

# 太平日日金货币市场基金 2019 年半年度报告（摘要）

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：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：2019 年 8 月 24 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                    |                    |
|---------------------|--------------------|--------------------|
| 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          | 3,208,671,478.18 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<br>份额总额 | 4,148,033.98 份     | 3,204,523,444.20 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<br>责人 | 姓名           | 王刚                       |
|             | 联系电话         | 021-38556787             |
|             | 电子邮箱         | wangg@taipingfund.com.cn |
| 客户服务电话      | 021-61560999 | 95561                    |
| 传真          | 021-38556677 | 021-62159217             |

### 2.4 信息披露方式

|                          |                        |
|--------------------------|------------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网<br>址 | www.taipingfund.com.cn |
|--------------------------|------------------------|

|             |  |
|-------------|--|
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼<br>1708 室 |
|-------------|--|

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日） |                  |
|---------------|-------------------------------------|------------------|
|               | 太平日日金 A                             | 太平日日金 B          |
| 本期已实现收益       | 86,572.84                           | 56,923,376.17    |
| 本期利润          | 86,572.84                           | 56,923,376.17    |
| 本期净值收益率       | 1.1629%                             | 1.2838%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2019 年 6 月 30 日）               |                  |
|               | 太平日日金 A                             | 太平日日金 B          |
| 期末基金资产净值      | 4,148,033.98                        | 3,204,523,444.20 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                              | 1.0000           |

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

|       | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④     |
|-------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.1809%      | 0.0020%             | 0.1110%        | 0.0000%               | 0.0699% | 0.0020% |
| 过去三个月 | 0.5437%      | 0.0017%             | 0.3366%        | 0.0000%               | 0.2071% | 0.0017% |
| 过去六个月 | 1.1629%      | 0.0027%             | 0.6695%        | 0.0000%               | 0.4934% | 0.0027% |

|            |         |         |         |         |         |         |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去一年       | 2.5565% | 0.0028% | 1.3500% | 0.0000% | 1.2065% | 0.0028% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.7248% | 0.0027% | 3.5840% | 0.0000% | 5.1408% | 0.0027% |

注：本基金的收益分配是按日结转份额。

太平日日金 B

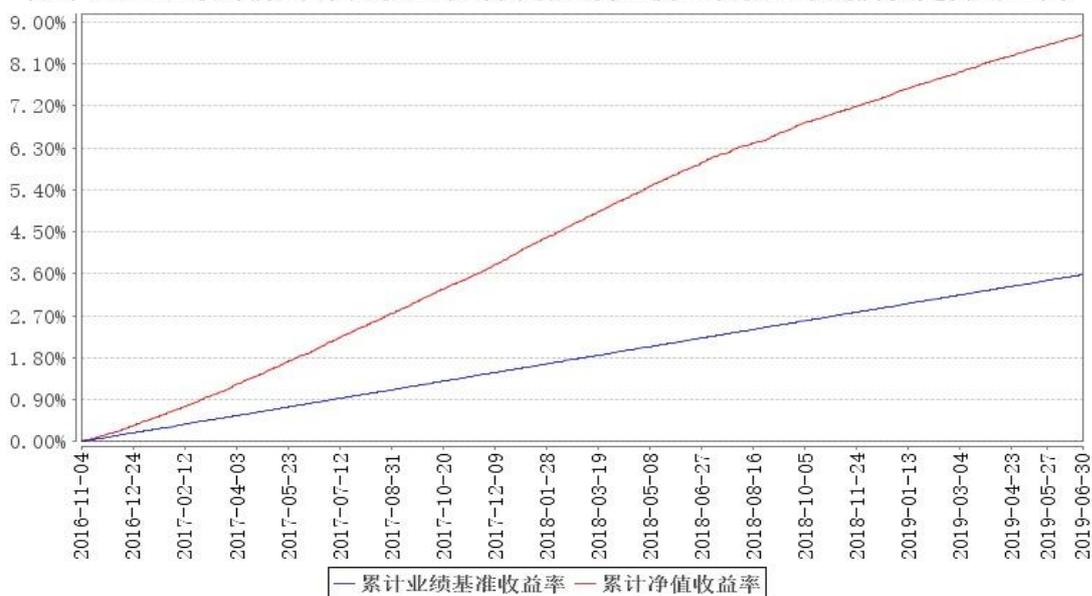
| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月      | 0.2008%  | 0.0020%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0898% | 0.0020% |
| 过去三个月      | 0.6043%  | 0.0017%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.2677% | 0.0017% |
| 过去六个月      | 1.2838%  | 0.0027%     | 0.6695%    | 0.0000%       | 0.6143% | 0.0027% |
| 过去一年       | 2.8043%  | 0.0028%     | 1.3500%    | 0.0000%       | 1.4543% | 0.0028% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.4287%  | 0.0027%     | 3.5840%    | 0.0000%       | 5.8447% | 0.0027% |

