

平安日增利货币市场基金 2019 年半年度报告

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：平安银行股份有限公司

送出日期： 2019 年 8 月 22 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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。

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.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 债券回购融资情况.....	44
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	44
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.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	46
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.....	47
7.9 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	54
10.9 其他重大事件.....	55
§11 备查文件目录.....	57

11.1 备查文件目录.....	57
11.2 存放地点.....	57
11.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安日增利货币市场基金
基金简称	平安日增利货币
场内简称	-
基金主代码	000379
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 3 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	129,518,677,938.42 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34	深圳市罗湖区深南东路 5047 号

	层	
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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)
本期已实现收益	1,900,449,342.28
本期利润	1,900,449,342.28
本期净值收益率	1.3266%
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	129,518,677,938.42
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
累计净值收益率	22.2815%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

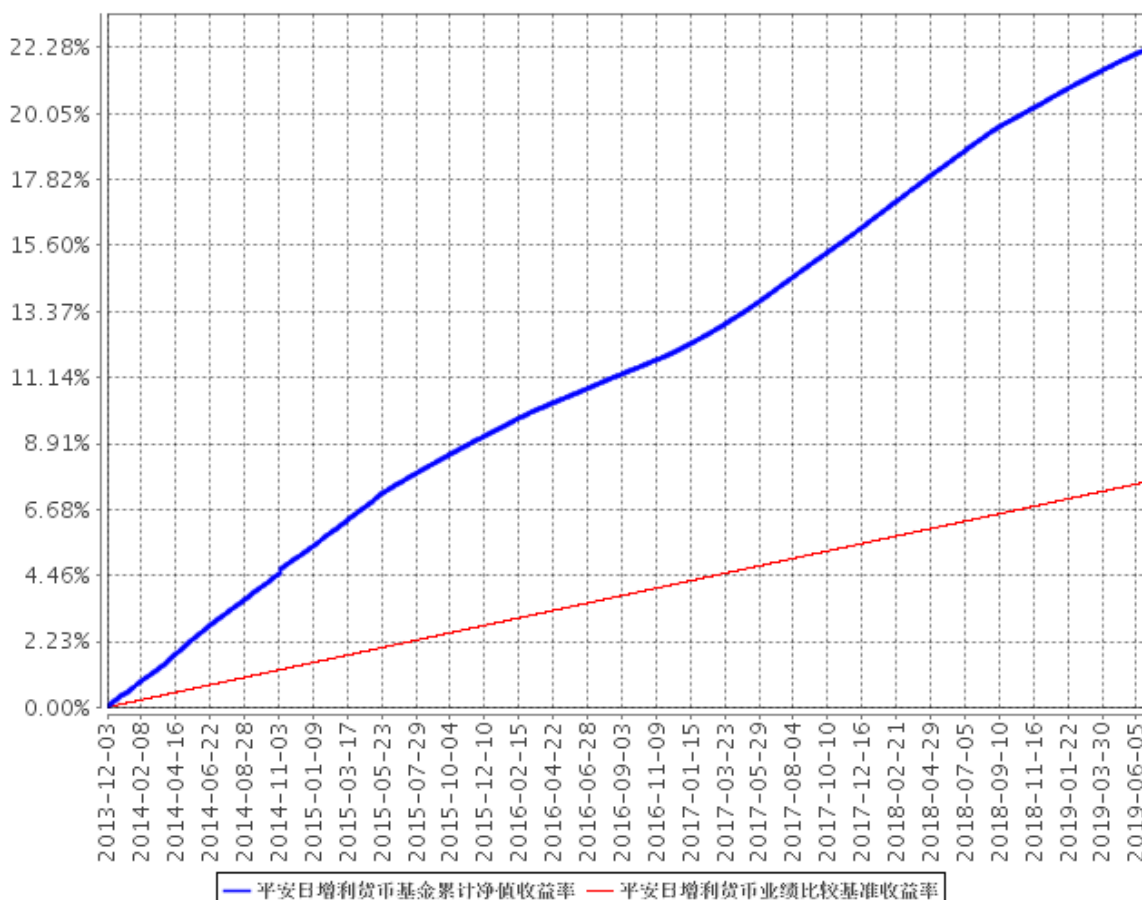
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.2011%	0.0004%	0.1125%	0.0000%	0.0886%	0.0004%
过去三个月	0.6288%	0.0006%	0.3413%	0.0000%	0.2875%	0.0006%
过去六个月	1.3266%	0.0007%	0.6788%	0.0000%	0.6478%	0.0007%
过去一年	2.9906%	0.0013%	1.3688%	0.0000%	1.6218%	0.0013%
过去三年	10.3792%	0.0018%	4.1063%	0.0000%	6.2729%	0.0018%
自基金合同生效起至今	22.2815%	0.0036%	7.6350%	0.0000%	14.6465%	0.0036%

