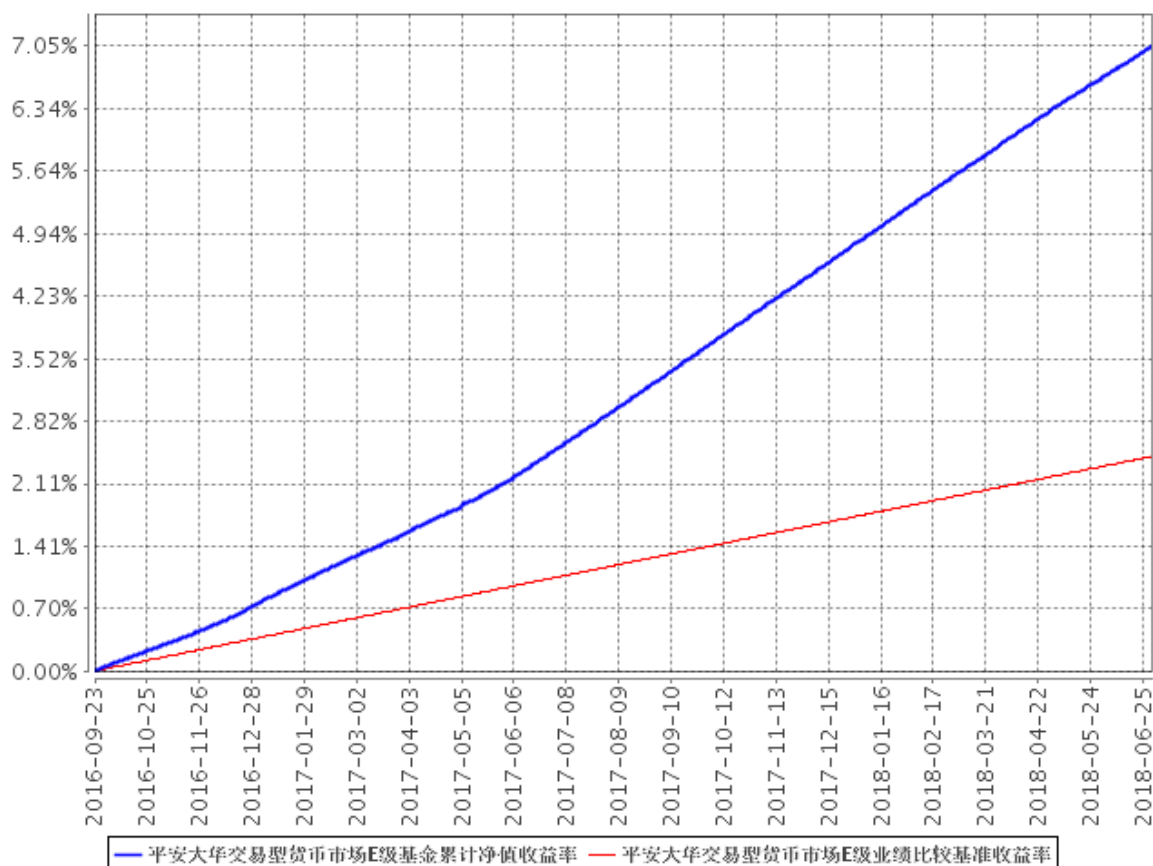
本基金业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）

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

平安大华交易型货币市场A级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



平安大华交易型货币市场E级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 9 月 23 日正式生效，截至报告期末已满一年；
- 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。

### 3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

## § 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“平安大华基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917号文批准设立。平安大华基金总部位于深圳，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%。平安大华基金秉承“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 2018 年 6 月 30 日，平安大华基金共管理 57 只公募基金，资产管理总规模 2442 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		
段玮婧	平安大华交易型货币市场基金基金经理	2017年1月5日	-	11	段玮婧女士，中山大学硕士，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。现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、平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华合瑞定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华短债债券型证券投资基金、平安大华合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。
申俊华	平安大	2016年9月23	-	9	申俊华女士，湖南大学金融

	<p>华交易型货币市场基金基金经理</p>	<p>日</p>		<p>学博士，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、平安大华金管家货币市场基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫荣混合型证券投资基金、平安大华惠悦纯债债券型证券投资基金、平安大华日增利货币市场基金基金经理。</p>
--	-----------------------	----------	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《平安大华交易型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。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组

