

# 泰康薪金保货币市场基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	泰康薪金保货币		
基金主代码	001477		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 19 日		
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	14,852,329,754.55 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	泰康薪金保货币 A	泰康薪金保货币 B	泰康薪金保货币 E
下属分级基金的交易代码:	001477	001478	002546
报告期末下属分级基金的份额总额	1,223,052,361.02 份	9,840,284,012.35 份	3,788,993,381.18 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在综合考虑基金资产安全性、收益性和流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资人创造稳定的收益。
投资策略	在深入研究宏观经济、货币政策等基础上，分析判断利率及收益率曲线走势、各类投资品种的收益性及流动性等特征，据此确定组合大类资产及各品种投资，对组合进行积极管理。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康资产管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈玮光	罗菲菲
	联系电话	010-58753683	010-58560666
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4001895522	95568
传真		010-57818785	010-58560798

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.tkfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	泰康薪金保货币 A	泰康薪金保货币 B	泰康薪金保货币 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	18,637,194.32	234,440,297.43	69,601,594.23
本期利润	18,637,194.32	234,440,297.43	69,601,594.23
本期净值收益率	1.2912%	1.4119%	1.3313%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)		
期末基金资产净值	1,223,052,361.02	9,840,284,012.35	3,788,993,381.18
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

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（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(2) 本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

(3) 本基金收益分配是按日结转份额。

#### 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

泰康薪金保货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1902%	0.0006%	0.1110%	0.0000%	0.0792%	0.0006%
过去三个月	0.5977%	0.0009%	0.3366%	0.0000%	0.2611%	0.0009%
过去六个月	1.2912%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	0.6217%	0.0013%
过去一年	2.8943%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	1.5443%	0.0018%
过去三年	10.4451%	0.0025%	4.0500%	0.0000%	6.3951%	0.0025%
自基金合同生效起至今	13.6574%	0.0029%	5.4481%	0.0000%	8.2093%	0.0029%

泰康薪金保货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	率③	准差④		
过去一个月	0.2100%	0.0006%	0.1110%	0.0000%	0.0990%	0.0006%
过去三个月	0.6581%	0.0009%	0.3366%	0.0000%	0.3215%	0.0009%
过去六个月	1.4119%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	0.7424%	0.0013%
过去一年	3.1418%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	1.7918%	0.0018%
过去三年	11.2419%	0.0025%	4.0500%	0.0000%	7.1919%	0.0025%
自基金合同 生效起至今	14.7584%	0.0029%	5.4481%	0.0000%	9.3103%	0.0029%