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

平安日增利货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效，截至报告期末已满五年；
- 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基金合同约定。

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

§ 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		
周琛	平安日增利货币市场基金的基金经理	2017 年 12 月 1 日	-	11	周琛女士，拉夫堡大学硕士。先后担任五矿证券有限公司助理研究员、交易员。2012 年 8 月加入平安基金管理有限公司，曾任基金运营部交易岗、投资研究部固定收益研究员。现任平安财富宝货币市场基金、平安日增利货币市场基金、平安合悦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。
张文平	固定收益投资中心投资执行总经理、平安日增利货币市场基	2018 年 8 月 10 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

	金的基金经理				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。
田元强	平安日增利货币市场基金的基金经理	2019 年 3 月 21 日	-	6	田元强先生，西安交通大学工商管理硕士，曾先后担任鹏元资信评估有限公司信用评级部分析师、生命保险资产管理有限公司信用评估部分析师、中国中投证券有限责任公司研究总部分析员。2016 年 11 月加入平安基金管理有限公司，任固定收益投资中心固定收益高级研究员。同时担任平安交易型货币市场基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安如意中短债债券型证券投资基金基金经理。
申俊华	平安日增利货币市场基金的基金经理	2017 年 12 月 5 日	2019 年 4 月 1 日	10	申俊华女士，湖南大学金融学博士。曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员。2012 年加入平安基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员。曾担任平安财富宝货币市场基金、平安日增利货币市场基金基金经理。

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、《平安日增利货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期基金份额净值增长率为 1.3266%，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。本报告期内盈分配收益 1,900,449,342.28 元，实际分配收

益 1,900,449,342.28 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

本基金本报告期末出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本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

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安日增利货币市场基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	38,737,385,650.12	75,410,649,147.60
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	58,974,814,090.02	70,316,337,408.28
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		56,654,601,034.93	68,424,677,770.90
资产支持证券投资		2,320,213,055.09	1,891,659,637.38
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	32,702,028,943.09	12,237,343,516.07
应收证券清算款		231,719,250.00	-
应收利息	6.4.7.5	455,014,534.15	777,069,603.71
应收股利		-	-
应收申购款		1,388,243.20	2,890,984.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		131,102,350,710.58	158,744,290,660.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,500,653,969.54	8,989,550,285.70
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	40,087,336.19
应付管理人报酬		36,084,268.76	45,650,167.81
应付托管费		8,747,701.52	11,066,707.36
应付销售服务费		27,336,567.22	34,583,460.42
应付交易费用	6.4.7.7	845,461.20	726,126.83

应交税费		936,373.35	991,820.35
应付利息		320,742.07	9,422,901.10
应付利润		8,590,383.63	11,195,428.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	157,304.87	27,559,405.04
负债合计		1,583,672,772.16	9,170,833,639.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	129,518,677,938.42	149,573,457,021.39
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		129,518,677,938.42	149,573,457,021.39
负债和所有者权益总计		131,102,350,710.58	158,744,290,660.44

报告截止日 2019 年 6 月 30 日，平安日增利货币基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 129,518,677,938.42 份。

6.2 利润表

会计主体：平安日增利货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,432,138,014.61	3,565,356,235.07
1.利息收入		2,411,564,479.89	3,567,979,451.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,184,500,171.45	2,185,942,926.67
债券利息收入		945,551,256.21	1,132,141,861.49
资产支持证券利息收入		39,840,593.49	3,859,417.44
买入返售金融资产收入		241,672,458.74	246,035,245.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,573,234.72	-2,656,130.38
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	20,578,341.99	-2,656,130.38
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-5,107.27	-
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	300.00	32,914.13

