

**太平日日金货币市场基金  
2017 年年度报告  
2017 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  
报告送出日期：二〇一八年三月二十九日

## § 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 2018 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
<b>§5 托管人报告</b>	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 审计报告</b>	16
一、管理层对财务报表的责任	16
二、注册会计师的责任	16
三、审计意见	17
<b>§7 年度财务报表</b>	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
<b>§8 投资组合报告</b>	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 债券回购融资情况	46
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	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细	48
8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	48
8.8 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	49
8.9 投资组合报告附注	49
<b>§9 基金份额持有人信息</b>	50

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	50
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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的情况 .....	51
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
11.4 基金投资策略的改变 .....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	53
11.9 其他重大事件 .....	53
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
13.1 备查文件目录 .....	55
13.2 存放地点 .....	55
13.3 查阅方式 .....	56

## § 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	6,473,323,097.32 份	
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	1,301,290.03 份	6,472,021,807.29 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，其预期收益和预期风险水平低于债券型、混合型和股票型基金，属于预期收益和预期风险偏低的基金品种

### 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	陈吟绮
	联系电话	021-38556782
	电子邮箱	disclosure@taipingfund.com
		015292@cib.com.cn

	.cn	
客户服务电话	021-61560999	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	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼 1708室	上海江宁路168号兴业大厦 20楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	汤海涛	高建平

## 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	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	太平基金管理有限公司	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年		2016 年 11 月 4 日（基金合同生效日） 至 2016 年 12 月 31 日	
	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	395,484.61	269,568,486.83	163,084.88	37,981,797.68

本期利润	395,484.61	269,568,486.83	163,084.88	37,981,797.68
本期净值收益率	3.6319%	3.8890%	0.4074%	0.4455%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2017 年末</b>		<b>2016 年末</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
期末基金资产净值	1,301,290.03	6,472,021,807.29	106,597,224.59	13,549,758,700.64
期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00	1.00
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2017 年末</b>		<b>2016 年末</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
累计净值收益率	4.0541%	4.3518%	0.4074%	0.4455%

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

#### 1. 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	0.9622%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	0.6219%	0.0016%
过去六个月	1.9110%	0.0016%	0.6805%	0.0000%	1.2305%	0.0016%
过去一年	3.6319%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	2.2819%	0.0018%
自基金合同生效起至今	4.0541%	0.0021%	1.5645%	0.0000%	2.4896%	0.0021%

注：本基金的收益分配是按日结转份额。

#### 2. 太平日日金 B：

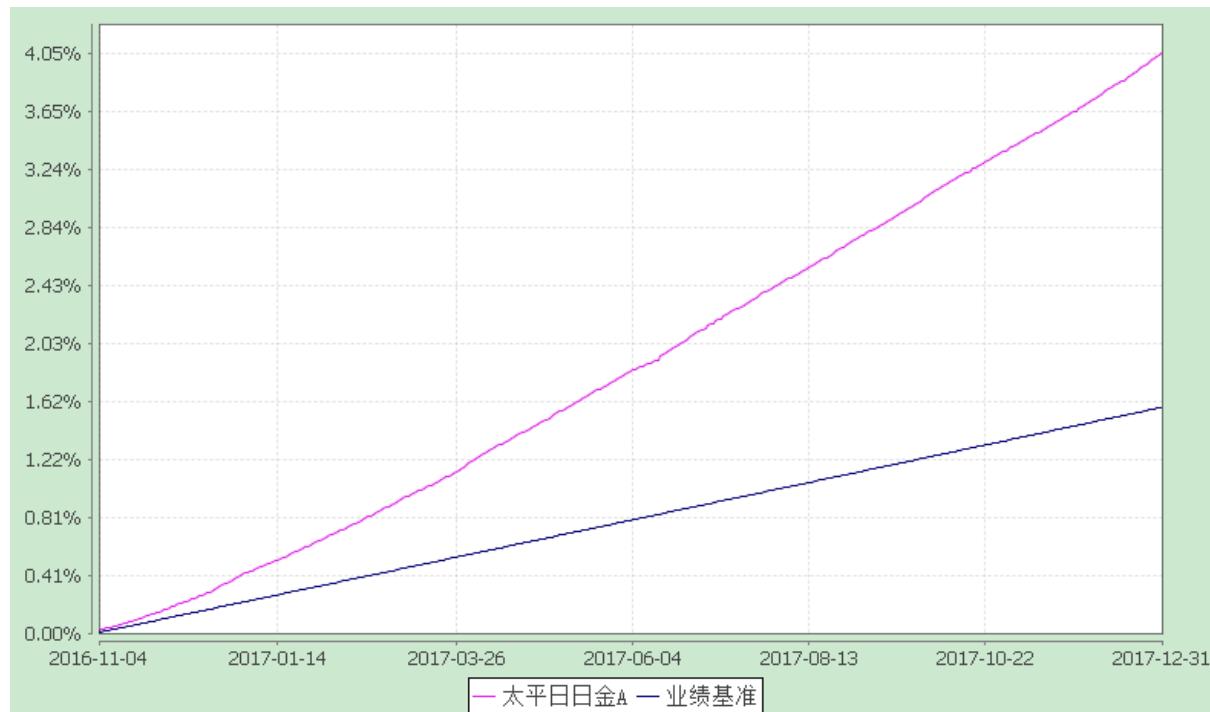
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0256%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	0.6853%	0.0016%
过去六个月	2.0382%	0.0016%	0.6805%	0.0000%	1.3577%	0.0016%
过去一年	3.8890%	0.0018%	1.3500%	0.0000%	2.5390%	0.0018%
自基金合同生效起至今	4.3518%	0.0021%	1.5645%	0.0000%	2.7873%	0.0021%