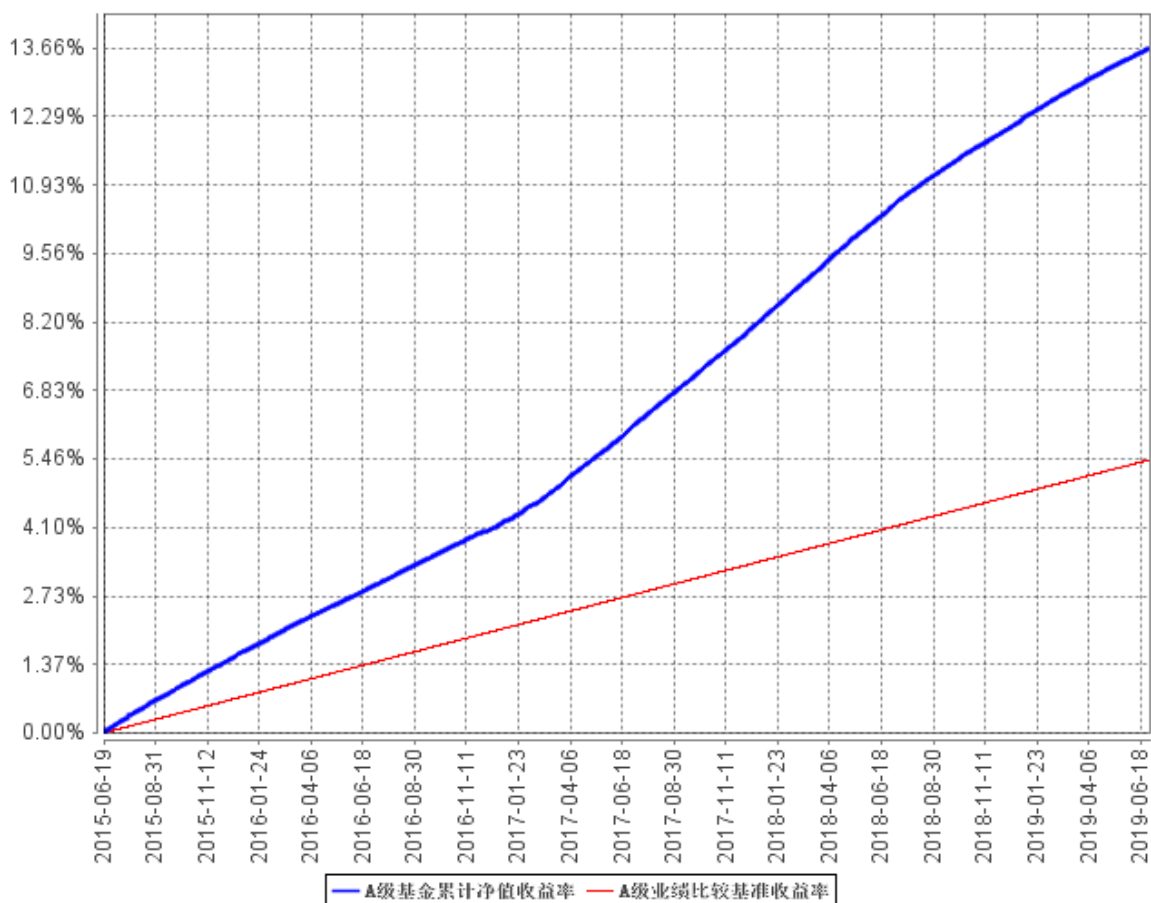
## 泰康新意保货币 E

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	0.1968%	0.0006%	0.1110%	0.0000%	0.0858%	0.0006%
过去三个月	0.6178%	0.0009%	0.3366%	0.0000%	0.2812%	0.0009%
过去六个月	1.3313%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	0.6618%	0.0013%
过去一年	2.9764%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	1.6264%	0.0018%
过去三年	10.6824%	0.0026%	4.0500%	0.0000%	6.6324%	0.0026%
自基金合同 生效起至今	11.0788%	0.0027%	4.2830%	0.0000%	6.7958%	0.0027%

