

平安大华交易型货币市场基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：平安大华基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华货币 ETF	
基金主代码	511700	
场内简称	场内货币	
基金运作方式	契约型开放式(ETF)	
基金合同生效日	2016 年 9 月 23 日	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	9,330,183,395.80 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2016 年 10 月 17 日	
下属分级基金的基金简称:	平安日鑫 A	场内货币
下属分级基金的场内简称:	-	场内货币
下属分级基金的交易代码:	003034	511700
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	9,325,556,678.71 份	4,626,717.09 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安大华基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责	姓名	陈特正	王健

人	联系电话	0755-22626828	021-38676252
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		400-800-4800	95521
传真		0755-23997878	021-38677819

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2017 年		2016 年 9 月 23 日(基金合同生效日)- 2016 年 12 月 31 日		2015 年	
	平安日鑫 A	场内货币	平安日鑫 A	场内货币	平安 日 鑫 A	场 内 货 币
本期 已实 现收 益	285,785,298.07	31,371,628.26	14,667,994.95	10,921,531.09	-	-
本期 利润	285,785,298.07	31,371,628.26	14,667,994.95	10,921,531.09	-	-
本期 净值 收益 率	4.0266%	4.0265%	0.7597%	0.7597%	-	-
3.1.2 期末 数据 和指 标	2017 年末		2016 年末		2015 年 末	

期末基金资产净值	9,325,556,678.71	462,671,709.36	3,006,892,914.78	1,872,910,666.67	-	-
期末基金份额净值	1.0000	100.00	1.0000	100.00	-	-

金额单位：人民币元

注：

- 1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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。
- 3、本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安日鑫 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1345%	0.0008%	0.3450%	0.0000%	0.7895%	0.0008%
过去六个月	2.2790%	0.0008%	0.6900%	0.0000%	1.5890%	0.0008%
过去一年	4.0266%	0.0021%	1.3688%	0.0000%	2.6578%	0.0021%
自基金合同生效起至今	4.8169%	0.0024%	1.7437%	0.0000%	3.0732%	0.0024%

场内货币

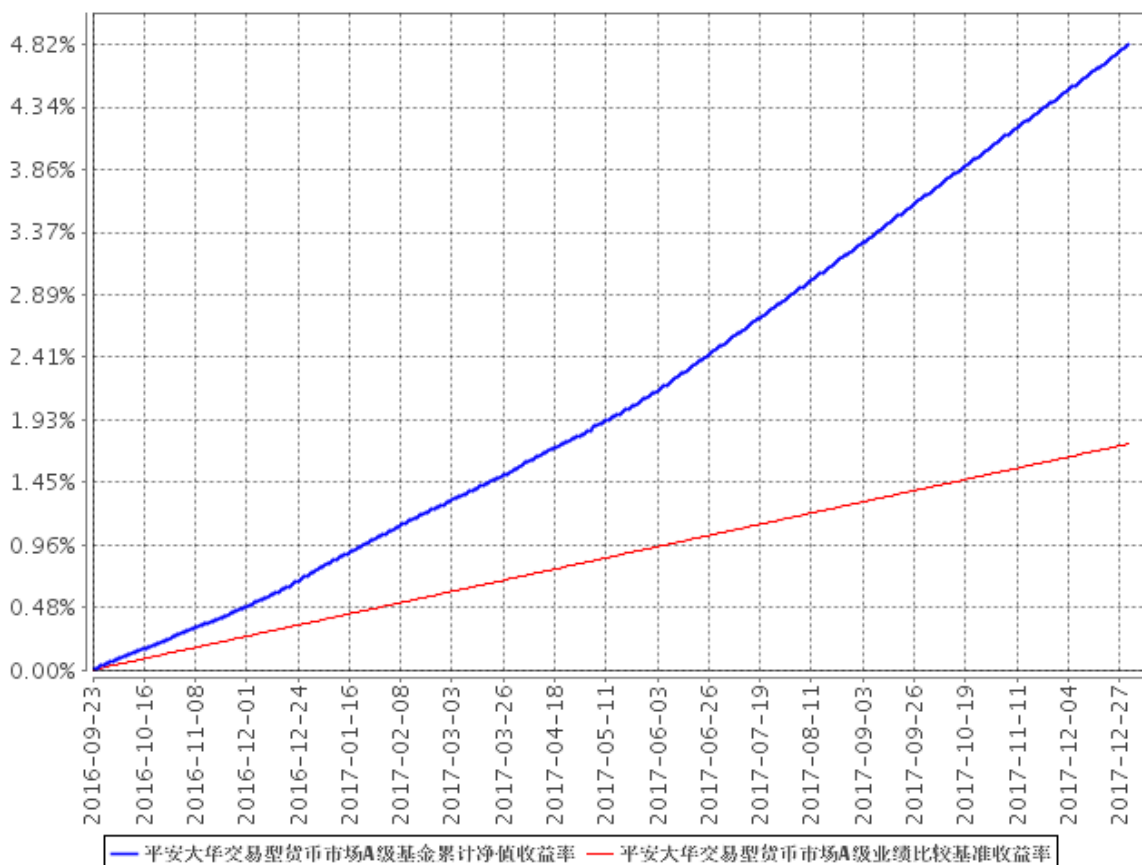
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1345%	0.0008%	0.3450%	0.0000%	0.7895%	0.0008%
过去六个月	2.2790%	0.0008%	0.6900%	0.0000%	1.5890%	0.0008%
过去一年	4.0265%	0.0021%	1.3688%	0.0000%	2.6577%	0.0021%
自基金合同生效起至今	4.8169%	0.0024%	1.7437%	0.0000%	3.0732%	0.0024%