合同单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 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

2018 年上半年，投资、消费、进出口走弱，CPI 冲高回落维持在 2% 以下，M2 处于历史低位，社融持续回落，实体融资需求疲弱，贸易摩擦持续升级成为基本面中超预期的因素。货币政策维持稳健中性，流动性合理充裕，央行先后通过定向降准、临时准备金动用安排、降准置换 MLF、扩大 MLF 抵押品范围等措施，向市场注入流动性。同时资管新规落地后好于市场预期，总体资金面宽松，仅在税期和季末 MPA 考核下，出现短期资金价格波动。债券市场收益率出现分化：利率债和中高等级信用债整体下行；而受信用事件频发影响，低等级信用债收益率上行。

报告期内，本基金的投资操作仍以加强流动性管理为主要原则，通过优选存款交易对手，提升协议存款的收益。在有效控制负偏离度的前提下，在关键配置时点拉长组合剩余期限、适当调整存款、存单和短融的配置比例，同时加强波段交易力度，提高组合整体收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期平安大华交易型货币市场 A 级的基金份额净值收益率为 2.1322%，本报告期平安大华交易型货币市场 E 级的基金份额净值收益率为 2.1323%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%。

### 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，预计地产投资缓慢下行、制造业投资复苏有限，消费方面对经济拉动边际力量减弱，贸易摩擦制约出口，宏观经济下行压力仍在；但受更加积极的财政政策带动，基建托底，体现下半场的宽信用方向。预计货币政策仍会维持边际放松，整体流动性保持合理充裕。

本基金下半年仍将以加强流动性管理为主要原则，稳健操作，严控风险，密切关注各类资产

价格的走势，把握市场配置机会，兼顾安全性和流动性的同时力争提高组合整体收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。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委员会，成员由投资管理部门、研究中心、资本市场风控监控室、基金运营部基金会计室及法律合规监察部相关人员组成。基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。

估值委员会的职责主要包括有：制订健全有效的估值政策和程序；定期对估值政策和程序进行评价等；保证基金估值的公平、合理；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；估值委员会成员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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 84,961,483.17 元，实际分配收益 84,961,483.17 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 万元的情形。

## § 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华交易型货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，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《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，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

本托管人复核了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、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：平安大华交易型货币市场基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	134,916,472.83	6,072,475,392.95
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	471,922,352.37	3,444,545,105.29
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		461,922,352.37	3,444,545,105.29
资产支持证券投资		10,000,000.00	-
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	45,045,187.57	460,149,410.23
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	5,456,789.02	75,259,396.75
应收股利		-	-
应收申购款		1.00	17,199.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		657,340,802.79	10,052,446,504.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		115,279,742.36	260,502,209.66
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		164,808.74	1,349,229.39
应付托管费		54,936.25	449,743.10
应付销售服务费		10,987.22	89,948.62
应付交易费用	6.4.7.7	37,930.16	65,481.45



应交税费		11,918.18	-
应付利息		18,174.40	124,101.81
应付利润		64,367.53	1,278,402.74
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	212,313.68	359,000.00
负债合计		115,855,178.52	264,218,116.77
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	541,485,624.27	9,788,228,388.07
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		541,485,624.27	9,788,228,388.07
负债和所有者权益总计		657,340,802.79	10,052,446,504.84

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.00 元，E 类基金份额净值 100.00 元。基金份额总额 232,885,911.35 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 229,768,742.53 份，E 类基金份额的份额总额为 3,117,168.82 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安大华交易型货币市场基金

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1月1日至2017 年6月30日
<b>一、收入</b>		90,809,145.13	78,970,041.18
1.利息收入		91,011,012.12	79,650,009.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	57,345,788.89	41,280,411.36
债券利息收入		24,686,695.22	26,464,934.98
资产支持证券利息收入		148,239.39	-
买入返售金融资产收入		8,830,288.62	11,904,662.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-202,158.66	-679,967.83
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	-202,158.66	-679,967.83
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	291.67	-
<b>减: 二、费用</b>		5,847,661.96	8,672,432.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,987,452.88	6,183,879.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	995,817.61	1,499,122.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	199,163.55	187,390.33
4. 交易费用	6.4.7.19	9.98	-
5. 利息支出		1,439,263.53	605,755.88
其中: 卖出回购金融资产支出		1,439,263.53	605,755.88
6. 税金及附加		4,040.73	-
7. 其他费用	6.4.7.20	221,913.68	196,283.77
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		84,961,483.17	70,297,608.75
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		84,961,483.17	70,297,608.75

