太平日日金货币市场基金
2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10

§4 管理人报告 11

4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 17

§5 托管人报告 17

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 17

§6 审计报告 18

6.1 审计报告基本信息 18
6.2 审计报告的基本内容 18

§7 年度财务报表 20

7.1 资产负债表 20
7.2 利润表 21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 22
7.4 报表附注 24

§8 投资组合报告 49

8.1 期末基金资产组合情况 49
8.2 债券回购融资情况 49

8.3 基金投资组合平均剩余期限 50
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 51
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 52
8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 52
8.9 投资组合报告附注 52
§9 基金份额持有人信息 53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 53
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 53
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 53
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 54
§10 开放式基金份额变动 54
§11 重大事件揭示 54
11.1 基金份额持有人大会决议 54
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 55
11.4 基金投资策略的改变 55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 55
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 56
11.9 其他重大事件 56
§12 影响投资者决策的其他重要信息 58
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 58
§13 备查文件目录 59
13.1 备查文件目录 59
13.2 存放地点 59
13.3 查阅方式 59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平日日金货币市场基金	
基金简称	太平日日金货币	
基金主代码	003398	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 4 日	
基金管理人	太平基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	658,525,518.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	太平日日金 A	太平日日金 B
下属分级基金的交易代码	003398	003399
报告期末下属分级基金的份额总额	30,971,164.20 份	627,554,354.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求保持基金资产安全性和高流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对短期金融工具的积极投资管理，在有效控制投资风险和保持流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准，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，为证券投资基金中的低风险品种。本基金预期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		太平基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵霖	陈玮
	联系电话	021-38556613	021-52629999
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn	chenw823@cib.com.cn
客户服务电话		021-61560999/400-028-8699	95561
传真		021-38556677	021-62535823
注册地址		上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼	上海市银城路 167 号
邮政编码		200120	200041
法定代表人		焦艳军	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 楼
注册登记机构	太平基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	太平日日金 A	太平日日金 B	太平日日金 A	太平日日金 B	太平日日金 A	太平日日金 B
本期已实现收益	1,150,430.40	20,634,557.96	349,549.90	37,092,760.43	125,547.82	92,145,566.96
本期利润	1,150,430.40	20,634,557.96	349,549.90	37,092,760.43	125,547.82	92,145,566.96
本期净值收益率	2.0840%	2.3304%	1.8972%	2.1410%	2.2412%	2.4900%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末基金资产净值	30,971,164.20	627,554,354.32	83,528,864.07	1,515,827,636.04	797,494.73	2,148,582,051.08

期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
累计净值收益率	14.3018%	15.7383%	11.9684%	13.1026%	9.8837%	10.7319%

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）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。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

太平日日金 A

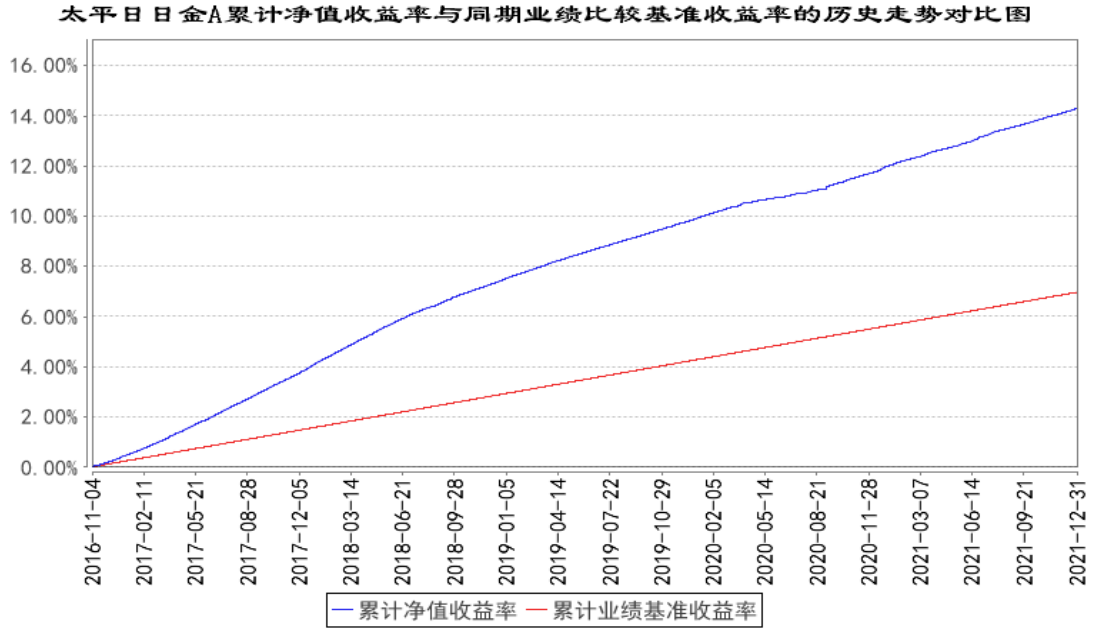
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.5121%	0.0021%	0.3403%	0.0000%	0.1718%	0.0021%
过去六个月	1.0141%	0.0033%	0.6805%	0.0000%	0.3336%	0.0033%
过去一年	2.0840%	0.0042%	1.3500%	0.0000%	0.7340%	0.0042%
过去三年	6.3521%	0.0039%	4.0537%	0.0000%	2.2984%	0.0039%

