

平安日增利货币市场基金 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 4 月 29 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 2020 年 4 月 28 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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2019 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
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遵规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	61
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.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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	67
§9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	71
§10 开放式基金份额变动	72
§11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	74
11.9 其他重大事件	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 影响投资者决策的其他重要信息	80
§13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 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	108,306,221,675.33 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	LISHUAIISHUAI130@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	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
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
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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	3,305,683,986.47	5,772,646,562.60	3,175,594,212.72
本期利润	3,305,683,986.47	5,772,646,562.60	3,175,594,212.72
本期净值收益率	2.5417%	3.6758%	3.7929%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末基金资产净值	108,306,221,675.33	149,573,457,021.39	115,083,667,635.44
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
累计净值收益率	23.7479%	20.6806%	16.4018%

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。

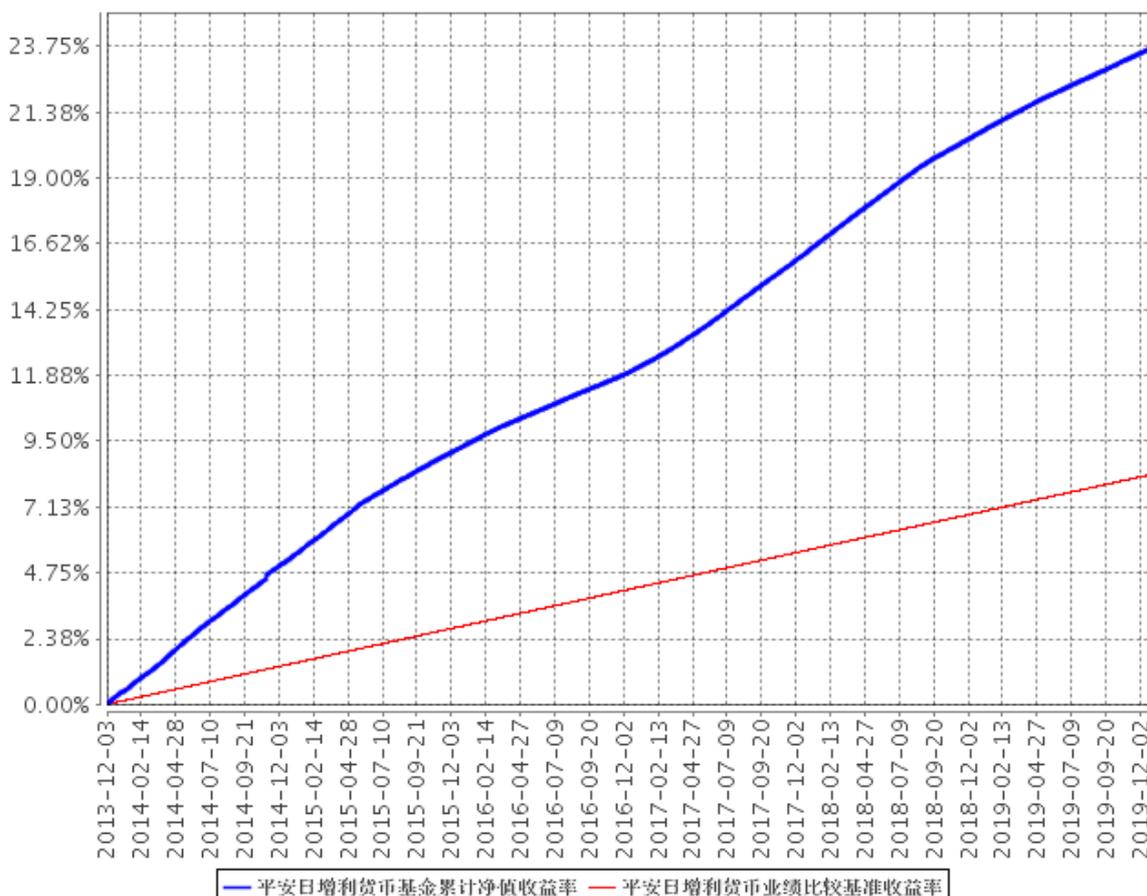
3.2 基金净值表现

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	0.6107%	0.0008%	0.3450%	0.0000%	0.2657%	0.0008%
过去六个月	1.1992%	0.0006%	0.6900%	0.0000%	0.5092%	0.0006%
过去一年	2.5417%	0.0008%	1.3688%	0.0000%	1.1729%	0.0008%
过去三年	10.3431%	0.0019%	4.1063%	0.0000%	6.2368%	0.0019%
过去五年	17.4827%	0.0024%	6.8475%	0.0000%	10.6352%	0.0024%
自基金合同生效起至今	23.7479%	0.0035%	8.3250%	0.0000%	15.4229%	0.0035%