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 平安大华交易型货币市场基金

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)	9,788,228,388.07	-	9,788,228,388.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	84,961,483.17	84,961,483.17
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)	-9,246,742,763.80	-	-9,246,742,763.80
其中: 1. 基金申购款	5,847,969,338.04	-	5,847,969,338.04
2. 基金赎回款	-15,094,712,101.84	-	-15,094,712,101.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-84,961,483.17	-84,961,483.17

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）	541,485,624.27	-	541,485,624.27
项目	上年度可比期间 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）	4,879,803,581.45	-	4,879,803,581.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,297,608.75	70,297,608.75
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）	5,503,959,648.67	-	5,503,959,648.67
其中：1. 基金申购款	22,020,976,458.15	-	22,020,976,458.15
2. 基金赎回款	-16,517,016,809.48	-	-16,517,016,809.48
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）	-	-70,297,608.75	-70,297,608.75
五、期末所有者权益（基金净值）	10,383,763,230.12	-	10,383,763,230.12

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
林婉文

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
胡明

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安大华交易型货币市场基金(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]1380号《关于准予平安大华交易型货币市场基金注册的批复》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《平安大华交易

型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式，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 1,590,518,565.34 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(2016)第 1210 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华交易型货币市场基金基金合同》于 2016 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,590,527,400.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 8,834.75 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，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)。

根据《平安大华交易型货币市场基金基金合同》和《平安大华交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人平安大华基金管理有限公司在基金合同生效日当日，即 2016 年 9 月 23 日为本基金 E 类基金份额办理份额折算。本基金 E 类基金份额募集认购金额为 1,384,657,000.00 元，折算前基金份额总额为 1,384,657,000.00 份，折算前基金份额净值为 1.00 元；根据本基金的基金份额折算方法，折算后 E 类基金份额总额为 13,846,570.00 份，折算后基金份额净值为 100.00 元。本基金 E 类基金份额的注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2016 年 9 月 26 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证自律监管决定书 [2016]246 号文审核同意，本基金 E 类基金份额于 2016 年 10 月 17 日在上交所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华交易型货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、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、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；以及中国证监会、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：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(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》、《平安大华交易型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于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

### 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[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)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。

## 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 2018年6月30日
活期存款	4,916,472.83
定期存款	130,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	30,000,000.00
存款期限3个月以上	-
存款期限3个月以上	100,000,000.00
其他存款	-
合计：	134,916,472.83

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018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	461,922,352.37	462,595,000.00	672,647.63	0.1242%
	合计	461,922,352.37	462,595,000.00	672,647.63	0.1242%
资产支持券	10,000,000.00	10,000,000.00	-	-	
合计	471,922,352.37	472,595,000.00	672,647.63	0.1242%	

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

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末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 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	45,045,187.57	-
合计	45,045,187.57	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末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 2018年6月30日
应收活期存款利息	19,576.43
应收定期存款利息	711,444.37
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	115.65
应收债券利息	4,437,338.90
应收资产支持证券利息	152,686.67
应收买入返售证券利息	135,627.00
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	5,456,789.02

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	37,930.16
合计	37,930.16

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	212,313.68
合计	212,313.68

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安大华交易型货币市场 A 级		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,325,556,678.71	9,325,556,678.71
本期申购	3,600,509,504.96	3,600,509,504.96
本期赎回(以“-”号填列)	-12,696,297,441.14	-12,696,297,441.14
- 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	229,768,742.53	229,768,742.53

金额单位：人民币元

平安大华交易型货币市场 E 级		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额



上年度末	4,626,717.09	462,671,709.36
本期申购	22,474,598.34	2,247,459,833.08
本期赎回(以“-”号填列)	-23,984,146.61	-2,398,414,660.70
- 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	3,117,168.82	311,716,881.74

注：申购含红利再投、转换转入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安大华交易型货币市场 A 级			
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	66,387,023.42	-	66,387,023.42
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	-66,387,023.42	-	-66,387,023.42
本期末	-	-	-

单位：人民币元

平安大华交易型货币市场 E 级			
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	18,574,459.75	-	18,574,459.75
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	-18,574,459.75	-	-18,574,459.75
本期末	-	-	-

