

# 平安交易型货币市场基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

送出日期： 2019 年 8 月 23 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。本半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 2019 年 8 月 22 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。

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

本报告中财务资料未经审计。

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 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	平安货币 ETF	
场内简称	场内货币	
基金主代码	511700	
基金运作方式	契约型、交易型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 23 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
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	11,100,894,522.10 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	2016-10-17	
下属分级基金的基金简称:	平安日鑫 A	场内货币
下属分级基金场内简称:	-	-
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	11,096,223,795.13 份	4,670,726.97 份

本基金 A 类份额（平安日鑫 A）净值为 1.00 元，E 类份额（场内货币）净值为 100.00 元。

### 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	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）。	
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
信息披露负责人	姓名	陈特正	王健
	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	021-38917599-5
传真		0755-23997878	021-38677819

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金半年度报告备置地点	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	平安日鑫 A	场内货币
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日 )	报告期( 2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	25,395,685.35	5,452,026.62
本期利润	25,395,685.35	5,452,026.62
本期净值收益率	1.4497%	1.4496%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2019 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	11,096,223,795.13	467,072,697.05
期末基金份额净值	1	100

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

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
过去一个月	0.2292%	0.0004%	0.1125%	0.0000%	0.1167%	0.0004%
过去三个月	0.6930%	0.0007%	0.3413%	0.0000%	0.3517%	0.0007%
过去六个月	1.4497%	0.0019%	0.6788%	0.0000%	0.7709%	0.0019%
过去一年	3.1940%	0.0027%	1.3688%	0.0000%	1.8252%	0.0027%
自基金合同生效起至今	10.4711%	0.0026%	3.7912%	0.0000%	6.6799%	0.0026%

场内货币

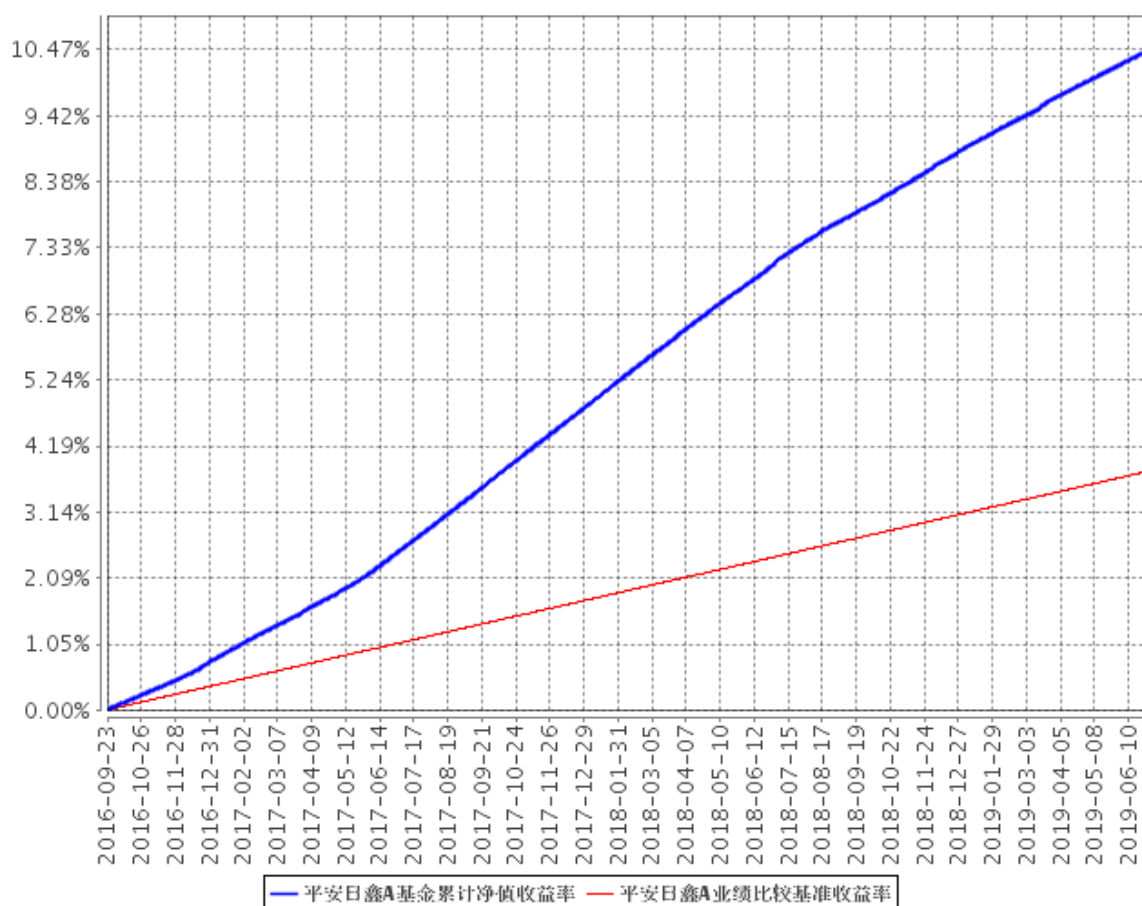
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2292%	0.0004%	0.1125%	0.0000%	0.1167%	0.0004%
过去三个月	0.6930%	0.0007%	0.3413%	0.0000%	0.3517%	0.0007%

