

泰康现金管家货币市场基金 2018 年半年度报告

2018 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 债券回购融资情况.....	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.9 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53

§12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康现金管家货币市场基金	
基金简称	泰康现金管家货币	
基金主代码	004861	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 8 日	
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,168,150,308.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	下属分级基金的交易代码	报告期末下属分级基金的份额总额
泰康现金管家货币 A	004861	112,874,743.75 份
泰康现金管家货币 B	004862	42,970,613.57 份
泰康现金管家货币 C	004863	1,012,304,951.25 份
泰康现金管家货币 D	004864	0.00 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	<p>本基金在分析各类资产的信用风险、流动性风险及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力的基础上，通过比较或合理预期各类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整优先配置的资产类别和配置比例。</p> <p>本基金在对国内外宏观经济形势研究基础上，对利率期限结构和债券市场变化趋势进行深入分析和预测，确定并动态调整利率品种的期限配置策略。本基金综合分析经济基本面、政策面、资金面以及收益水平和流动性风险通过在行业和个券方面进行分散化投资，同时规避高信用风险行业和主体的前提下，适度提高组合收益并控制投资风险。</p> <p>本基金在严格遵守杠杆比例的前提下，通过对流动性状况深入分析，综合比较回购利率与短期债券收益率、存款利率，判断是否存在利差套利空间，进而确定是否进行杠杆操作。</p> <p>本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、银行定期存款提前支取、持有高流动性券种、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性，以满足日常的基金资产变现需求。</p>
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	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	陈玮光	郭明
	联系电话	010-58753683	010-66105798
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4001895522	95588
传真		010-57818785	010-66105799
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区张杨路 828-838 号 26F07、F08 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		段国圣	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰康资产管理有限责任公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 5 层

§ 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	3.1.1 期间数据和指标	本期已实现收益	本期利润	本期净值收益率
泰康现金管家货币 A	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	1,879,649.58	1,879,649.58	2.0479%
泰康现金管家货币 B	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	717,785.63	717,785.63	2.1684%
泰康现金管家货币 C	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	22,851,211.55	22,851,211.55	2.1684%
基金级别	3.1.2 期末数据和指标	期末基金资产净值		期末基金份额净值
泰康现金管家货币 A	报告期末(2018年6月30日)	112,874,743.75		1.0000
泰康现金管家货币 B		42,970,613.57		1.0000
泰康现金管家货币 C		1,012,304,951.25		1.0000
基金级别	3.1.3 累计期末指标	累计净值收益率		
泰康现金管家货币 A	报告期末(2018年6月30日)	3.3276%		
泰康现金管家货币 B		3.5274%		
泰康现金管家货币 C		3.5274%		

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。

(4) 本基金暂未对 D 类份额进行募集。

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

泰康现金管家货币 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	0.3033%	0.0016%	0.1110%	0.0000%	0.1923%	0.0016%
过去三个月	0.9649%	0.0037%	0.3366%	0.0000%	0.6283%	0.0037%
过去六个月	2.0479%	0.0032%	0.6695%	0.0000%	1.3784%	0.0032%
自基金合同生效起至今	3.3276%	0.0028%	1.0948%	0.0000%	2.2328%	0.0028%