注：本基金的收益分配是按日结转份额。

### 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

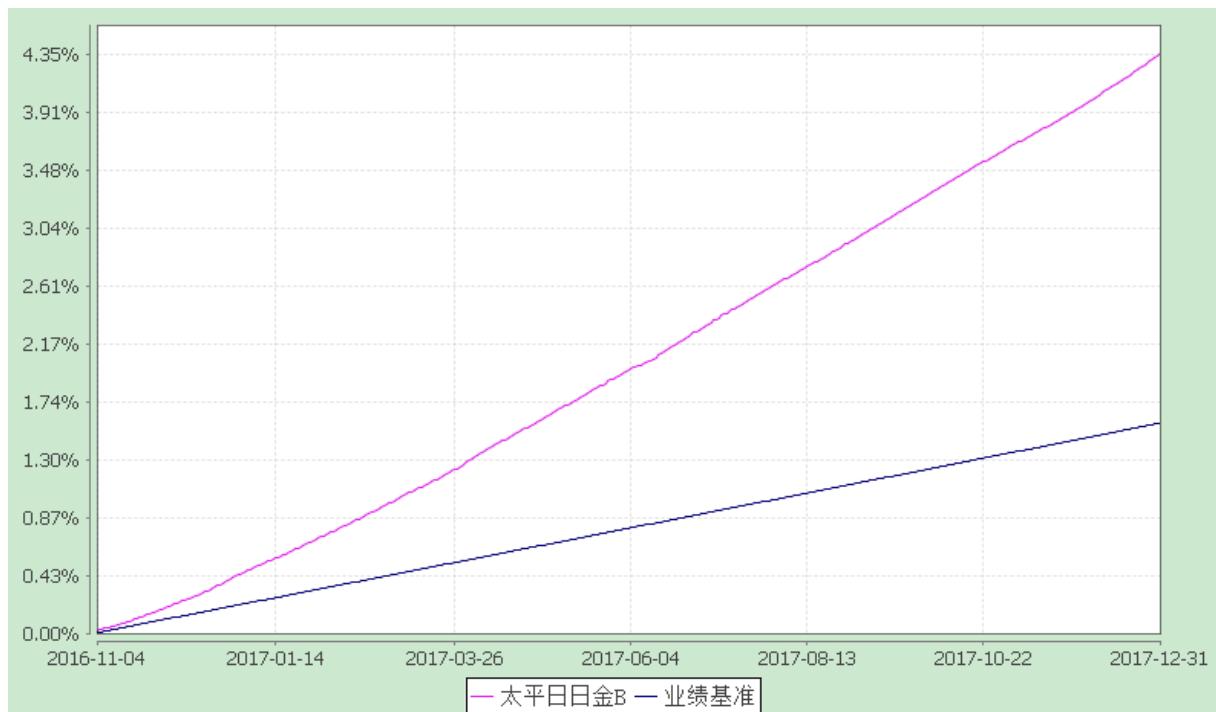
太平日日金货币市场基金  
累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2016年11月4日至2017年12月31日)