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

#### 1、太平日日金 A

太平日日金A份额累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

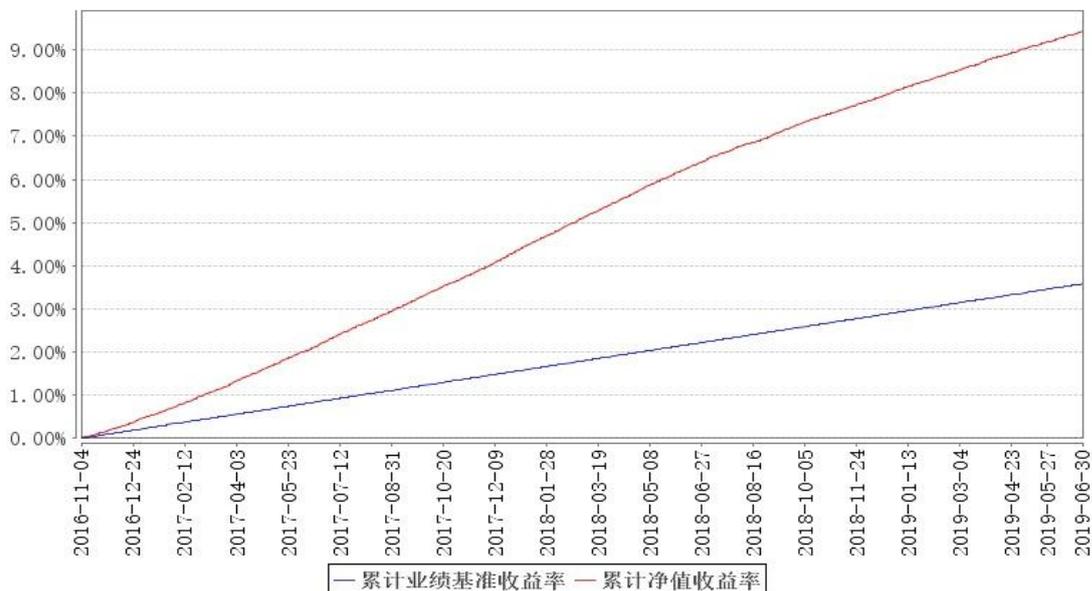


注：本基金合同于 2016 年 11 月 4 日生效。按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建

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

太平日日金B份额累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2016 年 11 月 4 日生效。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。

## § 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 7 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、

太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金。

#### 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 | 2018年2月12日      |      | 6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，现任固定收益部基金经理。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。中国国籍。 |
| 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                        | 2018年3月23日      |      | 7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，现任固定收益部基金经理。2018 年 3 月 23 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；2018 年 6 月 15 日起担任太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理。中国国籍。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、基金经理的任职日期和离任日期一般情况下指公司对外公告之日；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；