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

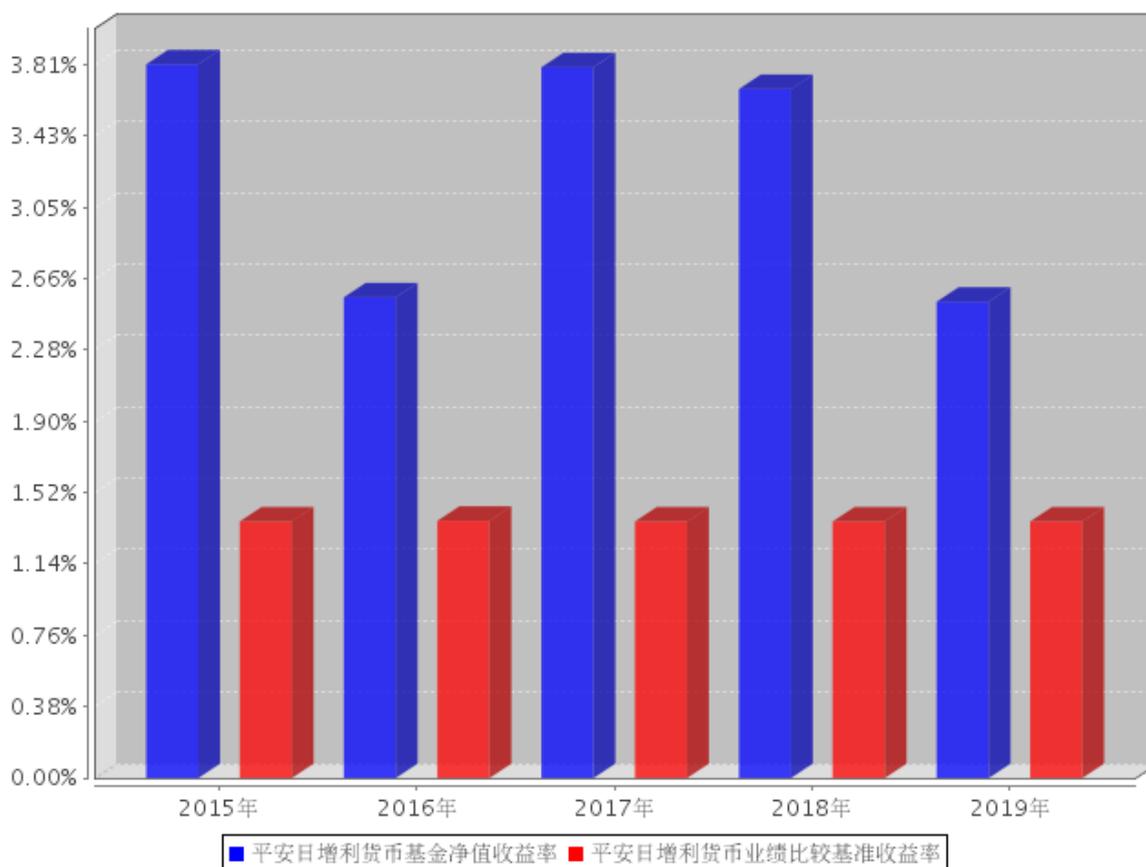
平安日增利货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效；
- 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，建仓结束时各资产符合合同比例要求。

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



本基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效。

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
2019	3,309,488,304.56	-	-3,804,318.09	3,305,683,986.47	
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	
合计	12,251,060,551.12	-	2,864,210.67	12,253,924,761.79	

§ 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 2019 年 12 月 31 日，平安基金共管理 98 只公募基金，资产管理总规模约为 3494 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		
周琛	平安日增利货币市场基金基金经理	2017年12月1日	-	11	周琛女士，拉夫堡大学硕士。先后担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、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。

田元强	平安日增利货币市场基金的基金经理	2019 年 3 月 21 日	-	6	<p>田元强先生，西安交通大学工商管理硕士，曾先后担任鹏元资信评估有限公司信用评级部分析师、生命保险资产管理有限公司信用评估部分析师、中国中投证券有限责任公司研究总部分析员。2016 年 11 月加入平安基金管理有限公司，任固定收益投资中心固定收益高级研究员。同时担任平安交易型货币市场基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安如意中短债债券型证券</p>
-----	------------------	-----------------	---	---	--

					投资基金、平安合信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
申俊华	平安日增利货币市场基金经理	2017 年 12 月 5 日	2019 年 4 月 1 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，任固定收益研究员。曾担任平安财富宝货币市场基金、平安日增利货币市场基金经理。
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	2019 年 9 月 18 日	8	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

					<p>总经理。同时担任平安短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、平安中短债债券型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安如意中短债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、平安交易型货币市场基金、平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金、平安 5-10 年期政策性金融债债券型证券投资基金基金经理。</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。

3、本基金经理周琛女士因个人原因（休产假）无法正常履行职务，自 2019 年 11 月 28 日起，由本公司的基金经理段玮婧代为管理，共同管理本基金的其他基金经理正常履职。

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《公开募集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

回顾 2019 年，受制造业投资增速下行、消费拖累，实际 GDP 增速持续下行；总需求不振、经济预期悲观、企业投资意愿缺失，宏观经济持续走弱。货币政策持续宽松，降成本持续推进。基本面走弱、货币政策宽松背景下，债券市场虽有波动，但整体表现尚可。报告期内，本基金的投资操作以流动性管理为基础原则，在有效控制偏离度的前提下，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 2.5417%，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

疫情影响下，GDP 在一季度或低位开局，二季度存在政策频出、基本面弱复苏的可能，但尽管有政策扰动，基本面中期下行趋势不改。稳增长、降成本大背景下，货币政策宽松格局难改。债券市场方面，当前收益率已处于历史低位，预计波动会加剧，但基本面偏弱牵引下并无大幅上行基础，预计全年以震荡为主。

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 3,305,683,986.47 元，实际分配收益 3,305,683,986.47 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 5,000 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(2020)第 24432 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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(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金、终止运营或别无其他现实的选择。 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。

注册会计师对财务报表审计的责任	<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(包括披露)、结构和内容，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。</p>
-----------------	--

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	邓昭君
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	2020 年 4 月 23 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	20,356,238,241.96	75,410,649,147.60
结算备付金		96,833,333.31	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	70,403,864,469.34	70,316,337,408.28
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		66,772,416,071.57	68,424,677,770.90
资产支持证券投资		3,631,448,397.77	1,891,659,637.38
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	26,119,431,489.21	12,237,343,516.07
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	333,214,916.90	777,069,603.71
应收股利		-	-
应收申购款		12,788,840.94	2,890,984.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		117,322,371,291.66	158,744,290,660.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 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		8,941,820,377.37	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		30,945,057.39	45,650,167.81
应付托管费		7,501,832.10	11,066,707.36
应付销售服务费		23,443,225.29	34,583,460.42
应付交易费用	7.4.7.7	1,116,105.70	726,126.83
应交税费		1,227,428.06	991,820.35
应付利息		2,515,480.26	9,422,901.10
应付利润		7,391,110.16	11,195,428.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	189,000.00	27,559,405.04
负债合计		9,016,149,616.33	9,170,833,639.05
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	108,306,221,675.33	149,573,457,021.39
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		108,306,221,675.33	149,573,457,021.39
负债和所有者权益总计		117,322,371,291.66	158,744,290,660.44