#### 1、太平日日金 A



注：按照本基金基金合同和招募说明书的约定，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。

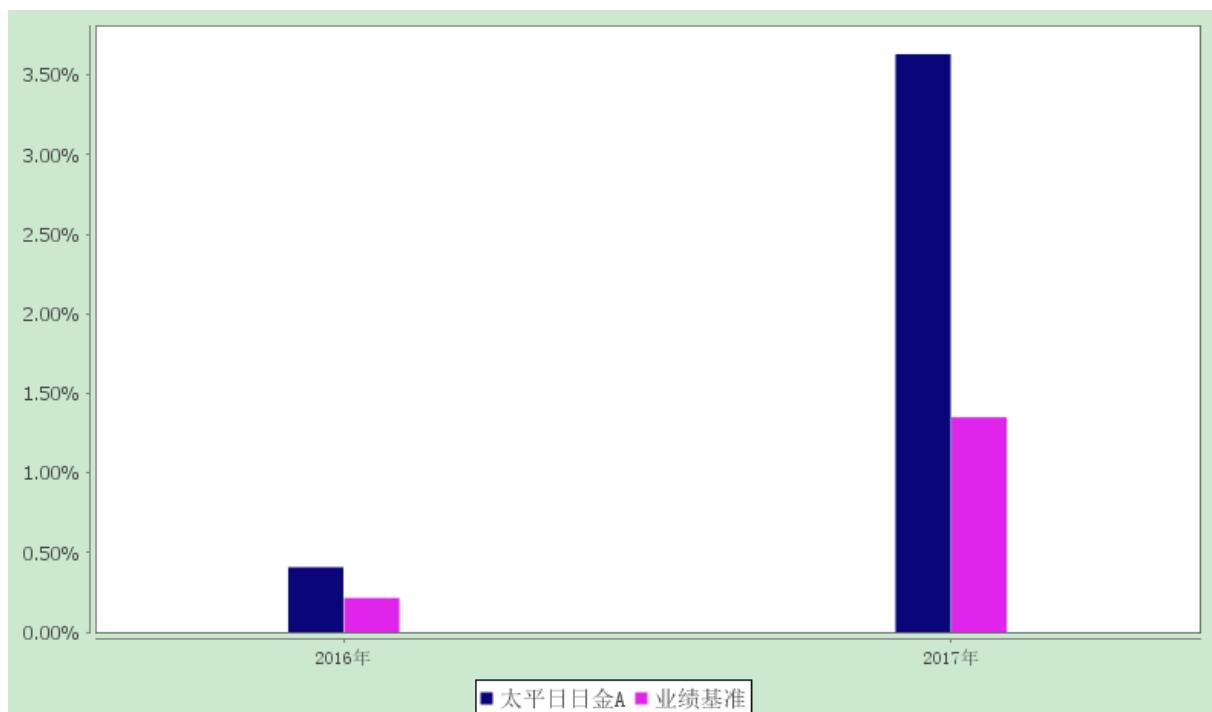
#### 2、太平日日金 B



注：按照本基金基金合同和招募说明书的约定，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 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

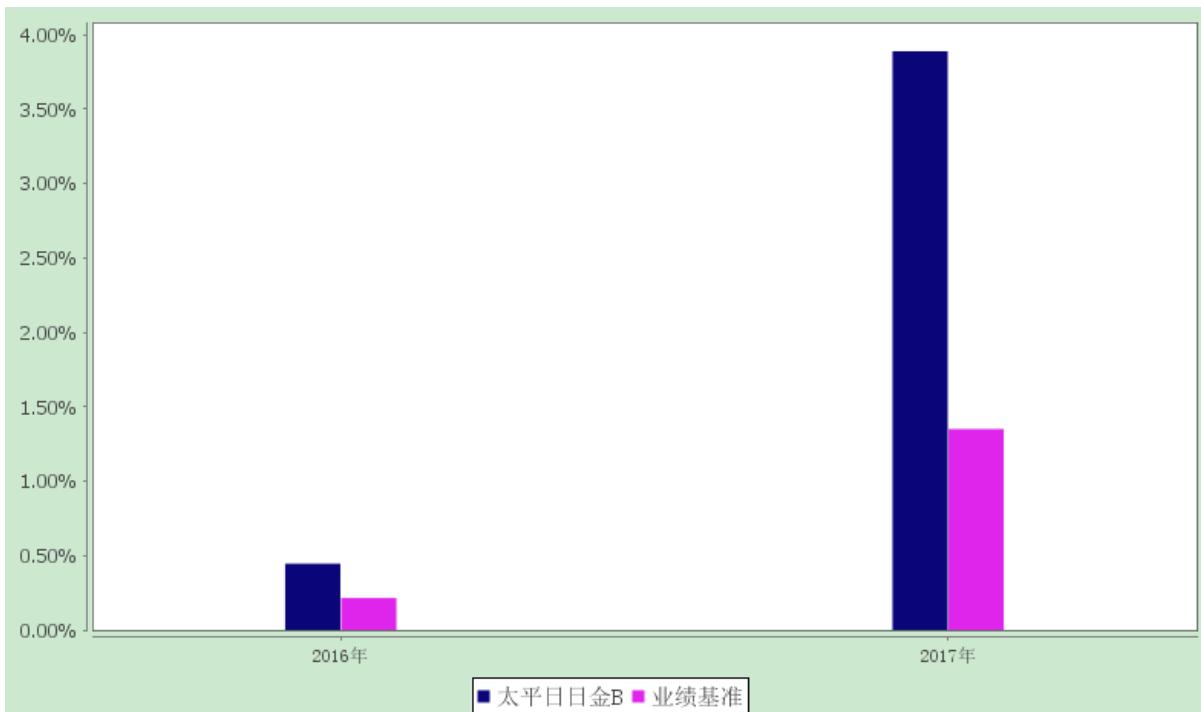
#### 1、太平日日金 A



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

## 2、太平日日金 B



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

#### 太平日日金 A:

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2017 年	404,933.51	-	-9,448.90	395,484.61	-
2016 年	153,471.31	-	9,613.57	163,084.88	-
合计	558,404.82	-	164.97	558,569.49	-

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 4 日。

#### 太平日日金 B:

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2017 年	270,017,811.84	-	-449,325.01	269,568,486.83	-
2016 年	36,670,957.57	-	1,310,840.11	37,981,797.68	-

合计	306,688,769.41	-	861,515.10	307,550,284.51	-
----	----------------	---	------------	----------------	---

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 4 日。

## § 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。目前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 83%，中原证券股份有限公司的出资占注册资本的 8.5%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 8.5%。

目前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，在投资管理、策略设计、产品设计、客户服务等方面配置了专业团队及集中了优势资源，力求为客户创造长期持续稳健的回报。截至本报告期末，公司共管理 4 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。