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

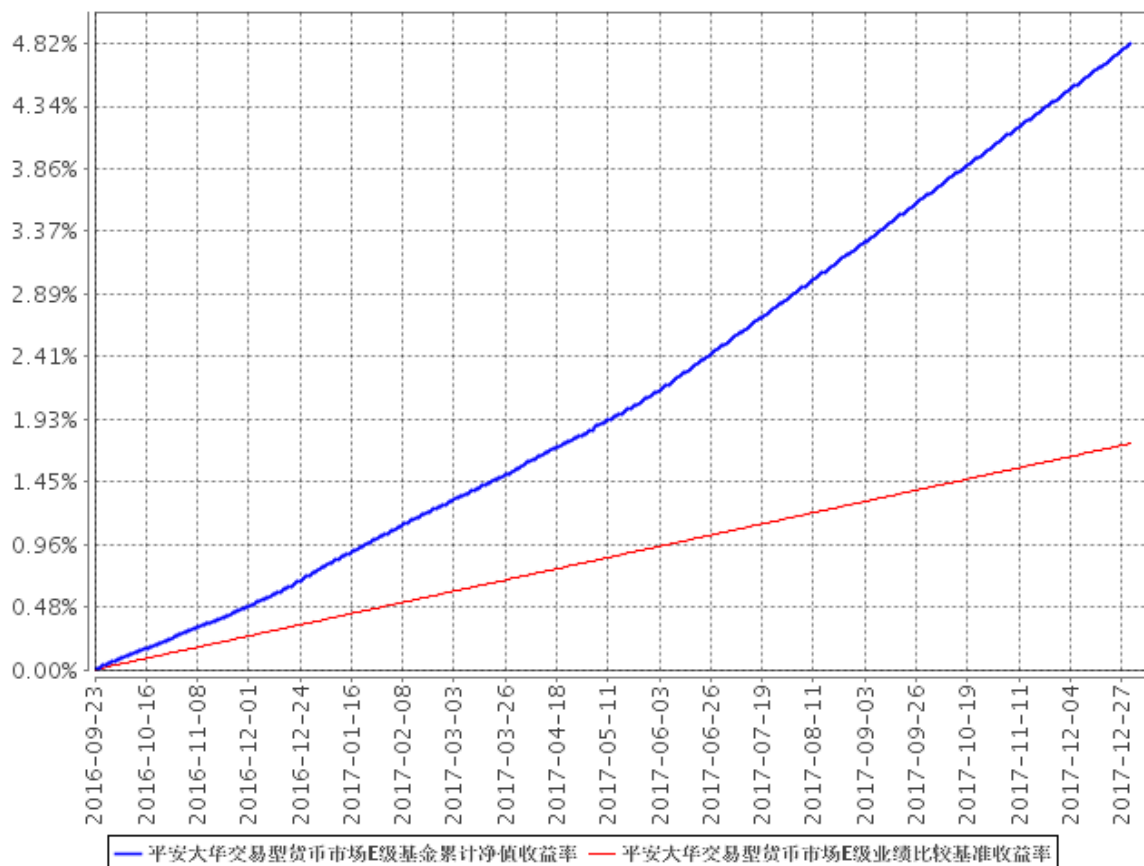
获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资范围、投资目标及流动性特征，选取同期七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