泰康现金管家货币 B

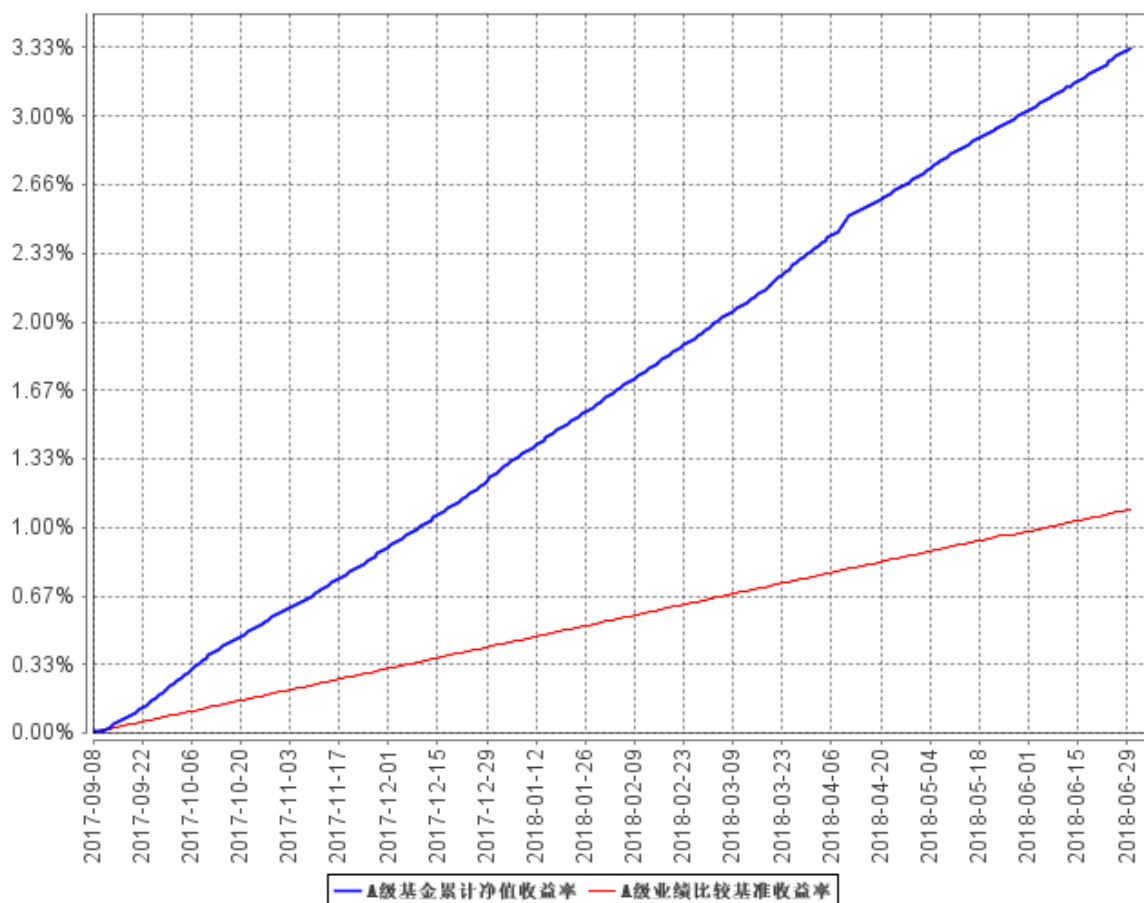
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3233%	0.0016%	0.1110%	0.0000%	0.2123%	0.0016%
过去三个月	1.0251%	0.0037%	0.3366%	0.0000%	0.6885%	0.0037%
过去六个月	2.1684%	0.0032%	0.6695%	0.0000%	1.4989%	0.0032%
自基金合同生效起至今	3.5274%	0.0028%	1.0948%	0.0000%	2.4326%	0.0028%

泰康现金管家货币 C

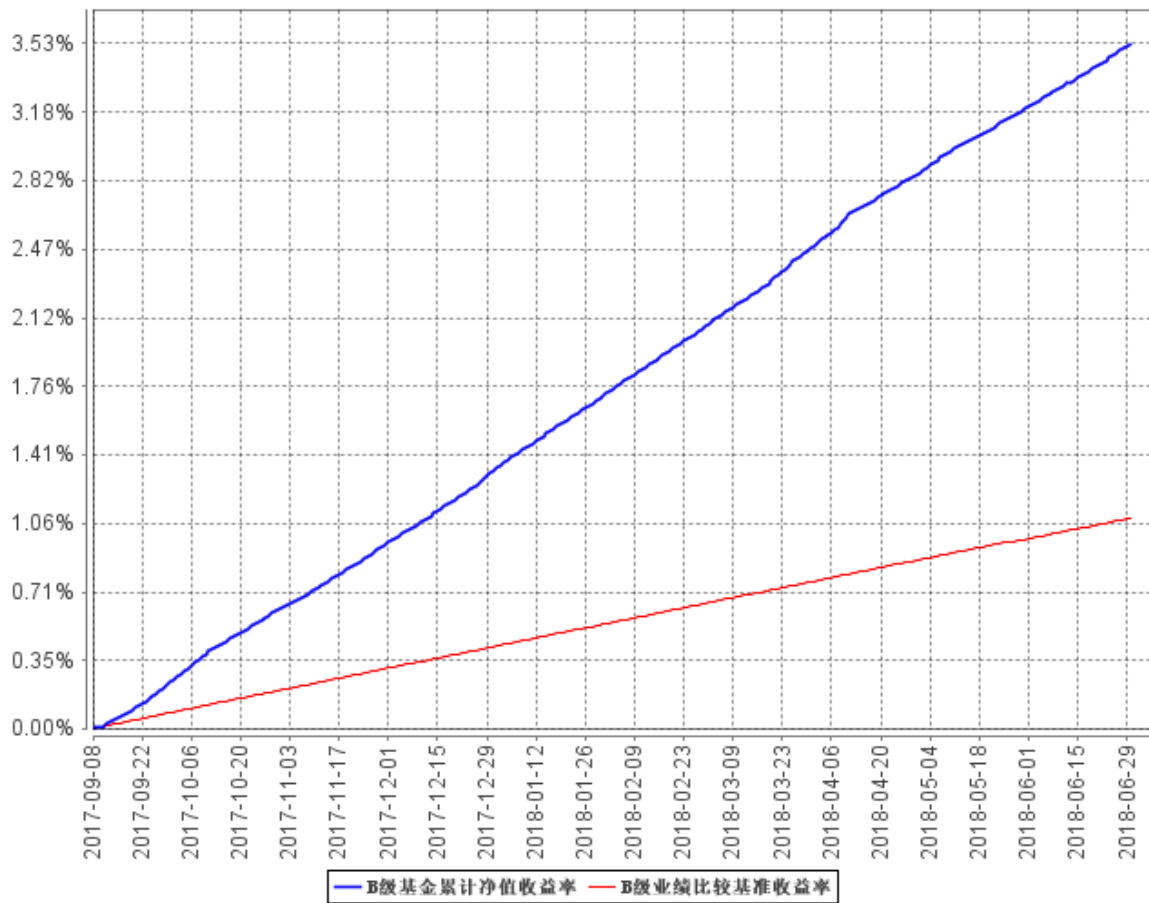
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3233%	0.0016%	0.1110%	0.0000%	0.2123%	0.0016%
过去三个月	1.0251%	0.0037%	0.3366%	0.0000%	0.6885%	0.0037%
过去六个月	2.1684%	0.0032%	0.6695%	0.0000%	1.4989%	0.0032%
自基金合同生效起至今	3.5274%	0.0028%	1.0948%	0.0000%	2.4326%	0.0028%