#### 4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
吴素涵	本基金的基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理	2017-06-21	-	3	韩国淑明女子大学学士，具有证券投资基金从业资格。2014 年 6 月起曾在汇丰晋信基金管理有限公司任固定收益交易员。2016 年 6 月加入本公司，现任基金经理。2017 年 6 月 21 日起担任太平日日金货币市场基金经理、太平日日鑫货币市场基金经理。中国国籍。
翁锡赟	本基金的基金经理、太平日日鑫货币	2016-11-04	2017-12-1 2	13	复旦大学金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2004 年 1 月起曾在兴业基金管理有限公司（现兴全基金管理有限公司）任首席交易员和债券研究

市场基金基金经理、固定收益部总监				员，万家基金管理有限公司任基金经理助理，国泰基金管理有限公司任国泰货币市场证券投资基金基金经理(任职期间：2008年8月23日至2011年6月15日)、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金管理人基金经理(任职期间：2010年6月10日至2011年6月15日)、社保409、709组合投资经理，东吴证券股份有限公司任债券投资部副总经理，国泰君安（香港）有限公司任国泰君安巨龙中国固定收益基金（RQFII）基金经理(任职期间：2012年3月9日至2013年11月22日)、高级副总裁，在本公司任中原英石货币市场基金基金经理(任职期间：2014年9月11日至2015年10月21日该基金合同已终止)；太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理(任职期间：2016年3月8日至2017年5月9日)；太平日日金货币市场基金基金经理(任职期间：2016年11月4日至2017年12月12日)；太平日日鑫货币市场基金基金经理(任职期间：2017年3月15日至2017年12月20日)。中国国籍。
------------------	--	--	--	---

注：1、基金经理的任职日期和离职离任日期一般情况下指为公司对外公告之日；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日起；

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、2018年3月3日，本基金管理人发布《太平基金管理有限公司关于吴素涵女士卸任太平日日金货币市场基金基金经理的公告》，吴素涵女士自2018年3月2日起不再担任本基金基金经理，除此之外基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

#### 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

本基金在报告期内，判断债券市场总体呈现收益率上行的趋势，货币政策易紧难松，在货币基金的配置上采取了更为稳健的运作方式。从仓位配置上，债券以及同业存单仓

位总体控制在一定水平内，避免利率风险过多暴露。在久期控制上，采取了低久期的策略，在市场和基金规模的波动中保持相对平稳的收益水平。在品种的选择上，本基金保持一贯的高评级策略，债券以及同业存单的配置上选择了 AAA 发行人为主的方式，在定期存款方面选择股份制银行作为对手方，控制交易对手风险，保持组合收益稳健提升。在杠杆方面，保持低杠杆的操作方式，在市场波动中始终努力为持有人带来一定的回报。

#### 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 3.6319%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%；太平日日金 B 的净值收益率为 3.8890%，同期业绩比较基准收益率为 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

展望 2018 年，中国的经济基本面仍将保持在稳定增长的区间，通胀预期或将有所抬升，将一定程度上带动无风险利率抬升，金融监管仍或将是 2018 年的重要主题。2018 年房地产投资下行压力仍在，基建投资的动力可能将趋弱。去年债券市场经历了基本面稳定背景下的金融监管年，利率不断上行，货币政策总体稳中趋紧，预计在金融监管继续的背景下仍当前局面将可能在新的一年持续，长端可能仍有较大的压力。就信用市场而言，市场对信用风险进一步暴露的预期较为充分，信用风险事件爆发从而出现大幅波动的可能性较小，但仍应多加关注信用市场可能出现的风险。

### 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，公司稽核与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，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金估值定价与评估制度》和《太平基金管理有限公司基金会计业务管理制度》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员由营运总监负责，成员包括投资组合经理、行业研究员、风控人员、金融工程研究员及基金会计等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。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：395,484.61 元，B 级分配收益 269,568,486.83 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《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

太平日日金货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了太平日日金货币市场基金（以下简称“太平日日金货币市场基金”）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度和 2016 年 11 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是太平日日金货币市场基金的基金管理人太平基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；
- (2) 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。

### 二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

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。

### 三、审计意见

我们认为，上述太平日日金货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了太平日日金货币基金 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 11 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

薛竟、顾卓毅

上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

2018-03-24

### § 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	7.4.7.1	1,166,392,538.19	7,941,546,436.72
结算备付金		19,409,090.93	29,781,818.18
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	4,214,778,019.05	993,125,425.67
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,214,778,019.05	993,125,425.67
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	1,265,669,486.70	4,381,038,820.64
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	12,145,986.89	36,026,572.62

应收股利		-	-
应收申购款		-	279,191,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		6,678,395,121.76	13,660,710,073.83
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		201,068,378.40	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,064,389.15	2,212,888.03
应付托管费		625,572.47	670,572.15
应付销售服务费		62,855.41	72,514.28
应付交易费用	7.4.7.7	57,381.42	17,282.52
应交税费		-	-
应付利息		147,531.32	-
应付利润		861,679.77	1,320,453.68
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	184,236.50	60,437.94
负债合计		205,072,024.44	4,354,148.60
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	6,473,323,097.32	13,656,355,925.23
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		6,473,323,097.32	13,656,355,925.23
负债和所有者权益总计		6,678,395,121.76	13,660,710,073.83