过去六个月	1.4496%	0.0019%	0.6788%	0.0000%	0.7708%	0.0019%
过去一年	3.1939%	0.0027%	1.3688%	0.0000%	1.8251%	0.0027%
自基金合同生效起至今	10.4710%	0.0026%	3.7912%	0.0000%	6.6798%	0.0026%

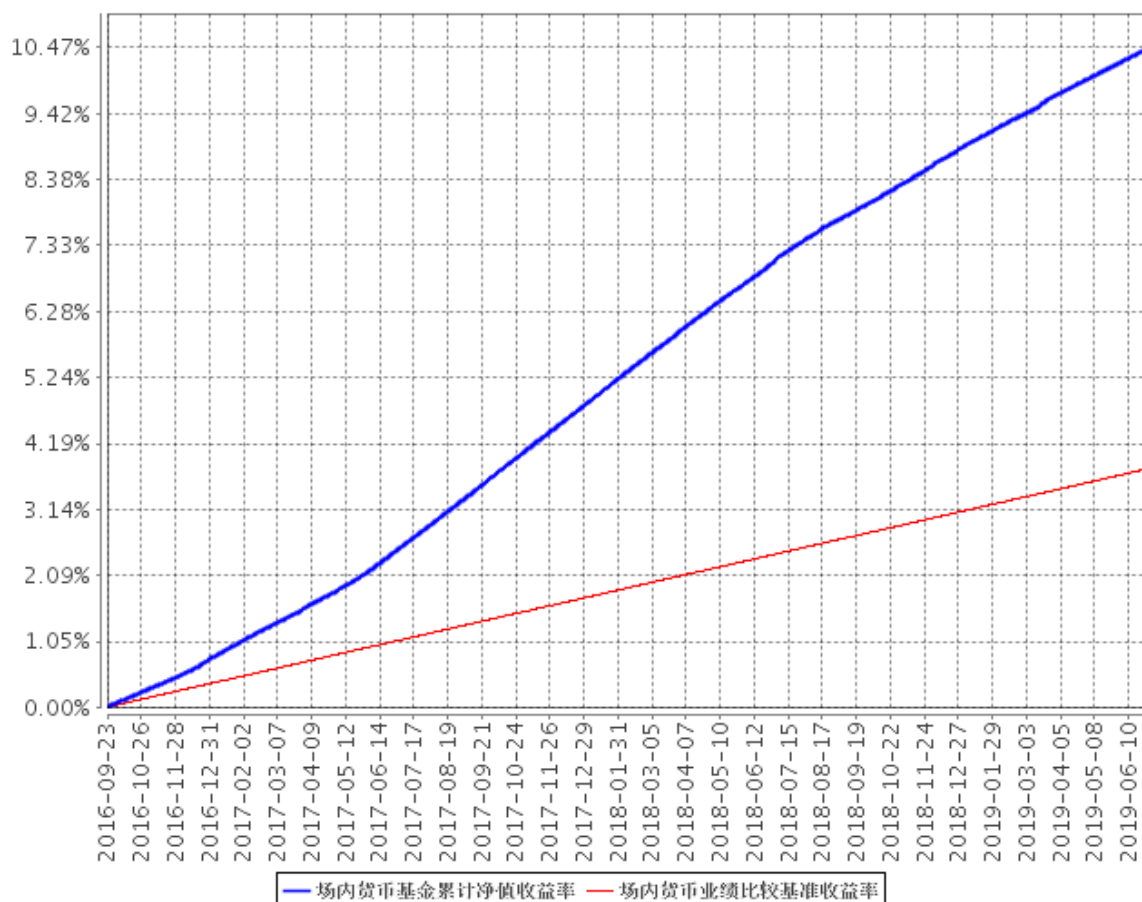
本基金业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方可支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资范围、投资目标及流动性特征，选取同期七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