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

平安大华交易型货币市场A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



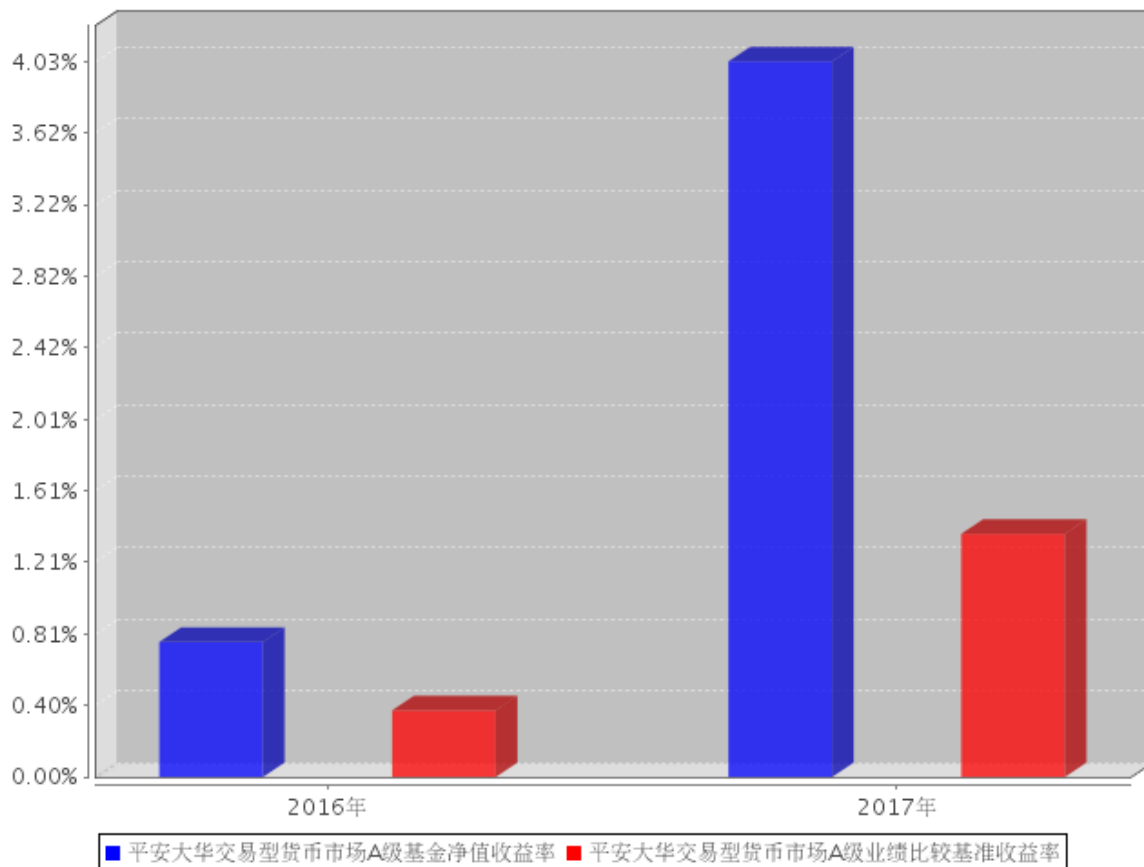
平安大华交易型货币市场E级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