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,473,323,097.32 份。其中 A 类基金份额的份额总额 1,301,290.03 份，B 类基金份额的份额总额 6,472,021,807.29 份。于 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 13,656,355,925.23 份。其中 A 类基金份额的份额总额 106,597,224.59 份， B 类基金份额的份额总额 13,549,758,700.64 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 11 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：太平日日金货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 11 月 4 日 (基金合同生效 日) 至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>305,182,700.34</b>	<b>44,125,574.51</b>
1.利息收入		301,538,875.87	44,125,574.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	69,588,470.86	33,270,870.51
债券利息收入		148,149,668.24	1,651,939.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		83,800,736.77	9,202,764.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,623,550.50	-
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	3,623,550.50	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	20,273.97	-
<b>减：二、费用</b>		<b>35,218,728.90</b>	<b>5,980,691.95</b>
1. 管理人报酬		23,516,227.40	4,376,590.89
2. 托管费		7,126,129.59	1,326,239.66
3. 销售服务费		739,511.61	147,080.78
4. 交易费用	7.4.7.18	946.34	-

5. 利息支出		3,554,414.44	62,448.67
其中：卖出回购金融资产支出		3,554,414.44	62,448.67
6. 其他费用	7.4.7.19	281,499.52	68,331.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>269,963,971.44</b>	<b>38,144,882.56</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>269,963,971.44</b>	<b>38,144,882.56</b>

注：比较财务报表的实际编制期间为 2016 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

### 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	实收基金	未分配利润
一、期初所有者权益（基金净值）	13,656,355,925.23	-	13,656,355,925.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	269,963,971.44	269,963,971.44
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）	-7,183,032,827.91	-	-7,183,032,827.91
其中：1.基金申购款	26,382,939,600.60	-	26,382,939,600.60
2.基金赎回款	-33,565,972,428.51	-	-33,565,972,428.51
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）	-	-269,963,971.44	-269,963,971.44
五、期末所有者权益（基金净值）	6,473,323,097.32	-	6,473,323,097.32

项目	上年度可比期间		
	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)	11,905,478,318.58	-	11,905,478,318.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,144,882.56	38,144,882.56
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)	1,750,877,606.65	-	1,750,877,606.65
其中：1.基金申购款	6,446,299,178.64	-	6,446,299,178.64
2.基金赎回款	-4,695,421,571.99	-	-4,695,421,571.99
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)	-	-38,144,882.56	-38,144,882.56
五、期末所有者权益(基金净值)	13,656,355,925.23	-	13,656,355,925.23

注：比较财务报表的实际编制期间为 2016 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日(下同)。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：宋小龙，主管会计工作负责人：宋卫华，会计机构负责人：孙波

## 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《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。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 2018 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平日日金货币市场基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度和 2016 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的 财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证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公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，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。

债券投资和资产支持证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；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。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。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值目的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够的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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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 类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

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每日以红利再投资方式集中支付累计收益。

#### 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并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 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，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,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。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

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

- (1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征增值税, 对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。
- (2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖债券的差价收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

## 7.4.7 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
----	-----	------

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	4,392,538.19	1,541,546,436.72
定期存款	1,162,000,000.00	6,400,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	100,000,000.00	2,600,000,000.00
存款期限 1-3 个月	912,000,000.00	3,700,000,000.00
存款期限 3 个月以上	150,000,000.00	100,000,000.00
其他存款	-	-
合计	1,166,392,538.19	7,941,546,436.72

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 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	4,214,778,019.05	4,212,077,000.00	-2,701,019.05	-0.0417
	合计	4,214,778,019.05	4,212,077,000.00	-2,701,019.05	-0.0417
项目		上年度末 2016 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	993,125,425.67	992,558,000.00	-567,425.67	-0.0042
	合计	993,125,425.67	992,558,000.00	-567,425.67	-0.0042

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。

#### 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	
	2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	541,200,000.00	-
银行间市场	724,469,486.70	-
合计	1,265,669,486.70	-

项目	上年度末	
	2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	980,610,000.00	-
银行间市场	3,400,428,820.64	-
合计	4,381,038,820.64	-

注：2017年12月31日交易所买入返售证券余额中包含的交易所固收平台质押式协议回购的余额为0.00元(2016年12月31日：965,610,000.00元)。

#### 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	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
应收活期存款利息	7,745.35	311,767.45
应收定期存款利息	4,574,178.59	19,598,471.75
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	9,607.51	19,688.62
应收债券利息	5,343,090.40	11,208,998.06
应收买入返售证券利息	2,211,365.04	4,887,646.74
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	12,145,986.89	36,026,572.62

#### 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 2017年12月31日	上年度末 2016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	57,381.42	17,282.52
合计	57,381.42	17,282.52

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
其他应付款	10,236.50	7,337.94
预提信息披露费	80,000.00	30,000.00
预提审计费用	83,000.00	20,000.00
账户维护费	11,000.00	3,100.00
合计	184,236.50	60,437.94

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 太平日日金 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	106,597,224.59	106,597,224.59
本期申购	142,330,539.58	142,330,539.58
本期赎回(以“-”号填列)	-247,626,474.14	-247,626,474.14
本期末	1,301,290.03	1,301,290.03

注：表内各级基金的申购和赎回均包括红利再投资、分级调整以及基金转入和转出数。

##### 太平日日金 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	13,549,758,700.64	13,549,758,700.64
本期申购	26,240,609,061.02	26,240,609,061.02
本期赎回(以“-”号填列)	-33,318,345,954.37	-33,318,345,954.37
本期末	6,472,021,807.29	6,472,021,807.29