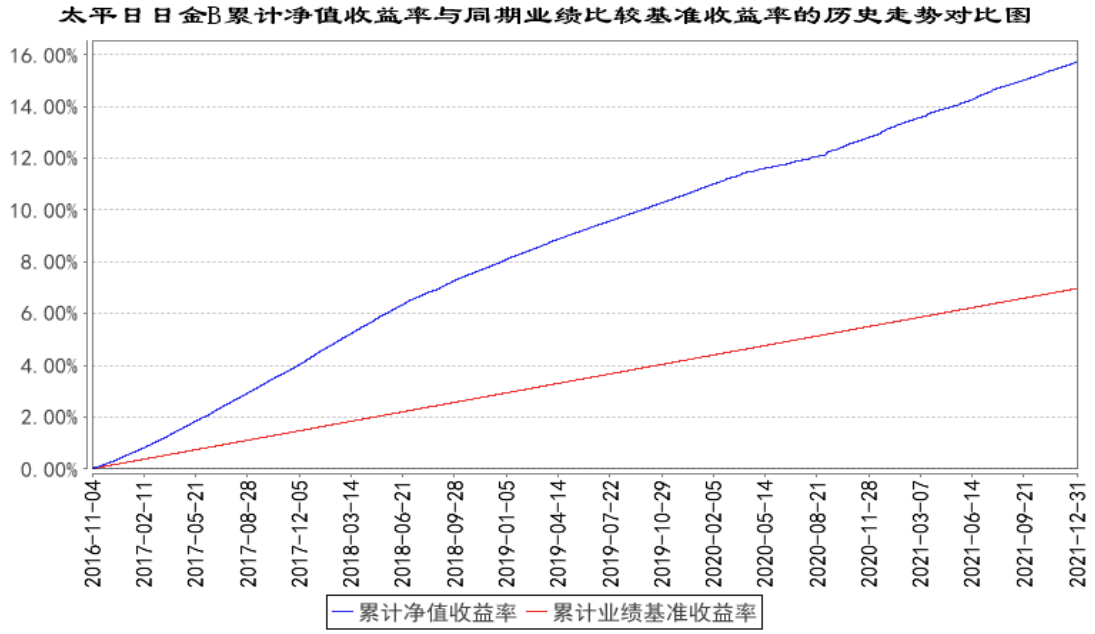
过去五年	13.8380%	0.0038%	6.7537%	0.0000%	7.0843%	0.0038%
自基金合同生效起至今	14.3018%	0.0038%	6.9682%	0.0000%	7.3336%	0.0038%

太平日日金 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
过去三个月	0.5733%	0.0021%	0.3403%	0.0000%	0.2330%	0.0021%
过去六个月	1.1372%	0.0033%	0.6805%	0.0000%	0.4567%	0.0033%
过去一年	2.3304%	0.0042%	1.3500%	0.0000%	0.9804%	0.0042%
过去三年	7.1238%	0.0039%	4.0537%	0.0000%	3.0701%	0.0039%
过去五年	15.2250%	0.0038%	6.7537%	0.0000%	8.4713%	0.0038%
自基金合同生效起至今	15.7383%	0.0038%	6.9682%	0.0000%	8.7701%	0.0038%

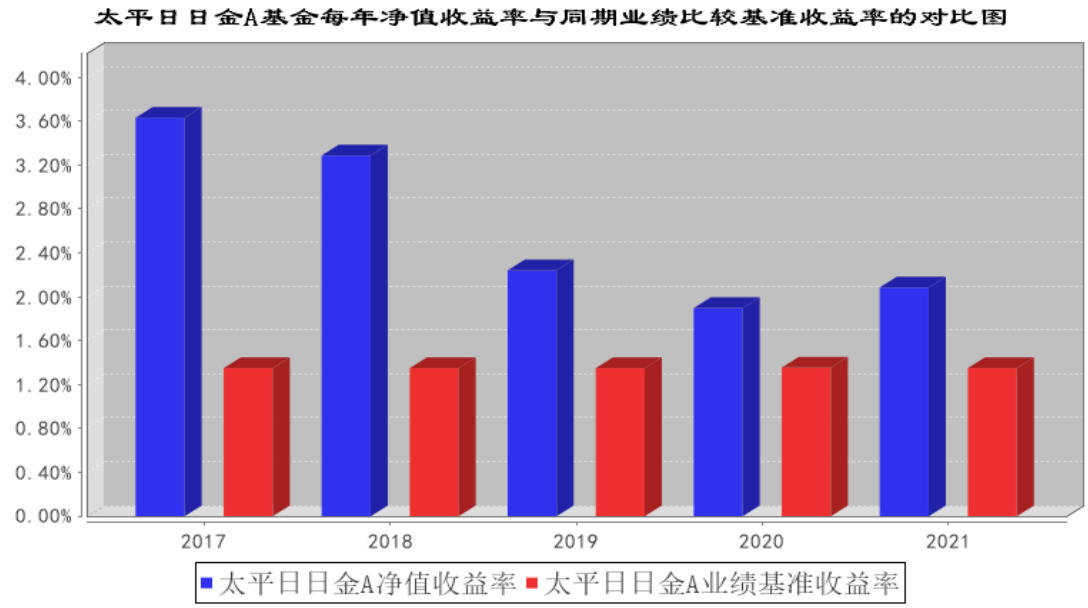
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

