

平安日增利货币市场基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
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
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况.....	61
8.2 债券回购融资情况.....	61
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	62
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	63

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	64
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
8.9 投资组合报告附注	66
§9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.4 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的情况	70
§10 开放式基金份额变动	71
§11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	73
11.9 其他重大事件	73
§12 影响投资者决策的其他重要信息	78
12.1 影响投资者决策的其他重要信息	78
§13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安日增利货币市场基金
基金简称	平安日增利货币
场内简称	-
基金主代码	000379
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 3 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	149,573,457,021.39 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，本基金的风险和预期收益低于

	股票型基金、混合型基金、债券型基金。
--	--------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	Lishuaishuai130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 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	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		518048	518001
法定代表人		罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层
--------	------------	------------------------------------

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	5,772,646,562.60	3,175,594,212.72	960,775,958.68
本期利润	5,772,646,562.60	3,175,594,212.72	960,775,958.68
本期净值收益率	3.6758%	3.7929%	2.5646%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末基金资产净值	149,573,457,021.39	115,083,667,635.44	49,997,751,000.87
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
累计净值收益率	20.6806%	16.4018%	12.1482%

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

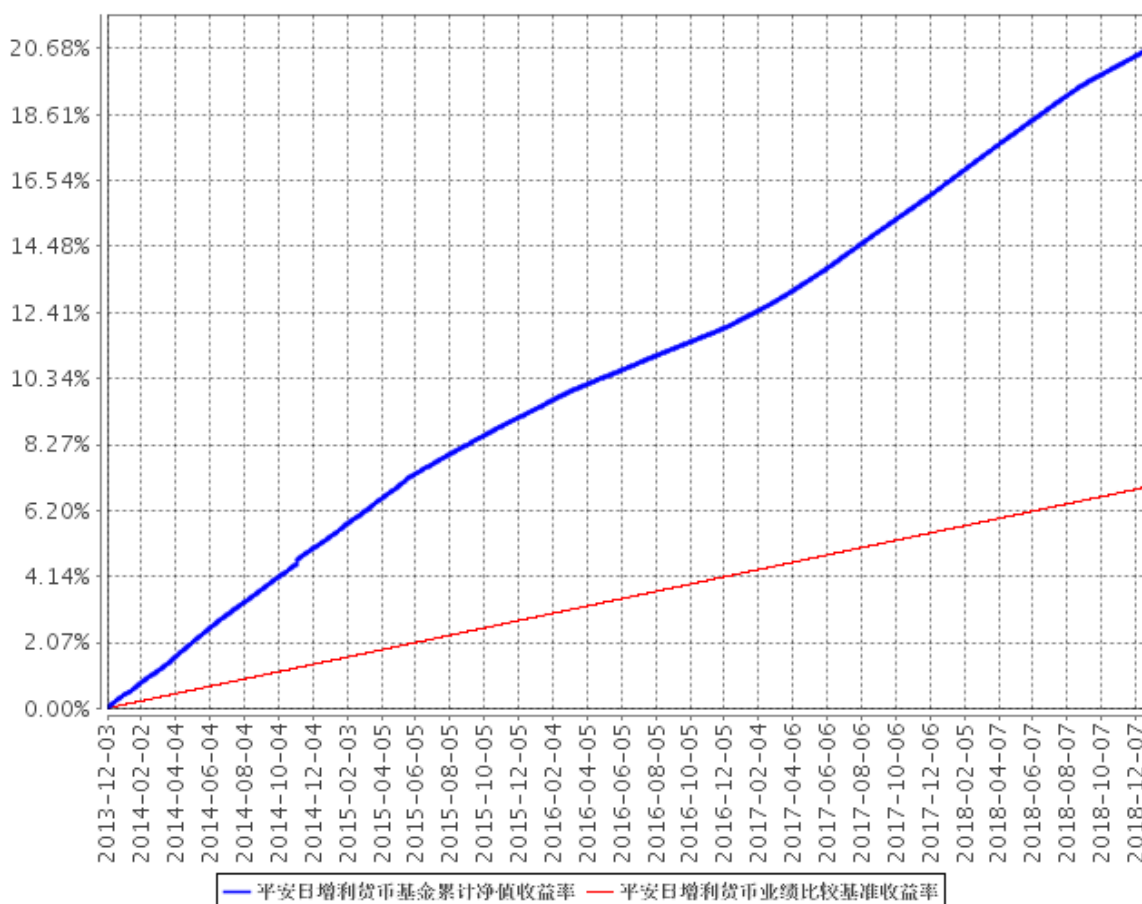
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7361%	0.0007%	0.3450%	0.0000%	0.3911%	0.0007%
过去六个月	1.6421%	0.0012%	0.6900%	0.0000%	0.9521%	0.0012%
过去一年	3.6758%	0.0014%	1.3688%	0.0000%	2.3070%	0.0014%
过去三年	10.3678%	0.0019%	4.1100%	0.0000%	6.2578%	0.0019%
过去五年	20.1924%	0.0036%	6.8475%	0.0000%	13.3449%	0.0036%
自基金合同 生效起至今	20.6806%	0.0036%	6.9563%	0.0000%	13.7243%	0.0036%