注：表内各级基金的申购和赎回均包括红利再投资、分级调整以及基金转入和转出数。

本基金自 2016 年 10 月 17 日至 2016 年 10 月 28 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 11,905,295,398.80 元。根据《太平日日金货币市场基金招募说明书》和《太平日日金货币市场基金基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 182,919.78 元在本基金成立后，折算为 182,919.78 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.10 未分配利润

太平日日金 A

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	395,484.61	-	395,484.61
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	-395,484.61	-	-395,484.61
本期末	-	-	-

太平日日金 B

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	269,568,486.83	-	269,568,486.83
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	-269,568,486.83	-	-269,568,486.83
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 11 月 4 日（基金 合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,935,402.43	3,483,452.75
定期存款利息收入	67,517,224.92	29,734,709.32
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	122,540.00	52,392.19
其他	13,303.51	316.25
合计	69,588,470.86	33,270,870.51

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年11月4日（基金 合同生效日）至2016年12 月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额	19,494,605,939.42	-
减： 卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成本总额	19,419,421,256.61	-
减： 应收利息总额	71,561,132.31	-
买卖债券差价收入	3,623,550.50	-

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本报告期内本基金及上年度可比期间无衍生工具投资收益。

**7.4.7.15 股利收益**

本报告期内本基金及上年度可比期间无股利收益。

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

本基金报告期内及上年度可比期间无公允价值变动收益。

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月4日（基金合同生效日）至2016年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	20,273.97	-
合计	20,273.97	-

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月4日（基金合同生效日）至2016年12月31日
交易所市场交易费用	0.00	-
银行间市场交易费用	946.34	-
合计	946.34	-

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月4日（基金合同生效日）至2016年12月31日
审计费用	63,000.00	20,000.00

信息披露费	80,000.00	30,000.00
银行汇划费	101,299.52	14,831.95
账户维护费	37,200.00	3,100.00
其他	-	400.00
合计	281,499.52	68,331.95

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作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(“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(“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
太平资产管理有限公司(“太平资管”)	基金管理人的股东
中原证券股份有限公司(“中原证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
安石投资管理有限公司(“安石投资”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 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 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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，无支付关联方的佣金。

#### 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 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年11月4日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	23,516,227.40	4,376,590.89
其中：支付销售机构的客户维护费	106,614.98	36,633.96

注：支付基金管理人 太平基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 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 X 0.33% / 当年天数

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年11月4日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,126,129.59	1,326,239.66

注：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 X 0.10% / 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 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平日日金 A	太平日日金 B	合计
太平基金	12,499.81	703,930.77	716,430.58

合计	12,499.81	703,930.77	716,430.58
上年度可比期间 2016年11月4日（基金合同生效日）至2016年12月31日			
当期发生的基金应支付的销售服务费			
	太平日日金A	太平日日金B	合计
太平基金	2,959.68	129,649.19	132,608.87
合计	2,959.68	129,649.19	132,608.87

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的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给 太平基金管理有限公司，再由 太平基金管理有限公司 计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。销售服务费的计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 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

本期 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市 场交易的 各关联方 名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金 买入	基金 卖出	交易 金额	利息 收入	交易 金额	利息 支出
兴业银行	48,812,076.58	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2016年11月4日(基金合同生效日)至2016年12月31日						
银行间市 场交易的 各关联方 名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金 买入	基金 卖出	交易 金额	利息 收入	交易 金额	利息 支出
-	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月	2016年11月4日（基金合同生效

	31 日		日) 至 2016 年 12 月 31 日	
	太平日日金 A	太平日日金 B	太平日日金 A	太平日日金 B
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	46,407,945.26	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	46,407,945.26	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

注: 1.、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2.、基金管理人太平基金管理有限公司在本年度申购/赎回本基金的交易委托太平基金直销办理, 适用费率为零。

#### 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

太平日日金 B

份额单位: 份

关联方名称	太平日日金B本期末 2017年12月31日		太平日日金B上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
兴业银行	-	-	1,705,912,629.11	12.49%

#### 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年11月4日(基金合同生效日) 至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

兴业银行	4,392,538.19	11,796,707.97	1,841,546,436.72	4,221,230.54
------	--------------	---------------	------------------	--------------

注：本基金的活期银行存款及部分协议存款由基金托管人兴业银行保管，活期存款按银行同业利率计息，协议存款按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 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					
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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： 股/张)	总金额
兴业银行	111710256	17 兴业银行 CD256	网下申购	1,000,000.0 0	98,816,900.00

上年度可比期间					
2016 年 11 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 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： 股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 1、太平日日金 A

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
404,933.51	-	-9,448.90	395,484.61	-

##### 2、太平日日金 B

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

270,017,811.84	-	-449,325.01	269,568,486.83	-
----------------	---	-------------	----------------	---

#### 7.4.12 期末（2017 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无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

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 201,068,378.40 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
179947	17 贴现国债 47	2018-01-02	99.87	1,000,000.0 0	99,871,610.13
170003	17 附息国债 03	2018-01-02	99.99	1,031,000.0 0	103,093,416.57
合计	-	-	-	2,031,000.0 0	202,965,026.70