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

平安日鑫A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



场内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 2016 年 9 月 23 日正式生效，截至报告期末已满两年；
- 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。

## § 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，持有股份 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股份 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份 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 6 月 30 日，平安基金共管理 83 只公募基金，公募基金管理总规模 2877 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		
段玮婧	平安交易型货币市场基金的基金经理	2017 年 1 月 5 日	-	12	段玮婧女士，中山大学硕士。曾担任中国中投证券有限责任公司投资经理。2016 年 9 月加入平安基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益组投资经理。现任平安交易型货币市场基金、平安金管家货币市场基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安短债债券型证券投资基金、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合丰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、平安中短债债券型证券投资基金基金经理。
田元强	平安交易型货币基金的基金经理	2018 年 11 月 26 日	-	6	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分析师、生命保险资产管理有限公司信用评级部分分析师、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投资基金基金经理。
张文平	平安交易型货币基金的基金经理；固定收益投资中心投资执行总经理；	2019 年 6 月 14 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总经理。同时担任平安短债债券型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠轩纯债债券型证券投资基

					金、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、平安惠裕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。

3、自 2019 年 7 月 12 日起，段玮婧不再担任本基金的基金经理，该事项已在中国基金业协会办理变更手续。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安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

投资组合在本报告期连续四个季度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。

#### 4.3.2 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

报告期内，名义 GDP 持续走低，经济基本面偏弱；货币政策强调“不搞大水漫灌”但整体相对宽松；财政政策适度刺激，基建企稳回升；受阶段性通胀回升、贸易谈判反复等影响，债市预期出现摇摆，债券市场震荡为主。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

本报告期平安日鑫 A 的基金份额净值收益率为 1.4497%，本报告期场内货币的基金份额净值收益率为 1.4496%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%。

#### 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，全球经济走弱，各国货币政策再次步入宽松格局；国内经济增长动力依然不足，下行压力持续；政策倾向于结构性调节为主，慎搞总量刺激；降低实体融资成本仍将持续，需维持相对宽松的资金面格局；地产行业监管趋严，销售、投资均有望走弱；由此，债市整体偏友好；不过，考虑到债市收益率已经处于历史低位，预计下行将不会顺畅。我们将继续稳健操作，力争在保障安全性、流动性的情况下，为客户创造良好的收益。

#### 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 30,847,711.97 元,实际分配收益 30,847,711.97 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

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安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的复核，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：平安交易型货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,041,603,706.79	111,307,413.37
结算备付金		-	-
存出保证金		17,843.23	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,105,653,548.47	427,971,963.74
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,937,153,601.09	394,928,080.46
资产支持证券投资		168,499,947.38	33,043,883.28
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	4,572,945,259.43	80,028,440.04
应收证券清算款		20,149,500.00	-
应收利息	6.4.7.5	23,463,506.79	3,466,104.38
应收股利		-	-
应收申购款		1,928,951.26	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,765,762,315.97	622,773,921.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		200,219,699.89	61,699,471.35
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		752,765.43	79,248.86
应付托管费		250,921.80	26,416.27
应付销售服务费		50,184.38	5,283.26
应付交易费用	6.4.7.7	92,456.39	20,090.76
应交税费		57,555.19	17,015.37