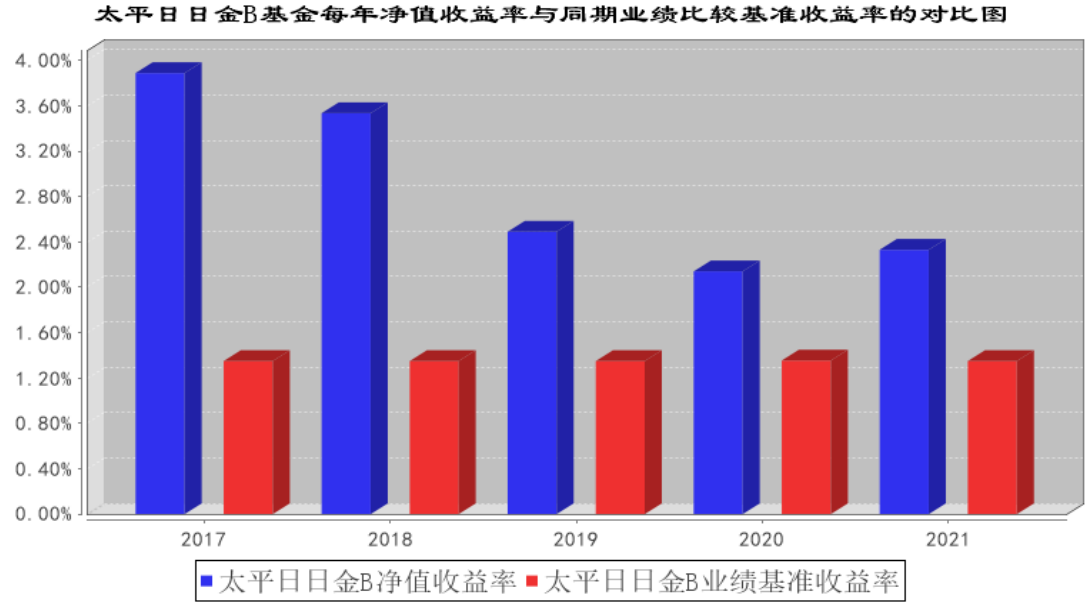




注：本基金基金合同于 2016 年 11 月 4 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 4 日，至本报告期末已满 5 年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

太平日日金 A

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2021 年	1,151,904.89	-	-1,474.49	1,150,430.40	-
2020 年	343,637.36	-	5,912.54	349,549.90	-

2019 年	126,099.18	-	-551.36	125,547.82	-
合计	1,621,641.43	-	3,886.69	1,625,528.12	-

太平日日金 B

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2021 年	20,656,259.97	-	-21,702.01	20,634,557.96	-
2020 年	37,149,884.39	-	-57,123.96	37,092,760.43	-
2019 年	92,576,228.99	-	-430,662.03	92,145,566.96	-
合计	150,382,373.35	-	-509,488.00	149,872,885.35	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立。截至本报告期末，公司注册资本为人民币 4 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 91.5%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 8.5%。

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 25 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金、太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金、太平恒利纯债债券型证券投资基金、太平睿盈混合型证券投资基金、太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金、太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金、太平恒睿纯债债券型证券投资基金、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金、太平智选一年定期开放股票型发起式证券投资基金、太平行业优选股票型证券投资基金、太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平睿安混合型证券投资基金、太平恒久纯债债券型证券投资基金、太平价值增长股票型证券投资基金、太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金、太平睿享混合型证券投资基金、太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平恒兴纯债债券型证券投资基金、太平睿庆混合型证券投资基金。

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		
吴超	本基金的基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理、太平睿盈混合型证券投资基金基金经理、太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、太平恒久纯债债券型证券投资基金基金经理、太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券	2018 年 2 月 12 日	-	8 年	美国本特利商学院金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013 年 5 月起曾在西部证券股份有限公司固定收益部、上海金懿投资有限公司担任部门经理、投资总监等职。2017 年 3 月加入本公司。2018 年 2 月 12 日起任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2019 年 3 月 25 日担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 27 日起任太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 28 日起任太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 7 日起担任太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 12 日起担任太平恒久纯债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 24 日起担任太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 17 日起担任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。

	投资基金基金经理、太平睿享混合型证券投资基金基金经理				
甘源	本基金的基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理、太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、太平睿庆混合型证券投资基金基金经理	2021 年 2 月 22 日	-	5 年	清华大学金融硕士，具有证券投资基金从业资格。2015 年起先后在中信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、恒大研究院从事资金运营、宏观研究及货币研究等工作。2019 年 11 月加入本公司，担任固定收益投资部基金经理助理。2021 年 2 月 22 日起担任太平日日金货币市场基金基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2021 年 11 月 18 日起担任太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 21 日起担任太平睿庆混合型证券投资基金基金经理。
潘莉	本基金的基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理、太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理、太平恒睿纯债债券型证券投资基金基金经理	2018 年 3 月 23 日	2021 年 4 月 21 日	8 年	牛津大学工商管理硕士，具有证券投资基金从业资格。2004 年 6 月起曾就职于东京海上日动火灾保险株式会社非日系部、英国皇家太阳联合保险公司大客户部担任核保和客服工作；中国人保资产管理有限公司历任集中交易室交易员、固定收益部投资经理；南通农村商业银行股份有限公司历任金融市场部固收类投资经理、投资总监。2018 年 2 月加入本公司。2018 年 3 月 23 日至 2021 年 4 月 21 日担任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2018 年 6 月 15 日至 2021 年 4 月 21 日担任太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 3 月 12 日至 2021 年 4 月 21 日担任太平恒睿纯债债券型证券投资基金基金经理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；

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有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，未发生违法违规或未履行基金合同的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