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

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

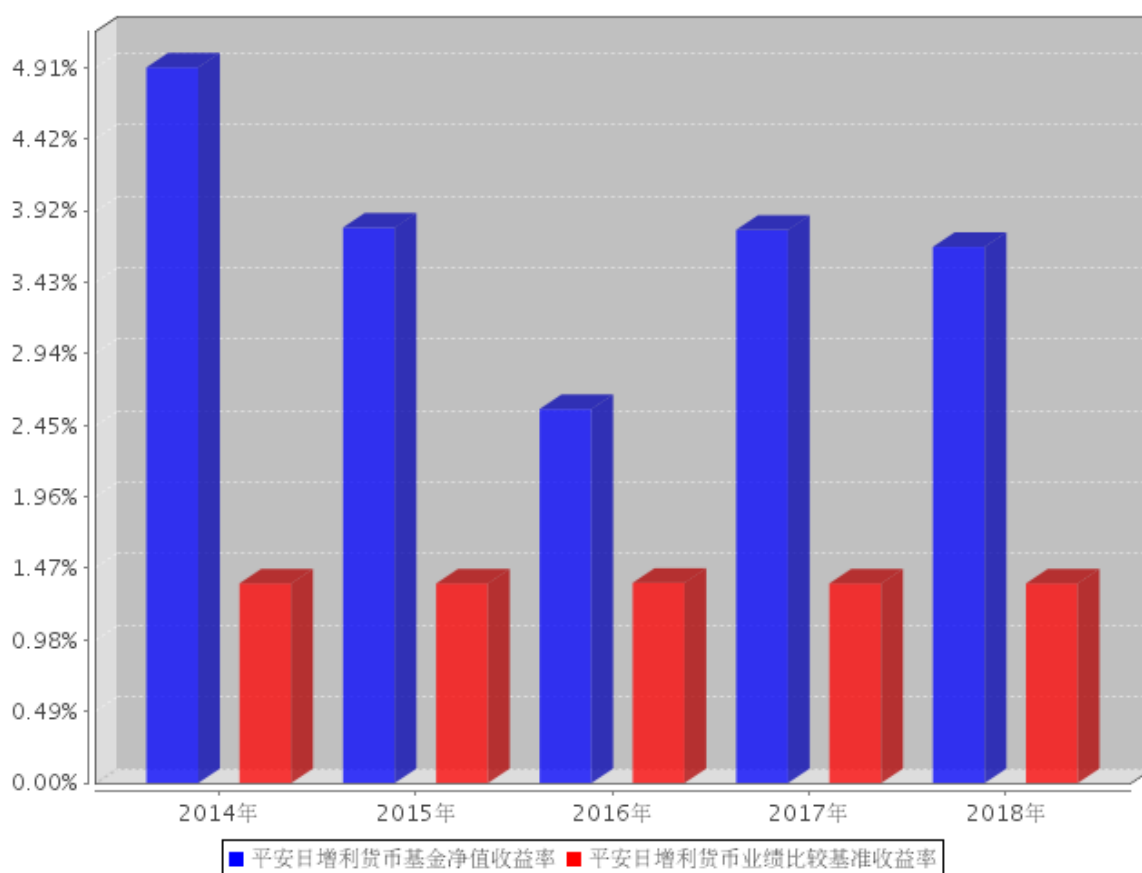
平安日增利货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效，截至报告期已满五年；
- 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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安日增利货币过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



1. 本基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效，截止报告期末已满五年。
2. 2013 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	5,775,127,065.91	-	-2,480,503.31	5,772,646,562.60	
2017	3,166,445,180.65	-	9,149,032.07	3,175,594,212.72	
2016	958,368,622.21	-	2,407,336.47	960,775,958.68	
合计	9,899,940,868.77	-	9,075,865.23	9,909,016,734.00	

§ 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

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股权 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2018 年 12 月 31 日，平安基金共管理 66 只公募基金，资产管理总规模 2879 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申俊华	平安日增利货币市场基金基金经理	2017 年 12 月 5 日	-	10	申俊华女士，湖南大学金融学博士。曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员。2012 年加入平安基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员。现担任平安财富宝货币市场基金、平安日增利货币市场基金基金经理。
周琛	平安日增利货币市	2017 年 12 月 1 日	-	10	周琛女士，拉夫堡大学硕士。先后担

	场基金基金 基金经理				任五矿证券有限公司助理研究员、交易员。2012 年 8 月加入平安基金管理有限公司，曾任基金运营部交易岗、投资研究部固定收益研究员。现任平安财富宝货币市场基金、平安日增利货币市场基金、平安合悦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。
张文平	固定收益 投资中心 投资执行 总经理、 平安日增 利货币市 场基金的 基金经理	2018 年 8 月 10 日	-	7	张文平先生，南京大学硕士。先后担任毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。2018 年 3 月加入平安基金管理有限公司，现任固定收益投资中心投资执行总经理。同时担任

					平安短债债券型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠轩纯债债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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、《平安日增利货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易管理制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控及报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年以金融去杠杆和地方政府债务管控开局，社融增速、基建投资增速下行贯穿全年，叠加中美贸易摩擦制约风险偏好，债市持续走强；年中经济压力增大，货币政策转向托底，这进一步支撑债市收益率下行。整体而言，债牛行情贯穿全年。报告期内，本基金的投资操作以流动性管理为基础原则，适当保持杠杆比例，适当拉长组合剩余期限，调整大类资产的配置比例，使得基金净值保持了稳步增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 3.6758%，业绩比较基准收益率为 1.3688%。

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 2019 年，受益于基本面下行、通缩风险再现、货币宽松加码、美国加息周期进入尾声，债市依旧向好。但是，宽信用政策持续推进、专项债加速发行、社融增速有望见底回升、权益市场企稳等，可能导致市场预期出现摇摆。全年债市收益率中枢有望再下台阶，但不会顺畅，可能持续反复。本基金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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人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工作组，由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值工作组的相关人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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金基金合同的规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人，并按照自然日结转至基金份额持有人的基金账户。本报告期内应分配收益 5,772,646,562.60 元，实际分配收益 5,772,646,562.60 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 23301 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安日增利货币市场基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了平安日增利货币基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度 的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安日增利货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	平安日增利货币基金的基金管理人平安基金管理有限公司（原平安大华基金管理有限公司，以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安日增利货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算平安日增利货币基

	<p>金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安日增利货币基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对平安日增利货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安日增利货币基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计</p>