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 108,306,221,675.33 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 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
		2019 年 1 月 1 日至	2018 年 1 月 1 日至

		2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
一、收入		4,272,766,523.91	6,975,027,809.35
1. 利息收入		4,240,147,637.05	6,947,703,847.57
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,697,242,800.70	3,984,318,002.91
债券利息收入		1,844,706,842.83	2,589,168,044.02
资产支持证券利息收入		95,463,650.53	27,587,920.36
买入返售金融资产收入		602,734,342.99	346,629,880.28
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		32,618,586.86	27,291,047.65
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	32,645,157.97	27,291,047.65
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-26,571.11	-
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	300.00	32,914.13
减：二、费用		967,082,537.44	1,202,381,246.75
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	432,373,037.71	530,367,682.19
2. 托管费	7.4.10.2.2	104,817,706.04	128,573,983.55
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	327,555,331.57	401,793,698.52
4. 交易费用	7.4.7.19	3,362.45	2,888.33
5. 利息支出		100,778,047.74	139,612,280.91
其中：卖出回购金融资产支出		100,778,047.74	139,612,280.91
6. 税金及附加		1,217,851.93	1,423,313.25

7. 其他费用	7.4.7.20	337,200.00	607,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,305,683,986.47	5,772,646,562.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,305,683,986.47	5,772,646,562.60

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：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019年1月1日至2019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）	149,573,457,021.39	-	149,573,457,021.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,305,683,986.47	3,305,683,986.47
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）	-41,267,235,346.06	-	-41,267,235,346.06
其中：1. 基金申购款	522,256,560,531.81	-	522,256,560,531.81
2. 基金赎回款	-563,523,795,877.87	-	-563,523,795,877.87
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	-	-3,305,683,986.47	-3,305,683,986.47

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	108,306,221,675.33	-	108,306,221,675.33
项目	上年度可比期间		
	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

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

张南南
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<年度报告和中期报告>》、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 2019 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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 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。

债券投资或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。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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和资产支持证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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	56,238,241.96	30,649,147.60
定期存款	20,300,000,000.00	75,380,000,000.00

其中：存款期限 1 个月以内	-	1,500,000,000.00
存款期限 1-3 个月	7,800,000,000.00	2,600,000,000.00
存款期限 3 个月以上	12,500,000,000.00	71,280,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	20,356,238,241.96	75,410,649,147.60

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2019 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	66,772,416,071.57	66,834,398,500.00	61,982,428.43	0.0572%
	合计	66,772,416,071.57	66,834,398,500.00	61,982,428.43	0.0572%
资产支持证券		3,631,448,397.77	3,631,448,397.77	-	0.0000%
合计		70,403,864,469.34	70,465,846,897.77	61,982,428.43	0.0572%
项目		上年度末			
		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%

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 2019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	26,119,431,489.21	-
合计	26,119,431,489.21	-
项目	上年度末 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	-

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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	292,196.34	86,815.63
应收定期存款利息	56,799,478.06	416,334,664.57
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	43,575.00	-
应收债券利息	205,176,334.04	301,911,324.23

应收资产支持证券利息	49,496,986.68	32,703,138.47
应收买入返售证券利息	21,406,346.78	26,033,660.81
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	333,214,916.90	777,069,603.71

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 2019年12月31日	上年度末 2018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	1,116,105.70	726,126.83
合计	1,116,105.70	726,126.83

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	1,000.00
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	189,000.00	579,000.00
应付管理人款	-	26,979,405.04
合计	189,000.00	27,559,405.04

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	149,573,457,021.39	149,573,457,021.39
本期申购	522,256,560,531.81	522,256,560,531.81
本期赎回(以“-”号填列)	-563,523,795,877.87	-563,523,795,877.87
- 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	108,306,221,675.33	108,306,221,675.33

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	3,305,683,986.47	-	3,305,683,986.47
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	-3,305,683,986.47	-	-3,305,683,986.47
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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	2,104,008.17	4,511,472.88
定期存款利息收入	1,694,938,535.69	3,979,315,167.97
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	177,313.94	133,674.11
其他	22,942.90	357,687.95
合计	1,697,242,800.70	3,984,318,002.91

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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31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	32,645,157.97	27,291,047.65
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	32,645,157.97	27,291,047.65

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 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	179,832,759,722.77	173,535,638,715.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	178,959,279,853.31	172,805,023,916.05
减：应收利息总额	840,834,711.49	703,323,751.32
买卖债券差价收入	32,645,157.97	27,291,047.65

7.4.7.13.3 债券投资收益——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

本基金本报告期内及上年度可比期间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 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
卖出资产支持证券成交总额	2,433,998,657.96	1,771,418,395.12
减：卖出资产支持证券成本总额	2,358,027,437.65	1,695,934,000.00
减：应收利息总额	75,997,791.42	75,484,395.12
资产支持证券投资收益	-26,571.11	-

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

本基金本报告期内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
	2019年1月1日至2019年 12月31日	2018年1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	300.00	875.00
违约金收入	-	32,039.13
合计	300.00	32,914.13

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	3,362.45	2,446.53
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	3,362.45	2,888.33

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	180,000.00	180,000.00
信息披露费	120,000.00	390,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	1,200.00	1,400.00
账户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	337,200.00	607,400.00

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
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
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
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
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
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
上海陆金所基金销售有限公司（“陆金	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基

所”)	金销售机构
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
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
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
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
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
深圳壹账通科技服务有限公司(“壹账通 科技服务”)	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
深圳壹账通智能科技有限公司(“壹账通 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
上海易浣宇网络科技有限公司(“易浣宇 科技”)	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。

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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	432,373,037.71	530,367,682.19
其中：支付销售机构的客户维护费	13,837,297.55	4,288,927.87

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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	104,817,706.04	128,573,983.55