在内控制度方面，公司根据相关法律法规制订了规范的投资管理制度和公平交易管理制度，以确保公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，研究团队为公司所有投资组合提供平等、公平的研究支持，所有投资组合共享公司统一的投资研究平台；严格实行各类资产管理业务之间的业务隔离和人员隔离制度，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，各投资组合的持仓及交易信息等均有效隔离。在交易执行方面，实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，保证交易在各投资组合间的公正实施。在监控和稽核方面，交易部门在交易执行过程中对公平交易实施一线监控与报告，稽核风控部对投资交易行为进行持续监督和评估，定期进行公平交易的分析工作，每季度和每年度对不同投资组合的收益率差异以及同向交易和反向交易情况进行分析，加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本基金管理人管理的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的 5%的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2020 年是全球经济受疫情冲击近乎停摆的一年，中国成为全球唯一实现经济正增长的主要经济体；2021 年是全球经济逐渐摆脱新冠疫情影响的首年，全球经济复苏快慢有别，中国经济增长在强劲反弹之后有所放缓。其中中国的经济压力主要体现在 2021 年下半年，“类滞胀”格局凸显，高企的 PPI 与经济下行形成鲜明反差。一方面，疫情余波、原材料涨价、电力短缺，国际输入性因素叠加供给冲击，PPI 不断超市场预期。PPI 从 2021 年 1 月的 0.3%快速上升至 2021 年 10 月的 13.5%，创有数据以来新高；动力煤期货收盘价从 2021 年 7 月初的 782.6 元/吨快速上升至 2021 年 10 月的 1835.6 元/吨。另一方面，刺激政策的退出及房地产政策的调控短期经济承压，房地产销售、投资、拿地呈现断崖式下滑。2021 年 7 月，房地产销售面积当月同比从上月的 7.5%下滑至-8.5%，10 月进一步走低至-21.7%；房地产开发投资完成额当月同比从 6 月的 5.9%下滑至 10 月的-5.4%；2021 年 4 月第一批集中供地期间，100 个大中城市成交土地溢价率达 23.7%，到 10 月已低至 2.7%，为 2012 年 3 月以来新低。

2021 年影响债券市场的核心因素是信用收敛带来的经济承压和对货币预期的变化。年初由于银行间资金缺口收缩以及央行减少资金投放，引发市场紧缩担忧，10 年国债在春节后首个交易日冲上高点 3.28%；2-5 月经济下行和配置需求带来收益率缓慢下行；7-8 月超预期降准债券收益率下行至年内低点；9-10 月因宽松不及预期、资金利率抬升，债市从震荡转为快速调整，随后转为区间震荡；年末降息预期发酵，10Y 国债突破降准之后的低点达到 2.77%。除了 1　月末由于财政投放资金期限错位导致资金出现超预期紧张局面外，资金面整体较为平稳且呈现总量宽松、波动放缓的状态。本基金将继续秉持“短久期、高评级、低杠杆”的投资思路，严格控制流动性风险，积极把握短期市场资金面波动带来的机会增加收益。本报告期内，本基金在遵守基金合同、控制风险的前提下，为投资者取得了符合货币基金特征的风险收益比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平日日金 A 的净值收益率为 2.0840%，同期业绩比较基准为 1.3500%；太平日日金 B 的净值收益率为 2.3304%，同期业绩比较基准为 1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年是稳增长的一年，为结构转型创造条件。年初在春节、冬奥会、两会、疫情的反复下，经济的改善幅度可能不会太高。3 月中旬随着冬奥会和两会闭幕，稳增长条件具备，经济有望实质性改善。下半年宏观经济和政策演绎的不确定性较多：一是国内的逆周期政策的时间和力度不确定性。一方面，此次稳增长的政策更加前倾，特别是针对地产的房住不炒和基建相关的隐性债

务监管也限制了投资增速。另一方面，如果上半年经济复苏明显，下半年政策力度可能收敛，潜在的触发因素包括房价躁动和通胀上行；二是在海外产业链重启的情况下，美联储加息缩表的力度和节奏不确定性；三是疫情能否流感化、如何演绎、各国的封锁政策及我国的应对政策的不确定性。

对于债市而言，整个 1 季度处于宽货币宽信用阶段，收益率有望保持震荡格局。直到经济企稳、金融数据回升、货币政策措辞收敛，收益率可能会出现调整。流动性方面，1 月的降息使得资金面的预期出现了大幅的改善，在资金利率围绕政策利率运行的大框架下，流动性有望保持平稳态势。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。

在内控制度建设方面，公司持续完善内控制度建设，并时刻关注法规的新变化、结合行业发展的新动态、围绕业务开展的新需要，适时组织更新相关业务制度。在公司合规文化建设方面，公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，不断增强全体员工的合规自觉与风控意识，为公司业务的规范开展和健康发展创造良好的内控环境。在稽核检查方面，公司稽核风控部在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对各项业务活动进行监督、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，定期对各类业务开展情况以及公司整体运营情况进行覆盖全面、重点突出的检查、总结和反馈，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基

金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金资产的估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值和产品委员会成员由主席负责，估值分委会常任委员由稽核风控部、投资部门（含权益投资部、专户业务部、固定收益投资部）、研究部、基金运营部等部门负责人担任。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人，分红方式为红利再投资。本报告期内本基金以红利再投资方式进行收益分配，A 级分配收益：1,150,430.40 元,B 级分配收益 20,634,557.96 元，符合法律法规及《基金合同》的约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警的情况。