	发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	曹翠丽	陈怡
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2019 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安日增利货币市场基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	75,410,649,147.60	70,054,803,092.76
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	70,316,337,408.28	37,798,215,690.92
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		68,424,677,770.90	37,655,289,486.60
资产支持证券投资		1,891,659,637.38	142,926,204.32
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	12,237,343,516.07	6,559,780,109.67
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	777,069,603.71	673,313,403.34
应收股利		-	-
应收申购款		2,890,984.78	105,904,409.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		158,744,290,660.44	115,192,016,706.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		8,989,550,285.70	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		40,087,336.19	-
应付管理人报酬		45,650,167.81	33,500,002.81
应付托管费		11,066,707.36	8,121,212.81
应付销售服务费		34,583,460.42	25,378,790.00
应付交易费用	7.4.7.7	726,126.83	221,728.77
应交税费		991,820.35	-
应付利息		9,422,901.10	-
应付利润		11,195,428.25	13,675,931.56
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	27,559,405.04	27,451,405.04
负债合计		9,170,833,639.05	108,349,070.99
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	149,573,457,021.39	115,083,667,635.44
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		149,573,457,021.39	115,083,667,635.44
负债和所有者权益总计		158,744,290,660.44	115,192,016,706.43

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额 1.0000 元，基金份额总额 149,573,457,021.39 份。

7.2 利润表

会计主体：平安日增利货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日至	2017 年 1 月 1 日至

		2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
一、收入		6,975,027,809.35	3,736,357,409.24
1. 利息收入		6,947,703,847.57	3,739,528,077.99
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,984,318,002.91	2,624,281,825.81
债券利息收入		2,589,168,044.02	899,311,889.66
资产支持证券利息收入		27,587,920.36	20,824,197.33
买入返售金融资产收入		346,629,880.28	195,110,165.19
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,291,047.65	-3,249,244.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	27,291,047.65	-3,249,244.52
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	32,914.13	78,575.77
减：二、费用		1,202,381,246.75	560,763,196.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	530,367,682.19	274,381,098.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	128,573,983.55	66,516,629.82
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	401,793,698.52	207,864,468.38
4. 交易费用	7.4.7.19	2,888.33	1,167.50
5. 利息支出		139,612,280.91	11,399,432.52
其中：卖出回购金融资产支出		139,612,280.91	11,399,432.52
6. 税金及附加		1,423,313.25	-
7. 其他费用	7.4.7.20	607,400.00	600,400.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,772,646,562.60	3,175,594,212.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,772,646,562.60	3,175,594,212.72

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安日增利货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	115,083,667,635.44	-	115,083,667,635.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,772,646,562.60	5,772,646,562.60
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）	34,489,789,385.95	-	34,489,789,385.95
其中：1. 基金申购款	966,155,947,528.44	-	966,155,947,528.44
2. 基金赎回款	-931,666,158,142.49	-	-931,666,158,142.49
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）	-	-5,772,646,562.60	-5,772,646,562.60

五、期末所有者权益（基金净值）	149,573,457,021.39	-	149,573,457,021.39
项目	上年度可比期间		
	2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	49,997,751,000.87	-	49,997,751,000.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,175,594,212.72	3,175,594,212.72
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）	65,085,916,634.57	-	65,085,916,634.57
其中：1. 基金申购款	865,610,852,676.47	-	865,610,852,676.47
2. 基金赎回款	-800,524,936,041.90	-	-800,524,936,041.90
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）	-	-3,175,594,212.72	-3,175,594,212.72
五、期末所有者权益（基金净值）	115,083,667,635.44	-	115,083,667,635.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安日增利货币市场基金(原名为平安大华日增利货币市场基金,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[2013]1211号文核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于2018年10月25日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华日增利货币市场基金基金合同》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525,508,703.96元,业经安永华明会计师事务所安永华明(2013)验字第60937497_H01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华日增利货币市场基金基金合同》于2013年12月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为525,531,640.49份基金份额,其中认购资金利息折合22,936.53份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华日增利货币市场基金于2018年11月30日起更名为平安日增利货币市场基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安日增利货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金,期限一年以内(含一年)的银行存款、同业存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:税后同期七天通知存款利率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安日增利货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其

剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。(2) 本基金收益分配方式约定为红利再投资，不收取再投资费用。(3) “每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益。(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除。(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的分配权益。(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所

上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
活期存款	30,649,147.60	119,803,092.76
定期存款	75,380,000,000.00	69,935,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	1,500,000,000.00	1,000,000,000.00
存款期限 1-3 个月	2,600,000,000.00	10,820,000,000.00
存款期限 3 个月以上	71,280,000,000.00	58,115,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	75,410,649,147.60	70,054,803,092.76

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2018 年 12 月 31 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	68,424,677,770.90	68,552,085,405.04	127,407,634.14	0.0852%
	合计	68,424,677,770.90	68,552,085,405.04	127,407,634.14	0.0852%
资产支持证券	1,891,659,637.38	1,891,659,637.38	-	0.0000%	
合计	70,316,337,408.28	70,443,745,042.42	127,407,634.14	0.0852%	
项目	上年度末				
	2017 年 12 月 31 日				

		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	37,655,289,486.60	37,646,345,805.04	-8,943,681.56	-0.0078%
	合计	37,655,289,486.60	37,646,345,805.04	-8,943,681.56	-0.0078%
资产支持证券		142,926,204.32	142,904,000.00	-22,204.32	0.0000%
合计		37,798,215,690.92	37,789,249,805.04	-8,965,885.88	-0.0078%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	12,237,343,516.07	-
合计	12,237,343,516.07	-
项目	上年度末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	6,559,780,109.67	-
合计	6,559,780,109.67	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	86,815.63	68,169.21
应收定期存款利息	416,334,664.57	424,050,003.58
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	301,911,324.23	237,344,962.02
应收资产支持证券利息	32,703,138.47	1,574,445.86
应收买入返售证券利息	26,033,660.81	10,275,822.67
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	777,069,603.71	673,313,403.34