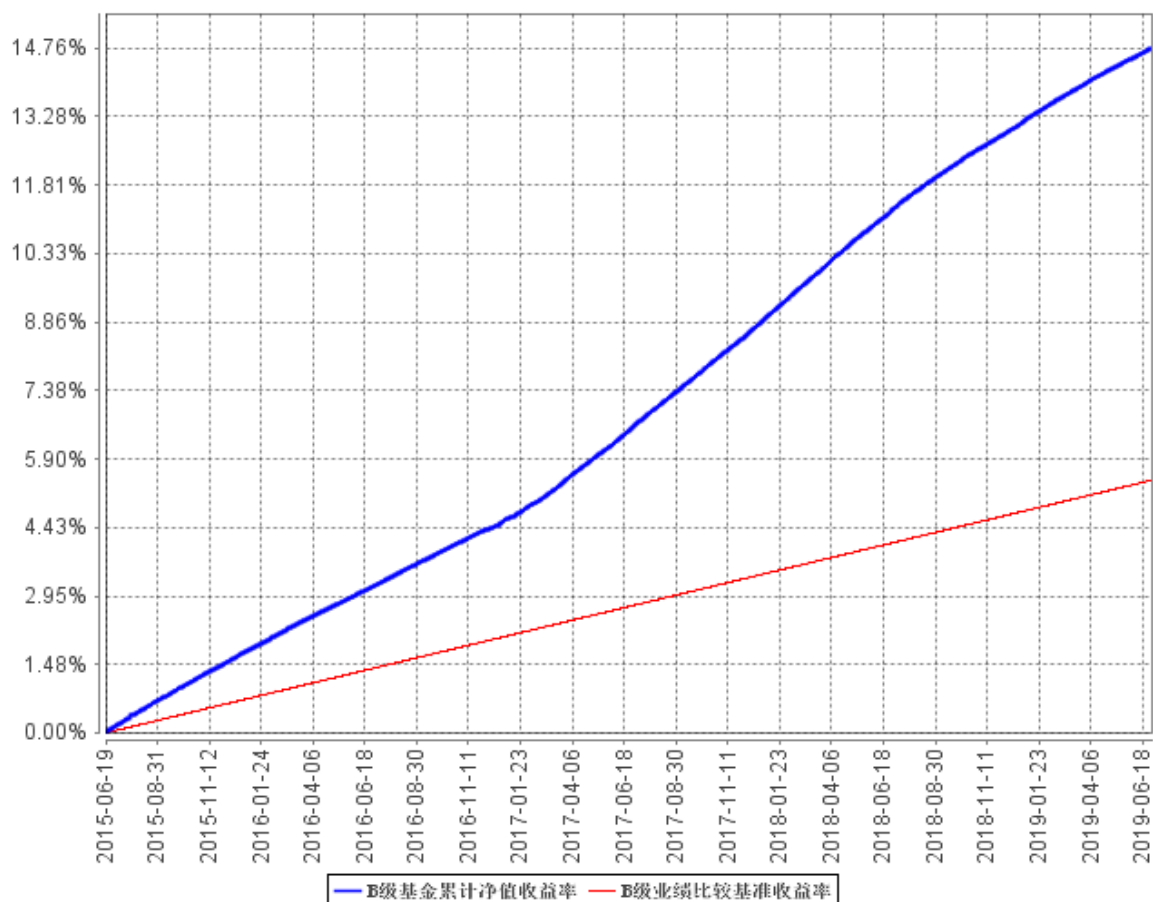
注：本基金收益分配按日结转份额。

### 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

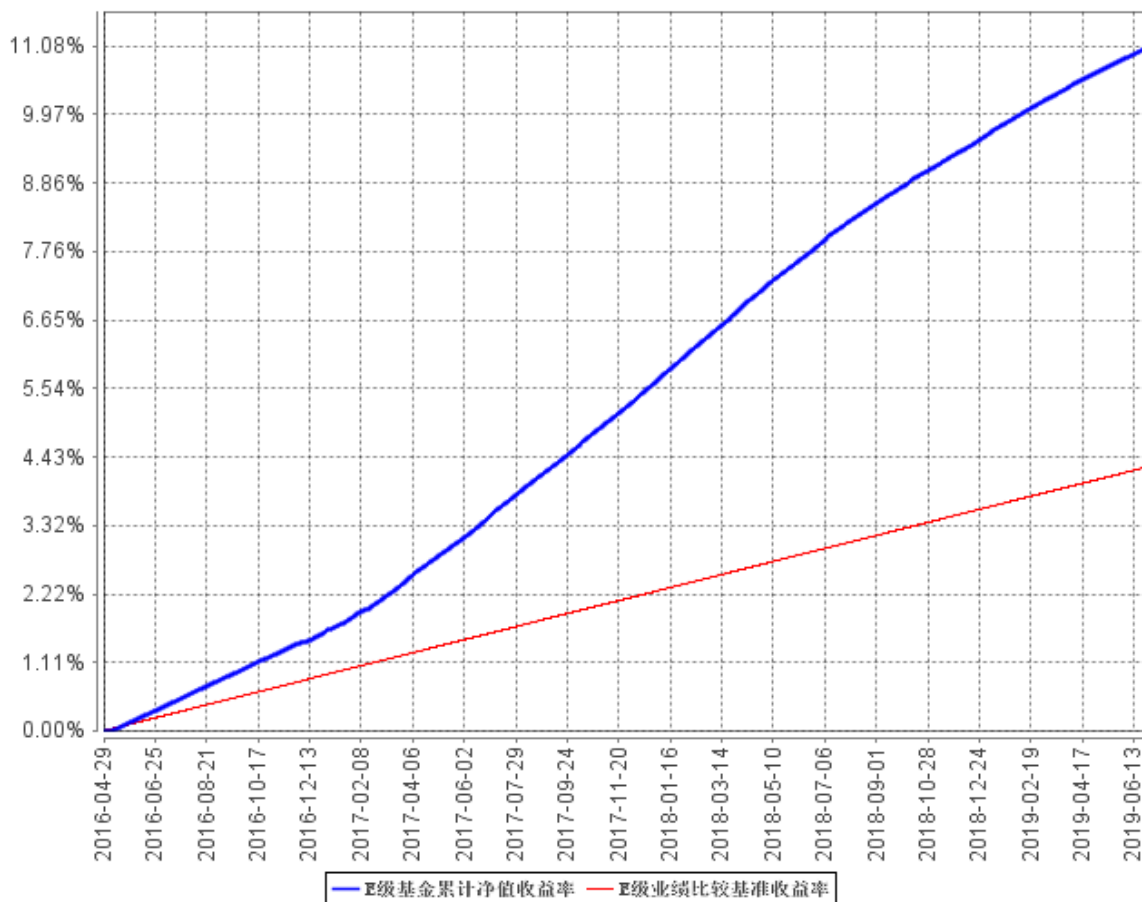
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B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



**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**



注：1、本基金基金合同于 2015 年 06 月 19 日生效。

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，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）成立于 2006 年，前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心，投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外公开市场投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等，所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、QDII 专户、公募基金产品、基本养老保险基金投资管理等。截至 2018 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 14000 亿元。除管理泰康委托的资产外，泰康资产管理的第三方业务总规模突破 7500 亿元，另类投资管理规模超过 3300 亿元。目前泰康资产退休金管理规模超过 2800 亿元，其中企业年金管理规模超过 2300 亿元，是国内最大的企业年金投资管理人。

2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。截至 2019 年 6 月 30 日，公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金、泰康均衡优选混合型证券投资基金、泰康睿利量化多策略混合型证券投资基金、泰康颐年混合型证券投资基金、泰康颐享混合型证券投资基金、泰康弘实 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金、泰康裕泰债券型证券投资基金、泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金、泰康中证港股通大消费主题指数型发起式证券投资基金、泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金、泰康产业升级混合型证券投资基金、泰康安和纯债 6 个月定期开放债券型证券投资基金、泰康安业政策性金融债债券型证券投资基金共 35 只证券投资基金。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋利娟	本基金基金经理	2015年6月19日	-	11	蒋利娟于2008年7月加入泰康资产，历任集中交易室交易员，固定收益投资部流动性投资经理、固定收益投资经理，固定收益投资中心固定收益投资经理。现任公募事业部固定收益投资执行总监。2015年6月19日至今担任泰康新意保货币市场基金基金经理。2015年9月23日至今担任泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年12月8日至2016年12月27日任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年2月3日至今任泰康稳健增利债券型证券投资基金基金经理。2016年6月8日至今任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2017年1月22日至今任泰康金泰回报3个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。2017年6月15日至今任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017年8月30日至2019年5月9日担任泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017年9月8日至今担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。2018年5月30日至今担任泰康颐年混合型证券投资基金基金经理。2018年6月13日至今担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2018年8月24日至今担任泰康弘实3个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。
任慧娟	本基金	2015年12月9日	-	12	任慧娟于2015年8月加入泰康