§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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2201229 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	太平日日金货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的太平日日金货币市场基金 （以下简称“太平日日金货币基金”） 财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益 （基金净值） 变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会 （以下简称“中国证监会”） 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了太平日日金货币基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则 （以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于太平日日金货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	太平日日金货币基金管理人太平基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括太平日日金货币基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估太平日日金货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 （如适用），并运用持续经营假设，除非太平日日金货币基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督太平日日金货币基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对太平日日金货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致太平日日金货币基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报 （包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张楠	鲍涵
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 28 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：太平日日金货币市场基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,792,484.70	2,934,827.14
结算备付金		2,408,391.02	4,104,761.90
存出保证金		-	4,929.58
交易性金融资产	7.4.7.2	488,373,117.81	1,208,516,948.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		488,373,117.81	1,208,516,948.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	164,964,259.95	436,210,890.31
应收证券清算款		57,127,455.10	17,501.91
应收利息	7.4.7.5	1,402,843.08	2,047,732.76
应收股利		-	-
应收申购款		50,885.59	12,665,605.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		716,119,437.25	1,666,503,198.15
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 12 月 31 日**	**上年度末 2020 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	66,349,700.47
应付证券清算款		57,000,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		140,775.08	307,419.42

应付托管费		28,155.04	61,483.89
应付销售服务费		12,987.01	17,478.19
应付交易费用	7.4.7.7	14,630.13	37,153.63
应交税费		5,653.87	11,666.09
应付利息		-	14,034.60
应付利润		99,800.99	122,977.49
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	291,916.61	224,784.26
负债合计		57,593,918.73	67,146,698.04
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	658,525,518.52	1,599,356,500.11
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		658,525,518.52	1,599,356,500.11
负债和所有者权益总计		716,119,437.25	1,666,503,198.15

注： 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 658,525,518.52 份，其中 A 类基金份额的份额总额 30,971,164.20 份， B 类基金份额的份额总额 627,554,354.32 份。

7.2 利润表

会计主体：太平日日金货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		25,992,150.05	47,756,038.31
1.利息收入		25,131,080.55	44,843,348.46
其中：存款利息收入	7.4.7.11	102,098.44	450,663.02
债券利息收入		17,702,074.47	31,817,926.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,326,907.64	12,574,759.37
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		861,069.50	2,912,689.85
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	861,069.50	2,912,689.85
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		4,207,161.69	10,313,727.98
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	2,387,869.49	5,713,968.68
2．托管费	7.4.10.2.2	477,573.95	1,622,503.48
3．销售服务费	7.4.10.2.3	231,414.41	228,032.94
4．交易费用	7.4.7.19	-	-
5．利息支出		874,782.98	2,451,846.28
其中：卖出回购金融资产支出		874,782.98	2,451,846.28
6．税金及附加		11,865.67	12,004.64
7．其他费用	7.4.7.20	223,655.19	285,371.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,784,988.36	37,442,310.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,784,988.36	37,442,310.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：太平日日金货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,599,356,500.11	-	1,599,356,500.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,784,988.36	21,784,988.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	-940,830,981.59	-	-940,830,981.59

“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	688,741,376.55	-	688,741,376.55
2.基金赎回款	-1,629,572,358.14	-	-1,629,572,358.14
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）	-	-21,784,988.36	-21,784,988.36
五、期末所有者权益（基金净值）	658,525,518.52	-	658,525,518.52
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,149,379,545.81	-	2,149,379,545.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,442,310.33	37,442,310.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-550,023,045.70	-	-550,023,045.70
其中：1.基金申购款	3,756,336,326.53	-	3,756,336,326.53
2.基金赎回款	-4,306,359,372.23	-	-4,306,359,372.23
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）	-	-37,442,310.33	-37,442,310.33
五、期末所有者权益（基金净值）	1,599,356,500.11	-	1,599,356,500.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

范宇	史彦刚	王瑞瑾

基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

太平日日金货币市场基金(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”)《关于准予太平日日金货币市场基金注册的批复》(证监许可[2016]1156 号)核准，由太平基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平日日金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 11,905,295,398.80 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 1354 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《太平日日金货币市场基金基金合同》于 2016 年 11 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 11,905,478,318.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 182,919.78 份基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。根据《太平日日金货币市场基金基金合同》和《太平日日金货币市场基金招募说明书》的规定，本基金根据基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量，对其持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费，因此形成不同的基金份额类别。本基金设 A 类和 B 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，并分别公布基金份额的每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率，不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平日日金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 1 年以内(含 1 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品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：人民币七天通知存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人太平基金管理有限公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格(即相关金融工具的公允价值)，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险

和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。?

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税 （如适用） 后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理。因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益 ；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在当日收益支付时，若当日净收益大于零时，则为投资人增加相应的基金份额；若当日净收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，则缩减投资人基金份额。当日申购的基金份额自下一个交易日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个交易日起，不享有基金的收益分配权益。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下固定收益品种的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对自国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(d) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,792,484.70	2,934,827.14
定期存款	-	-
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	-	-
其他存款	-	-
合计	1,792,484.70	2,934,827.14

注：1. 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2.本基金报告期内未提前支取部分定期存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	488,373,117.81	488,575,000.00	201,882.19	0.0307
	合计	488,373,117.81	488,575,000.00	201,882.19	0.0307
资产支持证券		-	-	-	-
合计		488,373,117.81	488,575,000.00	201,882.19	0.0307
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	11,000.95	11,047.30	46.35	0.0000
	银行间市场	1,208,505,947.65	1,209,690,500.00	1,184,552.35	0.0741
	合计	1,208,516,948.60	1,209,701,547.30	1,184,598.70	0.0741
资产支持证券		-	-	-	-
合计		1,208,516,948.60	1,209,701,547.30	1,184,598.70	0.0741