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	267,146.16
定期存款利息收入	56,905,093.22
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	173,527.04
其他	22.47
合计	57,345,788.89

**6.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期内无股票投资收益。

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	-202,158.66
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	-202,158.66

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,454,958,009.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,420,890,055.15
减：应收利息总额	34,270,112.59
买卖债券差价收入	-202,158.66

#### **6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

#### **6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的申购差价收入。

#### **6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### **6.4.7.14 贵金属投资收益**

##### **6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资。

##### **6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资。

##### **6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资。

##### **6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资。

#### **6.4.7.15 衍生工具收益**

##### **6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### **6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### **6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

#### **6.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	291.67
合计	291.67

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	9.98
合计	9.98

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	74,383.76
信息披露费	99,177.14
其他	600.00
账户维护费	18,000.00
上市年费	29,752.78
合计	221,913.68

#### 6.4.7.21 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，无须作披露的分部报告。

### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露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。

#### 6.4.9.2 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
平安大华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安”)	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	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司	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	基金管理人的最终控股母公司
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

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。

### 6.4.10 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

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安	540,000,000.00	100.00%	240,000,000.00	100.00%

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	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	2,987,452.88	6,183,879.99
其中：支付销售机构的客户维护费	2,177.57	2.20

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	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	995,817.61	1,499,122.46

注：支付基金托管人国泰君安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。

**6.4.10.2.3 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		
	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		
	平安大华交易型货币市场 A 级	平安大华交易型货币市场 E 级	合计

平安大华基金管理有限公司	153,841.22	13,991.32	167,832.54
平安证券股份有限公司	0.54	1,665.55	1,666.09
国泰君安证券股份有限公司	270.59	1,822.18	2,092.77
合计	154,112.35	17,479.05	171,591.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	平安大华交易型货币市场 A 级	平安大华交易型货币市场 E 级	合计
平安大华基金管理有限公司	144,184.97	0.00	144,184.97
平安证券股份有限公司	0.00	1,335.23	1,335.23
国泰君安证券股份有限公司	0.00	8,604.97	8,604.97
合计	144,184.97	9,940.20	154,125.17

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 0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安大华基金管理有限公司，再由平安大华基金管理有限公司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 × 0.01% / 当年天数。

#### 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

本基金于本期及上年度可比期间均未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

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	平安大华交易型货币市场 A 级	平安大华交易型货币市场 E 级
基金合同生效日（2016年9月23日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	202,757.00
期间申购/买入总份额	50,140,518.89	1,421,765.00
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	35,000,000.00	1,624,522.00
期末持有的基金份额	15,140,518.89	-

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	6.5013%	-
-----------------------	---------	---

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	平安大华交易型货币市场 A 级	平安大华交易型货币市场 E 级
基金合同生效日（2016 年 9 月 23 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	100,209,662.01	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	100,209,662.01	-
期末持有的基金份额	0.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

报告期间持有份额含红利再投资、未付收益转份额，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 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

平安大华交易型货币市场 A 级

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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
国泰君安证 券股份有限 公司	50,005,880.69	21.4723%	0.00	0.0000%
深圳平安大 华汇通财富 管理有限公 司	50,168,981.51	21.5423%	0.00	0.0000%



## 平安大华交易型货币市场 E 级

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	168,844.05	0.0725%	0.00	0.0000%
中国平安人寿保险股份有限公司	1.00	0.0000%	1.00	0.0000%

## 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
国泰君安证券-活期	4,916,472.83	267,146.16	4,153,543.52	647,475.15
平安银行-定期	30,000,000.00	3,523,277.61	1,080,000,000.00	4,394,166.79

注：本基金的活期银行存款由基金托管人国泰君安证券保管，按银行同业利率计息；定期存款由平安银行保管，按协议利率计息。

## 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

## 平安大华交易型货币市场A级

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
67,577,685.30	-	-1,190,661.88	66,387,023.42	-

## 平安大华交易型货币市场E级

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
18,597,833.08	-	-23,373.33	18,574,459.75	-

注：本基金在本年度累计分配收益 84,961,483.17 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 84,897,115.64 元，计入应付收益科目 64,367.53 元。

**6.4.12 期末（2018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**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 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。

**6.4.12.3 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 2018 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 115,279,742.36 元，是以如下债券作为质押：