	基金经 理	日		<p>资产管理有限责任公司，现担任公募事业部固定收益投资经理。2007 年 7 月至 2008 年 7 月在阳光财产保险公司资金运用部统计分析岗工作，2008 年 7 月至 2011 年 1 月在阳光保险集团资产管理中心历任风险管理岗、债券研究岗，2011 年 1 月起任固定收益投资经理，至 2015 年 8 月在阳光资产管理公司固定收益部投资部任高级投资经理。2015 年 12 月 9 日至今担任泰康薪金保货币市场基金基金经理。2016 年 5 月 9 日至今担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 7 月 13 日至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 24 日至今担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 21 日至 2019 年 5 月 8 日担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 8 日至今担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。</p>
--	----------	---	--	---

注：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。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

#### 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相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2019 年上半年经济平稳中小幅下滑，总体下行压力可控。出口的增速受到外需走弱、全球贸易割裂的影响有所下滑，是上半年经济较大的拖累项；同时，制造业投资受到出口的影响表现较弱，从而拖累总体投资增速有所下行。但消费增速受益于居民可支配收入的提升而有所上行，对经济形成支撑。通胀方面呈现了 CPI 向上、PPI 向下的格局。货币条件方面，M2 保持稳定；社融受益于宽信用政策的传导而明显改善；汇率则先升值后贬值，总体稳定。

债券市场方面，上半年利率区间震荡，总体变动较小。年初随着资金面宽松，利率有所下行，但随后一季度经济金融数据好于预期，风险偏好持续回升，利率有所反弹；4 月下旬开始，基本面边际走弱，中美贸易前景有所恶化，同时海外宽松预期再起，利率重回下行通道。总体来看，上半年 10 年国债收益率保持不变，10 年国开小幅下行 3bp。

报告期内，本基金以同业存单、存款、逆回购、短期融资券为主要配置资产，保持适度杠杆，并根据申购赎回情况、市场收益率情况调整组合平均剩余期限。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末泰康薪意保 A 基金净值增长率为 1.2912%；截至本报告期末泰康薪意保 B 基金净值增长率为 1.4119%；截至本报告期末泰康薪意保 E 基金净值增长率为 1.3313%；同期业绩比较基准增长率为 0.6695%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，基本面下行的压力没有完全释放，但预计下行斜率缓慢。全球贸易环境割裂、外需维持低位，对出口的造成负面影响；同时地产投资随着前期拿地和新开工的下行，地产资金链边际趋紧，也将步入下行通道，但另一方面，基建投资有望形成对冲，消费在汽车缓慢复苏的背景下也有所支持。政策上将在稳增长和防风险之间保持平衡和灵活性，财政政策继续落实减税降费、盘活存量；货币政策将保持流动性合理充裕，同时加速推进利率市场化改革，引导实际贷款利率的下行。

债券市场方面，债券市场震荡的格局预计将维持。基本面边际向下的大方向、流动性保持合理充裕的条件下，利率很难进入明显的熊市，但当前利率水平较低，政策也保持定力，不宜追涨

杀跌，若有调整则可能带来交易性机会。信用债将以中高等级信用债为主，主体的精挑细选仍是主要思路。

本基金将坚持货币基金作为流动性管理工具的定位，投资类属将继续以同业存单、存款、逆回购、短期融资券为主，保持适度杠杆、剩余期限，追求稳定的投资收益，为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有公募估值小组，并制定了相关制度及流程。公司公募估值小组设成员若干名，成员由公募各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理部、投资部、监察稽核部等。公募估值小组成员均具有相关工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，本基金 A 级应分配且已分配利润 18,637,194.32 元，B 级应分配且已分配利润 234,440,297.43 元，E 级应分配且已分配利润 69,601,594.23 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

#### **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**

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：泰康薪金保货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	1,700,717,281.94	8,253,173,494.14
结算备付金	65,653,339.68	49,486,680.05
存出保证金	16,681.17	5,589.89
交易性金融资产	11,210,694,768.81	9,497,562,186.88
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	11,210,694,768.81	9,497,562,186.88
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	3,512,197,725.63	5,859,413,149.13
应收证券清算款	173,955.76	-
应收利息	73,548,803.40	115,098,085.33
应收股利	-	-
应收申购款	764,709.18	30,337,714.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	16,563,767,265.57	23,805,076,900.32
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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	-	-
卖出回购金融资产款	1,650,111,724.32	3,951,643,152.50
应付证券清算款	51,601,099.32	-
应付赎回款	1,133,036.22	4,959,040.86
应付管理人报酬	4,955,953.74	7,441,259.42
应付托管费	750,902.10	1,127,463.54
应付销售服务费	956,499.25	1,464,016.68
应付交易费用	271,710.59	438,193.05
应交税费	18,838.49	18,512.08