注：于 12 月 31 日，本基金交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资成本。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

1.偏离金额=影子定价 - 摊余成本；

2.偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	125,000,000.00	-
银行间市场	39,964,259.95	-
合计	164,964,259.95	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	286,000,000.00	-
银行间市场	150,210,890.31	-
合计	436,210,890.31	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	156.21	856.48
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,192.07	2,031.81
应收债券利息	1,413,166.04	1,856,653.89
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-11,671.24	188,188.05
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	2.53
合计	1,402,843.08	2,047,732.76

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	14,630.13	37,153.63
合计	14,630.13	37,153.63

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提信息披露费	240,000.00	120,000.00
预提审计费	40,000.00	90,000.00
账户维护费	11,000.00	11,000.00
银行手续费	916.61	3,784.26
合计	291,916.61	224,784.26

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

太平日日金 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,528,864.07	83,528,864.07
本期申购	339,480,090.42	339,480,090.42
本期赎回（以“-”号填列）	-392,037,790.29	-392,037,790.29
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	30,971,164.20	30,971,164.20

太平日日金 B

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,515,827,636.04	1,515,827,636.04
本期申购	349,261,286.13	349,261,286.13
本期赎回（以“-”号填列）	-1,237,534,567.85	-1,237,534,567.85
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	627,554,354.32	627,554,354.32

注：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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

太平日日金 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	1,150,430.40	-	1,150,430.40
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	-1,150,430.40	-	-1,150,430.40
本期末	-	-	-

太平日日金 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	20,634,557.96	-	20,634,557.96
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	-20,634,557.96	-	-20,634,557.96
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	16,303.66	189,437.15

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	85,744.51	261,124.06
其他	50.27	101.81
合计	102,098.44	450,663.02

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-买卖股票差价收入。

7.4.7.12.2 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	861,069.50	2,912,689.85
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	861,069.50	2,912,689.85

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,498,165,825.71	7,050,477,421.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付)成本总额	3,481,601,879.81	7,011,483,388.23
减：应收利息总额	15,702,876.40	36,081,343.29
买卖债券差价收入	861,069.50	2,912,689.85

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

本基金本报告期内及上年度可比期间无交易费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,200.00	37,200.00
其他	-	1,640.50
银行划款手续费	26,455.19	36,531.46
合计	223,655.19	285,371.96

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

于 2022 年 1 月，经本基金的基金管理人太平基金股东会决议通过，并根据中国证监会批复核准(证监许可[2021]4051 号)，太平人寿保险有限公司认缴太平基金新增注册资本，增资事项完成后，太平资产管理有限公司、太平人寿保险有限公司及安石投资管理有限公司对太平基金的持股比例分别变更为 56.31%、38.46%、5.23%。上述事项的工商变更登记已于 2022 年 1 月 27 日办理完毕。

除以上情况外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
太平基金管理有限公司(以下简称“太平基金”)	基金管理人、基金销售机构、登记机构
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	基金托管人
太平资产管理有限公司(以下简称“太平资管”)	基金管理人的股东
安石投资管理有限公司(以下简称“安石投资”)	基金管理人的股东
中原证券股份有限公司(以下简称“中原证券”)	原基金管理人的股东

注：经本基金的基金管理人太平基金股东会决议通过，并经中国证监会批复核准(证监许可[2019]2864 号)，太平基金原股东中原证券股份有限公司将所持太平基金 8.5%股权转让给太平资产管理有限公司，太平基金已于 2020 年 2 月 19 日完成工商变更。自 2020 年 2 月 19 日起，中原证券股份有限公司不作为本基金的关联方列示。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,387,869.49	5,713,968.68
其中：支付销售机构的客户维护费	49,011.80	43,880.49

注：自基金合同生效日至 2020 年 9 月 13 日，支付基金管理人太平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。

根据《太平基金管理有限公司关于太平日日金货币市场基金调整管理费率及托管费率并修改基金合同等事项的公告》，自 2020 年 9 月 14 日起，支付基金管理人太平基金的管理人报酬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。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	477,573.95	1,622,503.48

注：注：自基金合同生效日至 2020 年 9 月 13 日，支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

根据《太平基金管理有限公司关于太平日日金货币市场基金调整管理费率及托管费率并修改基金合同等事项的公告》，自 2020 年 9 月 14 日起，支付基金托管人兴业银行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。

7.4.10.2.3 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平日日金 A	太平日日金 B	合计
兴业银行	8,877.83	-	8,877.83
太平基金	6,861.30	89,411.50	96,272.80
合计	15,739.13	89,411.50	105,150.63

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平日日金 A	太平日日金 B	合计
兴业银行	3,346.89	-	3,346.89
太平基金	3,893.38	179,598.06	183,491.44
合计	7,240.27	179,598.06	186,838.33

注：支付销售机构的基金销售服务费按前一日太平日日金 A 类份额基金资产净值 0.25%和前一日太平日日金 B 类份额基金资产净值 0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

太平日日金 A 日基金销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.25%/ 当年天数

太平日日金 B 日基金销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.01%/ 当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未持有过本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,792,484.70	16,303.66	2,934,827.14	189,437.15

注：本基金通过“兴业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任

公司的结算备付金，于 2021 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 2,408,391.02 元。（2020 年 12 月 31 日：人民币 4,104,761.90 元）

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2021 年度，本基金因投资兴业银行的同业存单而取得的利息收入为人民币 0.00 元(2020 年度：1,650,569.51 元)。于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有兴业银行的同业存单(2020 年 12 月 31 日：无)。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