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
111810238	18 兴业银行 CD238	2018 年 7 月 2 日	99.39	1,000,000	99,390,703.57
111892949	18 厦门国际银行 CD028	2018 年 7 月 2 日	97.90	180,000	17,621,599.93
合计				1,180,000	117,012,303.50

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**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。本基金管理人制订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。

#### 6.4.13.2 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存放在本基金的托管人国泰君安证券开立于交通银行股份有限公司的托管账户；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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净值产的 10%。

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。

##### 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	125,004,772.66	459,693,721.98
合计	125,004,772.66	459,693,721.98

注：以上按短期信用评级的债券投资未评级的债券投资为政策性金融债、超短期融资券。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	10,000,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	10,000,000.00	-

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	286,927,191.43	2,904,974,212.30
合计	286,927,191.43	2,904,974,212.30

**6.4.13.2.4 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	49,990,388.28	79,877,171.01
合计	49,990,388.28	79,877,171.01

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。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

**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。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、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

于 2018 年 6 月 30 日本基金投资组合的平均剩余期限未超过 120 天，平均剩余存续期限未超过 240 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。

于 2018 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 115,279,742.36 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，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，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 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；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，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 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日

内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 6 月 30 日，本基金不持有流通受限资产，组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 14,916,472.83 元，超过经确认的当日净赎回金额。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### **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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	4,916,472.83	130,000,000.00	-	-	-	-	134,916,472.83
交易性金融资产	114,993,910.03	218,731,997.18	138,196,445.16	-	-	-	471,922,352.37
买入返售金融资产	45,045,187.57	-	-	-	-	-	45,045,187.57
应收利息	-	-	-	-	-	5,456,789.02	5,456,789.02
应收申购款	-	-	-	-	-	1.00	1.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	164,955,570.43	348,731,997.18	138,196,445.16	-	-	5,456,790.02	657,340,802.79
负债							
卖出回购金融资产款	115,279,742.36	-	-	-	-	-	115,279,742.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	164,808.74	164,808.74
应付托管费	-	-	-	-	-	54,936.25	54,936.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,987.22	10,987.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	37,930.16	37,930.16
应付利息	-	-	-	-	-	18,174.40	18,174.40
应付利润	-	-	-	-	-	64,367.53	64,367.53
其他负债	-	-	-	-	-	224,231.86	224,231.86
负债总计	115,279,742.36	-	-	-	-	575,436.16	115,855,178.52
利率敏感度缺口	49,675,828.07	348,731,997.18	138,196,445.16	-	-	4,881,353.86	541,485,624.27
上年度末 2017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	1,302,475,392.95	4,770,000,000.00	-	-	-	-	6,072,475,392.95
交易性金融资产	219,913,132.74	1,635,766,872.50	1,588,865,100.05	-	-	-	3,444,545,105.29
买入返售金融资产	460,149,410.23	-	-	-	-	-	460,149,410.23
应收利息	-	-	-	-	-	75,259,396.75	75,259,396.75
应收申购款	-	-	-	-	-	17,199.62	17,199.62
资产总计	1,982,537,935.92	6,405,766,872.50	1,588,865,100.05	-	-	75,276,596.37	10,052,446,504.84
负债							
卖出回购金融资产款	260,502,209.66	-	-	-	-	-	260,502,209.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,349,229.39	1,349,229.39
应付托管费	-	-	-	-	-	449,743.10	449,743.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	89,948.62	89,948.62
应付交易费用	-	-	-	-	-	65,481.45	65,481.45

应付利息	-	-	-	-	124,101.81	124,101.81
应付利润	-	-	-	-	1,278,402.74	1,278,402.74
其他负债	-	-	-	-	359,000.00	359,000.00
负债总计	260,502,209.66	-	-	-	3,715,907.11	264,218,116.77
利率敏感度缺口	1,722,035,726.26	6,405,766,872.50	1,588,865,100.05	-	-71,560,689.26	9,788,228,388.07

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	209,451.64	2,570,575.42
	市场利率上升 25 个基点	-209,139.33	-2,565,770.11

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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，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

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 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。