应付利息	430,435.51	4,327,995.44
应付利润	1,089,196.54	1,770,498.56
递延所得税负债	-	-
其他负债	118,114.94	99,409.18
负债合计	1,711,437,511.02	3,973,289,541.31
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	14,852,329,754.55	19,831,787,359.01
未分配利润	-	-
所有者权益合计	14,852,329,754.55	19,831,787,359.01
负债和所有者权益总计	16,563,767,265.57	23,805,076,900.32

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，泰康薪意保货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,223,052,361.02 份；泰康薪意保货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 9,840,284,012.35 份；泰康薪意保货币 E 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3,788,993,381.18 份。泰康薪意保货币份额总额合计为 14,852,329,754.55 份。

## 6.2 利润表

会计主体：泰康薪意保货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	391,093,208.85	550,548,565.61
1.利息收入	383,085,601.09	532,899,784.82
其中：存款利息收入	95,900,208.46	234,529,263.65
债券利息收入	167,440,006.03	201,313,311.77
资产支持证券利息收入	-	71,243.50
买入返售金融资产收入	119,745,386.60	96,985,965.90
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	8,007,607.76	17,648,780.79
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,007,607.76	17,648,780.79
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-



<b>减：二、费用</b>	68,414,122.87	82,314,217.44
1. 管理人报酬	38,291,866.89	36,880,234.37
2. 托管费	5,801,798.02	5,587,914.34
3. 销售服务费	7,021,436.41	11,414,505.93
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	17,109,957.26	28,192,388.39
其中：卖出回购金融资产支出	17,109,957.26	28,192,388.39
6. 税金及附加	8,315.73	11,306.02
7. 其他费用	180,748.56	227,868.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	322,679,085.98	468,234,348.17
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	322,679,085.98	468,234,348.17

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康薪意保货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	19,831,787,359.01	-	19,831,787,359.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	322,679,085.98	322,679,085.98
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）	-4,979,457,604.46	-	-4,979,457,604.46
其中：1. 基金申购款	43,898,256,515.62	-	43,898,256,515.62
2. 基金赎回款	-48,877,714,120.08	-	-48,877,714,120.08
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）	-	-322,679,085.98	-322,679,085.98
五、期末所有者权益（基金净值）	14,852,329,754.55	-	14,852,329,754.55
项目	上年度可比期间 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)	14,539,016,058.34	-	14,539,016,058.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	468,234,348.17	468,234,348.17
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)	4,597,449,350.01	-	4,597,449,350.01
其中：1.基金申购款	81,605,630,504.67	-	81,605,630,504.67
2.基金赎回款	-77,008,181,154.66	-	-77,008,181,154.66
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)	-	-468,234,348.17	-468,234,348.17
五、期末所有者权益(基金净值)	19,136,465,408.35	-	19,136,465,408.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>段国圣</u> 基金管理人负责人	<u>金志刚</u> 主管会计工作负责人	<u>李俊佑</u> 会计机构负责人
------------------------	-------------------------	-----------------------

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

泰康薪金保货币市场基金(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[2015]第 1100 号《关于准予泰康薪金保货币市场基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康薪金保货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,149,108,289.71 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(2015)第 613 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康薪金保货币市场基金基金合同》于 2015 年 6 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,149,123,448.12 份基金份额,其中认购资金利息折合 15,158.41 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康资产管理有限责任公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)。

根据《泰康薪金保货币市场基金招募说明书》，本基金根据投资人认/申购本基金的金额，对投资人持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额类别，即 A 类基金份额、B 类基金份额、E 类基金份额。本基金 A 类、B 类、E 类基金份额分别设置代码，并分别公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。在基金存续期内，若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额；若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。E 类份额不进行基金份额的升降级。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康薪金保货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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和资产支持证券，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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他货币市场工具的，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下，本基金可参与其他货币市场工具的投资，不须召开份额持有人大会。其投资比例遵循届时有效法律法规或监管机构的相关规定执行。本基金的业绩比较基准为：人民币 7 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》、《泰康薪金保货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金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[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。

### 6.4.7 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
--------------	---------------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	38,291,866.89	36,880,234.37
其中：支付销售机构的客户维护费	5,396,040.84	8,611,035.42

注：支付基金管理人泰康资产管理有限责任公司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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,801,798.02	5,587,914.34

注：支付基金托管人民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	泰康薪意保货币 A	泰康薪意保货币 B	泰康薪意保货币 E	合计
泰康资产管理有限责任公司	1,689,589.74	753,412.93	-	2,443,002.67
民生银行	13,078.05	388.47	4,394,163.85	4,407,630.37
合计	1,702,667.79	753,801.40	4,394,163.85	6,850,633.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	泰康薪意保货币 A	泰康薪意保货币 B	泰康薪意保货币 E	合计
泰康资产管理有限责任公司	1,751,567.31	444,470.92	-	2,196,038.23
民生银行	7,717.82	1,557.25	9,090,703.19	9,099,978.26
合计	1,759,285.13	446,028.17	9,090,703.19	11,296,016.49

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰康资产管理有限责任公司，再由泰康资产管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%和 0.25%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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
民生银行	415,413,024.72	49,729,149.72	-	-	184,500,000.00	12,636.99
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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
民生银行	175,266,488.07	173,185,652.47	-	-	2,273,625,000.00	285,623.37