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	726,126.83	221,728.77
合计	726,126.83	221,728.77

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,000.00	-
预提费用	579,000.00	472,000.00
应付管理人款	26,979,405.04	26,979,405.04
合计	27,559,405.04	27,451,405.04

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	115,083,667,635.44	115,083,667,635.44
本期申购	966,155,947,528.44	966,155,947,528.44
本期赎回(以“-”号填列)	-931,666,158,142.49	-931,666,158,142.49
- 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	149,573,457,021.39	149,573,457,021.39

注：申购含红利再投份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	5,772,646,562.60	-	5,772,646,562.60

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	-5,772,646,562.60	-	-5,772,646,562.60
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	4,511,472.88	6,721,033.96
定期存款利息收入	3,979,315,167.97	2,614,513,153.10
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	133,674.11	21,214.75
其他	357,687.95	3,026,424.00
合计	3,984,318,002.91	2,624,281,825.81

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债	27,291,047.65	-3,249,244.52

券（、债转股及债券到期兑付）差价收入		
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	27,291,047.65	-3,249,244.52

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	173,535,638,715.02	38,861,439,805.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	172,805,023,916.05	38,626,894,194.04
减：应收利息总额	703,323,751.32	237,794,856.18
买卖债券差价收入	27,291,047.65	-3,249,244.52

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末及上年度末均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末及上年度末均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

卖出资产支持证券成交总额	1,771,418,395.12	872,819,223.86
减：卖出资产支持证券成本总额	1,695,934,000.00	856,066,000.00
减：应收利息总额	75,484,395.12	16,753,223.86
资产支持证券投资收益	-	-

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无公允价值变动损益。

7.4.7.18 其他收入

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 12月31日	2017年1月1日至2017年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	875.00	972.22
违约金收入	32,039.13	77,603.55
合计	32,914.13	78,575.77

7.4.7.19 交易费用

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 12月31日	2017年1月1日至2017年12 月31日
交易所市场交易费用	441.80	-
银行间市场交易费用	2,446.53	1,167.50
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	2,888.33	1,167.50

7.4.7.20 其他费用

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12月31日	2017年1月1日至2017年 12月31日
审计费用	180,000.00	173,000.00
信息披露费	390,000.00	390,000.00
其他	1,400.00	1,400.00

账户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	607,400.00	600,400.00

7.4.7.21 分部报告

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

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司（“平安大华汇通”）	基金管理人的子公司
深圳平安汇通初创投资管理有限公司（“平安汇通初创”）	基金管理人的子公司的合营企业
深圳鑫橙投资管理有限公司（“深圳鑫橙”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”）	基金管理人的最终控股母公司

深圳平安综合金融服务有限公司（“平安综合金融”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安金融科技咨询有限公司（“平安金融科技”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安国际融资租赁有限公司（“平安国际租赁”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳万里通网络信息技术有限公司（“万里通”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安不动产有限公司（“平安不动产”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
北京车之家信息技术有限公司（“车之家”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安付科技服务有限公司（“平安付”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安普惠融资担保有限公司（“普惠融资”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳联新投资管理有限公司（“深圳联新”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安通信科技有限公司（“平安通信”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳前海普惠众筹交易股份有限公司（“前海普惠众筹”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 的 联营公司
深圳前海征信中心股份有限公司（“前海征信中心”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳市平安赢致投资基金管理有限公司（“平安赢致投资”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
上海陆金所基金销售有限公司（“陆金所”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
大华银行有限公司（“大华银行”）	基金管理人的股东的实际控制人、基金销售机构

广州平安好贷小额贷款有限公司（“平安好贷”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安科技(深圳)有限公司（“平安科技”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安直通咨询有限公司（“平安直通咨询”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
上海友玩网络科技有限公司（“友玩网络”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳鑫植网络科技有限公司（“深圳鑫植”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的 联营公司
深圳壹帐通科技服务有限公司（“壹帐通科技”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的 联营公司
深圳壹帐通智能科技有限公司（“壹帐通智能科技”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的 联营公司
珠海亿融通资产管理有限公司（“珠海亿融通”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的 联营公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内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。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内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。

7.4.10.1.5 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均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	530,367,682.19	274,381,098.30
其中：支付销售机构的客户维护费	4,288,927.87	2,017,509.44

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	128,573,983.55	66,516,629.82

注：支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.08% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

平安银行	3,579,850.97
大华银行	417.24
平安基金	393,160,949.84
平安证券	72,782.57
合计	396,814,000.62
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
平安证券	214,315.08
平安银行	2,654,202.62
平安基金	204,161,291.00
合计	207,029,808.70

支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安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×0.25%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年12月31日						
银行间市场交 易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收入	交易金额	利息支出
平安集团	-	-	-	-	298,350,000.00	781,595.26
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场交 易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收入	交易金额	利息支出
平安集团	-	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2013 年 12 月 3 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	8.68	0.00
期间申购/买入总份额	422,050,033.61	120,047.75
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	195,000,008.69	120,039.07
期末持有的基金份额	227,050,033.60	8.68
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1518%	0.0000%

1、期间申购\买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回\卖出总份额含转出总份额。

2、基金管理人 平安基金在本年度申购/赎回本基金的交易委托平安基金直销柜台办理，使用费率为 0%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2018 年 12 月 31 日		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
车之家	120,059.11	0.0001%	628,601.87	0.0006%
平安好贷	30,038,811.34	0.0201%	0.00	0.0000%
平安不动产	1,000,000,000.00	0.6686%	503,037,138.20	0.4371%
平安付	171,204,266.76	0.1145%	123,130,336.57	0.1070%