##### 6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 08 月 27 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	471,922,352.37	71.79
	其中: 债券	461,922,352.37	70.27
	资产支持证券	10,000,000.00	1.52
2	买入返售金融资产	45,045,187.57	6.85
	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	134,916,472.83	20.52
4	其他各项资产	5,456,790.02	0.83
5	合计	657,340,802.79	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	3.69	
	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	115,279,742.36	21.29
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2018 年 6 月 26 日	32.12	产品遭遇巨额赎回	10 个工作日
2	2018 年 6 月 27 日	33.51	产品遭遇巨额赎回	10 个工作日
3	2018 年 6 月 28 日	25.47	产品遭遇巨额赎回	10 个工作日

4	2018 年 6 月 29 日	21.29	产品遭遇巨额赎回	10 个工作日
---	-----------------	-------	----------	---------

### 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	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	67
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	20

#### 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	30.46	21.29
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	64.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	21.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		120.39	21.29

#### 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	114,993,910.03	21.24
	其中：政策性金融债	114,993,910.03	21.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,001,250.91	11.08
6	中期票据	-	-
7	同业存单	286,927,191.43	52.99
8	其他	-	-
9	合计	461,922,352.37	85.31
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	111810238	18 兴业银行 CD238	1,000,000	99,390,703.57	18.36
2	150418	15 农发 18	500,000	49,990,388.28	9.23
3	111806142	18 交通银行 CD142	500,000	49,695,220.88	9.18
4	111898031	18 南京银行 CD079	500,000	49,645,715.66	9.17
5	111892949	18 厦门国际银行 CD028	500,000	48,948,888.69	9.04
6	170207	17 国开 07	350,000	35,000,447.98	6.46
7	170410	17 农发 10	300,000	30,003,073.77	5.54
8	011800349	18 比亚迪 SCP001	200,000	20,000,452.25	3.69
9	011800730	18 海国鑫泰 SCP002	200,000	20,000,441.59	3.69
10	011800938	18 中航租赁 SCP004	200,000	20,000,357.07	3.69

## 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	0.1309%
报告期内偏离度的最低值	-0.0021%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0222%

### 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	149086	借呗 49A1	100,000	10,000,000.00	1.84

## 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

本组合投资的前十名证券的发行主体之一兴业银行，于 2018 年 4 月 19 日被银保监公开处罚，主要违法违规事实包括：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。中国银行保险监督管理委员会决定罚款兴业银行 5870 万元。

本组合投资的前十名证券的发行主体之一南京银行于 2018 年 1 月 9 日被中国银行业监督管理

委员会江苏监管局处以行政处罚（苏银监罚决字【2018】1号），对南京银行镇江分行违规办理票据业务违反审慎经营原则的行为罚款 3230 万元人民币。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有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	-
3	应收利息	5,456,789.02
4	应收申购款	1.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,456,790.02

### 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

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
平安大华交易型货币市场 A 级	555	413,997.73	213,512,309.25	92.92%	16,256,433.28	7.08%
平安大华交易型货币市场 E 级	1,249	2,495.73	1,071,155.72	34.36%	2,046,013.10	65.64%
合计	1,804	129,094.19	214,583,464.97	92.14%	18,302,446.38	7.86%

上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。“持有份额”包含未结转的未付收益。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

平安大华交易型货币市场 E 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海艾方资产管理有限公司—艾方锐进多空 1 号投资基金	222,013.36	7.12%
2	深圳平安大华汇通财富管理有限公司	168,844.05	5.42%
3	上海艾方资产管理有限公司—艾方江苏量化混合策略子基金 13 号私募证券投资基金	76,047.17	2.44%
4	深圳市思道科投资有限公司—深圳市思道科投资有限公司现金 2 号私募投资基金	70,055.07	2.25%

5	太平资管—建设银行—太平资产 量化 7 号资管产品	66,949.13	2.15%
6	陈誉涛	57,933.03	1.86%
7	范凌燕	53,432.23	1.71%
8	广东逸信基金管理有限公司—逸 信富利 5 号私募基金	48,362.70	1.55%
9	刘红军	46,454.73	1.49%
10	陈健	46,120.10	1.48%

本基金 E 类份额（场内货币）为上市份额，“上市总份额”和“份额”包含未结转的未付收益，“占上市总份额的比例”计算中，分母使用本基金 E 类份额总额。

### 8.3 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）	占总份额比例
1	基金类机构	50,337,825.56	21.61
2	券商类机构	50,005,880.69	21.47
3	基金类机构	36,027,507.30	15.47
4	基金类机构	15,140,518.89	6.50
5	保险类机构	10,724,233.48	4.60
6	券商类机构	10,057,527.50	4.32
7	基金类机构	10,032,708.15	4.31
8	银行类机构	10,031,554.74	4.31
9	银行类机构	10,026,539.61	4.31
10	券商类机构	5,542,092.92	2.38