减：二、费用		531,688,672.33	513,366,805.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	235,761,535.10	252,356,659.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	57,154,311.45	61,177,372.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	178,607,223.47	191,179,287.81
4. 交易费用	6.4.7.19	2,046.62	1,134.24
5. 利息支出		59,528,600.96	7,537,841.80
其中：卖出回购金融资产支出		59,528,600.96	7,537,841.80
6. 税金及附加		468,049.86	816,724.11
7. 其他费用	6.4.7.20	166,904.87	297,785.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,900,449,342.28	3,051,989,429.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,900,449,342.28	3,051,989,429.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安日增利货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 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）	149,573,457,021.39	-	149,573,457,021.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,900,449,342.28	1,900,449,342.28
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）	-20,054,779,082.97	-	-20,054,779,082.97
其中：1.基金申购款	286,624,274,896.74	-	286,624,274,896.74
2.基金赎回款	-306,679,053,979.71	-	-306,679,053,979.71
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）	-	-1,900,449,342.28	-1,900,449,342.28
五、期末所有者权益（基金净值）	129,518,677,938.42	-	129,518,677,938.42

告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华日增利货币市场基金基金合同》于 2013 年 12 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 525,531,640.49 份基金份额,其中认购资金利息折合 22,936.53 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华日增利货币市场基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安日增利货币市场基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安日增利货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金,期限一年以内(含一年)的银行存款、同业存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:税后同期七天通知存款利率。

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》、《平安日增利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 6 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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 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 2019年6月30日
活期存款	37,385,650.12
定期存款	38,700,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	1,500,000,000.00
存款期限1-3个月	11,900,000,000.00
存款期限3个月以上	25,300,000,000.00
其他存款	-
合计：	38,737,385,650.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019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	56,654,601,034.93	56,702,599,100.00	47,998,065.07	0.0371%
	合计	56,654,601,034.93	56,702,599,100.00	47,998,065.07	0.0371%
	资产支持证券	2,320,213,055.09	2,320,198,211.17	-14,843.92	0.0000%
	合计	58,974,814,090.02	59,022,797,311.17	47,983,221.15	0.0370%

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

本基金于本期末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 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	-	-
银行间市场	32,702,028,943.09	-
合计	32,702,028,943.09	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末未持有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 2019年6月30日
应收活期存款利息	427,190.00
应收定期存款利息	200,813,196.89
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	180,819,485.22
应收资产支持证券利息	35,372,985.80
应收买入返售证券利息	37,581,676.24
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	455,014,534.15

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	845,461.20
合计	845,461.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	157,304.87
合计	157,304.87

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	149,573,457,021.39	149,573,457,021.39
本期申购	286,624,274,896.74	286,624,274,896.74
本期赎回(以“-”号填列)	-306,679,053,979.71	-306,679,053,979.71
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	129,518,677,938.42	129,518,677,938.42

注：申购含红利再投份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	1,900,449,342.28	-	1,900,449,342.28
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	-1,900,449,342.28	-	-1,900,449,342.28
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	799,375.72
定期存款利息收入	1,183,699,948.98
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	428.69
其他	418.06
合计	1,184,500,171.45

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期内无股票投资收益。

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 2019年1月1日至2019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	20,578,341.99
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	20,578,341.99

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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	92,471,287,836.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	91,927,270,824.50
减：应收利息总额	523,438,670.15
买卖债券差价收入	20,578,341.99

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	1,282,105,277.84
减：卖出资产支持证券成本总额	1,244,085,107.27
减：应收利息总额	38,025,277.84
资产支持证券投资收益	-5,107.27

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动损益。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	300.00
合计	300.00

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	2,046.62
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,046.62

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	89,260.15
信息披露费	59,044.72
其他	600.00
账户维护费	18,000.00
合计	166,904.87