平安国际租赁	0.00	0.0000%	300,000,000.00	0.2607%
平安科技	2,338,281.08	0.0016%	53,976,289.83	0.0469%
普惠融资	0.00	0.0000%	624,470.97	0.0005%
平安直通咨询	17,166,852.10	0.0115%	0.00	0.0000%
友玩网络	10,011,390.57	0.0067%	0.00	0.0000%
深圳联新	0.00	0.0000%	3,189,071.63	0.0028%
平安大华汇通	607,000,693.37	0.4058%	312,904,600.86	0.2719%
平安汇通初创	1,530,488.27	0.0010%	0.00	0.0000%
平安金融科技	1,004,669,956.23	0.6717%	0.00	0.0000%
平安通信	0.00	0.0000%	17,598.13	0.0000%
平安综合金融	255,202,254.14	0.1706%	492,688,792.62	0.4281%
前海普惠众筹	0.00	0.0000%	3,732,338.91	0.0032%
前海征信中心	4,046,038.10	0.0027%	56,439,929.80	0.0490%
平安赢致投资	5,066,052.03	0.0034%	4,878,424.45	0.0042%
万里通	0.00	0.0000%	155,929,067.22	0.1355%
深圳鑫橙	20,405,465.47	0.0136%	0.00	0.0000%
深圳鑫植	13,731,144.36	0.0092%	0.00	0.0000%
壹账通科技	21,330,401.23	0.0143%	0.00	0.0000%
壹账通智能科技	10,006,569.29	0.0067%	0.00	0.0000%
珠海亿融通	33,290,528.36	0.0223%	0.00	0.0000%
大华银行	90,640,799.56	0.0606%	87,422,596.09	0.0760%
平安人寿	3,018,774.22	0.0020%	2,906,970.02	0.0025%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

平安银行-活期	30,649,147.60	4,511,472.88	119,803,092.76	6,721,033.96
平安银行-定期	1,000,000,000.00	321,673,700.34	5,200,000,000.00	176,630,875.12
合计	1,030,649,147.60	326,185,173.22	5,319,803,092.76	183,351,909.08

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有 20,300,000 张平安银行的同业存单，成本总额为人民币 2,006,158,046.24 元，估值总额为人民币 2,007,404,000.00 元，占基金资产净值的比例为 1.34%(2017 年 12 月 31 日：无)。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收 基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
5,775,127,065.91	-	-2,480,503.31	5,772,646,562.60	-

注：本基金在本年度累计分配收益 5,772,646,562.60 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 5,761,451,134.35 元，无包含于赎回款的已分配未支付收益，计入应付收益科目 11,195,428.25 元。

7.4.12 (2018 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购/增发而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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 8,989,550,285.7 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111804046	18 中国银 行 CD046	2019 年 1 月 2 日	98.31	5,555,000	546,089,191.40
111808295	18 中信银 行 CD295	2019 年 1 月 2 日	97.83	3,261,000	319,036,866.41
111810513	18 兴业银 行 CD513	2019 年 1 月 2 日	98.07	112,000	10,983,514.81
111810554	18 兴业银 行 CD554	2019 年 1 月 2 日	97.86	5,556,000	543,685,028.56
111812184	18 北京银 行 CD184	2019 年 1 月 2 日	98.47	207,000	20,383,063.45
111815565	18 民生银 行 CD565	2019 年 1 月 2 日	98.00	672,000	65,859,218.29
111884861	18 长沙银 行 CD171	2019 年 1 月 2 日	98.41	2,110,000	207,654,371.96
120221	12 国开 21	2019 年 1 月 2 日	100.39	300,000	30,115,604.90
140209	14 国开 09	2019 年 1 月 2 日	100.50	1,900,000	190,941,667.20
140418	14 农发 18	2019 年 1 月 2 日	100.55	800,000	80,436,227.58
140422	14 农发 22	2019 年 1 月 2 日	100.32	1,000,000	100,319,781.92
160202	16 国开 02	2019 年 1 月 2 日	99.98	1,000,000	99,981,654.48
160402	16 农发 02	2019 年 1 月 2 日	100.01	200,000	20,001,156.19
160415	16 农发	2019 年 1 月	99.88	2,300,000	229,716,659.97

	15	2 日			
180003	18 付息国 债 03	2019 年 1 月 2 日	100.03	300,000	30,010,201.73
180201	18 国开 01	2019 年 1 月 2 日	100.03	8,719,000	872,161,091.19
180207	18 国开 07	2019 年 1 月 2 日	99.99	5,780,000	577,970,519.73
180305	18 进出 05	2019 年 1 月 2 日	99.88	1,400,000	139,833,548.55
111803155	18 农业银 行 CD155	2019 年 1 月 3 日	99.36	4,377,000	434,883,624.40
111821226	18 渤海银 行 CD226	2019 年 1 月 3 日	99.26	1,099,000	109,086,373.07
111883354	18 宁波银 行 CD157	2019 年 1 月 3 日	99.55	316,000	31,456,944.25
111888721	18 宁波银 行 CD229	2019 年 1 月 3 日	99.63	979,000	97,536,000.22
111889253	18 宁波银 行 CD237	2019 年 1 月 3 日	98.75	2,084,000	205,803,107.74
120404	12 农发 04	2019 年 1 月 3 日	100.31	371,000	37,215,702.01
130235	13 国开 35	2019 年 1 月 4 日	99.46	2,180,000	216,812,057.37
180201	18 国开 01	2019 年 1 月 4 日	100.03	815,000	81,524,405.24
180207	18 国开 07	2019 年 1 月 4 日	99.99	9,392,000	939,152,097.11
180209	18 国开 09	2019 年 1 月 4 日	100.10	5,800,000	580,586,476.97