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合规守信情况的说明

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不公平交易的情况。

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。

##### 4.3.2 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

在全球主要经济体增速放缓和中美贸易战的背景下，今年上半年 GDP 维持同比增长 6.3%，规模以上工业增加值同比增长 6.0%。三架马车中，社会消费品零售总额增长受累于汽车销售增长乏力；制造业投资增速今年以来处于下行通道，位于近三年来新低；基建和房地产共同托底经济；贸易战影响、制造业乏力导致进出口总值下滑，出口增速减缓，贸易顺差扩大。总体而言，下半年经济依然面临一定的下行压力，政策仍会维持“稳增长、调结构”的基调，一方面，坚持“房住不炒”，积极调整经济结构，行业出清，也为货币政策寻求空间；另一方面，强化逆周期调节，财政发力，扩大消费，提振经济。货币政策上，在外围宽松的环境中有条件保持独立性，结构性宽松将继续替代总量宽松来配合经济发展路径，重点在于提升流动性向实体的传导能力，但波动可能有所加大。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，为投资者取得了不错的收益，符合货币基金的风险收益特征。

##### 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 1.1629%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%；太平日日金 B 的净值收益率为 1.2838%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年资金面宽松，原非标资产逐渐到期，“资产荒”有显现，债市收益率总体有所下行。中短端上，信用债的收益率较利率债下行更多，高等级信用债利差有所收敛。但因货币边际收紧，信用风险事件时有发生，短期内流动性传导的问题无法彻底解决，还无法期待信用溢价出现进一步下降。

本基金挑选中高等级债券，严格控制信用风险，在资金成本较低的情况下保持一定的杠杆率，并灵活运用久期策略进行趋势交易，力争为持有人创造价值。

#### 4.6 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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》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。公司估值委员会成员由主席负责，成员包括稽核风控部门负责人、量化投资部门负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人等人员组成，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。

#### 4.7 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：86,572.84 元，B 级分配收益 56,923,376.17 元，符合法律法规及《基金合同》的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期内，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 1,291,453.46                   | 856,456,157.51                   |
| 结算备付金           |            | 17,060,500.00                  | 32,814,090.90                    |
| 存出保证金           |            | 5,151.04                       | 2,263.93                         |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 2,276,691,184.02               | 3,541,214,126.14                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 2,276,691,184.02               | 3,541,214,126.14                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 1,167,414,801.32               | 1,582,009,345.01                 |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 2,038,857.21                   | 12,136,266.03                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 3,464,501,947.05               | 6,024,632,249.52                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 254,159,050.52                 | 220,245,229.63                   |
| 应付证券清算款         |            | -                              | 20,631,829.03                    |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付管理人报酬       |          | 868,937.66       | 1,695,497.27     |
| 应付托管费         |          | 263,314.44       | 513,787.05       |
| 应付销售服务费       |          | 27,287.15        | 52,158.67        |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 46,348.40        | 61,628.84        |
| 应交税费          |          | 19,748.13        | 6,228.99         |
| 应付利息          |          | 51,103.25        | 144,217.83       |
| 应付利润          |          | 205,443.83       | 605,402.30       |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 189,235.49       | 226,574.52       |
| 负债合计          |          | 255,830,468.87   | 244,182,554.13   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 3,208,671,478.18 | 5,780,449,695.39 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -                | -                |
| 所有者权益合计       |          | 3,208,671,478.18 | 5,780,449,695.39 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 3,464,501,947.05 | 6,024,632,249.52 |

注：1、报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3,208,671,478.18 元。其中 A 类基金份额的份额总额 4,148,033.98 份，B 类基金份额的份额总额 3,204,523,444.20 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

## 6.2 利润表

会计主体：太平日日金货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| 一、收入              |          | 70,761,832.06                            | 164,384,978.06                                |
| 1. 利息收入           |          | 69,622,332.81                            | 162,896,846.50                                |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.11 | 5,704,564.71                             | 30,580,207.52                                 |
| 债券利息收入            |          | 43,349,863.40                            | 94,546,651.59                                 |
| 资产支持证券利息收入        |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入        |          | 20,567,904.70                            | 37,769,987.39                                 |
| 其他利息收入            |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 1,139,499.25                             | 1,488,131.56                                  |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.12 | -  | -   |