应付利息		24,326.51	52,211.52
应付利润		831,520.01	57,718.97
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	186,394.19	347,000.00
负债合计		202,465,823.79	62,304,456.36
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	11,563,296,492.18	560,469,465.17
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		11,563,296,492.18	560,469,465.17
负债和所有者权益总计		11,765,762,315.97	622,773,921.53

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 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 11,100,894,522.10 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 11,096,223,795.13 份，E 类基金份额的份额总额为 4,670,726.97 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安交易型货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		35,970,888.78	90,809,145.13
1.利息收入		35,797,686.55	91,011,012.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,825,351.73	57,345,788.89
债券利息收入		21,794,483.88	24,686,695.22
资产支持证券利息收入		1,097,503.25	148,239.39
买入返售金融资产收入		6,080,347.69	8,830,288.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		173,202.23	-202,158.66
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	173,202.23	-202,158.66
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	-	291.67
<b>减：二、费用</b>		5,123,176.81	5,847,661.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,589,925.40	2,987,452.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	529,975.13	995,817.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	105,995.07	199,163.55
4. 交易费用	6.4.7.19	-	9.98
5. 利息支出		2,720,254.80	1,439,263.53
其中：卖出回购金融资产支出		2,720,254.80	1,439,263.53
6. 税金及附加		21,032.22	4,040.73
7. 其他费用	6.4.7.20	155,994.19	221,913.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		30,847,711.97	84,961,483.17
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		30,847,711.97	84,961,483.17

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安交易型货币市场基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	560,469,465.17	-	560,469,465.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,847,711.97	30,847,711.97
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）	11,002,827,027.01	-	11,002,827,027.01
其中：1. 基金申购款	16,116,992,969.47	-	16,116,992,969.47
2. 基金赎回款	-5,114,165,942.46	-	-5,114,165,942.46
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）	-	-30,847,711.97	-30,847,711.97



以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	11,563,296,492.18	-	11,563,296,492.18
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	9,788,228,388.07	-	9,788,228,388.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	84,961,483.17	84,961,483.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-9,246,742,763.80	-	-9,246,742,763.80
其中：1. 基金申购款	5,847,969,338.04	-	5,847,969,338.04
2. 基金赎回款	-15,094,712,101.84	-	-15,094,712,101.84
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)	-	-84,961,483.17	-84,961,483.17
五、期末所有者权益(基金净值)	541,485,624.27	-	541,485,624.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>张南南</u>
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

平安交易型货币市场基金(原名为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《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》，平安大华交易型货币市场基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安交易型货币市场基金。

根据《平安交易型货币市场基金基金合同》和《平安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)。

#### 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》、《平安交易型货币市场基金基金

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于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司	基金管理人、A 类基金份额的注册登记机构、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	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	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
平安科技(深圳)有限公司	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	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安融资担保(天津)有限公司	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
平安国际融资租赁有限公司	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	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安汇富资产管理有限公司	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
深圳联新投资管理有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安综合金融服务有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳万里通网络信息技术有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安普惠融资担保有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的

	联营公司
深圳前海联礼阳投资有限责任公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳市兴科融投资有限责任公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
重庆金安小额贷款有限公司	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
上海灿烜企业管理有限公司	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	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
乌鲁木齐广丰荣股权投资管理有限合伙企业	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
京乾（北京）投资管理有限责任公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安国际智慧城市科技股份有限公司	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
深圳市平安置业投资有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
厦门金烜投资有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安健康互联网股份有限公司	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
平安医疗健康管理股份有限公司	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
深圳平安普惠小额贷款有限公司	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
平安普惠投资咨询有限公司	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
平安磐海资本有限责任公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安财产保险股份有限公司	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	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
上海陆金所基金销售有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金于本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。

**6.4.8.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	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 成交总额的比例
国泰君安	172,191,057.60	100.00%	-	-