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

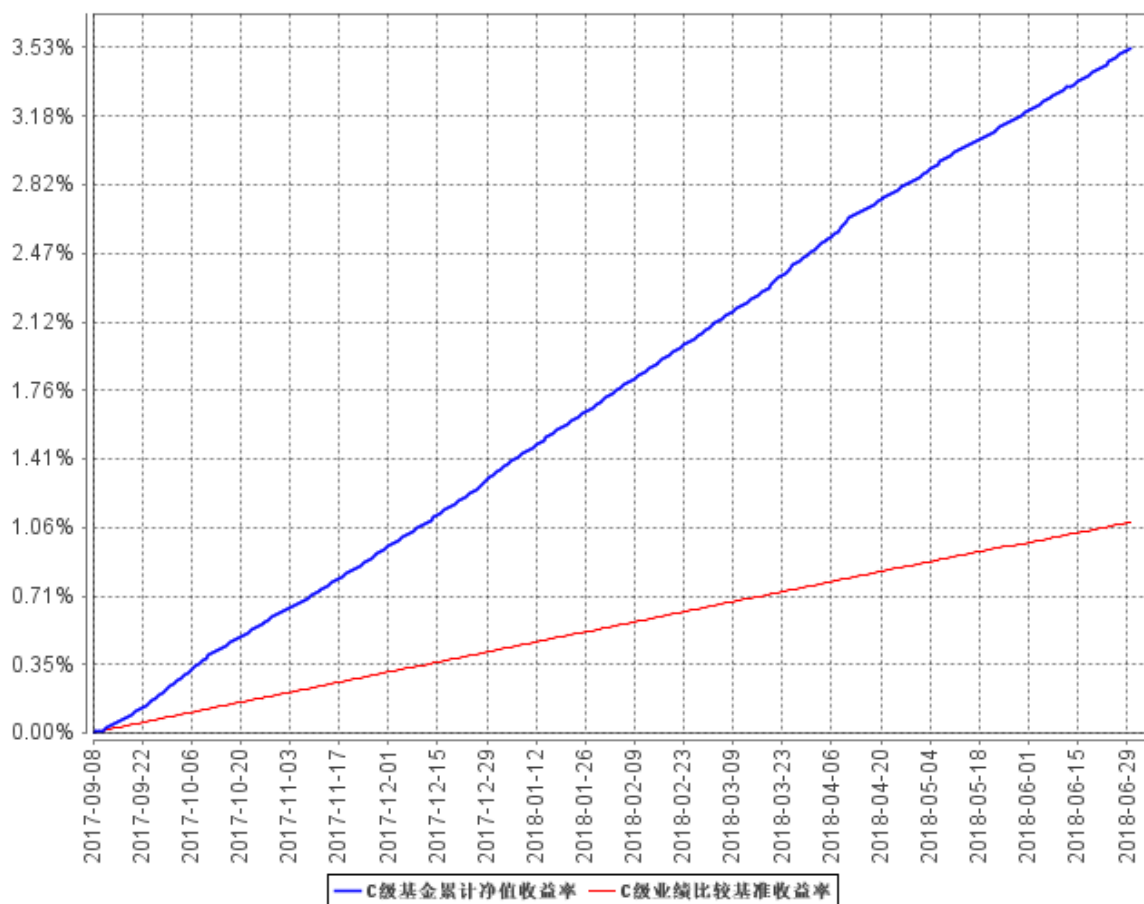
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



C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 2017 年 09 月 08 日生效，截止报告期末本基金未满一年。
 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，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 2017 年 12 月 31 日，泰康资产管理资产总规模超过 12000 亿元。除管理泰康委托资产外，泰康资产第三方业务总规模突破 6000 亿元，另类投资管理规模超过 3000 亿元，退休金管理规模超过 2000 亿元，是中国市场最大的退休金管理人之一。