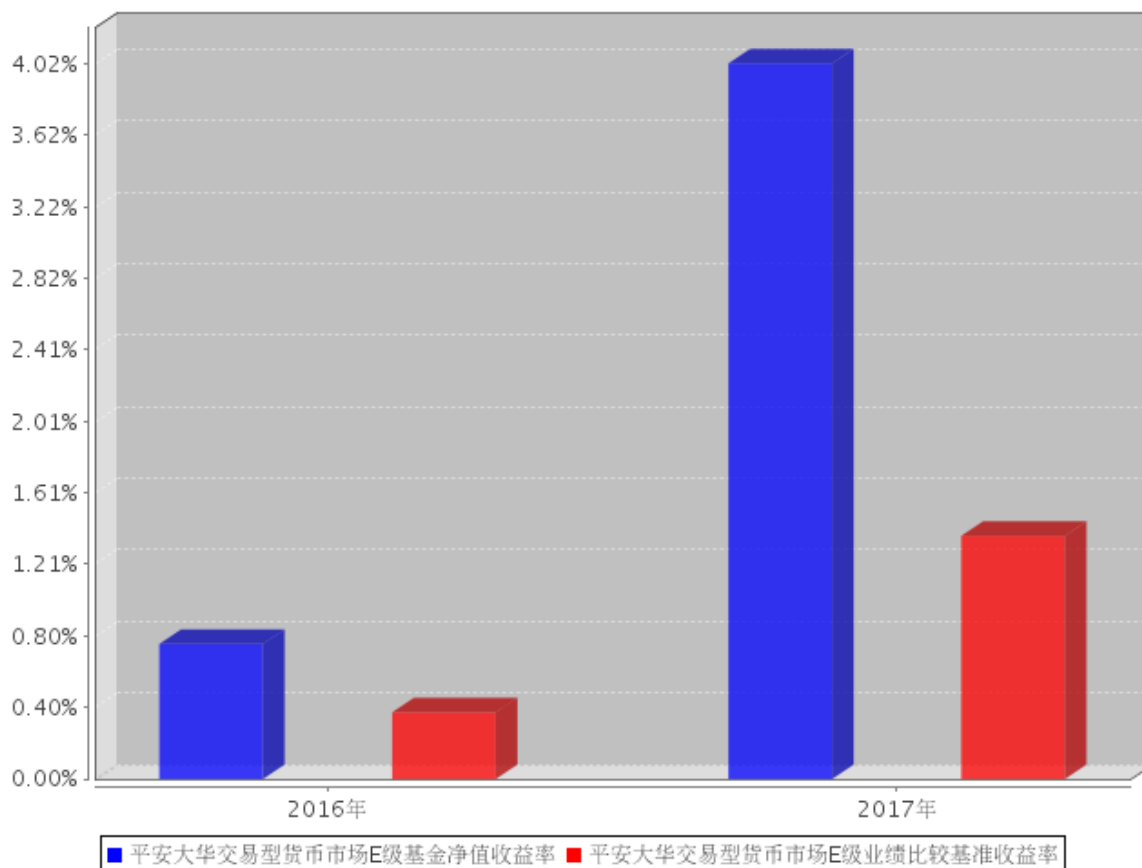
- 1、本基金基金合同于 2016 年 9 月 23 日正式生效，截至报告期末已满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

平安大华交易型货币市场A级自基金合同生效以来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



平安大华交易型货币市场E级自基金合同生效以来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 2016 年 9 月 23 日正式生效，截止报告期末已满一年。
2. 2016 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 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

平安日鑫 A					
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
2017	284,863,444.00	-	921,854.07	285,785,298.07	-
2016	14,371,874.05	-	296,120.90	14,667,994.95	-
合计	299,235,318.05	-	1,217,974.97	300,453,293.02	-
场内货币					
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
2017	31,495,646.04	-	-124,017.78	31,371,628.26	-
2016	10,737,085.54	-	184,445.55	10,921,531.09	-
合计	42,232,731.58	-	60,427.77	42,293,159.35	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）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 3 亿元人民币，是目前中国内地基金业注册资本金最高的基金公司之一。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股权 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。

平安基金秉承“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，不断丰富的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 2017 年 12 月 31 日，平安基金共管理 46 只公募基金，资产管理总规模 1795 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
段玮婧	平安大华交易型货币市场基金基金经理	2017 年 1 月 5 日	-	10	段玮婧女士，中山大学硕士，10 年证券基金从业经验，曾担任中国中投证券有限责任公司投资经理。2016 年 9 月加入平安大华基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益组投资经理。2017 年 1 月起担任平安大华交易型货币市场基金、平安大华金管家货币市场基金基金经理。
申俊华	平安大华交易型货币市场基金基金经理	2016 年 9 月 23 日	-	9	申俊华女士，湖南大学金融学博士，9 年证券基金从业经验，曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员。2012 年加入平安大华基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员。现