180404	18 农发 04	2019 年 1 月 4 日	100.07	6,568,000	657,227,900.04
111883170	18 中原银 行 CD187	2019 年 1 月 7 日	97.73	1,064,000	103,981,722.69
120231	12 国开 31	2019 年 1 月 7 日	100.43	1,500,000	150,643,108.61
130213	13 国开 13	2019 年 1 月 7 日	100.02	1,500,000	150,030,849.65
130217	13 国开 17	2019 年 1 月 7 日	99.78	1,000,000	99,775,474.97
180404	18 农发 04	2019 年 1 月 7 日	100.07	2,062,000	206,334,337.68
111804095	18 中国银 行 CD095	2019 年 1 月 9 日	99.38	5,555,000	552,067,808.02
111889120	18 宁波银 行 CD235	2019 年 1 月 9 日	99.60	1,342,000	133,668,901.84
180305	18 进出 05	2019 年 1 月 9 日	99.88	2,000,000	199,762,212.21
111807190	18 招商银 行 CD190	2019 年 1 月 10 日	98.18	3,315,000	325,480,544.77
合计				94,491,000	9,398,209,017.18

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通

过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和部分定期存款存放在本基金的托管行平安银行；其他定期存款存放在资信状况良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的资产支持证券余额为 1,891,659,637.38 元，均为长期信用评级 AAA 级(2017 年 12 月 31 日：142,926,204.32 元，均为长期信用评级 AAA 级)。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	830,014,791.43	2,248,954,729.50
A-1 以下	-	-
未评级	9,672,433,492.73	10,663,834,412.81
合计	10,502,448,284.16	12,912,789,142.31

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

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 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 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	55,942,142,569.06	21,931,484,340.18
合计	55,942,142,569.06	21,931,484,340.18

7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,980,086,917.68	2,811,016,004.11
合计	1,980,086,917.68	2,811,016,004.11

注：以上按长期信用评级的债券投资未评级债券为国债和政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	1,891,659,637.38	142,926,204.32
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,891,659,637.38	142,926,204.32

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。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%。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于 2018 年 12 月 31 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 2017 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 8,989,550,285.70 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.2 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。

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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	1,630,649,147.60	45,270,000,000.00	28,510,000,000.00	-	-	-	75,410,649,147.60
交易性金融资产	4,641,480,141.97	29,537,647,981.90	36,137,209,284.41	-	-	-	70,316,337,408.28
买入返售金融资产	12,237,343,516.07	-	-	-	-	-	12,237,343,516.07
应收利息	-	-	-	-	-	777,069,603.71	777,069,603.71
应收申购款	-	-	-	-	-	2,890,984.78	2,890,984.78
资产总计	18,509,472,805.64	74,807,647,981.90	64,647,209,284.41	-	-	779,960,588.49	158,744,290,660.44
负债							
卖出回购金融资产款	8,989,550,285.70	-	-	-	-	-	8,989,550,285.70
应付赎回款	-	-	-	-	-	40,087,336.19	40,087,336.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	45,650,167.81	45,650,167.81
应付托管费	-	-	-	-	-	11,066,707.36	11,066,707.36
应付销售	-	-	-	-	-	34,583,460.42	34,583,460.42

服务费							
应付交易费用						726,126.83	726,126.83
应付利息						9,422,901.10	9,422,901.10
应付利润						11,195,428.25	11,195,428.25
应交税费						991,820.35	991,820.35
其他负债						27,559,405.04	27,559,405.04
负债总计	8,989,550,285.70					181,283,353.35	9,170,833,639.05
利率敏感度缺口	9,519,922,519.94	74,807,647,981.90	64,647,209,284.41			-598,677,235.14	149,573,457,021.39
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	7,519,803,092.76	49,040,000,000.00	13,495,000,000.00				70,054,803,092.76
交易性金融资产	2,754,920,314.73	14,852,640,764.85	20,190,654,611.34				37,798,215,690.92
买入返售金融资产	6,559,780,109.67						6,559,780,109.67
应收利息						673,313,403.34	673,313,403.34
应收申购款						105,904,409.74	105,904,409.74
其他资产							
资产	16,834,503,517.16	63,892,640,764.85	33,685,654,611.34			779,217,813.08	115,192,016,706.43

总计							
负债							
应付管理人报酬						33,500,002.81	33,500,002.81
应付托管费						8,121,212.81	8,121,212.81
应付销售服务费						25,378,790.00	25,378,790.00
应付交易费用						221,728.77	221,728.77
应付利润						13,675,931.56	13,675,931.56
其他负债						27,451,405.04	27,451,405.04
负债总计						-108,349,070.99	108,349,070.99
利率敏感度缺口	16,834,503,517.16	63,892,640,764.85	33,685,654,611.34			-670,868,742.09	115,083,667,635.44

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其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12月31日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	28,610,966.43	29,349,808.60
	市场利率上升 25 个基点	-28,541,223.95	-29,288,619.39

7.4.13.4.2 外汇风险

由于本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 68,424,677,770.90 元，属于第三层次的余额为 1,891,659,637.38 元，无属于第一层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 37,698,215,690.92 元，第三层次 100,000,000.00 元，无第一层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

——资产支持证券投资

2018 年 1 月 1 日 100,000,000.00

购买 3,405,989,703.42

兑付-1,612,558,283.06

转入第三层级-

转出第三层级-

当期利得或损失总额-1,771,782.98

计入损益的利得或损失-1,771,782.98

2018 年 12 月 31 日 1,891,659,637.38

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益-

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

交易性金融资产

——资产支持证券投资

2017 年 1 月 1 日 589,000,000.00

购买 100,000,000.00

兑付-589,000,000.00

转入第三层级-

转出第三层级-

当期利得或损失总额-

计入损益的利得或损失-

2017 年 12 月 31 日 100,000,000.00

2017 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2017 年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益-

于 2017 年 12 月 31 日仍持有的第三层次金融资产中无计入 2017 年度损益的利得。

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

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 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) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	70,316,337,408.28	44.30
	其中：债券	68,424,677,770.90	43.10
	资产支持证券	1,891,659,637.38	1.19
2	买入返售金融资产	12,237,343,516.07	7.71
	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	75,410,649,147.60	47.50
4	其他各项资产	779,960,588.49	0.49
5	合计	158,744,290,660.44	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.81	
	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	8,989,550,285.70	6.01
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