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无须作披露的分部报告。

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

截至本财务报表批准报出日，本基金并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
平安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	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
北京车之家信息技术有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
大华银行有限公司	基金管理人股东的实际控制人
上海友玩网络科技有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安汇通初创投资管理有限公司	基金管理人的子公司的合营公司
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
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
深圳壹账通信息科技服务有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的联营公司
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
深圳壹账通智能科技有限公司	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
珠海亿融通资产管理有限公司	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
大华银行（中国）有限公司	基金管理人股东的实际控制人控制的企业、基金销售机构

注：以下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

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	235,761,535.10	252,356,659.89
其中：支付销售机构的客户维护费	5,647,806.36	1,889,492.15

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 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	57,154,311.45	61,177,372.09

注：支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.08%/ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
平安银行股份有限公司	1,134,549.25
大华银行（中国）有限公司	1.79
平安基金管理有限公司	167,807,020.21
平安证券股份有限公司	26,537.85
合计	168,968,109.10
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
平安银行股份有限公司	1,849,287.53
平安基金管理有限公司	189,889,232.76
平安证券股份有限公司	45,151.77
合计	191,783,672.06

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 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/ 当年天数。

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

本基金于本期及上年度可比期间均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	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
基金合同生效日（2013 年 12 月 3 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	227,050,033.60	-
期间申购/买入总份额	92,030,161.02	100,276,132.13
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	220,000,000.00	0.00
期末持有的基金份额	99,080,194.62	100,276,132.13
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0765%	0.0599%

报告期间持有份额含红利再投资、未付收益转份额

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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2019 年 6 月 30 日		2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
北京车之家信息技术有限公司	121,584.92	0.0001%	120,059.11	0.0001%
大华银行有限公司	197,468,847.60	0.1525%	90,640,799.56	0.0606%
平安不动产有限公司	-	-	1,000,000,000.00	0.6686%
平安付科技服务有限公司	-	-	171,204,266.76	0.1145%
广州平安好贷小额贷款有限公司	-	-	30,038,811.34	0.0201%
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	106,751,726.33	0.0824%	607,000,693.37	0.4058%
深圳平安汇通初创投资管理有限	1,550,956.69	0.0012%	1,530,488.27	0.0010%

公司				
深圳平安金融科技咨询有限公司	2,605,389,610.51	2.0116%	1,004,669,956.23	0.6717%
平安科技(深圳)有限公司	-	-	2,338,281.08	0.0016%
中国平安人寿保险股份有限公司	3,059,146.53	0.0024%	3,018,774.22	0.0020%
深圳市平安赢致投资基金管理有限公司	-	-	5,066,052.03	0.0034%
平安直通咨询有限公司	-	-	17,166,852.10	0.0115%
平安国际智慧城市科技股份有限公司	300,773,456.33	0.2322%	-	-
深圳平安综合金融服务有限公司	18,959,365.36	0.0146%	255,202,254.14	0.1706%
深圳前海征信中心股份有限公司	-	-	4,046,038.10	0.0027%
深圳鑫橙投资管理有限公司	-	-	20,405,465.47	0.0136%
深圳鑫植网络科技有限公司	-	-	13,731,144.36	0.0092%
深圳壹账通信息科技服务有限公司	20,065,408.54	0.0155%	-	-
深圳万里通网络信息技术有限公司	202,409,315.76	0.1563%	-	-
深圳壹账通科技服务有限公司	-	-	21,330,401.23	0.0143%
深圳壹账通智能科技有限公司	80,290,818.23	0.0620%	10,006,569.29	0.0067%
上海友玩网络科技有限公司	5,012,985.91	0.0039%	10,011,390.57	0.0067%
珠海亿融通资产管理有限公司	30,217,843.43	0.0233%	33,290,528.36	0.0223%
中国平安保险(集团)股份有限公司	2,444,616.27	0.0019%	300,836,651.57	0.2011%

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期	37,385,650.12	799,375.72	58,142,490.67	4,114,910.22
平安银行-定期	-	6,699,999.52	10,528,000,000.00	185,023,157.88

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息，定期存款按协议利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2019年1月1日至2019年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	860,000	86,000,000.00
平安证券	139772	绿城 13 优	私募	890,000	89,000,000.00