					担任平安大华财富宝货币市场基金、平安大华交易型货币市场基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、平安大华金管家货币市场基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、平安大华惠元纯债债券型证券投资基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫荣混合型证券投资基金、平安大华惠悦纯债债券型证券投资基金、平安大华日增利货币市场基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华交易型货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《平安大华基金管理有限责任公司公平交易管理制度》、《平安大华基金管理有限责任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连续四个季度期间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

2017 年在货币政策和宏观审慎政策双支柱调控框架下，货币政策维持中性偏紧的状态，去杠杆进一步深化。金融监管持续发力，政策密集出台，加剧了市场波动。央行在公开市场操作上更具前瞻性、灵活性，并加强预调微调 and 预期管理，操作上采取“削峰填谷”的方式，熨平流动性波动。2017 年全年，受基本面向好、强监管政策等多重因素的影响，债券市场收益率整体上行，出现两波较大幅度的调整。

本基金的投资操作以加强流动性管理为主要原则，增加类现金比例的投资、在有效控制偏离度的前提下，动态调整债券投资比例，增加不受估值影响的协议存款的投资比例，适时增加久期、提高货币基金长期收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期平安大华交易型货币市场 A 级的基金份额净值收益率为 4.0266%，本报告期平安大华交易型货币市场 E 级的基金份额净值收益率为 4.0265%，同期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 2018 年，海外经济整体延续复苏态势，国内宏观经济仍有韧性，通胀温和。货币政策仍将保持中性偏紧，宏观审慎体系将进一步得到完善，监管政策及措施将逐步落地，“去杠杆”仍将是影响 2018 年债券市场的主要因素。因此在 2018 年的操作中，一方面要防范去杠杆过程中带来的流动性风险，另一方面要把握配置机会，增强基金整体收益率。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金基金合同的规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人，并按照自然日结转至基金份额持有人的基金账户。本报告期内应分配收益 317,156,926.33 元，实际分配收益 317,156,926.33 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华交易型货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由平安大华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、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(2018)第 22923 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	平安大华交易型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，公允反映了平安大华货币 ETF 基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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，我们独立于平安大华货币 ETF 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	平安大华货币 ETF 基金的基金管理人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大华货币 ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)

	<p>，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大华货币 ETF 基金、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大华货币 ETF 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，就可能导致对平安大华货币 ETF 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大华货币 ETF 基金不能持续经营。</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。 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。	
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	边晓红
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	2018 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安大华交易型货币市场基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		6,072,475,392.95	2,708,559,692.52
结算备付金		-	155,591,909.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产		3,444,545,105.29	1,308,235,866.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,444,545,105.29	1,308,235,866.40
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		460,149,410.23	699,208,528.81
应收证券清算款		-	-
应收利息		75,259,396.75	10,355,158.95
应收股利		-	-
应收申购款		17,199.62	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-

资产总计		10,052,446,504.84	4,881,951,155.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
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		260,502,209.66	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,349,229.39	1,208,808.22
应付托管费		449,743.10	293,044.44
应付销售服务费		89,948.62	36,630.54
应付交易费用		65,481.45	22,524.67
应交税费		-	-
应付利息		124,101.81	-
应付利润		1,278,402.74	480,566.45
递延所得税负债		-	-
其他负债		359,000.00	106,000.00
负债合计		264,218,116.77	2,147,574.32
所有者权益:			
实收基金		9,788,228,388.07	4,879,803,581.45
未分配利润		-	-
所有者权益合计		9,788,228,388.07	4,879,803,581.45
负债和所有者权益总计		10,052,446,504.84	4,881,951,155.77

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.00 元，E 类基金份额净值 100.00 元。基金份额总额 9,330,183,395.80 份，其中 A 类基金份额总额 9,325,556,678.71 份，E 类基金份额总额 4,626,717.09 份。

7.2 利润表

会计主体：平安大华交易型货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年9月23日(基 金合同生效日)至 2016年12月31日
一、收入		343,850,229.02	29,499,157.09
1.利息收入		344,078,980.29	29,695,768.99
其中：存款利息收入		172,027,348.61	17,432,846.60