|                        |            |               |                |
|------------------------|------------|---------------|----------------|
| 基金投资收益                 |            | -             | -              |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | 1,139,499.25  | 1,488,131.56   |
| 资产支持证券投资收益             |            | -             | -              |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.14   | -             | -              |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.15   | -             | -              |
| 股利收益                   | 6.4.7.16   | -             | -              |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.17   | -             | -              |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)     |            | -             | -              |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)     | 6.4.7.18   | -             | -              |
| 减：二、费用                 |            | 13,751,883.05 | 18,180,746.33  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 7,261,019.69  | 12,119,379.37  |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 2,200,309.01  | 3,672,539.19   |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 228,947.10    | 373,762.89     |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | -             | -              |
| 5. 利息支出                |            | 3,915,054.65  | 1,832,487.77   |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 3,915,054.65  | 1,832,487.77   |
| 6. 税金及附加               |            | 13,845.91     | 30,403.09      |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 132,706.69    | 152,174.02     |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)    |            | 57,009,949.01 | 146,204,231.73 |
| 减：所得税费用                |            | -             | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 57,009,949.01 | 146,204,231.73 |

### 6.3 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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |               |                   |
|--------------------------|----------------------------|---------------|-------------------|
|                          | 实收基金                       | 未分配利润         | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）          | 5,780,449,695.39           | -             | 5,780,449,695.39  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | -                          | 57,009,949.01 | 57,009,949.01     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数     | -2,571,778,217.21          | -             | -2,571,778,217.21 |

|  |                                 |                 |                   |
|--|---------------------------------|-----------------|-------------------|
| （净值减少以“-”号填列）                          |                                 |                 |                   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,413,962,963.07                | -               | 1,413,962,963.07  |
| 2. 基金赎回款                               | -3,985,741,180.28               | -               | -3,985,741,180.28 |
| 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） | -                               | -57,009,949.01  | -57,009,949.01    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 3,208,671,478.18                | -               | 3,208,671,478.18  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                 |                   |
|  | 实收基金                            | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 6,473,323,097.32                | -               | 6,473,323,097.32  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 146,204,231.73  | 146,204,231.73    |
| 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）      | -406,268,447.52                 | -               | -406,268,447.52   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 6,383,803,262.99                | -               | 6,383,803,262.99  |
| 2. 基金赎回款                               | -6,790,071,710.51               | -               | -6,790,071,710.51 |
| 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） | -                               | -146,204,231.73 | -146,204,231.73   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 6,067,054,649.80                | -               | 6,067,054,649.80  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邱宏斌

基金管理人负责人

宋卫华

主管会计工作负责人

孙波

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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，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用，因此形成不同的基金份额类。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 2019 年 8 月 22 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平日日金货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况、2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期未发生重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红

利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系           |
|--------------------|-------------------|
| 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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未通过关联交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未通过关联交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 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。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                 | 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,261,019.69                     | 12,119,379.37                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 20,106.44                        | 3,785.91                         |

注：支付基金管理人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：每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值 X0.33%÷当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,200,309.01                     | 3,672,539.19                     |

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：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值 X0.1%÷当年天数。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                               |            |            |
|----------------|----------------------------------|------------|------------|
|                | 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |            |            |
|                | 太平日日金 A                          | 太平日日金 B    | 合计         |
| 兴业银行股份有限公司     | 590.50                           | 0.00       | 590.50     |
| 太平基金管理有限公司     | 7,566.58                         | 218,508.23 | 226,074.81 |
| 合计             | 8,157.08                         | 218,508.23 | 226,665.31 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                          |            |            |
|                | 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |            |            |
|                | 太平日日金 A                          | 太平日日金 B    | 合计         |

|            |          |            |            |
|------------|----------|------------|------------|
| 兴业银行股份有限公司 | 138.05   | 0.00       | 138.05     |
| 太平基金管理有限公司 | 5,677.40 | 366,751.61 | 372,429.01 |
| 合计         | 5,815.45 | 366,751.61 | 372,567.06 |

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个交易日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个交易日起享受 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金报告期内及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本期末及上年度末，其他关联方均未投资本基金。

##### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期                   |           | 上年度可比期间              |            |
|------------|----------------------|-----------|----------------------|------------|
|            | 2019年1月1日至2019年6月30日 |           | 2018年1月1日至2018年6月30日 |            |
|            | 期末余额                 | 当期利息收入    | 期末余额                 | 当期利息收入     |
| 兴业银行股份有限公司 | 1,291,453.46         | 96,606.79 | 238,493,295.77       | 700,648.84 |

##### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

##### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本报告期末（2019 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本报告期末（2019 年 6 月 30 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本报告期末 2019 年 6 月 30 日，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 254,1590,50.52 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         |
|-----------|------------------|-------------------|--------|---------|----------------|
| 199922    | 19 贴现国债<br>22    | 2019 年 7 月 1<br>日 | 99.59  | 200000  | 19,918,370.96  |
| 199925    | 19 贴现国债<br>25    | 2019 年 7 月 1<br>日 | 99.49  | 500000  | 49,746,692.09  |
| 180026    | 18 付息国债<br>26    | 2019 年 7 月 1<br>日 | 100.04 | 300000  | 30,011,527.83  |
| 199917    | 19 贴现国债<br>17    | 2019 年 7 月 1<br>日 | 99.83  | 200000  | 19,965,299.23  |
| 111915026 | 19 民生银行<br>CD026 | 2019 年 7 月 1<br>日 | 98.35  | 400000  | 39,338,770.62  |
| 199902    | 19 贴现国债<br>02    | 2019 年 7 月 4<br>日 | 99.96  | 1000000 | 99,955,629.55  |
| 199923    | 19 贴现国债<br>23    | 2019 年 7 月 4<br>日 | 99.53  | 100000  | 9,953,061.89   |
| 合计        |                  |                   |        | 2700000 | 268,889,352.17 |

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.10 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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 2,276,691,184.02 元，无属于第一或第三层次的余额 (2018 年 12 月 31 日：第二层次 3,541,214,126.14 元，无第一或第三层次)。

(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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2018 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) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资            | 2,276,691,184.02 | 65.71         |
|    | 其中：债券             | 2,276,691,184.02 | 65.71         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 1,167,414,801.32 | 33.70         |
|    | 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 | 18,351,953.46    | 0.53   |
| 4 | 其他各项资产       | 2,044,008.25     | 0.06   |
| 5 | 合计           | 3,464,501,947.05 | 100.00 |

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例（%）  |               |
|----|--------------|----------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 7.66           |               |
|    | 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 | 254,159,050.52 | 7.92          |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              | -             |

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

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 55 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 65 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 38 |

### 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。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产净值的比例（%） |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 54.39              | 7.92               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 11.20              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 22.01              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 2.47               | -                  |

|   |                            |        |      |
|---|----------------------------|--------|------|
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含）          | 17.84  | -    |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
|   | 合计                         | 107.91 | 7.92 |

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 240 天。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种                 | 摊余成本             | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|----------------------|------------------|------------------|
| 1  | 国家债券                 | 259,398,596.80   | 8.08             |
| 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              | 150,163,619.52   | 4.68             |
| 6  | 中期票据                 | -                | -                |
| 7  | 同业存单                 | 1,867,128,967.70 | 58.19            |
| 8  | 其他                   | -                | -                |
| 9  | 合计                   | 2,276,691,184.02 | 70.95            |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -                |

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

金额单位：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<br>净值比例<br>(%) |
|----|-----------|------------------|-----------|---------------|----------------------|
| 1  | 111916081 | 19 上海银行<br>CD081 | 1,000,000 | 99,992,046.42 | 3.12                 |
| 2  | 199902    | 19 贴现国债 02       | 1,000,000 | 99,955,629.55 | 3.12                 |
| 3  | 111903078 | 19 农业银行<br>CD078 | 1,000,000 | 99,836,703.25 | 3.11                 |
| 4  | 111905069 | 19 建设银行<br>CD069 | 1,000,000 | 99,450,238.52 | 3.10                 |
| 5  | 111815494 | 18 民生银行<br>CD494 | 1,000,000 | 99,291,468.19 | 3.09                 |

|    |           |                    |           |               |      |
|----|-----------|--------------------|-----------|---------------|------|
| 6  | 111813158 | 18 浙商银行<br>CD158   | 1,000,000 | 98,874,032.22 | 3.08 |
| 7  | 111812228 | 18 北京银行<br>CD228   | 1,000,000 | 98,659,288.36 | 3.07 |
| 8  | 111870780 | 18 甘肃银行<br>CD138   | 1,000,000 | 98,655,330.26 | 3.07 |
| 9  | 111994548 | 19 厦门国际银行<br>CD041 | 1,000,000 | 98,542,144.32 | 3.07 |
| 10 | 111916158 | 19 上海银行<br>CD158   | 900,000   | 89,879,009.45 | 2.80 |