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。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	12.29	6.01
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.24	-
2	30 天(含)—60 天	10.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	39.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	5.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	37.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.61	6.01

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	99,994,058.04	0.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,902,271,235.42	5.95
	其中：政策性金融债	8,902,271,235.42	5.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,480,269,908.38	2.33
6	中期票据	-	-
7	同业存单	55,942,142,569.06	37.40
8	其他	-	-
9	合计	68,424,677,770.90	45.75
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	358,358,662.66	0.24

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值 比例 (%)
1	180207	18 国开 07	22,100,000	2,209,887,281.31	1.48
2	180404	18 农发 04	19,300,000	1,931,257,379.83	1.29
3	180201	18 国开 01	15,600,000	1,560,467,143.32	1.04
4	111816367	18 上海银行 CD367	15,000,000	1,491,769,863.39	1.00
5	111816378	18 上海银行 CD378	14,000,000	1,391,293,034.54	0.93

6	111817242	18 光大银行 CD242	12,000,000	1,192,582,975.77	0.80
7	111811327	18 平安银行 CD327	10,000,000	995,627,190.20	0.67
8	111803221	18 农业银行 CD221	10,000,000	991,845,017.02	0.66
9	111809427	18 浦发银行 CD427	10,000,000	991,474,749.62	0.66
10	111810554	18 兴业银行 CD554	10,000,000	978,554,767.03	0.65

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.2080%
报告期内偏离度的最低值	0.0330%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0906%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	149920	18 花呗 6A	2,300,000	230,000,000.00	0.15
2	156081	18 建花 3A	1,600,000	160,000,000.00	0.11
3	149808	借呗 55A1	1,400,000	140,483,956.07	0.09

4	149380	18 花 06A1	1,200,000	120,000,000.00	0.08
5	139275	蚁信 06A	1,100,000	110,000,000.00	0.07
6	149448	18 花呗 2A	1,000,000	100,831,174.45	0.07
7	156126	国花 01A	1,000,000	100,000,000.00	0.07
8	156087	花呗 66A1	900,000	90,000,000.00	0.06
9	139248	万科 26A1	800,000	80,074,248.12	0.05
10	149086	借呗 49A1	750,000	75,474,248.69	0.05
11	116909	深借呗 1A	700,000	70,639,597.62	0.05
12	116904	万科优 02	540,000	54,481,576.82	0.04
13	139027	万科优 08	500,000	50,327,090.98	0.03
14	116832	信融 01 优	500,000	50,180,365.56	0.03
15	149251	花呗 56A1	450,000	45,385,329.57	0.03
16	149127	18 花 01A1	400,000	40,297,619.42	0.03
17	139261	万科 29A1	400,000	40,035,450.83	0.03
18	149864	18 花 15A1	400,000	40,000,000.00	0.03
19	149246	18 花 05A1	300,000	30,237,554.63	0.02
20	156076	金地 04A	300,000	30,019,817.05	0.02
21	149588	18 花 11A1	300,000	30,000,000.00	0.02
21	139183	蚁信 05A	300,000	30,000,000.00	0.02
21	149787	18 花呗 5A	300,000	30,000,000.00	0.02
22	139065	万科优 09	200,000	20,064,841.65	0.01
23	139070	万科优 10	200,000	20,049,575.63	0.01
24	156167	18 信易 2	200,000	20,000,000.00	0.01
24	139211	信融 03 优	200,000	20,000,000.00	0.01
24	156084	花呗 63A1	200,000	20,000,000.00	0.01
25	139239	18TCL01A	150,000	15,000,000.00	0.01
26	139059	万科 22A1	100,000	10,031,126.94	0.01
27	156376	18 信易 3	100,000	10,000,000.00	0.01
28	139071	万科 23A1	50,000	5,015,174.93	0.00

29	149138	18 花 04A1	30,000	3,030,888.42	0.00
----	--------	-----------	--------	--------------	------

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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。

8.9.2

银保监会于 2018 年 11 月 9 日做出银保监银罚决字〔2018〕10 号处罚决定，由于中国光大银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）以误导方式违规销售理财产品；（三）以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品；（四）违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务；（五）同业投资违规接受担保；（六）通过同业投资或贷款虚增存款规模。根据相关规定对公司没收违法所得 100 万元，罚款 1020 万元，合计 1120 万元。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力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。

银监会于 2018 年 2 月 12 日做出银监罚决字〔2018〕4 号处罚决定，由于上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；（三）通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；（四）理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；（五）提供不实说明材料、不配合调查取证；（六）以贷转存，虚增存贷款；（七）票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；（八）国内信用证业务贸易背景审查不严；（九）贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款；（十）违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；（十一）票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；（十二）对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；（十三）以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；（十四）投资多款同业理财产品未尽审查，涉及金额较大；（十五）修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；（十六）为非保本理财产品出具保本承诺函；（十七）向关系人发放信用贷款；（十八）向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；（十九）收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本。根据相关规定对公司罚款 5845 万

元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。2018 年 1 月 18 日，银监会四川监管局对公司成都分行作出行政处罚决定，对成都分行内控管理严重失效、授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款 46,175 万元人民币。上海浦东发展银行股份有限公司于 2018 年 7 月 26 日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字（2018 年）3 号）。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为以上事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力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。

银保监会于 2018 年 4 月 19 日做出银保监银罚决字（2018）1 号处罚决定，由于兴业银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（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。根据相关规定对公司罚款 5870 万元。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力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七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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	777,069,603.71
4	应收申购款	2,890,984.78
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	779,960,588.49

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
29,546,598	5,062.29	26,926,816,964.60	18.00%	122,646,640,056.79	82.00%