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 19,300,000 张平安银行的同业存单，成本总额为人民币 1,874,921,307.69 元，估值总额为人民币 1,875,131,000.00 元，占基金资产净值的比例为 1.45%(2018 年 6 月 30 日：无)。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
1,903,054,386.90	-	-2,605,044.62	1,900,449,342.28	-

注：本基金在本年度累计分配收益 1,900,449,342.28 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 1,891,858,958.65 元，无包含于赎回款的已分配未支付收益，计入应付收益科目 8,590,383.63 元。

6.4.12 期末（2019 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

6.4.12.1.4 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
159179	19 信易 05	2019 年 5 月 13 日	2019 年 7 月 1 日	新资产支持证券未上市	100.00	100.00	160,000	16,000,000.00	16,000,000.00	-
139760	联易融 13	2019 年 6 月 18 日	2019 年 7 月 9 日	新资产支持证券未上市	100.00	100.00	260,000	26,000,000.00	26,000,000.00	-
139706	链融 11A3	2019 年 6 月 3 日	2019 年 7 月 5 日	新资产支持证券未上市	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-
139704	链融 11A1	2019 年 6 月 3 日	2019 年 7 月 5 日	新资产支持证券未上市	100.00	100.00	320,000	32,000,000.00	32,000,000.00	-
139726	永熙优 05	2019 年 6 月 13 日	2019 年 7 月 4 日	新资产支持证券	100.00	100.00	370,000	37,000,000.00	37,000,000.00	-

			日	券未上市						
139705	链融 11A2	2019 年 6 月 3 日	2019 年 7 月 5 日	新资产支持证券未上市	100.00	100.00	390,000	39,000,000.00	39,000,000.00	-
159383	19 京保 6A	2019 年 6 月 20 日	2019 年 7 月 17 日	新资产支持证券未上市	100.00	100.00	400,000	40,000,000.00	40,000,000.00	-
139732	永熙 优 06	2019 年 6 月 17 日	2019 年 7 月 2 日	新资产支持证券未上市	100.00	100.00	400,000	40,000,000.00	40,000,000.00	-
139719	天著 优 03	2019 年 6 月 10 日	2019 年 7 月 3 日	新资产支持证券未上市	100.00	100.00	400,000	40,000,000.00	40,000,000.00	-
139718	金易 01	2019 年 6 月 11 日	2019 年 7 月 4 日	新资产支持证券未上市	100.00	100.00	490,000	49,000,000.00	49,000,000.00	-
139784	中交 4 优 A	2019 年 6 月	2019 年 7 月	新资产支持证	100.00	100.00	570,000	57,000,000.00	57,000,000.00	-

		27 日	月 16 日	持证 券未 上市						
139772	绿城 13 优	2019 年 6 月 24 日	2019 年 7 月 15 日	新资 产支 持证 券未 上市	100.00	100.00	890,000	89,000,000.00	89,000,000.00	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 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 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,500,653,969.54 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	100.03	1,000,000	100,028,422.11
180018	18 付息国 债 18	2019 年 7 月 1 日	100.07	4,336,000	433,910,986.09
180209	18 国开 09	2019 年 7 月 1 日	100.01	5,076,000	507,647,568.37
180312	18 进出 12	2019 年 7 月 1 日	100.14	2,020,000	202,273,891.57
180410	18 农发 10	2019 年 7 月 1 日	100.05	3,130,000	313,161,343.04
合计				15,562,000	1,557,022,211.18

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制订了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制订了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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平安银行；其他定期存款存放在资信状况良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的资产支持证券余额为 2,320,213,055.09 元，均为长期信用评级 AAA 级(2018 年 12 月 31 日：1,891,659,637.38 元，均为长期信用评级 AAA 级)。

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	2,069,674,997.94	830,014,791.43
A-1 以下	-	-
未评级	13,546,614,875.44	9,672,433,492.73
合计	15,616,289,873.38	10,502,448,284.16

注：以上按短期信用评级的债券投资未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	39,075,179,538.53	55,942,142,569.06
合计	39,075,179,538.53	55,942,142,569.06

注：以上按短期信用评级列示的同业存单未评级的债券投资为同业存单。

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	10,033,226.54	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,953,098,396.48	1,980,086,917.68
合计	1,963,131,623.02	1,980,086,917.68