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 2018 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共 25 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		
任慧娟	本基金基金经理	2017 年 9 月 8 日	-	11	任慧娟于 2015 年 8 月加入泰康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 日至今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。
蒋利娟	本基金基金经理	2017 年 9 月 8 日	-	10	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 日至今担任泰康薪金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 日至今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。
--	--	--	--	--	--

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

2018 年上半年，宏观经济走势平稳，结构上有所分化。1-5 月工业增加值累积同比 6.9%，较去年有所回升，冬季采暖限产导致企业加速赶工，生产较为旺盛。从三大需求来看，外需持续保持高位，出口表现强劲；消费一季度表现平稳，但二季度有所下滑；投资增速下滑明显，其中主要受到基建投资的影响，房地产和制造业投资仍然得以支撑。受到结构性去杠杆的影响，表外非标快速萎缩，社融增速有所下滑。货币政策有所调整，以对冲基本面下行的担忧，流动性也保持合理充裕。物价方面总体平稳，通胀压力不大。汇率方面，人民币先升后贬，总体变动不大。

债券市场方面，1 月初受金融监管政策影响、利率有所上行，此后呈现震荡下行的走势。一月末以来，银行间资金面保持相对宽松，短端利率明显下行；叠加社融增速下行、贸易战等因素引发市场对基本面的担忧，带动长端利率下行。4 月 17 日，央行宣布降准置换 MLF，带动利率快速下行；但随后随着资金面紧张，叠加油价快速上行，美债突破 3%，国内利率有所回调。5 月下半月以来，国内信用风险频发又带来市场对紧信用的担忧，同时央行的货币政策明显调整，先是不跟随美联储加息、然后又进行降准，利率震荡下行。上半年来看，10Y 国债下行 41bp，10Y 国开下行 57bp。

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现金管家 A 基金净值增长率为 2.0479%；截至本报告期末泰康现金管家 B 基金净值增长率为 2.1684%；截至本报告期末泰康现金管家 C 基金净值增长率为 2.1684%；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

展望下半年，基本面存在一定的下行压力，但在货币政策转向宽松、财政政策强调更加积极的政策组合下，下行的幅度总体可控。上半年社融增速下行向经济的传导作用，将会逐渐体现；居民的消费倾向受到房地产市场的挤压，消费增速也难以回升；外部环境受到中美贸易战的影响，不确定性也快速上升。但是，货币政策转向的政策思路将得以延续；财政政策下半年也有一定的

发力空间。这一政策组合下，社融增速有望企稳，经济下行的压力可控。

债券市场方面，在结构性去杠杆的方针不变的情况下，债券市场的牛市仍将持续，利率仍然存在一定的下行空间，但不宜盲目追涨。信用债仍需防范信用风险，同时积极挖掘个体的超额收益。

本基金将坚持货币基金作为流动性管理工具的定位，继续保持组合较好的流动性和适度的杠杆、剩余期限。基金投资类属配置继续以存款、存单、回购及信用资质相对较好的债券为主，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，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。公司估值小组设成员若干名，成员由各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理中心公募运营部、公募投资部、监察稽核部、公募产品部等。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，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 1,879,649.58 元，B 级应分配且已分配利润 717,785.63 元，本基金 C 级应分配且已分配利润 22,851,211.55 元，本基金 D 级应分配且已分配利润 0.00 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，本基金托管人在对泰康现金管家货币基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，泰康现金管家货币基金的管理人——泰康资产管理有限责任公司在泰康现金管家货币基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对泰康资产管理有限责任公司编制和披露的泰康现金管家货币基金 2018 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、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：泰康现金管家货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	485,189,700.70	405,552,838.06
结算备付金		6,010,454.55	1,000,000.00
存出保证金		907.44	6,368.88
交易性金融资产	6.4.7.2	397,652,725.84	337,972,880.90
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		387,652,725.84	337,972,880.90
资产支持证券投资		10,000,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	437,941,939.15	138,770,768.16
应收证券清算款		20,047,173.97	-
应收利息	6.4.7.5	7,735,625.21	5,569,638.76
应收股利		-	-
应收申购款		203,171.14	153,840.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	146.01	-
资产总计		1,354,781,844.01	889,026,334.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		165,836,061.93	81,269,678.09
应付证券清算款		20,000,000.00	-
应付赎回款		13,976.15	12.13
应付管理人报酬		179,822.51	112,032.29
应付托管费		71,929.01	44,812.93
应付销售服务费		37,660.25	10,674.32
应付交易费用	6.4.7.7	76,886.13	36,012.78
应交税费		-	-

应付利息		60,141.84	93,757.59
应付利润		135,470.76	98,536.32
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	219,586.86	95,500.00
负债合计		186,631,535.44	81,761,016.45
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,168,150,308.57	807,265,318.31
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,168,150,308.57	807,265,318.31
负债和所有者权益总计		1,354,781,844.01	889,026,334.76

注：（1）报告截止日 2018 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0000 元，B 类基金份额净值 1.0000 元，C 类基金份额净值 1.0000 元，D 类基金份额净值 1.0000 元；基金份额总额 1,168,150,308.57 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 112,874,743.75 份，B 类基金份额总额 42,970,613.57 份，C 类基金份额总额 1,012,304,951.25 份，D 类基金份额总额 0.00 份。