太平日日金 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
1,151,904.89	-	-1,474.49	1,150,430.40	-
太平日日金 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
20,656,259.97	-	-21,702.01	20,634,557.96	-

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资于货币市场工具，每万份基金已实现收益会因为货币市场波动等因素产生波动。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。本基金面临的主要风险是市场风险、信用风险、流动性风险。其中本基金的市场风险主要是利率风险。本基金基金管理人风险管理的目标是通过对短期金融工具的积极投资管理，在有效控制投资风险和保持流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门在内的多级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会主要负责确定公司风险管理总体目标、制定公司风险管理战略和风险应对策略等事项。经营管理层及其下设的风险控制委员会负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，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，不投资于信用评级在 AA+级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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	140,027,164.19	29,923,057.57
合计	140,027,164.19	29,923,057.57

注：未评级债券为国债和短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	348,345,953.62	1,103,580,629.39
合计	348,345,953.62	1,103,580,629.39

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	75,013,261.64
合计	-	75,013,261.64

注：未评级债券为国债、地方政府债和政策性金融债。

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

截至本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

7.4.13.3.1 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》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 2021 年 12 月 31 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 96.45%，本基金投资组合的平均剩余期限为 55 天，平均剩余存续期为 55 天。本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债以及 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大于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行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%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的市值合计未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检测结果集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，无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	1,792,484	-	-	-	-	-	1,792,484.70

	.70						
结算备付金	2,408,391.02	-	-	-	-	-	2,408,391.02
交易性金融资产	149,824,372.83	189,386,001.50	149,162,743.48	-	-	-	488,373,117.81
买入返售金融资产	164,964,259.95	-	-	-	-	-	164,964,259.95
应收利息	-	-	-	-	-	1,402,843.08	1,402,843.08
应收申购款	-	-	-	-	-	50,885.59	50,885.59
应收证券清算款	-	-	-	-	-	57,127,455.10	57,127,455.10
资产总计	318,989,508.50	189,386,001.50	149,162,743.48	-	-	58,581,183.77	716,119,437.25
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	140,775.08	140,775.08
应付托管费	-	-	-	-	-	28,155.04	28,155.04
应付证券清算款	-	-	-	-	-	57,000,000.00	57,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,987.01	12,987.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,630.13	14,630.13
应付利润	-	-	-	-	-	99,800.99	99,800.99
应交税费	-	-	-	-	-	5,653.87	5,653.87
其他负债	-	-	-	-	-	291,916.61	291,916.61
负债总计	-	-	-	-	-	57,593,918.73	57,593,918.73
利率敏感度缺口	318,989,508.50	189,386,001.50	149,162,743.48	-	-	987,265.04	658,525,518.52
上年度末 2020 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	2,934,827.14	-	-	-	-	-	2,934,827.14
结算备付金	4,104,761.90	-	-	-	-	-	4,104,761.90
存出保证金	4,929.58	-	-	-	-	-	4,929.58

交易性金融资产	49,936,777.57	1,030,481,086.10	128,099,084.93	-	-	-	1,208,516,948.60
买入返售金融资产	436,210,890.31	-	-	-	-	-	436,210,890.31
应收利息	-	-	-	-	-	2,047,732.76	2,047,732.76
应收申购款	-	-	-	-	-	12,665,605.95	12,665,605.95
应收证券清算款	-	-	-	-	-	17,501.91	17,501.91
资产总计	493,192,186.50	1,030,481,086.10	128,099,084.93	-	-	14,730,840.62	1,666,503,198.15
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	307,419.42	307,419.42
应付托管费	-	-	-	-	-	61,483.89	61,483.89
卖出回购金融资产款	66,349,700.47	-	-	-	-	-	66,349,700.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,478.19	17,478.19
应付交易费用	-	-	-	-	-	37,153.63	37,153.63
应付利息	-	-	-	-	-	14,034.60	14,034.60
应付利润	-	-	-	-	-	122,977.49	122,977.49
应交税费	-	-	-	-	-	11,666.09	11,666.09
其他负债	-	-	-	-	-	224,784.26	224,784.26
负债总计	66,349,700.47	-	-	-	-	796,997.57	67,146,698.04
利率敏感度缺口	426,842,486.03	1,030,481,086.10	128,099,084.93	-	-	13,933,843.05	1,599,356,500.11

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况

	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
	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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末 （2020 年 12 月 31 日 ）
分析	市场利率下降 25 个基点	233,318.36	565,917.42
	市场利率上升 25 个基点	-232,595.69	-564,184.50

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1 以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 488,373,117.81 元，无属于第一、三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：

属于第二层次的余额为人民币 1,208,516,948.60 元，无属于第一、三层次的余额。)。

(a)第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020 年 12 月 31 日：无)。

2 其他金融工具的公允价值 （期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	488,373,117.81	68.20
	其中：债券	488,373,117.81	68.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	164,964,259.95	23.04
	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	4,200,875.72	0.59
4	其他各项资产	58,581,183.77	8.18
5	合计	716,119,437.25	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	3.91
	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	-	-
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
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

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。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	57.11	8.66
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	13.62	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	15.14	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.55	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	15.10	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		108.52	8.66