9.2 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）	占总份额比例
1	银行类机构	3,722,902,424.33	2.49%
2	银行类机构	1,206,316,796.06	0.81%
3	银行类机构	1,049,709,839.49	0.70%
4	银行类机构	1,012,012,954.28	0.68%
5	银行类机构	1,006,298,160.94	0.67%
6	银行类机构	1,004,722,003.97	0.67%
7	其他机构	1,004,669,956.23	0.67%
8	其他机构	1,000,000,000.00	0.67%
9	银行类机构	810,174,384.52	0.54%
10	银行类机构	806,217,848.53	0.54%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,232,148.02	0.0028%

9.4 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 3 日）基金份额总额	525,531,640.49
本报告期期初基金份额总额	115,083,667,635.44
本报告期期间基金总申购份额	966,155,947,528.44
减:本报告期期间基金总赎回份额	931,666,158,142.49
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	149,573,457,021.39

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 5 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 180,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	

国信证券	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、基金交易单元的选择标准如下：

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	2,410,372,460.52	100.00%	20,269,091,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金新增南京证券为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 1 月 12 日
2	平安日增利货币市场基金招募说明书(更新) 2017 年第 2 期以及摘要	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 1 月 13 日
3	平安日增利货币市场基金 2017 年第 4 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券	2018 年 1 月 19 日

		日报	
4	关于旗下部分基金新增上海攀赢金融信息服务有限公司为销售机构及开通转换业务的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 1 月 25 日
5	关于旗下部分基金在小牛基金销售有限公司开通定投业务的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 1 月 31 日
6	关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 2 月 6 日
7	平安日增利货币市场基金 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、中国证券报、证券日报	2018 年 2 月 10 日
8	关于平安日增利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、中国证券报、证券日报	2018 年 3 月 24 日
9	平安日增利货币市场基金 2017 年年度报告以及摘要	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 3 月 29 日
10	平安日增利货币市场基金 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、中国证券报、证券日报	2018 年 3 月 30 日
11	关于旗下部分基金新增中民财富基金销售（上海）有限公司为销售机构公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 3 月 30 日
12	关于旗下部分基金新增海银基金为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 4 月 16 日

13	平安日增利货币市场基金 2018 年 1 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 4 月 20 日
14	平安日增利货币市场基金 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、中国证券报、证券日报	2018 年 4 月 25 日
15	平安日增利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、中国证券报、证券日报	2018 年 5 月 7 日
16	平安日增利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、中国证券报、证券日报	2018 年 5 月 11 日
17	关于平安日增利货币市场基金增加赣州银行为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 5 月 14 日
18	关于平安日增利货币市场基金增加佛山银行为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 5 月 16 日
19	关于旗下部分基金新增上海大智慧基金销售有限公司为销售机构公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 5 月 18 日
20	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、中国证券报、证券日报	2018 年 5 月 29 日
21	关于旗下部分基金新增济安财富（北京）基金销售有限公司为销售机构公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 6 月 13 日
22	平安基金管理有限公司关于调整货币基金快速赎回业务限额	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券	2018 年 6 月 30 日

	的提示性公告	日报	
23	平安日增利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、中国证券报、证券日报	2018 年 7 月 14 日
24	平安日增利货币市场基金 2018 年第 2 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 7 月 18 日
25	关于旗下部分基金新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 7 月 20 日
26	关于旗下部分基金新增华安证券、世纪证券为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 7 月 30 日
27	关于平安日增利货币市场基金基金经理变更公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 8 月 14 日
28	平安日增利货币市场基金 2018 年半年度报告以及摘要	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 8 月 24 日
29	关于旗下部分基金新增民商基金销售（上海）有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 9 月 5 日
30	平安日增利货币市场基金 2018 年国庆节前暂停申购、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、中国证券报、证券日报	2018 年 9 月 22 日
31	关于新增平安日增利货币市场基金销售机构并开通定投业务并参与其费率优惠的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 10 月 22 日

32	平安日增利货币市场基金 2018 年第 3 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 10 月 25 日
33	关于旗下部分基金新增弘业期货股份有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2018 年 10 月 31 日
34	关于平安大华基金管理有限公 司注册资本、股权及法定名称变 更事宜的公告	公司网站、证券时报、上海 证券报、中国证券报、证券 日报	2018 年 11 月 2 日
35	关于平安基金管理有限公司旗 下基金更名事宜的公告	公司网站、证券时报、上海 证券报、中国证券报、证券 日报	2018 年 11 月 28 日
36	关于子公司深圳平安汇通财富 管理有限公司增加注册资本的 公告	公司网站、证券时报、上海 证券报、中国证券报、证券 日报	2018 年 11 月 29 日
37	关于旗下部分基金参与平安银 行费率调整的公告	公司网站、证券时报、上海 证券报、中国证券报、证券 日报	2018 年 12 月 6 日
38	平安日增利货币市场基金 2019 年元旦假期前暂停申购、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、中国证券报、证券 日报	2018 年 12 月 25 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、自 2018 年 10 月 25 日起，本基金管理人法定名称由“平安大华基金管理有限公司”变更为“平安基金管理有限公司”。为保护投资者利益，避免对投资者造成混淆和误导，本基金名称由“平安大华日增利货币市场基金”变更为“平安日增利货币市场基金”。

2、经本基金管理人 2017 年第六次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会《关于核准平安大华基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可【2018】1595 号），公司新增注册资本 10 亿元人民币。本次增资完成后，本公司注册资本由 3 亿元人民币增加至 13 亿元人民币。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华日增利货币市场基金的文件；
- 2、平安日增利货币市场基金基金合同；
- 3、平安日增利货币市场基金托管协议；
- 4、平安日增利货币市场基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

- 1、深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层
- 2、基金托管人住所

13.3 查阅方式

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

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

平安基金管理有限公司

2019 年 3 月 26 日