**6.4.8.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	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	261,400,000.00	100.00%	540,000,000.00	100.00%

**6.4.8.1.4 权证交易**

本基金于本期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。

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**6.4.8.2 关联方报酬****6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,589,925.40	2,987,452.88
其中：支付销售机构的客户维护费	30,778.68	2,177.57

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 0.15%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。

## 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	529,975.13	995,817.61

注：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 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

## 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安日鑫 A	场内货币	合计
平安银行股份有限公司	24.74	-	24.74
平安基金管理有限公司	79,096.84	3,627.37	82,724.21
上海陆金所基金销售有限公司	5,017.00	-	5,017.00
国泰君安证券股份有限公司	259.62	584.42	844.04
平安证券股份有限公司	111.12	10,811.88	10,923.00
合计	84,509.32	15,023.67	99,532.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安日鑫 A	场内货币	合计
平安基金管理有限公司	153,841.22	13,991.32	167,832.54
平安证券股份有限公司	0.54	1,665.55	1,666.09
国泰君安证券股份有限公司	270.59	1,822.18	2,092.77
合计	154,112.35	17,479.05	171,591.40

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×0.01%/当年天数。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2019年1月1日至2019年6月30日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
国泰君安证券股份有限公司	49,501,023.48	-	-	-	-	-

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	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	49,950,603.25	-
期间申购/买入总份额	733,861.25	-
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	50,684,464.50	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.4566%	-

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	-	202,863.91
期间申购/买入总份额	50,140,518.89	1,421,658.09
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	35,000,000.00	1,624,522.00



期末持有的基金份额	15,140,518.89	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	6.5013%	-

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

平安日鑫 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 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
平安科技 (深圳)有限公司	100,023,976.62	0.9010%	-	-
深圳平安金融科技咨询有限公司	451,439,256.23	4.0667%	-	-
平安融资担保(天津)有限公司	150,025,240.91	1.3515%	-	-
平安国际融资租赁有限公司	100,008,630.08	0.9009%	-	-
平安不动产 有限公司	100,327,667.84	0.9038%	-	-
深圳平安汇富资产管理 有限公司	200,017,260.16	1.8018%	-	-
中国平安保险(集团) 股份有限公司	50,483,969.36	0.4548%	-	-
深圳联新投资管理 有限公司	32,078.96	0.0003%	-	-
深圳平安综合金融服务 有限公司	100,016,827.28	0.9010%	-	-
深圳万里通网络信息技	100,055,968.71	0.9013%	-	-

术有限公司				
平安普惠融 资担保有限 公司	800,410,228.58	7.2103%	-	-
深圳前海联 礼阳投资有 限责任公司	350,509,859.60	3.1575%	-	-
深圳市兴科 融投资有限 责任公司	109,556,101.36	0.9869%	-	-
重庆金安小 额贷款有限 公司	50,008,413.63	0.4505%	-	-
上海灿炬企 业管理有限 公司	50,483,969.36	0.4548%	-	-
广州平安好 贷小额贷款 有限公司	-	-	20,004,521.84	5.9491%
乌鲁木齐广 丰荣股权投 资管理有限 合伙企业	30,851,620.29	0.2779%	-	-
京乾（北京） 投资管理有 限责任公司	5,087,553.03	0.0458%	5,013,890.23	1.4911%
平安国际智 慧城市科技 股份有限公 司	201,052,100.79	1.8111%	40,000,000.00	11.8956%
深圳市平安 置业投资有 限公司	200,032,739.09	1.8020%	-	-
厦门金炬投 资有限公司	50,483,969.36	0.4548%	-	-
平安健康互 联网股份有 限公司	100,000,000.00	0.9008%	-	-
平安医疗健 康管理股份 有限公司	100,008,630.08	0.9009%	-	-
中国平安财 产保险股份 有限公司	500,541,303.15	4.5090%	-	-

中国平安人寿保险股份有限公司	3,000,287,719.50	27.0274%	-	-
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	-	-	20,003,371.02	5.9488%