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 2019年1月1日至2019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	1,869,782.03	
大华银行	3.65	
平安基金	305,500,990.31	
陆金所	51.03	
平安证券	95,232.21	
合计	307,466,059.23	
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 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	
陆金所	0.00	
平安证券	72,782.57	
合计	396,814,000.62	

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 2019年1月1日至2019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	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日						
银行间市场交	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
易的 各关联方名称	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

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自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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	-
报告期初持有的基金份额	227,050,033.60	8.68
报告期间申购/买入总份额	263,403,671.26	422,050,033.61
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	471,000,000.00	195,000,008.69
报告期末持有的基金份额	19,453,704.86	227,050,033.60
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0180%	0.1518%

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	
	2019 年 12 月 31 日		2018 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%
大华银行	199,863,042.16	0.1845%	90,640,799.56	0.0606%
平安好贷	30,073,641.76	0.0278%	30,038,811.34	0.0201%
平安不动产	40,443,299.81	0.0373%	1,000,000,000.00	0.6686%
平安付	100,611,455.81	0.0929%	171,204,266.76	0.1145%
平安科技	-	-	2,338,281.08	0.0016%
平安直通咨询	-	-	17,166,852.10	0.0115%
易浣宇科技	7,034,014.62	0.0065%	-	-
友玩网络	-	-	10,011,390.57	0.0067%
平安汇通初创	1,569,761.34	0.0014%	1,530,488.27	0.0010%
平安汇通	-	-	607,000,693.37	0.4058%
平安金融科技	515,913,735.02	0.4763%	1,004,669,956.23	0.6717%
平安综合金融	-	-	255,202,254.14	0.1706%
前海征信中心	-	-	4,046,038.10	0.0027%
深圳鑫橙	-	-	20,405,465.47	0.0136%
深圳鑫植	-	-	13,731,144.36	0.0092%
壹账通科技服务	-	-	21,330,401.23	0.0143%
壹账通智能科技	40,075,759.00	0.0370%	10,006,569.29	0.0067%
平安赢致投资	-	-	5,066,052.03	0.0034%
平安集团	2,474,255.91	0.0023%	-	-
平安人寿	3,096,237.07	0.0029%	3,018,774.22	0.0020%
珠海亿融通	3,318,780.46	0.0031%	33,290,528.36	0.0223%

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	56,238,241.96	2,104,008.17	30,649,147.60
平安银行-定期	1,000,000,000.00	20,347,777.15	1,000,000,000.00	321,673,700.34
合计	1,056,238,241.96	22,451,785.32	1,030,649,147.60	326,185,173.22

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

金额单位：人民币元

本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
平安证券	139915	瑞新 4A1	私募	230,000	23,000,000.00
平安证券	139916	瑞新 4A2	私募	240,000	24,000,000.00
平安证券	139772	绿城 13 优	私募	890,000	89,000,000.00
平安证券	139485	信融 05 优	私募	860,000	86,000,000.00
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
平安证券	-	-	-	-	-

注：上述关联交易基金管理人已按照监管要求履行内部审批流程，并事先征得托管行同意，符合法律法规和公司制度的规定。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2019 年度，本基金因投资平安银行的同业存单而取得的利息收入为人民币 45,975,712.79 元(2018 年度: 5,426,591.19 元)。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有 19,300,000 张平安银行的同业存单，账面价值为人民币 1,902,764,262.58 元，占基金资产净值的比例为 1.76%(2018 年 12 月 31 日: 本基金持有 20,300,000 张平安银行的同业存单，账面价值为人民币 2,006,158,046.24 元，占基金资产净值的比例为 1.34%)。

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
3,309,488,304.56	-	-3,804,318.09	3,305,683,986.47	-

注：本基金在本年度累计分配收益 3,305,683,986.47 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 3,298,292,876.31 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 7,391,110.16 元。

7.4.12 (2019 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2019 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 8,941,820,377.37 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
100204	10 国开 04	2020 年 1 月 2 日	99.91	4,200,000	419,627,003.13
111905220	19 建设银 行 CD220	2020 年 1 月 2 日	98.64	3,668,000	361,826,224.70

111907178	19 招商银 行 CD178	2020 年 1 月 2 日	97.62	1,110,000	108,353,240.26
111908209	19 中信银 行 CD209	2020 年 1 月 2 日	97.69	2,223,000	217,160,458.69
111910200	19 兴业银 行 CD200	2020 年 1 月 2 日	98.88	1,000,000	98,879,859.51
111910227	19 兴业银 行 CD227	2020 年 1 月 2 日	98.71	4,666,000	460,564,625.32
111910256	19 兴业银 行 CD256	2020 年 1 月 2 日	98.54	1,000,000	98,537,423.08
111913047	19 浙商银 行 CD047	2020 年 1 月 2 日	99.30	2,223,000	220,736,014.79
111913104	19 浙商银 行 CD104	2020 年 1 月 2 日	99.64	1,810,000	180,349,463.88
111914218	19 江苏银 行 CD218	2020 年 1 月 2 日	97.21	2,326,000	226,107,162.36
111915435	19 民生银 行 CD435	2020 年 1 月 2 日	99.41	1,300,000	129,235,221.88
111915474	19 民生银 行 CD474	2020 年 1 月 2 日	99.32	3,334,000	331,140,180.91
130204	13 国开 04	2020 年 1 月 2 日	100.04	100,000	10,004,087.21
130208	13 国开 08	2020 年 1 月 2 日	100.01	200,000	20,001,756.93
130213	13 国开 13	2020 年 1 月 2 日	100.00	1,500,000	149,999,290.31
130217	13 国开 17	2020 年 1 月 2 日	99.95	1,000,000	99,952,352.21
130235	13 国开	2020 年 1 月	99.80	2,600,000	259,486,719.41