注：以上按长期信用评级的债券投资未评级债券为政策性金融债。

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	2,320,213,055.09	1,891,659,637.38
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	2,320,213,055.09	1,891,659,637.38

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于 2019 年 6 月 30 日本基金投资组合的平均剩余期限未超过 120 天，平均剩余存续期限未超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。

于 2019 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 1,500,653,969.54 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种（企业债或短期融资券），并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2019 年 06 月 30 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 9.58%，本基金投资组合的平均剩余期限为 80 天，平均剩余存续期为 81 天。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流

动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

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 2019年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,737,385,650.12	26,000,000,000.00	6,000,000,000.00	-	-	-	38,737,385,650.12
交易性金融资产	9,704,916,760.31	23,584,697,862.28	25,685,199,467.43	-	-	-	58,974,814,090.02
买入返售金融资产	32,702,028,943.09	-	-	-	-	-	32,702,028,943.09
应收证券清算款	-	-	-	-	-	231,719,250.00	231,719,250.00
应收利息	-	-	-	-	-	455,014,534.15	455,014,534.15
应收申购款	-	-	-	-	-	1,388,243.20	1,388,243.20
资产总计	49,144,331,353.52	49,584,697,862.28	31,685,199,467.43	-	-	688,122,027.35	131,102,350,710.58
负债							
卖出回购金融资产款	1,500,653,969.54	-	-	-	-	-	1,500,653,969.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,084,268.76	36,084,268.76
应付托管费	-	-	-	-	-	8,747,701.52	8,747,701.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-	27,336,567.22	27,336,567.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	845,461.20	845,461.20
应付利息	-	-	-	-	-	320,742.07	320,742.07

应付利润	-	-	-	-	-	8,590,383.63	8,590,383.63
应交税费	-	-	-	-	-	936,373.35	936,373.35
其他负债	-	-	-	-	-	157,304.87	157,304.87
负债总计	1,500,653,969.54	-	-	-	-	83,018,802.62	1,583,672,772.16
利率敏感度缺口	47,643,677,383.98	49,584,697,862.28	31,685,199,467.43	-	-	605,103,224.73	129,518,677,938.42
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,630,649,147.60	45,270,000,000.00	28,510,000,000.00	-	-	-	75,410,649,147.60
交易性金融资产	4,641,480,141.97	29,537,647,981.90	36,137,209,284.41	-	-	-	70,316,337,408.28
买入返售金融资产	12,237,343,516.07	-	-	-	-	-	12,237,343,516.07
应收利息	-	-	-	-	-	777,069,603.71	777,069,603.71
应收申购款	-	-	-	-	-	2,890,984.78	2,890,984.78
资产总计	18,509,472,805.64	74,807,647,981.90	64,647,209,284.41	-	-	779,960,588.49	158,744,290,660.44
负债							
卖出回购金融资产 款	8,989,550,285.70	-	-	-	-	-	8,989,550,285.70
应付赎回款	-	-	-	-	-	40,087,336.19	40,087,336.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	45,650,167.81	45,650,167.81
应付托管费	-	-	-	-	-	11,066,707.36	11,066,707.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	34,583,460.42	34,583,460.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	726,126.83	726,126.83
应付利息	-	-	-	-	-	9,422,901.10	9,422,901.10
应付利润	-	-	-	-	-	11,195,428.25	11,195,428.25
应交税费	-	-	-	-	-	991,820.35	991,820.35
其他负债	-	-	-	-	-	27,559,405.04	27,559,405.04
负债总计	8,989,550,285.70	-	-	-	-	181,283,353.35	9,170,833,639.05
利率敏感度缺口	9,519,922,519.94	74,807,647,981.90	64,647,209,284.41	-	-	598,677,235.14	149,573,457,021.39

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	21,403,926.99	28,610,966.43
	市场利率上升 25 个基点	-21,341,551.83	-28,541,223.95

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。本基金主要投资于证券交易所上市或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