### 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况     |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0792%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0172% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0368%  |

#### 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 0.5%的情况

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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。

#### 7.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体或其分支机构中，上海银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、北京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。

除上述情形外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责处罚的情况。

## 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 5,151.04     |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收利息    | 2,038,857.21 |
| 4  | 应收申购款   | -            |
| 5  | 其他应收款   | -            |
| 6  | 待摊费用    | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 2,044,008.25 |

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别    | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额      | 持有人结构            |            |            |            |
|---------|-----------|----------------|------------------|------------|------------|------------|
|         |           |                | 机构投资者            |            | 个人投资者      |            |
|         |           |                | 持有份额             | 占总份额比例 (%) | 持有份额       | 占总份额比例 (%) |
| 太平日日金 A | 410       | 10,117.16      | 3,217,104.96     | 77.56      | 930,929.02 | 22.44      |
| 太平日日金 B | 8         | 400,565,430.53 | 3,204,523,444.20 | 100.00     | 0.00       | 0.00       |
| 合计      | 418       | 7,676,247.56   | 3,207,740,549.16 | 99.97      | 930,929.02 | 0.03       |

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额 (份)         | 占上市总份额比例 (%) |
|----|-------|------------------|--------------|
| 1  | 保险类机构 | 2,583,243,192.71 | 80.51        |
| 2  | 券商类机构 | 211,293,719.70   | 6.59         |
| 3  | 信托类机构 | 108,301,814.01   | 3.38         |
| 4  | 其他机构  | 100,012,848.30   | 3.12         |
| 5  | 券商类机构 | 86,297,428.40    | 2.69         |
| 6  | 基金类机构 | 50,664,902.19    | 1.58         |
| 7  | 基金类机构 | 50,664,059.12    | 1.58         |
| 8  | 保险类机构 | 13,635,298.75    | 0.42         |
| 9  | 基金类机构 | 3,159,235.49     | 0.10         |
| 10 | 个人    | 255,012.83       | 0.01         |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别    | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|---------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 太平日日金 A | 20,493.16  | 0.49         |
|                  | 太平日日金 B | 0.00       | 0.00         |

|  |    |           |        |
|--|----|-----------|--------|
|  | 合计 | 20,493.16 | 0.0006 |
|--|----|-----------|--------|

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 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、基金投资和相关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                 |
|                                | 太平日日金 B | 0                 |
|                                | 合计      | 0                 |

### §9 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                   | 6,221,615.68   | 5,774,228,079.71  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 6,328,337.86   | 1,407,634,625.21  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 8,401,919.56   | 3,977,339,260.72  |
| 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                   | 4,148,033.98   | 3,204,523,444.20  |

### §10 重大事件揭示

#### 10.1 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。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

##### 1、基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

##### 2、基金托管人的重大人事变动情况

自 2019 年 1 月 22 日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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。

#### 10.4 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。

#### 10.5 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。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

本报告期内为基金租用证券公司交易单元无变化。

##### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信证券 | 50,135,000.00 | 100.00%      | 29,130,900,000.00 | 100.00%        | -    | -%           |

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期本基金不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

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

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                  |               |                  | 报告期末持有基金情况       |          |
|--|----------------|-------------------------|------------------|---------------|------------------|------------------|----------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额          | 赎回份额             | 持有份额             | 份额占比 (%) |
| 机构   | 1              | 20190101-20190630       | 2,727,956,867.27 | 35,299,754.04 | 180,013,428.60   | 2,583,243,192.71 | 80.51    |
| 机构   | 2              | 20190101-20190325       | 1,501,868,091.74 | 10,997,410.65 | 1,512,865,502.39 | 0.00             | 0.00     |
| 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。 |                |                         |                  |               |                  |                  |          |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

|   |
|---|
| 无 |
|---|

太平基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十四日