## 场内货币

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 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
平安普惠融资担保有限公司	83.02	0.0000%	-	-
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	206,824.71	0.0019%	203,830.24	0.0606%
平安融资担保（天津）有限公司	6.00	0.0000%	-	-
平安普惠投资咨询有限公司	1.00	0.0000%	-	-
平安健康互联网股份有限公司	92.02	0.0000%	-	-
平安磐海资本有限责任公司	1,703,883.28	0.0153%	-	-
深圳平安汇富资产管理有限公司	2,142.69	0.0000%	-	-
平安证券股份有限公司	1,090,382.78	0.0098%	-	-
平安国际融资租赁有限公司	47.01	0.0000%	-	-
平安科技（深圳）有	472.04	0.0000%	-	-

限公司				
深圳平安普惠小额贷款有限公司	77.06	0.0000%	-	-
中国平安人寿保险股份有限公司	-	-	1.00	0.0000%

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安-活期	414,603,706.79	966,402.08	4,916,472.83	267,146.16
平安银行-定期	-	-	30,000,000.00	3,523,277.61

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。

#### 6.4.8.6 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6月30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	139485	信融05优	私募	100,000	10,000,000.00

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

**6.4.9.2.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 200,219,699.89 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
120231	12 国开 31	2019 年 7 月 1 日	100.04	600,000	60,021,872.67
120312	12 进出 12	2019 年 7 月 1 日	100.23	1,000,000	100,227,722.89
199916	19 贴现国债 16	2019 年 7 月 1 日	99.88	500,000	49,939,636.36
199922	19 贴现国债 22	2019 年 7 月 1 日	99.59	30,000	2,987,831.12
合计				2,130,000	213,177,063.04

**6.4.9.2.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****6.4.10.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

**6.4.10.2 其他事项**

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	5,105,653,548.47	43.39
	其中:债券	4,937,153,601.09	41.96
	资产支持证券	168,499,947.38	1.43
2	买入返售金融资产	4,572,945,259.43	38.87
	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	2,041,603,706.79	17.35
4	其他各项资产	45,559,801.28	0.39
5	合计	11,765,762,315.97	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	11.93	
	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	200,219,699.89	1.73
	其中:买断式回购融资	-	-

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%。

### 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	44
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

### 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。

### 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	61.06	1.73
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	22.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	8.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	8.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		101.53	1.73

### 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

本基金本报告期内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	309,556,945.61	2.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	260,360,217.67	2.25
	其中：政策性金融债	260,360,217.67	2.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	694,730,223.62	6.01
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,672,506,214.19	31.76

8	其他	-	-
9	合计	4,937,153,601.09	42.70
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	111916140	19 上海银行 CD140	3,000,000	298,254,210.75	2.58
2	199916	19 贴现国债 16	1,700,000	169,794,763.62	1.47
3	011901248	19 苏交通 SCP009	1,500,000	149,880,480.27	1.30
4	111916156	19 上海银行 CD156	1,500,000	149,771,854.53	1.30
5	120312	12 进出 12	1,000,000	100,227,722.89	0.87
6	071900043	19 财通证券 CP002	1,000,000	100,001,513.61	0.86
7	111910190	19 兴业银行 CD190	1,000,000	99,706,609.76	0.86
8	111916110	19 上海银行 CD110	1,000,000	99,693,347.69	0.86
9	111882369	18 南京银行 CD102	1,000,000	99,681,335.42	0.86
10	111815395	18 民生银行 CD395	1,000,000	99,554,118.72	0.86

## 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	0.1585%
报告期内偏离度的最低值	-0.0128%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0585%

### 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%。



**7.8 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**

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	139446	恒融二7A(总价)	400,000.00	40,139,136.01	0.35
2	139463	方碧46优(总价)	300,000.00	30,348,769.01	0.26
3	139651	永熙3优1(总价)	280,000.00	28,000,000.00	0.24
4	139653	天著优02(总价)	240,000.00	24,000,000.00	0.21
5	139601	绿城11优(总价)	130,000.00	13,005,750.53	0.11
6	139485	信融05优(总价)	100,000.00	10,000,000.00	0.09
6	139352	链融02A1(总价)	100,000.00	10,000,000.00	0.09
7	149794	金地02A(总价)	70,000.00	7,006,291.83	0.06
8	156242	18裕源01(总价)	60,000.00	6,000,000.00	0.05