	35	2 日			
130307	13 进出 07	2020 年 1 月 2 日	100.41	1,500,000	150,609,130.03
130404	13 农发 04	2020 年 1 月 2 日	100.33	300,000	30,099,178.93
150203	15 国开 03	2020 年 1 月 2 日	100.11	2,000,000	200,215,047.67
150208	15 国开 08	2020 年 1 月 2 日	100.39	2,700,000	271,061,980.55
150213	15 国开 13	2020 年 1 月 2 日	100.49	500,000	50,246,801.20
150306	15 进出 06	2020 年 1 月 2 日	100.31	500,000	50,153,755.31
150407	15 农发 07	2020 年 1 月 2 日	100.26	100,000	10,025,889.62
150410	15 农发 10	2020 年 1 月 2 日	100.36	500,000	50,181,932.70
170205	17 国开 05	2020 年 1 月 2 日	100.33	1,000,000	100,326,862.42
170302	17 进出 02	2020 年 1 月 2 日	100.16	700,000	70,112,985.53
170305	17 进出 05	2020 年 1 月 2 日	100.30	600,000	60,180,751.21
170307	17 进出 07	2020 年 1 月 2 日	100.60	1,100,000	110,658,047.04
170402	17 农发 02	2020 年 1 月 2 日	100.01	300,000	30,004,409.46
180202	18 国开 02	2020 年 1 月 2 日	100.19	4,500,000	450,840,342.04

190001	19 付息国 债 01	2020 年 1 月 2 日	99.98	500,000	49,992,161.44
190201	19 国开 01	2020 年 1 月 2 日	100.00	1,750,000	174,999,969.49
190206	19 国开 06	2020 年 1 月 2 日	99.98	4,285,000	428,424,877.24
190301	19 进出 01	2020 年 1 月 2 日	99.99	1,800,000	179,986,039.49
190304	19 进出 04	2020 年 1 月 2 日	99.99	3,200,000	319,958,351.43
190402	19 农发 02	2020 年 1 月 2 日	99.93	5,310,000	530,640,730.45
190405	19 农发 05	2020 年 1 月 2 日	99.90	5,770,000	576,406,372.38
199946	19 贴现国 债 46	2020 年 1 月 2 日	99.78	800,000	79,825,552.64
199949	19 贴现国 债 49	2020 年 1 月 2 日	99.69	300,000	29,906,221.37
111907072	19 招商银 行 CD072	2020 年 1 月 3 日	98.88	1,200,000	118,661,338.67
111907073	19 招商银 行 CD073	2020 年 1 月 3 日	98.85	700,000	69,193,388.71
111907138	19 招商银 行 CD138	2020 年 1 月 3 日	98.29	430,000	42,262,844.75
111907153	19 招商银 行 CD153	2020 年 1 月 3 日	98.16	1,000,000	98,162,262.88
111909449	19 浦发银 行 CD449	2020 年 1 月 3 日	99.43	4,446,000	442,056,948.26
111970719	19 南京银	2020 年 1 月	99.08	2,000,000	198,155,968.73

	行 CD091	3 日			
111971045	19 南京银 行 CD097	2020 年 1 月 3 日	99.05	3,000,000	297,139,304.76
111975656	19 青岛农 商行 CD173	2020 年 1 月 3 日	99.41	2,223,000	220,995,537.21
190206	19 国开 06	2020 年 1 月 3 日	99.98	1,035,000	103,481,854.83
111909142	19 浦发银 行 CD142	2020 年 1 月 6 日	98.85	780,000	77,101,139.82
111909237	19 浦发银 行 CD237	2020 年 1 月 6 日	98.34	1,000,000	98,341,137.43
190302	19 进出 02	2020 年 1 月 6 日	99.99	3,700,000	369,947,502.09
190304	19 进出 04	2020 年 1 月 6 日	99.99	100,000	9,998,698.48
190402	19 农发 02	2020 年 1 月 6 日	99.93	330,000	32,977,672.51
合计				96,219,000	9,575,294,073.35

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

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

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。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。

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	1,901,123,410.10	830,014,791.43
A-1 以下	-	-
未评级	10,972,386,986.06	9,672,433,492.73
合计	12,873,510,396.16	10,502,448,284.16

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：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	51,203,887,243.16	55,942,142,569.06
合计	51,203,887,243.16	55,942,142,569.06

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	80,925,280.53	-
AAA 以下	20,304,828.81	-
未评级	2,593,788,322.91	1,980,086,917.68
合计	2,695,018,432.25	1,980,086,917.68

注：以上按长期信用评级的债券投资未评级债券为国债、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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	3,631,448,397.77	1,891,659,637.38
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	3,631,448,397.77	1,891,659,637.38

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均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

于报告期末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。

于报告期末，除卖出回购金融资产款余额中有 8,941,820,377.37 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。

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 2019 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产						

银行存款	20,356,238,241.96	-	-	-	-	20,356,238,241.96
结算备付金	96,833,333.31	-	-	-	-	96,833,333.31
交易性金融资产	56,768,230,134.20	13,635,634,335.14	-	-	-	70,403,864,469.34
买入返售金融资产	26,119,431,489.21	-	-	-	-	26,119,431,489.21
应收利息	-	-	-	-	333,214,916.90	333,214,916.90
应收申购款	-	-	-	-	12,788,840.94	12,788,840.94
资产总计	103,340,733,198.68	13,635,634,335.14	-	-	346,003,757.84	117,322,371,291.66
负债						
卖出回购金融资产款	8,941,820,377.37	-	-	-	-	8,941,820,377.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	30,945,057.39	30,945,057.39
应付托管费	-	-	-	-	7,501,832.10	7,501,832.10
应付销售服务费	-	-	-	-	23,443,225.29	23,443,225.29
应付交易费用	-	-	-	-	1,116,105.70	1,116,105.70
应付利息	-	-	-	-	2,515,480.26	2,515,480.26
应付利润	-	-	-	-	7,391,110.16	7,391,110.16
应交税费	-	-	-	-	1,227,428.06	1,227,428.06
其他负债	-	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	8,941,820,377.37	-	-	-	74,329,238.96	9,016,149,616.33
利率敏感度缺口	94,398,912,821.31	13,635,634,335.14	-	-	271,674,518.88	108,306,221,675.33
上年度	6个月以内	6个月-1年	1-5	5年	不计息	合计