债券利息收入		141,954,643.31	4,879,229.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		30,096,988.37	7,383,692.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-228,751.27	-196,611.90
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-228,751.27	-196,611.90
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）		-	-
减：二、费用		26,693,302.69	3,909,631.05
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	17,199,159.85	2,921,586.73
2. 托管费	7.4.8.2.2	4,716,150.25	708,263.47
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	739,849.44	88,532.92
4. 交易费用		190.06	-
5. 利息支出		3,572,166.76	14,118.71
其中：卖出回购金融资产支出		3,572,166.76	14,118.71
6. 其他费用		465,786.33	177,129.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		317,156,926.33	25,589,526.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		317,156,926.33	25,589,526.04

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华交易型货币市场基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	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）	4,879,803,581.45	-	4,879,803,581.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	317,156,926.33	317,156,926.33
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）	4,908,424,806.62	-	4,908,424,806.62
其中：1. 基金申购款	23,238,469,286.60	-	23,238,469,286.60
2. 基金赎回款	-18,330,044,479.98	-	-18,330,044,479.98
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）	-	-317,156,926.33	-317,156,926.33
五、期末所有者权益（基金净值）	9,788,228,388.07	-	9,788,228,388.07
项目	上年度可比期间 2016 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 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）	1,590,527,400.09	-	1,590,527,400.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	25,589,526.04	25,589,526.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,289,276,181.36	-	3,289,276,181.36
其中：1. 基金申购款	4,439,168,254.20	-	4,439,168,254.20
2. 基金赎回款	-1,149,892,072.84	-	-1,149,892,072.84
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）	-	-25,589,526.04	-25,589,526.04
五、期末所有者权益（基金净值）	4,879,803,581.45	-	4,879,803,581.45

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	_____ 林婉文	_____ 胡明
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安大华交易型货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1380号《关于准予平安大华交易型货币市场基金注册的批复》核准,由平安大华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,590,518,565.34元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1210号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华交易型货币市场基金基金合同》于2016年9月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,590,527,400.09份基金份额,其中认购资金利息折合8,834.75份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华交易型货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金、期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的七天通

知存款利率(税后)。

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》、《平安大华交易型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 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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

本基金的会计政策和会计估计详见本基金年报正文。

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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人

运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理有限公司(“平安大华”)	基金管理人、A类份额的注册登记机构、基金销售机构
国泰君安证券	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司(“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	基金管理人的最终控股母公司
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

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年9月23日(基金合同生效日)至 2016年12月31日
-------	-----------------------------	--

	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
国泰君安	240,000,000.00	100.00%	3,090,415,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年9月23日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,199,159.85	2,921,586.73
其中：支付销售机构的客户维护费	793.53	11.18

注：自2016年9月23日(基金合同生效日)至2017年8月20日，支付基金管理人平安大华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

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于平安大华交易型货币市场基金调整基金管理费率及基金托管费率相关事项的议案》，自2017年8月21日起，支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年9月23日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付	4,716,150.25	708,263.47

的托管费		
------	--	--

注：自 2016 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 8 月 20 日，支付基金托管人 国泰君安证券 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.08\% / \text{当年天数}。$$

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于平安大华交易型货币市场基金调整基金管理费率及基金托管费率相关事项的议案》，自 2017 年 8 月 21 日起，支付基金托管人国泰君安的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8.2.3 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 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		
	平安日鑫 A	场内货币	合计
平安大华	656,804.63	24,044.60	680,849.23
国泰君安证券	236.77	9,350.55	9,587.32
平安证券	-	2,257.38	2,257.38
合计	657,041.40	35,652.53	692,693.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安日鑫 A	场内货币	合计
平安大华	49,656.33	-	49,656.33
国泰君安证券	0.01	15,664.27	15,664.28
平安证券	-	524.30	524.30
合计	49,656.34	16,188.57	65,844.91

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安大华基金管理有限公司，再由平安大华基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.01\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8.3 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 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
国泰君安证券	103,422,863.01	20,102,458.46	-	-	-	-
上年度可比期间 2016 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	平安日鑫 A	场内货币
基金合同生效日（2016 年 9 月 23 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	100,000,000.00	1,800,262.91
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	100,000,000.00	1,597,399.00
期末持有的基金份额	0.00	202,863.91
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2016 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	平安日鑫 A	场内货币
基金合同生效日（2016 年 9 月 23 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-