###### 7.4.12.3.2 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。

#### 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。其中与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

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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存放在本基金的托管行兴业银行；定期存款存放在具有基金托管资格的广发银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司以及渤海银行股份有限公司，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，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。

##### 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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
A-1	-	49,738,842.14
A-1 以下	-	--
未评级	4,214,778,019.05	753,041,236.15
合计	4,214,778,019.05	802,780,078.29

注：未评级债券为国债、短期融资券和同业存单。

#### 7.4.13.2.2 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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	190,345,347.38
合计	-	190,345,347.38

注：未评级债券为国债。

#### 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 2017 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 201,068,378.40 元将在 1 个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合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。

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。

#### 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》(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 2017 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 97.07%，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%。

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。

#### 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价格因素的变动而发生波动的风险，与本基金相关的市场风险主要是利率风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	104,392,538.19	912,000,000.00	150,000,000.00	-	-	-	1,166,392,538.19
清算备付金	19,409,090.93	-	-	-	-	-	19,409,090.93
交易性金融资产	548,641,793.13	3,282,376,795.37	383,759,430.55	-	-	-	4,214,778,019.05
买入返售金融资产	1,265,669,486.70	-	-	-	-	-	1,265,669,486.70
应收利息	-	-	-	-	-	12,145,986.89	12,145,986.89
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,938,112,908.95	4,194,376,795.37	533,759,430.55	-	-	12,145,986.89	6,678,395,121.76
负债							
卖出回购证券款	201,068,378.40	-	-	-	-	-	201,068,378.40
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,064,389.15	2,064,389.15
应付托管费	-	-	-	-	-	625,572.47	625,572.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	62,855.41	62,855.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	57,381.42	57,381.42
应付利息	-	-	-	-	-	147,531.32	147,531.32
应付利润	-	-	-	-	-	861,679.7	861,679.77

						7	
其他负债	-	-	-	-	-	184,236.50	184,236.50
负债总计	201,068,378.40	-	-	-	-	4,003,646.04	205,072,024.44
利率敏感度缺口	1,737,044,530.55	4,194,376,795.37	533,759,430.55	-	-	8,142,340.85	6,473,323,097.32
上年度末 2016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	4,141,546,436.72	3,700,000,000.00	100,000,000.00	-	-	-	7,941,546,436.72
清算备付金	29,781,818.18	-	-	-	-	-	29,781,818.18
交易性金融资产	140,167,429.12	556,750,798.66	296,207,197.89	-	-	-	993,125,425.67
买入返售金融资产	4,381,038,820.64	-	-	-	-	-	4,381,038,820.64
应收利息	-	-	-	-	-	36,026,572.62	36,026,572.62
应收申购款	-	-	-	-	-	279,191,000.00	279,191,000.00
资产总计	8,692,534,504.66	4,256,750,798.66	396,207,197.89	-	-	315,217,572.62	13,660,710,073.83
负债							
卖出回购证券款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,212,888.03	2,212,888.03
应付托管费	-	-	-	-	-	670,572.15	670,572.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	72,514.28	72,514.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	17,282.52	17,282.52
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	1,320,453.68	1,320,453.68
其他负债	-	-	-	-	-	60,437.94	60,437.94

负债总计	-	-	-	-	-	4,354,148. 60	4,354,148. 60
利率敏感度缺口	8,692,534,504 .66	4,256,750,7 98.66	396,207,197. 89	-	-	310,863,4 24.02	13,656,35 5,925.23

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		
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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
	市场利率下降 25 个基点	1,862,417.15	662,639.22
	市场利率上升 25 个基点	-1,856,989.63	-660,371.46

#### 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，且以摊余成本进行后续计量，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) 公允价值
  - (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 4,214,778,019.05 元，无属于第一、第三层次的余额（上年度末：第二层次 993,125,425.67 元，无属于第一、第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	4,214,778,019.05	63.11
	其中：债券	4,214,778,019.05	63.11
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,265,669,486.70	18.95
	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	1,185,801,629.12	17.76
4	其他各项资产	12,145,986.89	0.18
5	合计	6,678,395,121.76	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目		
1		2.11	
报告期内债券回购融资余额		-	
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		3.11	
报告期末债券回购融资余额		201,068,378.40	-
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	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

#### 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	29.94	3.11
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	20.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	44.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	0.46%	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	7.78%	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	102.98	3.11

#### 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	389,575,552.84	6.02
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	160,030,471.81	2.47
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,665,171,994.40	56.62
8	其他	-	-
9	合计	4,214,778,019.05	65.11
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111720293	17 广发银行 CD293	3,000,000	296,840,439.42	4.59
2	111720300	17 广发银行 CD300	2,000,000	199,270,759.38	3.08
3	111708417	17 中信银行 CD417	2,000,000	198,264,812.36	3.06
4	111715457	17 民生银行 CD457	2,000,000	198,264,812.36	3.06
5	170003	17 附息国债 03	1,500,000	149,990,421.78	2.32
6	111709483	17 浦发银行 CD483	1,500,000	148,698,609.26	2.30
7	179949	17 贴现国债 49	1,400,000	139,713,520.93	2.16
8	179947	17 贴现国债 47	1,000,000	99,871,610.13	1.54
9	111709441	17 浦发银行 CD441	1,000,000	99,451,061.84	1.54
10	111716259	17 上海银行 CD259	1,000,000	99,308,595.17	1.53