上述“持有份额”包含未结转的未付收益，“持有份额占总份额的比例”的计算中，分母采用本基金下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 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	平安大华交 易型货币市 场 A 级	40,220.90	0.0175%
	平安大华交 易型货币市 场 E 级	-	-
	合计	40,220.90	0.0173%

基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用

各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.5 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安大华交易型货币市场 A 级	0
	平安大华交易型货币市场 E 级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安大华交易型货币市场 A 级	0
	平安大华交易型货币市场 E 级	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	平安大华交易型货币市场 A 级	平安大华交易型货币市场 E 级
基金合同生效日（2016 年 9 月 23 日）基金份额总额	205,870,400.09	13,846,570.00
本报告期期初基金份额总额	9,325,556,678.71	4,626,717.09
本报告期基金总申购份额	3,600,509,504.96	22,474,598.34
减：本报告期基金总赎回份额	12,696,297,441.14	23,984,146.61
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	229,768,742.53	3,117,168.82

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。



## § 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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，本基金管理人、本基金托管人的托管业务部门及其相关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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
国泰君安	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。

### 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
国泰君安	-	-	540,000,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内本基金偏离度绝对值未出现超过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	平安大华交易型货币市场基金 2017 年第 4 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 1 月 19 日
2	平安大华交易型货币市场基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 1 月 30 日
3	平安大华交易型货币市场基金 2018 年春节前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 2 月 10 日
4	关于平安大华交易型货币市场基金修改基金合同的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 3 月 24 日
5	平安大华交易型货币市场基金	公司网站、证券时报、上海	2018 年 3 月 29 日

	2017 年年度报告及摘要	证券报	日
6	平安大华交易型货币市场基金 2018 年清明节前暂停申购、转换 转入及定期定额投资业务的公 告	公司网站、证券时报、上海 证券报	2018 年 3 月 30 日
7	平安大华交易型货币市场基金 2018 年第 1 季度报告	公司网站、证券时报、上海 证券报	2018 年 4 月 20 日
8	平安大华交易型货币市场基金 2018 年劳动节前暂停申购、转换 转入及定期定额投资业务的公 告	公司网站、证券时报、上海 证券报	2018 年 4 月 25 日
9	平安大华交易型货币市场基金 招募说明书更新（2018 年第 1 期）以及摘要	公司网站、证券时报、上海 证券报	2018 年 5 月 5 日
10	平安大华交易型货币市场基金 调整大额申购、定期定额投资及 转换转入业务限制的公告	公司网站、证券时报、上海 证券报	2018 年 5 月 7 日
11	关于旗下部分基金新增万和证 券股份有限公司为销售机构公 告	公司网站、证券时报、上海 证券报	2018 年 5 月 29 日
12	平安大华基金管理有限公司关于 调整货币基金快速赎回业务 限额的提示性公告	公司网站、证券时报、上海 证券报	2018 年 6 月 30 日

## § 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	20180101-20180305	9,256,748,671.08	45,109,021.36	9,301,857,692.44	0.00	0.00%
	2	20180411-20180415	0.00	403,481,253.85	403,481,253.85	0.00	0.00%
	3	20180413-20180625	0.00	355,972,848.39	355,972,848.39	0.00	0.00%
	4	20180626-20180627	0.00	251,542,092.92	246,000,000.00	5,542,092.92	2.38%
	5	20180626-20180627	0.00	50,337,825.56	0.00	50,337,825.56	21.61%
	6	20180629-20180630	0.00	50,337,825.56	0.00	50,337,825.56	21.61%
	7	20180629-20180630	0.00	250,378,099.94	200,372,219.25	50,005,880.69	21.47%

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

“期初份额”和“持有份额”包含未结转的未付收益，“申购份额”包含红利再投所得份额，“赎回份额”包含赎回带走的未付收益。

上述“份额占比”的计算中，分母采用本基金下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华交易型货币市场基金的文件；
- 2、平安大华交易型货币市场基金基金合同；
- 3、平安大华交易型货币市场基金托管协议；
- 4、平安大华交易型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、报告期内平安大华交易型货币市场基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 12.3 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

2018 年 8 月 27 日