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

注：

1. 报告期间申购/买入总份额包含红利再投份额。
2. 基金管理人 平安大华在本年度/会计期间认购/申购/赎回本基金的交易委托平安证券办理，适用费率为 0%。

7.4.8.4.2 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

平安日鑫 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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
场内货币				

场内货币

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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
平安人寿	1.00	0.0000%	4,029,594.00	21.5200%

7.4.8.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 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
国泰君安证券- 活期	2,475,392.95	858,163.72	108,559,692.52	975,865.15
平安银行-定期	350,000,000.00	18,687,277.82	-	-

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

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 260,502,209.66 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
111795443	17 广州农村商业银行 CD069	2018 年 1 月 2 日	98.75	105,000	10,368,960.87
150418	15 农发 18	2018 年 1 月 2 日	99.77	411,000	41,003,686.54
170204	17 国开 04	2018 年 1 月 2 日	99.90	1,541,000	153,948,770.89
170408	17 农发 08	2018 年 1 月 2 日	99.94	600,000	59,964,247.65
合计				2,657,000	265,285,665.95

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

7.4.10 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 2017 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 3,444,545,105.29 元，无属于第一层次以及第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层次 1,308,235,866.40 元，无属于第一层次以及第三层次的余额)。

(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 2017 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(2)除公允价值和增值税外，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	3,444,545,105.29	34.27
	其中：债券	3,444,545,105.29	34.27
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	460,149,410.23	4.58
	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	6,072,475,392.95	60.41
4	其他各项资产	75,276,596.37	0.75
5	合计	10,052,446,504.84	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	2.32	
	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	260,502,209.66	2.66
	其中：买断式回购融资	-	-

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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

序号	发生日期	融资余额	原因	调整期
----	------	------	----	-----

		占基金资产净值比例 (%)		
1	2017 年 5 月 3 日	26.37	基金触发“巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上、连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形”，通过债券正回购融资付赎回款	10 个工作日
2	2017 年 5 月 4 日	30.76	基金触发“巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上、连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形”，通过债券正回购融资付赎回款	10 个工作日
3	2017 年 5 月 5 日	24.79	基金触发“巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上、连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形”，通过债券正回购融资付赎回款	10 个工作日

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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	122
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限 (天数)	原因	调整期
1	2017 年 9 月 12 日	122	被动超标	1 个工作日

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	14.12	2.66
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

2	30 天(含)—60 天	32.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	38.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	15.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.93	2.66

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	539,570,892.99	5.51
	其中：政策性金融债	539,570,892.99	5.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,904,974,212.30	29.68
8	其他	-	-
9	合计	3,444,545,105.29	35.19
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	111712207	17 北京银行 CD207	5,000,000	490,063,559.34	5.01
2	111783212	17 重庆银行 CD126	3,800,000	369,063,580.69	3.77
3	111780223	17 南京银行 CD124	3,000,000	296,814,115.04	3.03
4	111796813	17 福建海峡银行 CD021	3,000,000	295,159,839.89	3.02
5	111780324	17 威海商行 CD030	2,400,000	237,292,098.58	2.42
6	170204	17 国开 04	2,000,000	199,803,726.01	2.04
7	111789775	17 上海农商银行 CD212	2,000,000	198,408,470.76	2.03
8	111789891	17 上海农商银行 CD213	2,000,000	198,408,339.61	2.03
9	111784925	17 富邦华一银行 CD037	2,000,000	198,117,052.34	2.02
10	111780381	17 东莞银行 CD054	2,000,000	197,780,722.10	2.02

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	0.0606%
报告期内偏离度的最低值	-0.1246%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0397%

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。

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。

8.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	75,259,396.75
4	应收申购款	17,199.62
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	75,276,596.37

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

份额 级别	持有人 户数	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
平安日鑫 A	771	12,095,404.25	9,276,074,209.54	99.47%	49,482,469.17	0.53%
场内货币	1,030	4,491.96	2,637,498.62	57.01%	1,989,218.47	42.99%
合计	1,801	5,180,557.13	9,278,711,708.16	99.45%	51,471,687.64	0.55%