（2）报告截止日 2018 年 6 月 30 日，本基金暂未对 D 类份额进行募集。

6.2 利润表

会计主体：泰康现金管家货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		29,740,428.79
1. 利息收入		28,902,346.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,398,591.07
债券利息收入		11,693,059.71
资产支持证券利息收入		18,345.21
买入返售金融资产收入		7,792,350.34
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		838,082.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	838,082.46
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 18	-
减：二、费用		4, 291, 782. 03
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	908, 105. 35
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	363, 242. 11
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	180, 221. 04
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	-
5. 利息支出		2, 637, 370. 65
其中：卖出回购金融资产支出		2, 637, 370. 65
6. 税金及附加		1, 054. 82
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	201, 788. 06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25, 448, 646. 76
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25, 448, 646. 76

注：本基金合同生效日为 2017 年 9 月 8 日，本期是指 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康现金管家货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	807, 265, 318. 31	-	807, 265, 318. 31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25, 448, 646. 76	25, 448, 646. 76
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）	360, 884, 990. 26	-	360, 884, 990. 26
其中：1. 基金申购款	2, 069, 313, 327. 58	-	2, 069, 313, 327. 58
2. 基金赎回款	-1, 708, 428, 337. 32	-	-1, 708, 428, 337. 32
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, 448, 646. 76	-25, 448, 646. 76
五、期末所有者权益（基	1, 168, 150, 308. 57	-	1, 168, 150, 308. 57

金净值)			
------	--	--	--

注：本基金合同生效日为 2017 年 9 月 8 日，本期是指 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间，无上年度可比期间数据。

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：

_____ 段国圣	_____ 金志刚	_____ 李俊佑
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰康现金管家货币市场基金(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[2017]第 877 号《关于准予泰康现金管家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《泰康现金管家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 1,057,459,261.81 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(2017)第 314 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康现金管家货币市场基金基金合同》于 2017 年 9 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,057,518,704.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 59,442.57 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司银行(以下简称“工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康现金管家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、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，本基金在履行适当程序后，可参与其他货币市场工具的投资，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：人民币七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康现金管家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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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[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》、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》的规定及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。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。自 2018 年 1 月 1 日起,基金管理人运营基金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%的征收率在基金资产中计提增值税,并由基金管理人缴纳。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,已纳税额从基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,

暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	189,700.70
定期存款	485,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	485,000,000.00
其他存款	-
合计：	485,189,700.70

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	387,652,725.84	388,168,000.00	515,274.16	0.0441%
	合计	387,652,725.84	388,168,000.00	515,274.16	0.0441%
资产支持券	10,000,000.00	10,013,000.00	13,000.00	0.0011%	
合计	397,652,725.84	398,181,000.00	528,274.16	0.0452%	

注：(1) 偏离金额=影子定价-摊余成本；

(2) 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	74,000,000.00	-
银行间市场	363,941,939.15	-
合计	437,941,939.15	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	29.71
应收定期存款利息	2,906,844.33
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,704.70
应收债券利息	4,266,599.45
应收资产支持证券利息	18,345.21
应收买入返售证券利息	541,101.41
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.40
合计	7,735,625.21

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
其他应收款	146.01
待摊费用	-
合计	146.01

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	-

银行间市场应付交易费用	76,886.13
合计	76,886.13

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	23.85
预提费用	219,563.01
合计	219,586.86

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰康现金管家货币 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,421,952.01	14,421,952.01
本期申购	510,342,733.97	510,342,733.97
本期赎回(以“-”号填列)	-411,889,942.23	-411,889,942.23
本期末	112,874,743.75	112,874,743.75

金额单位：人民币元

泰康现金管家货币 B		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,106,126.23	10,106,126.23
本期申购	150,741,710.52	150,741,710.52
本期赎回(以“-”号填列)	-117,877,223.18	-117,877,223.18
本期末	42,970,613.57	42,970,613.57

金额单位：人民币元

泰康现金管家货币 C		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	782,737,240.07	782,737,240.07
本期申购	1,408,228,883.09	1,408,228,883.09
本期赎回(以“-”号填列)	-1,178,661,171.91	-1,178,661,171.91
本期末	1,012,304,951.25	1,012,304,951.25

注：1. 申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

2. 截至 2018 年 6 月 30 日, 本基金暂未对 D 类份额进行募集。

6.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

泰康现金管家货币 A			
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	1,879,649.58	-	1,879,649.58
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	-1,879,649.58	-	-1,879,649.58
本期末	-	-	-

单位: 人民币元

泰康现金管家货币 B			
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	717,785.63	-	717,785.63
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	-717,785.63	-	-717,785.63
本期末	-	-	-

单位: 人民币元

泰康现金管家货币 C			
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	22,851,211.55	-	22,851,211.55
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	-22,851,211.55	-	-22,851,211.55
本期末	-	-	-