**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，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。

**7.9.2**

上海银监局于2018年10月8日做出沪银监罚决字〔2018〕49号处罚决定，由于上海银行股份有限公司（以下简称“公司”）违规向其关系人发放信用贷款，根据相关规定对公司罚款约109万元。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2018年11月9日做出银保监银罚决字〔2018〕8号处罚决定，由于中国民生银

行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺。根据相关规定对公司罚款 3160 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 2018 年 11 月 9 日做出银保监银罚决字〔2018〕5 号处罚决定，由于中国民生银行股份有限公司（以下简称“公司”）：贷款业务严重违反审慎经营规则。根据相关规定对公司罚款 200 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。

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。

### 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	17,843.23
2	应收证券清算款	20,149,500.00
3	应收利息	23,463,506.79
4	应收申购款	1,928,951.26
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	45,559,801.28

### 7.9.4 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。

## § 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
平安 日鑫 A	31,756	349,421.33	10,670,308,681.90	96.16%	425,915,113.23	3.84%
场内 货币	821	5,689.07	3,365,960.29	72.07%	1,304,766.68	27.93%
合计	32,576	340,769.11	10,673,674,642.19	96.15%	427,219,879.91	3.85%

上述机构/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）。“持有份额”包含未结转的未付收益。

### 8.2 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	平安磐海资本有限责任公司	1,703,883.28	36.48%
2	平安证券股份有限公司	1,003,420.54	21.48%
3	深圳平安大华汇通财富管理有限公司	206,824.71	4.43%
4	陕西省国际信托股份有限公司-陕国投·东山精密员工持股集合资金信托计划	99,764.21	2.14%
5	平安证券股份有限公司	86,962.24	1.86%
6	杭州龙旗科技有限公司-龙旗东升二期私募投资基金	76,836.29	1.65%
7	太平资管-建设银行-太平资产量化7号资管产品	61,143.76	1.31%
8	刘宝增	31,700.02	0.68%
9	侯晓光	31,205.92	0.67%
10	方正中期期货有限公司-方正中期-金罗盘1号集合资产管理计划	24,516.59	0.52%

本基金 E 类份额（场内货币）为上市份额，“上市总份额”和“份额”包含未结转的未付收益。

**8.3 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	保险类机构	3,000,287,719.50	27.03%
2	其他机构	800,410,228.58	7.21%
3	银行类机构	800,000,000.00	7.21%
4	银行类机构	600,656,318.28	5.41%
5	保险类机构	500,541,303.15	4.51%
6	其他机构	451,439,256.23	4.07%
7	其他机构	350,509,859.60	3.16%
8	其他机构	300,190,848.19	2.70%
9	银行类机构	300,000,000.00	2.70%
10	其他机构	201,052,100.79	1.81%

“持有份额”和“总份额”均包含未结转的未付收益。

**8.4 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	162,837.76	0.0015%
	场内货币	0.00	0.0000%
	合计	162,837.76	0.0015%

上述从业人员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）。

**8.5 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

## § 9 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	333,994,444.14	2,264,750.21
本报告期期间基金总申购份额	14,553,527,207.04	15,634,657.62
减：本报告期期间基金总赎回份额	3,791,297,856.05	13,228,680.86
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	11,096,223,795.13	4,670,726.97

本基金 A 类份额净值为 1.00 元，E 类份额净值为 100.00 元

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 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

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。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用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。

### 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，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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	3	-	-	-	-	-

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	172,191,057.60	100.00%	261,400,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内本基金偏离度绝对值未出现超过0.5%的情况。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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	2019/06/28--2019/06/30	0.00	3,000,287,719.50	0.00	3,000,287,719.50	27.03%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同的情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

“期初份额”和“持有份额”包含未结转的未付收益，“申购份额”包含红利再投所得份额，“赎回份额”包含全部赎回带走的未付收益。

平安基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日