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 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	58,974,814,090.02	44.98
	其中:债券	56,654,601,034.93	43.21
	资产支持证券	2,320,213,055.09	1.77
2	买入返售金融资产	32,702,028,943.09	24.94
	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	38,737,385,650.12	29.55
4	其他各项资产	688,122,027.35	0.52
5	合计	131,102,350,710.58	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	3.22	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,500,653,969.54	1.16
	其中:买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

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	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本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	37.62	1.16
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	17.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	20.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	21.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.87	1.16

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	2,615,904,348.84	2.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,533,035,719.63	3.50
	其中：政策性金融债	4,533,035,719.63	3.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,420,448,201.39	8.05
6	中期票据	10,033,226.54	0.01
7	同业存单	39,075,179,538.53	30.17

8	其他	-	-
9	合计	56,654,601,034.93	43.74
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	111911097	19 平安银行 CD097	15,000,000	1,455,337,652.73	1.12
2	180209	18 国开 09	12,200,000	1,220,114,329.01	0.94
3	111905076	19 建设银行 CD076	11,000,000	1,067,449,012.72	0.82
4	111922010	19 邮储银行 CD010	9,000,000	888,315,765.73	0.69
5	111916156	19 上海银行 CD156	8,500,000	848,706,493.73	0.66
6	180410	18 农发 10	6,100,000	610,314,438.52	0.47
7	111810554	18 兴业银行 CD554	6,000,000	597,191,202.39	0.46
8	199913	19 贴现国债 13	5,500,000	550,000,000.00	0.42
9	180018	18 付息国债 18	5,100,000	510,365,781.61	0.39
10	111922012	19 邮储银行 CD012	5,000,000	499,215,896.16	0.39

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	0.1228%
报告期内偏离度的最低值	0.0068%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0628%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本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

本报告期内本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	149920	18 花呗 6A	2,300,000	230,000,000.00	0.18
2	149808	借呗 55A1	1,600,000	160,217,165.83	0.12
3	159213	19 京保 4A	1,420,000	142,000,000.00	0.11
4	139772	绿城 13 优	890,000	89,000,000.00	0.07
5	139485	信融 05 优	860,000	86,000,000.00	0.07
6	139248	万科 26A1	800,000	80,030,174.79	0.06
7	139652	永熙 3 优 2	760,000	76,000,000.00	0.06
8	159248	19 京保 5A	710,000	71,040,747.20	0.05
9	139462	绿城 10 优	600,000	60,028,491.71	0.05
10	139469	链融 08A1	600,000	60,000,000.00	0.05
10	139453	链融 07A1	600,000	60,000,000.00	0.05
10	139466	联易融 10	600,000	60,000,000.00	0.05
11	139784	中交 4 优 A	570,000	57,000,000.00	0.04
12	1989094	19 上 和 2A1	1,000,000	52,924,843.92	0.04
13	139406	一方碧 42	500,000	50,530,485.25	0.04
14	139352	链融 02A1	500,000	50,139,338.28	0.04
15	139027	万科优 08	500,000	50,018,884.24	0.04
16	139694	永熙优 04	500,000	50,000,000.00	0.04
17	139718	金易 01	490,000	49,000,000.00	0.04
18	139261	万科 29A1	400,000	40,015,415.95	0.03
19	139732	永熙优 06	400,000	40,000,000.00	0.03
19	139719	天著优 03	400,000	40,000,000.00	0.03
19	159383	19 京保 6A	400,000	40,000,000.00	0.03
20	139705	链融 11A2	390,000	39,000,000.00	0.03
21	139726	永熙优 05	370,000	37,000,000.00	0.03
22	156636	19 裕源 03	320,000	32,000,000.00	0.02
22	139704	链融 11A1	320,000	32,000,000.00	0.02
23	139674	联易融 12	310,000	31,000,000.00	0.02
24	139303	万科 30A1	300,000	30,019,884.72	0.02
25	156391	金地 06A	300,000	30,011,104.91	0.02
26	156076	金地 04A	300,000	30,006,184.87	0.02
27	139706	链融 11A3	300,000	30,000,000.00	0.02
27	149588	18 花 11A1	300,000	30,000,000.00	0.02
27	149787	18 花呗 5A	300,000	30,000,000.00	0.02
28	139760	联易融 13	260,000	26,000,000.00	0.02
29	139685	绿城 12 优	220,000	22,010,017.06	0.02
30	149805	借呗 54A1	200,000	20,084,563.83	0.02