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	泰康薪金保货币 A	泰康薪金保货币 B	泰康薪金保货币 E
基金合同生效日（2015 年 6 月 19 日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	659,234.73	-	-
报告期间申购/买入总份额	8,616.18	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	667,850.91	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0546%	-	-

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	泰康薪金保货币 A	泰康薪金保货币 B	泰康薪金保货币 E
基金合同生效日（2015 年 6 月 19 日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	264,541,841.16	-
报告期间申购/买入总份额	649,006.61	3,565,038.96	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	268,106,880.12	-
报告期末持有的基金份额	649,006.61	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0400%	-	-

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入及自动升降级调增份额，期间赎回/卖出总份额含转换出及自动升降级调减份额；

2. 基金管理人投资本基金相关费率按基金合同及更新招募说明书的有关规定支付；

3. 本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金 B 级和 E 级份额。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，本基金管理人之外的其他关联方未运用自有资金投资本基金。

**6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 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
民生银行	500,717,281.94	22,420,816.28	900,615.22	4,082,318.49

注：本基金的部分银行存款由基金托管人民生银行保管，按约定利率计息。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本报告期，2019 年 01 月 02 日，与上海浦东发展银行进行买入银行间债券交易，债券代码 111815640，债券名称 18 民生银行 CD640，债券数量 500,000 张，清算金额 49,681,483.33 元；2019 年 01 月 15 日，与中信建投证券股份有限公司进行卖出银行间债券交易，债券代码 111815640，债券名称 18 民生银行 CD640，债券数量 500,000 张，清算金额 49,756,588.89 元；2019 年 02 月 15 日，与前海开源嘉鑫灵活配置混合型证券投资基金进行买入银行间债券交易，债券代码 111815583，债券名称 18 民生银行 CD583，债券数量 100,000 张，清算金额 9,865,958.68 元；2019 年 02 月 18 日，与华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金进行买入银行间债券交易，债券代码 111815528，债券名称 18 民生银行 CD528，债券数量 500,000 张，清算金额 49,438,720.15 元；2019 年 03 月 27 日，与交通银行股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111815333，债券名称 18 民生银行 CD333，债券数量 1,000,000 张，清算金额 99,193,434.52 元；2019 年 04 月 29 日，与中国银行股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111915031，债券名称 19 民生银行 CD031，债券数量 1,500,000 张，清算金额 146,516,779.32 元；2019 年 04 月 29 日，与郑州银行股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111915021，债券名称 19 民生银行 CD021，债券数量 1,500,000 张，清算金额 146,593,150.68 元；2019 年 04 月 29 日，与中信证券股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111815459，债券名称 18 民生银行 CD459，债券数量 2,000,000 张，清算金额 199,271,795.60 元；2019 年 05 月 09 日，与浙商银行股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111815346，债券名称 18 民生银行 CD346，债券数量 1,000,000 张，清算金额 99,431,335.07 元；2019 年 05 月 28 日，与浙商银行股份有限公司进行卖出银行间债券交易，债券代码 111815574，债券名称 18 民生银行 CD574，债券数量 1,000,000 张，清算金额 99,442,166.67 元；2019 年 05 月 29 日，与厦门银行股份有限公司进行卖出银行间



债券交易，债券代码 111815574，债券名称 18 民生银行 CD574，债券数量 1,000,000 张，清算金额 99,468,041.03 元；2019 年 05 月 31 日，与第一创业证券股份有限公司进行卖出银行间债券交易，债券代码 111815533，债券名称 18 民生银行 CD533，债券数量 400,000 张，清算金额 39,855,859.93 元；2019 年 06 月 03 日，与浙商银行股份有限公司进行卖出银行间债券交易，债券代码 111815565，债券名称 18 民生银行 CD565，债券数量 1,000,000 张，清算金额 99,541,835.90 元；2019 年 06 月 04 日，与汉口银行股份有限公司进行卖出银行间债券交易，债券代码 111915031，债券名称 19 民生银行 CD031，债券数量 500,000 张，清算金额 48,998,384.11 元；2019 年 06 月 04 日，与民生证券股份有限公司进行卖出银行间债券交易，债券代码 111815459，债券名称 18 民生银行 CD459，债券数量 500,000 张，清算金额 49,971,030.22 元；2019 年 06 月 05 日，与中信建投证券股份有限公司进行卖出银行间债券交易，债券代码 111915031，债券名称 19 民生银行 CD031，债券数量 1,000,000 张，清算金额 97,999,157.53 元；2019 年 06 月 05 日，与宁波银行股份有限公司进行卖出银行间债券交易，债券代码 111815346，债券名称 18 民生银行 CD346，债券数量 1,000,000 张，清算金额 99,639,648.49 元；2019 年 06 月 21 日，与无锡农村商业银行股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111915011，债券名称 19 民生银行 CD011，债券数量 1,000,000 张，清算金额 98,353,485.21 元；2019 年 06 月 21 日，与浦发银行天添盈增利 2 号理财计划进行买入银行间债券交易，债券代码 111915071，债券名称 19 民生银行 CD071，债券数量 3,000,000 张，清算金额 293,932,823.01 元；2019 年 06 月 25 日，与洛阳银行股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111915164，债券名称 19 民生银行 CD164，债券数量 1,000,000 张，清算金额 98,137,516.67 元；2019 年 06 月 25 日，与洛阳银行股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111915203，债券名称 19 民生银行 CD203，债券数量 1,000,000 张，清算金额 97,944,593.43 元。