末 2018 年 12 月 31 日			年	以 上		
资产						
银行存款	72,510,649,147.60	2,900,000,000.00	-	-	-	75,410,649,147.60
交易性金融资产	55,082,980,841.04	15,233,356,567.24	-	-	-	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	139,830,973,504.71	18,133,356,567.24	-	-	-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
应付销售服务费	-	-	-	-	34,583,460.42	34,583,460.42
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

计					
利率敏感度缺口	130,841,423,219.01	18,133,356,567.24	-	-598,677,235.14	149,573,457,021.39

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（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	37,958,480.17	28,610,966.43
	市场利率上升 25 个基点	-37,866,961.72	-28,541,223.95

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 2019 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 66,772,416,071.57 元，属于第三层次的余额为 3,631,448,397.77 元，无属于第一层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次 68,424,677,770.90 元，第三层次 1,891,659,637.38 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均未发生重大变动。

(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

2019 年 1 月 1 日 1,891,659,637.38

购买 4,006,234,115.97

兑付-2,271,882,882.07

转入第三层级-

转出第三层级-

当期利得或损失总额 5,437,526.49

计入损益的利得或损失 5,437,526.49

2019 年 12 月 31 日 3,631,448,397.77

2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2019 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

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-

于 2018 年 12 月 31 日仍持有的第三层次金融资产中无计入 2018 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 2019 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(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) 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	70,403,864,469.34	60.01
	其中:债券	66,772,416,071.57	56.91
	资产支持证券	3,631,448,397.77	3.10
2	买入返售金融资产	26,119,431,489.21	22.26
	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	20,453,071,575.27	17.43
4	其他各项资产	346,003,757.84	0.29
5	合计	117,322,371,291.66	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	2.95	
	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	8,941,820,377.37	8.26
	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

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%。

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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

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	31.36	8.26
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	28.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	4.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	28.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	108.01	8.26

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	159,723,935.45	0.15
2	央行票据	-	-

3	金融债券	5,524,615,870.15	5.10
	其中：政策性金融债	5,504,504,947.10	5.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,803,069,836.52	9.05
6	中期票据	81,119,186.29	0.07
7	同业存单	51,203,887,243.16	47.28
8	其他	-	-
9	合计	66,772,416,071.57	61.65
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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	111903202	19 农业银行 CD202	15,000,000	1,480,712,661.30	1.37
2	111911097	19 平安银行 CD097	15,000,000	1,478,059,996.80	1.36
3	111905076	19 建设银行 CD076	11,000,000	1,084,010,368.18	1.00
4	111909449	19 浦发银行 CD449	10,000,000	994,280,135.54	0.92
5	111914218	19 江苏银行 CD218	10,000,000	972,085,822.71	0.90
6	111905220	19 建设银行 CD220	8,000,000	789,152,071.31	0.73
7	190402	19 农发 02	7,100,000	709,519,620.75	0.66
8	111908209	19 中信银行 CD209	6,000,000	586,128,093.62	0.54

9	111904121	19 中国银行 CD121	6,000,000	582,577,136.07	0.54
10	190405	19 农发 05	5,770,000	576,406,372.38	0.53

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	0.1228%
报告期内偏离度的最低值	0.0030%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0460%

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)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	159213	19 京保 4A	1,420,000	142,000,000.00	0.13
2	165246	19 花 06A1	1,350,000	135,000,000.00	0.12
2	165035	中花 02A1	1,350,000	135,000,000.00	0.12
3	138135	蚁信 11A	900,000	90,000,000.00	0.08
4	139772	绿城 13 优	890,000	89,000,000.00	0.08
5	138017	深借呗 4A	860,000	86,000,000.00	0.08
5	139485	信融 05 优	860,000	86,000,000.00	0.08
6	159974	弘花 01A	770,000	76,995,969.43	0.07
7	139652	永熙 3 优 2	760,000	76,000,000.00	0.07
8	165046	花呗 73A1	740,000	74,000,000.00	0.07
9	139873	永熙优 10	710,000	71,000,000.00	0.07

10	149876	18 借 02A1	700,000	70,855,864.60	0.07
11	138265	国链 16A1	670,000	67,000,000.00	0.06
11	138146	链诚 1A1	670,000	67,000,000.00	0.06
12	139808	方碧 54 优	660,000	66,000,000.00	0.06
13	139433	方碧 44 优	650,000	65,061,465.51	0.06
14	138104	永熙优 18	640,000	64,000,000.00	0.06
15	139462	绿城 10 优	600,000	60,003,067.18	0.06
16	139469	链融 08A1	600,000	60,000,000.00	0.06
16	139453	链融 07A1	600,000	60,000,000.00	0.06
16	138061	永熙优 17	600,000	60,000,000.00	0.06
16	139466	联易融 10	600,000	60,000,000.00	0.06
17	159967	建花 10A	600,000	59,995,671.50	0.06
18	139784	中交 4 优 A	570,000	57,000,000.00	0.05
19	139899	链融 16A1	510,000	51,000,000.00	0.05
20	139425	方碧 43 优	500,000	50,027,354.00	0.05
21	139694	永熙优 04	500,000	50,000,000.00	0.05
21	138253	鹏程 1A1	500,000	50,000,000.00	0.05
22	139718	金易 01	490,000	49,000,000.00	0.05
23	139854	天著优 05	450,000	45,000,000.00	0.04
24	138026	信借 01A	430,000	43,000,000.00	0.04
25	139516	方碧 47 优	410,000	41,090,672.39	0.04
26	159595	春秋 01 优	400,000	40,000,000.00	0.04
26	139879	国链 11A2	400,000	40,000,000.00	0.04
26	139878	国链 11A1	400,000	40,000,000.00	0.04
26	139719	天著优 03	400,000	40,000,000.00	0.04
26	139732	永熙优 06	400,000	40,000,000.00	0.04
27	139705	链融 11A2	390,000	39,000,000.00	0.04
28	139843	瑞新 2A1	370,000	37,013,469.01	0.03
29	139726	永熙优 05	370,000	37,000,000.00	0.03