注: 本基金暂未对 D 类份额进行募集。

6.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	9,221.03
定期存款利息收入	9,379,404.46
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,936.88
其他	28.70
合计	9,398,591.07

6.4.7.12 股票投资收益

本报告期，本基金无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	838,082.46
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	838,082.46

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,373,887,172.66
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,362,303,432.52
减：应收利息总额	10,745,657.68
买卖债券差价收入	838,082.46

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期，本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本报告期，本基金无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本报告期，本基金无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本报告期，本基金无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

本报告期，本基金无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	30,348.27
信息披露费	119,014.74
其他	600.00
账户维护费	18,000.00
银行费用	33,825.05
合计	201,788.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人股东
中国工商银行股份有限公司	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本报告期，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	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	908,105.35
其中：支付销售机构的客户维护费	23,020.05

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 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	363,242.11

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.06% 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 × 0.06% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期				
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	泰康现金管家货币 A	泰康现金管家货币 B	泰康现金管家货币 C	泰康现金管家货币 D	合计
泰康资产管理有限责任公司	45,843.82	1,555.52	52,593.11	-	99,992.45
工商银行	-	-	-	-	-
合计	45,843.82	1,555.52	52,593.11	-	99,992.45

注：（1）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、C 类基金份额和 D 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%、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。

(2) 本基金暂未对 D 类份额进行募集。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目		基金合同生效日(2017年9月8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
本期 2018年 1月1日 至2018 年6月 30日	泰康现金管家货币 A	-	-	-	-	-	-	-
	泰康现金管家货币 B	-	-	-	-	-	-	-
	泰康现金管家货币 C	-	-	15,280,771.67	-	-	15,280,771.67	1.5098%
	泰康现金管家货币 D	-	-	-	-	-	-	-

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的费用按基金合同及更新的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固有资金投资本基金 A 级份额和 B 级份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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固有资金投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	189,700.70	9,221.03

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

泰康现金管家货币A

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
1,868,897.11	-	10,752.47	1,879,649.58	-

泰康现金管家货币B

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
714,009.77	-	3,775.86	717,785.63	-

泰康现金管家货币C

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
22,828,805.44	-	22,406.11	22,851,211.55	-

注：本基金暂未对 D 类份额进行募集。

6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2018 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 165,836,061.93 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
111808080	18 中信银行 CD080	2018 年 7 月 3 日	99.05	40,000	3,961,951.90
111811132	18 平安银	2018 年 7 月 3	99.36	164,000	16,295,321.61

	行 CD132	日			
041751018	17 中煤 CP001	2018 年 7 月 5 日	100.34	102,000	10,234,781.83
111808080	18 中信银 行 CD080	2018 年 7 月 5 日	99.05	452,000	44,770,056.44
111811132	18 平安银 行 CD132	2018 年 7 月 5 日	99.36	302,000	30,007,238.58
111895834	18 盛京银 行 CD156	2018 年 7 月 5 日	96.58	300,000	28,975,372.51
111811076	18 平安银 行 CD076	2018 年 7 月 2 日	99.12	323,000	32,015,746.09
合计				1,683,000	166,260,468.96

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，属于高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括现金，通知存款，短期融资券，超短期融资券，证券公司短期公司债券，一年以内（含一年）的银行定期存款和大量存单，剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据和资产支持证券，期限在一年以内（含一年）的债券回购、中央银行票据，以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制订了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和部分定期存款存放在本基金的托管行工商银行；其他定期存款存放在光大银行、兴业银行、中信银行、平安银行、广发银行、浦发银行以及上海银行，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，不投资于信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末（20180630），本基金持有资产支持证券 10000000.00 元。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	40,188,082.05	10,025,431.16
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	40,188,082.05	10,025,431.16

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	50,153,558.10	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	50,153,558.10	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	10,000,000.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	10,000,000.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指

定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	237,286,180.53	218,143,046.78
AAA 以下	0.00	49,865,331.69
未评级	0.00	0.00
合计	237,286,180.53	268,008,378.47

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 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。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，本基金债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 20%。

于 2018 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 165836061.93 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

债券及同业存单流动性主要受信用风险影响，截止 2018 年 6 月 30 日，基金持仓债券及同业

存单均为高等级债券且未持仓市场负面债券，因此债券流动性较好。

压力测试方面，假设无风险利率上升 93BP，AAA 级利率上升 48BP，AA+级利率上升 59BP，净赎回率为 40%时，影子价格偏离度，均未低于-0.15%；赎回比例 10%的条件下（发生巨额赎回），假设基金通过从市场融入资金来应对赎回，基金的杠杆率未超过 20%。基金流动性风险较低。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	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	485,189,700.70	-	-	-	-	485,189,700.70
结算备付金	6,010,454.55	-	-	-	-	6,010,454.55
存出保证金	907.44	-	-	-	-	907.44
交易性金融资产	358,677,353.33	28,975,372.51	-	-	-	387,652,725.84
买入返售金融资产	437,941,939.15	-	-	-	-	437,941,939.15
应收证券清算款	-	-	-	-	20,047,173.97	20,047,173.97
应收利息	-	-	-	-	7,735,625.21	7,735,625.21
应收申购款	-	-	-	-	203,171.14	203,171.14
其他资产	-	-	-	-	10,000,146.01	10,000,146.01
资产总计	1,287,820,355.17	28,975,372.51	-	-	37,986,116.33	1,354,781,844.01
负债						
卖出回购金融资产款	165,836,061.93	-	-	-	-	165,836,061.93
应付证券清算款	-	-	-	-	20,000,000.00	20,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	13,976.15	13,976.15