上年度可比期间，2018 年 01 月 04 日，与兴业银行股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111715240，债券名称 17 民生银行 CD240，债券数量 2,000,000 张，清算金额 199,901,339.13 元；2018 年 04 月 02 日，与国寿安保货币市场基金进行买入银行间债券交易，债券代码 111815098，债券名称 18 民生银行 CD098，债券数量 1,000,000 张，清算金额 99,272,756.52 元；2018 年 04 月 03 日，与宁波银行股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111815119，债券名称 18 民生银行 CD119，债券数量 1,500,000 张，清算金额 148,776,394.57 元；2018 年 04 月 03 日，与厦门银行股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111815105，债券名称 18 民生银行 CD105，债券数量 500,000 张，清算金额 49,626,060.87 元；2018 年 04 月 11 日，与工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金进行买入银行间债券交易，债券代码 111815110，债

券名称 18 民生银行 CD110，债券数量 1,000,000 张，清算金额 99,352,204.35 元；2018 年 05 月 03 日，与第一创业证券股份有限公司进行买入银行间债券交易，债券代码 111815091，债券名称 18 民生银行 CD091，债券数量 500,000 张，清算金额 49,818,217.39 元；2018 年 05 月 29 日，与国泰君安证券股份有限公司进行卖出银行间债券交易，债券代码 111815091，债券名称 18 民生银行 CD091，债券数量 500,000 张，清算金额 49,935,682.61 元。

#### 6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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 1,650,111,724.32 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
111814113	18 江苏银行 CD113	2019 年 7 月 4 日	99.93	2,200,000	219,847,612.46
111809313	18 浦发银行 CD313	2019 年 7 月 4 日	99.89	2,300,000	229,757,647.58
111810505	18 兴业银行 CD505	2019 年 7 月 3 日	99.82	1,960,000	195,641,443.78
111915164	19 民生银行 CD164	2019 年 7 月 3 日	98.19	160,000	15,709,767.91
199915	19 贴现国债 15	2019 年 7 月 1 日	99.34	800,000	79,475,977.22
111911058	19 平安银行 CD058	2019 年 7 月 4 日	99.69	1,760,000	175,454,673.02
111915071	19 民生银行 CD071	2019 年 7 月 3 日	98.03	3,000,000	294,103,941.04
合计				12,180,000	1,209,991,063.01

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 11,210,694,768.81 元，无属于第一或第三层次的余额(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 9,497,562,186.88 元，无属于第一或第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	11,210,694,768.81	67.68
	其中:债券	11,210,694,768.81	67.68
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,512,197,725.63	21.20
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,766,370,621.62	10.66
4	其他各项资产	74,504,149.51	0.45
5	合计	16,563,767,265.57	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	5.14	
	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	1,650,111,724.32	11.11
	其中:买断式回购融资	-	-

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

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

#### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	60.09	11.46
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	8.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	5.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	2.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	33.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		111.02	11.46

#### 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

在本报告期内本货币市场基金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	140,858,036.32	0.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	703,233,469.68	4.73
	其中：政策性金融债	703,233,469.68	4.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	460,517,432.61	3.10
6	中期票据	302,083,125.72	2.03
7	同业存单	9,604,002,704.48	64.66
8	其他	-	-
9	合计	11,210,694,768.81	75.48
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	111809232	18 浦发银行 CD232	5,500,000	548,660,285.79	3.69
2	111809313	18 浦发银行 CD313	5,000,000	499,473,146.92	3.36
3	111807190	18 招商银行 CD190	4,500,000	449,397,911.14	3.03
4	111910062	19 兴业银行 CD062	4,500,000	441,488,645.88	2.97
5	111808249	18 中信银行 CD249	4,000,000	399,549,211.60	2.69
6	111814113	18 江苏银行 CD113	3,000,000	299,792,198.81	2.02
7	111813111	18 浙商银行 CD111	3,000,000	299,650,905.44	2.02
8	111810505	18 兴业银行 CD505	3,000,000	299,451,189.46	2.02
9	111911058	19 平安银行 CD058	3,000,000	299,070,465.37	2.01
10	111809337	18 浦发银行 CD337	3,000,000	297,276,110.23	2.00

## 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	0.0984%
报告期内偏离度的最低值	-0.0180%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0362%

## 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

在本报告期内本货币市场基金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

在本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到 0.50%。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

### 7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 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	16,681.17
2	应收证券清算款	173,955.76
3	应收利息	73,548,803.40
4	应收申购款	764,709.18
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	74,504,149.51