### 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	0.0420%
报告期内偏离度的最低值	-0.1102%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0208%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内无正偏离度的绝对值达到0.25%的情况

## 8.8 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

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

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	12,145,986.89
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	12,145,986.89

#### 8.9.4 其他需说明的重要事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 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	393	3,311.17	363,157.03	27.91%	938,133.00	72.09%
太平日日金 B	20	323,601,090.36	6,472,021,807.29	100.00%	0.00	0.00%
合计	413	15,673,905.80	6,472,384,964.32	99.99%	938,133.00	0.01%

#### 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	2,634,844,601.37	40.70%
2	银行类机构	2,026,588,714.66	31.31%
3	银行类机构	510,552,430.51	7.89%
4	券商类机构	310,535,452.16	4.80%
5	其他机构	202,864,310.43	3.13%
6	其他机构	160,897,616.57	2.49%
7	券商类机构	129,158,597.06	2.00%
8	券商类机构	106,305,335.57	1.64%
9	基金类机构	101,590,648.29	1.57%
10	基金类机构	100,000,000.00	1.54%

#### 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

基金管理人所有从业人员持有本基金	太平日日金 A	45,511.55	3.50%
	太平日日金 B	0.00	0.00%
	合计	45,511.55	0.001%

#### 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	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	106,597,224.59	13,549,758,700.64
本报告期基金总申购份额	142,330,539.58	26,240,609,061.02
减：本报告期基金总赎回份额	247,626,474.14	33,318,345,954.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,301,290.03	6,472,021,807.29

### § 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) 经太平基金管理有限公司第二届董事会 2017 年第十一次会议审议通过，于 2017 年 12 月 12 日起聘请邱宏斌先生为公司副总经理。上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会上海监管局备案，并于 2017 年 12 月 14 日发布了《太平基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

(2) 经太平基金管理有限公司第二届董事会 2017 年第十二次会议审议通过，于 2017 年 12 月 25 日起聘请吴东先生为公司副总经理。上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会上海监管局备案，并于 2017 年 12 月 26 日发布了《太平基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内基金管理人、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

本报告期内未发生涉及基金管理人、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

本基金自基金合同生效日（2016 年 11 月 4 日）起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。本报告期内应支付的审计费用为人民币捌万叁仟元整。

## 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，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
中信证券	1	-	-	-	-	-
中国国际	1	-	-	-	-	-

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

本报告期为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		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
中国国际	-	-	21,842,200,000.00	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	关于暂停太平日日金货币市场基金大额申购业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-01-23
2	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并参加相关费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-02-07
3	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-02-28
4	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-03-28

5	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-05-10
6	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-06-15
7	太平基金管理有限公司关于增聘吴素涵女士担任太平日日金货币市场基金基金经理的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-06-23
8	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-06-26
9	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-08-03
10	太平日日金货币市场基金开放转换业务公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-08-12
11	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-08-29
12	太平基金管理有限公司关于开展网上直销费率优惠的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-10-28
13	太平基金管理有限公司关于直销柜台开通赎回转购业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-11-21
14	太平基金管理有限公司关于直销微信交易开通赎回转购业务的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-11-22

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20171231	5,021,380,415.08	113,704,316.50	2,500,240,130.21	2,634,844,601.37	40.70%
	2	20170630-20170703, 20170705-20170718, 20170720-20170731, 20170831-20171231	1,000,000.00	5,033,694,532.73	4,007,105,818.07	2,026,588,714.66	31.31%
	3	20170104-20170110	2,500,000.00	3,573,330.48	2,503,573,330.48	0.00	0.00%
	4	20170608	502,744,806.	510,118,633.	1,012,863,439.77	0.00	0.00%

			01	76			
产品特有风险							
<p>(1) 本基金投资于货币市场工具，可能面临较高的货币市场利率波动的系统性风险以及流动性风险。货币市场利率的波动会影响基金的再投资收益，并影响到基金资产公允价值的变动，从而影响基金的收益水平。同时为应对赎回进行资产变现时，可能会由于货币市场工具流动性不足而面临流动性风险。</p> <p>(2) 本基金份额净值始终保持为1.00元，投资收益每日分配、按日支付，但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金每日分配的收益因市场情况上下波动，在极端情况下可能为负值，导致基金份额持有人的基金份额缩减的风险。</p> <p>(3) 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连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人按照公允价值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，导致基金份额持有人的基金份额缩减的风险。</p> <p>(4) 在特定条件下，为保证基金平稳运作，避免诱发系统性风险，基金管理人有可能对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用，本基金基金份额持有人会面临赎回份额少于预期的风险。</p> <p>(5) 在极端风险发生时，基金管理人及其股东在履行内部程序后，可以使用固有资金从货币市场基金购买金融工具。基金管理人及其股东存在着无法或来不及从货币市场基金购买金融工具的可能性，基金份额持有人可能面临损失。</p>							

## 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：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室）

### 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：021-61560999

公司网址：[www.taipingfund.com.cn](http://www.taipingfund.com.cn)

太平基金管理有限公司  
二〇一八年三月二十九日