30	139943	永熙优 13	350,000	35,000,000.00	0.03
30	138237	国链 15A1	350,000	35,000,000.00	0.03
31	139886	永熙优 11	330,000	33,000,000.00	0.03
31	138133	永熙优 19	330,000	33,000,000.00	0.03
31	138122	南链 2 优 2	330,000	33,000,000.00	0.03
32	159487	19 信易 06	321,000	32,100,000.00	0.03
33	138262	诚意 3A1	320,000	32,000,000.00	0.03
33	156636	19 裕源 03	320,000	32,000,000.00	0.03
33	139704	链融 11A1	320,000	32,000,000.00	0.03
34	139674	联易融 12	310,000	31,000,000.00	0.03
34	165254	19 天启 01	310,000	31,000,000.00	0.03
35	139447	方碧 45 优	300,000	30,038,357.40	0.03
36	138042	信借 02A	300,000	30,000,000.00	0.03
36	139706	链融 11A3	300,000	30,000,000.00	0.03
37	138290	链融 19A1	290,000	29,000,000.00	0.03
37	165405	19 天启 02	290,000	29,000,000.00	0.03
38	138261	联易融 17	280,000	28,000,000.00	0.03
38	138029	深借呗 5A	280,000	28,000,000.00	0.03
39	139760	联易融 13	260,000	26,000,000.00	0.02
40	138276	永熙优 20	250,000	25,000,000.00	0.02
41	139916	瑞新 4A2	240,000	24,000,000.00	0.02
41	139812	天著优 04	240,000	24,000,000.00	0.02
41	139806	招慧 02A	240,000	24,000,000.00	0.02
42	139915	瑞新 4A1	230,000	23,000,000.00	0.02
43	139685	绿城 12 优	220,000	22,004,254.80	0.02
44	139949	金易 02	220,000	22,000,000.00	0.02
45	138173	链融 17A1	210,000	21,000,000.00	0.02
46	139628	方碧 49 优	200,000	20,022,918.23	0.02
47	139730	方碧 53 优	200,000	20,012,434.86	0.02

48	139934	永熙优 12	200,000	20,000,000.00	0.02
48	138024	永熙优 15	200,000	20,000,000.00	0.02
49	159179	19 信易 05	160,000	16,000,000.00	0.01
49	138041	天著优 07	160,000	16,000,000.00	0.01
49	139852	国链 10A2	160,000	16,000,000.00	0.01
50	138279	招慧 05A	150,000	15,000,000.00	0.01
51	138009	天著优 06	130,000	13,000,000.00	0.01
51	159218	威新 04 优	130,000	13,000,000.00	0.01
51	165650	国科 04 优	130,000	13,000,000.00	0.01
52	149885	18 借 05A1	100,000	10,112,565.69	0.01
53	156298	东借 01A1	100,000	10,104,877.65	0.01
54	156943	金地 11A	100,000	10,001,376.11	0.01
55	138039	国链 14A1	100,000	10,000,000.00	0.01
55	138040	国链 14A2	100,000	10,000,000.00	0.01
55	138316	链诚 2A1	100,000	10,000,000.00	0.01
56	139650	链融 8A4	90,000	9,002,337.84	0.01
57	165226	19 信易 07	80,000	8,000,000.00	0.01
58	139648	链融 8A2	70,000	7,001,502.33	0.01
59	139649	链融 8A3	65,000	6,501,549.16	0.01
60	139536	云能 01 优	50,000	5,001,033.06	0.00
61	139647	链融 8A1	50,000	5,000,943.20	0.00
62	159230	荣茂 03 优	45,000	4,500,713.82	0.00

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

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 1.0000 元。

8.9.2 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

银保监会于 2019 年 6 月 24 日做出银保监罚决字〔2019〕7 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）对成都分行授信业务及整改情况严重失察；（二）重大审计发现未向监管部门报告；（三）轮岗制度执行不力。根据相关规定对公司罚款 130 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。

银保监会于 2019 年 7 月 3 日做出（2019）12 号处罚决定，由于中信银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）未按规定提供报表且逾期未改正；（二）错报、漏报银行业监管统计资料；（三）未向监管部门报告重要信息系统运营中断事件；（四）信息系统控制存在较大安全漏洞，未做到有效的安全控制；（五）未按企业划型标准将多家企业划分为小微企业，报送监管数据不真实；（六）向关系人发放信用贷款、向关系人发放担保贷款的条件优于其他借款人同类贷款条件；（七）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（八）贷后管理不到位导致贷款资金被挪用；（九）以流动资金贷款名义发放房地产开发贷款；（十）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（十一）投资同一家银行机构同期非保本理财产品采用风险权重不一致；（十二）购买非保本理财产品签订可提前赎回协议，未准确计量风险加权资产；（十三）未按规定计提资产支持证券业务的风险加权资产。根据相关规定对公司没收违法所得 33.6677 万元，罚款 2190 万元，合计 2223.6677 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。

全国银行间同业拆借中心于 2019 年 7 月 8 日对平安银行股份有限公司（以下简称“公司”）进行通报批评：在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09% 的异常利率交易。经公司自查，为交易员操作失误所致。根据相关规定暂停公司相关交易员的银行间本币市场交易员资格 1 年。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。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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	333,214,916.90
4	应收申购款	12,788,840.94
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	346,003,757.84

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
38,269,888	2,830.06	7,937,831,378.34	7.33%	100,368,390,296.99	92.67%

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	基金类机构	1,000,000,000.00	0.92%
2	信托类机构	657,330,258.48	0.61%
3	银行类机构	532,824,469.97	0.49%
4	其他机构	515,913,735.02	0.48%
5	银行类机构	500,000,000.00	0.46%
6	银行类机构	300,177,294.97	0.28%
7	基金类机构	299,876,512.95	0.28%
8	银行类机构	203,511,694.14	0.19%
9	银行类机构	201,258,986.89	0.19%
10	券商类机构	199,950,509.66	0.18%