应付管理人报酬	-	-	-	-	179,822.51	179,822.51
应付托管费	-	-	-	-	71,929.01	71,929.01
应付销售服务费	-	-	-	-	37,660.25	37,660.25
应付交易费用	-	-	-	-	76,886.13	76,886.13
应付利息	-	-	-	-	60,141.84	60,141.84
应付利润	-	-	-	-	135,470.76	135,470.76
其他负债	-	-	-	-	219,586.86	219,586.86
负债总计	165,836,061.93	-	-	-	20,795,473.51	186,631,535.44
利率敏感度缺口	1,121,984,293.24	28,975,372.51	-	-	-17,190,642.82	1,168,150,308.57
上年度末 2017 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	405,552,838.06	-	-	-	-	405,552,838.06
结算备付金	1,000,000.00	-	-	-	-	1,000,000.00
存出保证金	6,368.88	-	-	-	-	6,368.88
交易性金融资产	337,972,880.90	-	-	-	-	337,972,880.90
买入返售金融资产	138,770,768.16	-	-	-	-	138,770,768.16
应收利息	-	-	-	-	5,569,638.76	5,569,638.76
应收申购款	-	-	-	-	153,840.00	153,840.00
资产总计	883,302,856.00	-	-	-	5,723,478.76	889,026,334.76
负债						
卖出回购金融资产款	81,269,678.09	-	-	-	-	81,269,678.09
应付赎回款	-	-	-	-	12.13	12.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	112,032.29	112,032.29
应付托管费	-	-	-	-	44,812.93	44,812.93
应付销售服务费	-	-	-	-	10,674.32	10,674.32
应付交易费用	-	-	-	-	36,012.78	36,012.78
应付利息	-	-	-	-	93,757.59	93,757.59
应付利润	-	-	-	-	98,536.32	98,536.32
其他负债	-	-	-	-	95,500.00	95,500.00
负债总计	81,269,678.09	-	-	-	491,338.36	81,761,016.45
利率敏感度缺口	802,033,177.91	-	-	-	-5,232,140.40	807,265,318.31

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	市场利率下调 0.25%	187,685.89	118,030.48
	市场利率上调 0.25%	-187,343.37	-117,897.20

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 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 397,652,725.84 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 337,972,880.90 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

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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 2018 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(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) 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	397,652,725.84	29.35
	其中: 债券	387,652,725.84	28.61
	资产支持证券	10,000,000.00	0.74
2	买入返售金融资产	437,941,939.15	32.33
	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	491,200,155.25	36.26
4	其他各项资产	27,987,023.77	2.07
5	合计	1,354,781,844.01	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	12.31	
	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	165,836,061.93	14.20
	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	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

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	50.89	15.91
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	12.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	48.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	3.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		115.30	15.91

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,024,905.16	5.14
	其中：政策性金融债	60,024,905.16	5.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,341,640.15	7.73
6	中期票据	-	-
7	同业存单	237,286,180.53	20.31
8	其他	-	-
9	合计	387,652,725.84	33.19
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	170410	17 农发 10	600,000	60,024,905.16	5.14
2	111811076	18 平安银行 CD076	600,000	59,471,974.17	5.09
3	111811132	18 平安银行 CD132	500,000	49,680,858.57	4.25
4	111811144	18 平安银行 CD144	500,000	49,633,576.56	4.25
5	111808080	18 中信银行 CD080	500,000	49,524,398.72	4.24
6	011800100	18 陕延油 SCP001	300,000	30,132,002.13	2.58
7	111895834	18 盛京银行 CD156	300,000	28,975,372.51	2.48
8	041761014	17 潞安 CP004	200,000	20,119,882.38	1.72
9	041751018	17 中煤 CP001	200,000	20,068,199.67	1.72
10	011800021	18 大同煤矿 SCP001	200,000	20,021,555.97	1.71

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	0.1009%
报告期内偏离度的最低值	-0.0248%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0242%

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 0.5%。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1889112	18 上和 1A1	100,000	10,000,000.00	0.86

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金采用摊余成本法计价。

7.9.2

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，在报告编制日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	907.44
2	应收证券清算款	20,047,173.97
3	应收利息	7,735,625.21
4	应收申购款	203,171.14
5	其他应收款	146.01
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	27,987,023.77