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

## § 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
泰康薪金保货币 A	108,013	11,323.20	26,448,293.27	2.16%	1,196,604,067.75	97.84%
泰康薪金保货币 B	79	124,560,557.12	9,826,576,762.41	99.86%	13,707,249.94	0.14%
泰康薪金保货币 E	253,500	14,946.72	0.00	0.00%	3,788,993,381.18	100.00%
合计	361,488	41,086.65	9,853,025,055.68	66.34%	4,999,304,698.87	33.66%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占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）。

### 8.2 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	保险类机构	1,101,088,329.16	7.42%



2	保险类机构	533,133,085.62	3.59%
3	银行类机构	514,193,849.95	3.46%
4	银行类机构	513,204,768.16	3.46%
5	银行类机构	511,708,604.04	3.45%
6	银行类机构	511,662,433.19	3.45%
7	银行类机构	511,420,474.51	3.44%
8	基金类机构	320,342,016.25	2.16%
9	其他机构	312,140,247.74	2.10%
10	其他机构	253,987,879.76	1.71%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰康薪意保货币 A	7,661,187.03	0.6265%
	泰康薪意保货币 B	6,141,955.10	0.0624%
	泰康薪意保货币 E	1,116.13	0.0000%
	合计	13,804,258.26	0.0930%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	泰康薪意保货币 A	0~10
	泰康薪意保货币 B	>100
	泰康薪意保货币 E	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康薪意保货币 A	>100
	泰康薪意保货币 B	0
	泰康薪意保货币 E	0
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	泰康薪意保 货币 A	泰康薪意保货 币 B	泰康薪意保货 币 E
基金合同生效日（2015 年 6 月 19 日）基金份额总额	9,108,378.71	1,140,015,069.41	-
本报告期期初基金份额总额	1,510,945,173.71	12,052,999,663.86	6,267,842,521.44
本报告期基金总申购份额	1,465,074,996.30	26,045,381,791.44	16,387,799,727.88
减：本报告期基金总赎回份额	1,752,967,808.99	28,258,097,442.95	18,866,648,868.14
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	1,223,052,361.02	9,840,284,012.35	3,788,993,381.18

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入及基金份额自动升降级调增份额；基金总赎回份额含转换出及基金份额自动升降级调减份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、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

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：协议券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，即参选券商应满足以下条件：

- （1）经营业务比较全面，能够覆盖证券经纪、证券研究、投资银行、股指期货和融资融券等领域；
- （2）拥有独立的研究部门及 20 人以上的研究团队，研究范围覆盖宏观经济、金融市场和相关行

业，并且已建立完善的研究报告质量保障机制；（3）投资银行实力较强，能够提供优质服务；（4）建立相关业务利益冲突防范机制，完善隔离墙制度，确保研究、投行服务客观公正；（5）承诺接受中国证监会、保监会有关保险机构证券交易情况的监督，并履行本通知规定的相关要求和报告义务；（6）经评估符合向基金机构和保险机构投资提供交易单元的条件并经获准；（7）符合中国证监会、保监会规定的其他条件。除以上首要基本标准外，参选的券商还应当满足以下三个方面的要求：（1）公司财务状况良好，近一年内无重大违规事项；（2）在国内及海外市场拥有较高的市场声誉；（3）能够提供全方位的业务支持，包括但不限于、股指期货、融资融券、海外投资、QFII 等业务方面的咨询意见。

券商选择程序：（1）公募集中交易室负责组织定期比选工作，根据公募事业部制定的规则和需求选择券商，并对符合规定的券商发出邀请函；（2）券商有权决定是否参选，参选的券商应在规定时间内回复邀请函，未在规定时间内回复邀请函的券商视为放弃参选；（3）参选券商应根据邀请函的要求提供参选方案，并根据公募事业部安排完成现场评述、现场答疑等基本程序；（4）公募事业部应本着公平客观的原则，从承担投资、研究等职能的相关岗位中抽取相关专业人员形成评审小组，评审小组根据评价要素、分工范围，对参选券商进行评分。公募集中交易室负责汇总打分，并根据各项权重计算评价结果；评审小组成员包括以下业务骨干：基金经理、研究员、信评研究员、股票交易员等承担投资、研究职能的相关专业人员。（5）为保证评选的客观性、公正性，公募合规岗应全程参加现场评选，并监督评选全过程。公募合规岗有权对妨碍客观、公正原则的行为予以制止和纠正；（6）公募集中交易室将协议券商的评选结果和拟定的协议券商的交易单元租用计划在办公系统中以呈批件的形式，报送参评人员会签，部门负责人审批；（7）待呈批件审批通过后，运营管理部负责与协议券商签订《证券交易单元租用协议》、办理交易单元联通及相关账户报备等工作；（8）公募集中交易室负责与协议券商签订《证券研究综合服务协议》；（9）信息管理部负责对交易单元进行测试；（10）定期比选方式选择的协议券商将纳入公募事业部佣金分配体系，根据公募事业部对其的定期评价打分结果，在租用的交易单元上实现交易佣金的合理分配；（11）定期比选原则上三年一次。

3、本报告期内本基金租用券商交易单元变更情况：无。

### 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	成交金额	占当期权证成交总额

				的比例		的比例
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	128,618,290.53	100.00%	85,704,505,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期，本基金不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

泰康资产管理有限责任公司

2019 年 8 月 24 日