31	139065	万科优 09	200,000	20,011,352.10	0.02
32	139070	万科优 10	200,000	20,008,866.70	0.02
33	139318	万科 31A1	200,000	20,007,609.06	0.02
34	156167	18 信易 2	200,000	20,000,000.00	0.02
35	159179	19 信易 05	160,000	16,000,000.00	0.01
36	139239	18TCL01A	150,000	15,000,000.00	0.01
37	159218	威新 04 优	130,000	13,000,000.00	0.01
38	139516	方碧 47 优	110,000	11,072,983.70	0.01
39	156943	金地 11A	100,000	10,004,588.31	0.01
40	139059	万科 22A1	100,000	10,003,811.42	0.01
41	156376	18 信易 3	100,000	10,000,000.00	0.01
42	139650	链融 8A4	90,000	9,006,098.41	0.01
43	139648	链融 8A2	70,000	7,004,718.71	0.01
44	139649	链融 8A3	65,000	6,504,395.25	0.01
45	139536	云能 01 优	50,000	5,003,439.53	0.00
46	139647	链融 8A1	50,000	5,003,362.22	0.00
47	139071	万科 23A1	50,000	5,002,713.46	0.00
48	159230	荣茂 03 优	45,000	4,501,813.66	0.00

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。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

7.9.2

中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日做出处罚决定，由于平安银行股份有限公司（以下简称“公司”）：未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告。根据相关规定对公司罚款人民币 140 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。

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。

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	-
2	应收证券清算款	231,719,250.00
3	应收利息	455,014,534.15
4	应收申购款	1,388,243.20
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	688,122,027.35

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

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
33,601,930	3,854.50	21,110,645,388.63	16.30%	108,408,032,549.79	83.70%

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	其他机构	2,605,389,610.51	2.01%
2	银行类机构	2,262,878,111.35	1.75%
3	银行类机构	1,112,216,658.71	0.86%
4	银行类机构	1,107,321,633.16	0.85%
5	银行类机构	1,023,377,705.13	0.79%
6	银行类机构	1,010,340,314.11	0.78%
7	其他机构	1,000,223,097.99	0.77%
8	银行类机构	933,044,980.88	0.72%
9	银行类机构	816,999,974.09	0.63%
10	券商类机构	530,529,685.05	0.41%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,230,340.00	0.0040%

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 3 日）基金份额总额	525,531,640.49
本报告期期初基金份额总额	149,573,457,021.39
本报告期期间基金总申购份额	286,624,274,896.74
减：本报告期期间基金总赎回份额	306,679,053,979.71
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	129,518,677,938.42

§ 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	
国信证券	2	-	-	-	-	-

1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

3、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

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
国信证券	525,288,289.28	100.00%	50,000,000.00	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。

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	关于新增腾安基金销售(深圳)有限公司为平安日增利货币市场基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月3日
2	平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月3日
3	平安日增利货币市场基金招募说明书更新(2018年第2期)以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月12日
4	关于不法分子冒用“花生宝”名义开展非法金融业务的严正声明	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月17日
5	平安日增利货币市场基金2018年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月18日
6	平安日增利货币市场基金春节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月29日
7	平安基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月29日
8	平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年2月12日
9	关于旗下基金投资基金管理人关联公司代理销售证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年2月26日
10	平安基金管理有限公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年2月27日
11	关于暂停苏州财路基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年3月9日
12	关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年3月15日
13	平安日增利货币市场基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年3月22日
14	平安日增利货币市场基金2018年年度报告以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年3月26日
15	关于暂停北京钱景基金销售有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年3月29日
16	平安日增利货币市场基金基金	中国证监会指定报刊及	2019年4月2日

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

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安日增利货币市场基金的文件；
- 2、平安日增利货币市场基金基金合同；
- 3、平安日增利货币市场基金托管协议；
- 4、平安日增利货币市场基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>。

平安基金管理有限公司

2019 年 8 月 22 日