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
泰康现金管家货币 A	7,553	14,944.36	4,560,806.29	4.04%	108,313,937.46	95.96%
泰康现金管家货币 B	5	8,594,122.71	30,473,116.59	70.92%	12,497,496.98	29.08%
泰康现金管家货币 C	25	40,492,198.05	1,011,993,816.29	99.97%	311,134.96	0.03%
泰康现金管家货币 D	-	-	-	-	-	-
合计	7,583	154,048.57	1,047,027,739.17	89.63%	121,122,569.40	10.37%

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	310,492,748.08	26.59%
2	基金类机构	147,965,358.82	12.67%
3	银行类机构	141,123,460.64	12.08%
4	保险类机构	103,497,582.71	8.86%

5	保险类机构	62,098,549.63	5.32%
6	基金类机构	54,180,784.59	4.64%
7	保险类机构	51,495,330.90	4.41%
8	证券类机构	50,374,544.41	4.31%
9	保险类机构	31,049,274.82	2.66%
10	保险类机构	20,092,036.70	1.72%

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	泰康现金管家货币 A	1,651,385.58	1.4633%
	泰康现金管家货币 B	0.00	0.0000%
	泰康现金管家货币 C	0.00	0.0000%
	泰康现金管家货币 D	-	-
	合计	1,651,385.58	0.1414%

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	泰康现金管家货币 A	10~50
	泰康现金管家货币 B	0
	泰康现金管家货币 C	0
	泰康现金管家货币 D	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	泰康现金管家货币 A	10~50
	泰康现金管家货币 B	0
	泰康现金管家货币 C	0
	泰康现金管家货币 D	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	基金合同生效日（2017年9月8日）基金份额总额	本报告期期初基金份额总额	本报告期基金总申购份额	减：本报告期基金总赎回份额	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
泰康现金管家货币 A	307,705.00	14,421,952.01	510,342,733.97	411,889,942.23	-	112,874,743.75
泰康现金管家货币 B	8,000,800.00	10,106,126.23	150,741,710.52	117,877,223.18	-	42,970,613.57
泰康现金管家货币 C	1,049,210,199.38	782,737,240.07	1,408,228,883.09	1,178,661,171.91	-	1,012,304,951.25
泰康现金管家货币 D	-	-	-	-	-	-

注：（1）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。

（2）本基金暂未对 D 类份额进行募集。

§ 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

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	
华创证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-

注：1、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。

2、本报告期内本基金租用券商交易单元变更情况：无。

10.7.1 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
华创证券股份有限公司	12,002,400.00	100.00%	2,782,800,000.00	100.00%	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泰康资产管理有限责任公司关于调整大泰金石基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年2月2日
2	泰康资产管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金开通在上海华信证券有限责任公司基金转换业务并参加其基金转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018年2月6日
3	关于泰康资产管理有限责任公	《中国证券报》、《上海证券	2018年2月7

	司旗下部分开放式基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	报》、《证券时报》及基金管理人网站	日
4	泰康现金管家货币市场基金 2018 年“春节”假期前暂停申购、转换转入业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 2 月 9 日
5	泰康资产管理有限责任公司关于调整上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 2 月 28 日
6	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加上海有鱼基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 3 月 2 日
7	关于泰康资产管理有限责任公司旗下部分开放式基金增加南京途牛金融信息服务有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 3 月 6 日
8	关于基金直销电子交易平台开展泰康现金管家货币市场基金转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 3 月 16 日
9	泰康资产管理有限责任公司关于泰康现金管家货币市场基金修改基金合同、托管协议的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
10	泰康现金管家货币市场基金 2018 年“清明节”假期前暂停申购、转换转入业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 4 月 2 日
11	泰康现金管家货币市场基金 2018 年“劳动节”假期前暂停申购、转换转入业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 4 月 24 日
12	泰康资产管理有限责任公司关于调整中国银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 5 月 28 日
13	关于降低泰康现金管家货币市场基金 C 类基金份额单笔最低赎回份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 6 月 13 日
14	泰康现金管家货币市场基金 2018 年“端午节”假期前暂停申购、转换转入业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站	2018 年 6 月 13 日
15	泰康资产基金直销电子交易平台货币基金快速赎回服务额度	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管	2018 年 6 月 26 日

	调整的公告	理人网站	
--	-------	------	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101 - 20180416	303,835,121.78	6,657,626.30	-	310,492,748.08	26.59%
	2	20180424 - 20180508	303,835,121.78	6,657,626.30	-	310,492,748.08	26.59%
	3	20180614 - 20180630	303,835,121.78	6,657,626.30	-	310,492,748.08	26.59%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康现金管家货币市场基金注册的文件；
- (二) 《泰康现金管家货币市场基金基金合同》；
- (三) 《泰康现金管家货币市场基金招募说明书》；
- (四) 《泰康现金管家货币市场基金托管协议》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录基金管理人互联网网址（<http://www.tkfunds.com.cn>）查阅。

泰康资产管理有限责任公司

2018 年 8 月 27 日