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 240 天。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	40,006,404.01	6.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,020,760.18	15.19
6	中期票据	-	-
7	同业存单	348,345,953.62	52.90
8	其他	-	-
9	合计	488,373,117.81	74.16
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	112172187	21 宁波银行 CD300	500,000	49,907,863.25	7.58
2	210001	21 附息国债 01	400,000	40,006,404.01	6.08
3	112173220	21 杭州银行 CD211	300,000	29,919,262.71	4.54
4	112116151	21 上海银行 CD151	300,000	29,886,259.24	4.54
5	112198613	21 杭州银行 CD063	300,000	29,750,178.90	4.52
6	112109185	21 浦发银行 CD185	300,000	29,707,668.01	4.51
7	042100225	21 电网 CP004	200,000	20,065,696.10	3.05
8	012103557	21 大唐发电 SCP007	200,000	19,993,906.52	3.04
9	012104126	21 中电投 SCP039	200,000	19,992,266.68	3.04
10	012180041	21 申能集 SCP003	200,000	19,986,884.97	3.04

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0975%
报告期内偏离度的最低值	-0.0328%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0404%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	57,127,455.10
3	应收利息	1,402,843.08
4	应收申购款	50,885.59
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	58,581,183.77

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	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（%）
太平日日金 A	3,826	8,094.92	456,435.35	1.4737	30,514,728.85	98.5263
太平日日金 B	3	209,184,784.77	627,554,354.32	100.0000	0.00	0.0000
合计	3,829	171,983.68	628,010,789.67	95.3662	30,514,728.85	4.6338

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	保险类机构	577,150,552.78	87.6429
2	其他机构	45,386,983.39	6.8922
3	其他机构	5,016,818.15	0.7618
4	个人	923,507.97	0.1402
5	个人	909,580.81	0.1381
6	个人	687,417.65	0.1044
7	个人	601,761.09	0.0914
8	个人	510,663.77	0.0775
9	个人	455,574.77	0.0692
10	个人	453,846.59	0.0689

9.3 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	太平日日金 A	676,249.78	2.1835

理人所有从业人员持有本基金	太平日日金 B	0.00	0.0000
	合计	676,249.78	0.1027

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	太平日日金 A	0~10
	太平日日金 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	太平日日金 A	0~10
	太平日日金 B	0
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	太平日日金 A	太平日日金 B
基金合同生效日（2016 年 11 月 4 日）基金份额总额	106,958,171.58	11,798,520,147.00
本报告期期初基金份额总额	83,528,864.07	1,515,827,636.04
本报告期基金总申购份额	339,480,090.42	349,261,286.13
减：本报告期基金总赎回份额	392,037,790.29	1,237,534,567.85
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	30,971,164.20	627,554,354.32

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动情况

（1）本基金管理人于 2021 年 9 月 2 日发布公告，自 2021 年 8 月 31 日起：范宇先生担任公司总经理，不再担任公司董事长职务，代为履行公司董事长职务；季勇先生担任公司助理总经理，不再担任公司副总经理职务；史彦刚先生担任公司助理总经理，不再担任公司副总经理职务；尤象都先生不再担任公司总经理职务。

（2）本基金管理人于 2021 年 9 月 10 日发布公告，自 2021 年 9 月 8 日起：焦艳军先生担任公司董事长，范宇先生不再代为履行公司董事长职务。

（3）本基金管理人于 2021 年 10 月 16 日发布公告，自 2021 年 10 月 14 日起公司法定代表人变更为焦艳军先生。

2、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经过邀请招标，并履行适当程序，聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为我司审计机构。本基金本年度应支付审计费肆万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

（1）市场形象及财务状况良好。

（2）经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。

（3）内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

（4）研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

根据上述标准进行考察后，由基金管理人的投资决策委员会确定租用券商的交易单元，并由基金管理人与被选择的券商签订协议。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本报告期内，基金租用证券公司交易单元无变化。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	50,002,004.50	100.00%	11,788,046,000.00	100.00%	-	-

11.8 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。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	太平日日金货币市场基金基金经理变更公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 23 日
2	关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 01 日

	务限额的公告		
3	关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 03 月 29 日
4	关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 03 月 25 日
5	太平基金管理有限公司关于增聘甘源担任太平日日金货币市场基金基金经理的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 02 月 24 日
6	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加财咨道信息技术有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 01 月 25 日
7	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加民商基金销售（上海）有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 14 日
8	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 06 月 22 日
9	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加湘财证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 09 月 30 日
10	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加北京度小满基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、上海爱建基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 10 月 12 日
11	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加东方财富证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 11 月 30 日
12	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加泰信财富基金销售有限公司为销售机构	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 12 月 29 日
13	太平日日金货币市场基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 26 日
14	太平日日金货币市场基金（B 类份额）基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 26 日
15	太平日日金货币市场基金招募说明书（更新）2021 年第 3 号	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 26 日
16	太平日日金货币市场基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 20 日
17	太平日日金货币市场基金(B 类份额)基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 20 日
18	太平日日金货币市场基金招募说明书	指定报刊、基金管理人	2021 年 04 月 20 日

	更新(2021 年第 2 号)	网站	
19	太平日日金货币市场基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 02 月 25 日
20	太平日日金货币市场基金（B 类份额）基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 02 月 25 日
21	太平日日金货币市场基金招募说明书（更新）(2021 年第 1 号）	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 02 月 25 日
22	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 11 月 03 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20210101-20210103	1,058,672,422.43	-	1,058,672,422.43	-	0.0000
机构	2	20210104-20211231	-	1,077,167,665.80	500,017,113.02	577,150,552.78	87.6429
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：本章节中申购份额/赎回份额统计包含非交易过户业务。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会关于核准本基金募集的批复

2、《太平日日金货币市场基金基金合同》

3、《太平日日金货币市场基金招募说明书》

4、《太平日日金货币市场基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼）

13.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日