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末上市基金前十名持有人

场内货币

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	深圳市思道科投资有限公司—深圳市思道科投资有限公司现金 2 号私募投资基金	1,533,099.84	33.14%
2	中信盈时资产管理有限公司—中信盈时智明 1 号资产管理计划	450,858.40	9.74%
3	平安大华基金管理有限公司	202,757.92	4.38%
4	广东逸信基金管理有限公司—逸信智富 1 号基金	88,629.34	1.92%
5	北京天星天津投资中心（有限合伙）	85,301.87	1.84%
6	长丰众乐（深圳）投资咨询有限责任公司—长丰跃动一期私募投资基金	79,311.35	1.71%
7	马利平	57,057.25	1.23%
8	华润深国投信托有限公司—华润信托·恒远逍遥 2 号集合资金信托计划	49,537.11	1.07%
9	陈爱陈	32,945.44	0.71%
10	陈誉涛	31,651.19	0.68%

注：1、本基金 E 类基金份额上市交易，本表所列持有人为场内 E 类份额持有人；

2、本基金 E 类基金份额面值为人民币 100 元。

9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
----	-------	---------	--------

1	银行类机构	9,256,748,671.08	99.21%
2	基金类机构	35,270,219.55	0.38%
3	个人	2,033,333.77	0.02%
4	其他机构	1,533,099.84	0.02%
5	个人	905,606.03	0.01%
6	个人	805,682.17	0.01%
7	个人	665,715.62	0.01%
8	个人	655,730.50	0.01%
9	个人	553,009.27	0.01%
10	个人	524,727.59	0.01%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安日鑫 A	11,086.32	0.0001%
	场内货币	0.00	0.0000%
	合计	11,086.32	0.0001%

9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安日鑫 A	0
	场内货币	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安日鑫 A	0
	场内货币	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	平安日鑫 A	场内货币
基金合同生效日（2016 年 9 月 23 日）基金 份额总额	205,870,400.09	13,846,570.00
本报告期期初基金份额总额	3,006,892,914.78	18,729,106.67
本报告期基金总申购份额	20,772,588,640.56	24,658,806.46
减:本报告期基金总赎回份额	14,453,924,876.63	38,761,196.04
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	9,325,556,678.71	4,626,717.09

本基金 A 类份额净值为 1，本基金 E 类份额净值为 100。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金已于 2017 年 7 月 26 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2017 年 8 月 21 日表决通过了《关于平安大华交易型货币市场基金调整基金管理费率及基金托管费率相关事项的议案》

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、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第三十八次会议审议通过，由付强先生任职公司副总经理，任职日期为 2017 年 1 月 20 日。
- 2、经平安大华基金管理有限公司第四次职工代表大会审议通过，由李峥女士接替毛晴峰为第三届监事会职工监事，任职日期为 2017 年 2 月 17 日。
- 3、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由李兆良先生、李娟娟女士、刘雪生先生、潘汉腾先生接替曹勇先生、刘茂山先生、郑学定先生、黄士林先生任职公司第三届董事会董事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。
- 4、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由巢傲文先生接替张云平为第三届监事会监事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。
- 5、经平安大华基金管理有限公司第三届董事会第二次会议通过，同意选举罗春风先生为第三届董事会董事长；同意聘任肖宇鹏先生为总经理；同意聘任付强先生、林婉文女士、汪涛先

生为副总经理；同意聘任陈特正先生为督察长兼董事会秘书，任职日期为 2017 年 7 月 13 日。

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

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 2 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 150,000.00 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，本基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金管理人及其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	
国泰君安	2	-	-	-	-	-

1、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

2、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
国泰君安	-	-	-240,000,000.00	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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170323	2,002,017,677.01	365,138,392.38	2,367,156,069.39	0.00	0.00%
	2	20170323-20170502	115,500,000.00	102,891,242.25	183,121,022.70	35,270,219.55	0.38%
	3	20170503-20170508	58,990,284.18	991,203.21	59,981,487.39	0.00	0.00%
	4	20170509-20170518	2,002,017,677.01	365,138,392.38	2,367,156,069.39	0.00	0.00%
	5	20170519-20170531	0.00	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00	0.00%
	6	20170524-20170531	0.00	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00	0.00%
	7	20170602-20171231	0.00	10,256,748,671.08	1,000,000,000.00	9,256,748,671.08	99.21%

产品特有风险

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

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

平安大华基金管理有限公司
2018 年 3 月 29 日