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	2,095,233.96	0.0019%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 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	149,573,457,021.39
本报告期基金总申购份额	522,256,560,531.81
减:本报告期基金总赎回份额	563,523,795,877.87
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	108,306,221,675.33

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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

- 1、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
- 2、经平安基金管理有限公司（以下简称“公司”）2019 年第三次股东会议审议通过，由薛世峰先生接替李兆良先生任职公司的独立董事，任职日期为 2019 年 6 月 7 日。
- 3、2019 年 8 月 19 日，付强先生因工作调动，辞去平安基金管理有限公司副总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

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 6 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，公司收到监管机构对我司采取责令改正措施的决定、对相关责任人出具警示函的决定。公司高度重视，制定并实施相关整改措施，及时向监管机构提交整改报告。报告期内，公司已完成整改。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	1,011,580,799.29	100.00%	27,954,000,000.00	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	平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月3日
2	关于新增腾安基金销售（深圳）有限公司为平安日增利货币市场基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月3日
3	平安日增利货币市场基金招募说明书更新（2018年第2期）以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月12日
4	关于不法分子冒用“花生宝”名义开展非法金融业务的严正声明	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月17日
5	平安日增利货币市场基金 2018 年	中国证监会指定报刊及	2019年1月18日

	第 4 季度报告	网站	
6	平安基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 1 月 29 日
7	平安日增利货币市场基金春节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 1 月 29 日
8	平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 2 月 12 日
9	关于旗下基金投资基金管理人关联公司代理销售证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 2 月 26 日
10	平安基金管理有限公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 2 月 27 日
11	关于暂停苏州财路基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 3 月 9 日
12	关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 3 月 15 日
13	平安日增利货币市场基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 3 月 22 日
14	平安日增利货币市场基金 2018 年年度报告以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 3 月 26 日
15	关于暂停北京钱景基金销售有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 3 月 29 日
16	平安日增利货币市场基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 4 月 2 日
17	关于旗下部分基金新增国盛证券有限责任公司为销售机构及开通定	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 4 月 3 日

	投、转换业务并参与其费率优惠的公告		
18	平安日增利货币市场基金 2019 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 4 月 18 日
19	平安日增利货币市场基金劳动节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 4 月 25 日
20	关于旗下部分基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 5 月 10 日
21	关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 5 月 14 日
22	关于新增包商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 5 月 14 日
23	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 6 月 18 日
24	关于旗下基金投资基金管理人关联公司代理销售证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 6 月 22 日
25	关于旗下部分基金新增北京百度百盈基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 6 月 25 日
26	平安基金管理有限公司 2019 年 6 月 30 日基金净值披露公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 6 月 30 日
27	平安日增利货币市场基金招募说明书更新（2019 年第 1 期）以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 7 月 3 日
28	平安日增利货币市场基金 2019 年 2 季度投资组合报告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 7 月 9 日

29	关于子公司深圳平安大华汇通财富管理有限公司名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年7月9日
30	平安日增利货币市场基金 2019 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年7月15日
31	关于旗下部分基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年7月19日
32	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年7月31日
33	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增喜鹊财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月14日
34	平安基金管理有限公司关于新增深圳前海微众银行股份有限公司为平安日增利货币市场基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月15日
35	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月20日
36	平安日增利货币市场基金 2019 年半年度报告（摘要）	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月22日
37	平安日增利货币市场基金 2019 年半年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月22日
38	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月26日
39	关于旗下部分基金新增中信证券（山东）有限责任公司为销售机构及开通、定投、转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月27日

40	平安基金管理有限公司关于暂停凤凰金信（银川）基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月30日
41	平安基金管理有限公司关于旗下基金关联交易公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年9月3日
42	平安日增利货币市场基金招募说明书更新以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年9月19日
43	关于平安日增利货币市场基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年9月19日
44	平安日增利货币市场基金国庆节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年9月20日
45	平安日增利货币市场基金 2019 年 3 季度投资组合报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年10月11日
46	关于新增上海陆金所基金销售有限公司为平安日增利货币市场基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年10月15日
47	平安日增利货币市场基金 2019 年 第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年10月24日
48	关于旗下部分基金新增浦领基金销售有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年10月25日
49	关于旗下部分基金新增上海银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年11月1日
50	关于平安日增利货币市场基金调整收益支付方式并修改基金合同、托管协议的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年11月7日
51	平安日增利货币市场基金招募说明	中国证监会指定报刊及网站	2019年11月7日

	书更新以及摘要	网站	
52	平安日增利货币市场基金托管协议	中国证监会指定报刊及 网站	2019 年 11 月 7 日
53	平安日增利货币市场基金基金合同	中国证监会指定报刊及 网站	2019 年 11 月 7 日
54	平安基金管理有限公司关于基金经 理代为履行职务的公告	中国证监会指定报刊及 网站	2019 年 11 月 27 日
55	平安基金管理有限公司关于旗下部 分基金新增大连网金基金销售有限 公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及 网站	2019 年 11 月 28 日
56	平安基金管理有限公司关于旗下部 分基金新增中信建投证券股份有限 公司为销售机构及开通定投、转换 业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及 网站	2019 年 12 月 4 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

为满足投资者的理财需求，更好地服务于投资者，根据《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》等法律法规的规定和《平安日增利货币市场基金基金合同》、《平安日增利货币市场基金托管协议》的约定，经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，平安基金管理有限公司决定自 2019 年 11 月 7 日起，对旗下平安日增利货币市场基金调整收益支付方式，详细内容可阅读本公司于 2019 年 11 月 7 日发布的《关于平安日增利货币市场基金调整收益支付方式并修改基金合同、托管协议的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准平安日增利货币市场基金设立的文件；
- 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、报告期内在指定报刊以及指定网站上披露的各项公告。

13.2 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

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

2020 年 4 月 29 日