

太平日日金货币市场基金 2019 年年度 报告

2019 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：2020 年 3 月 25 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 2020 年 3 月 23 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 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合规守信情况的说明 | 13 |
| 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 | 14 |
| 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 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| 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 | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .. | 16 |
| 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 |
| §6 审计报告 | 16 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 16 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 16 |
| §7 年度财务报表 | 18 |
| 7.1 资产负债表..... | 18 |
| 7.2 利润表 | 19 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 21 |
| 7.4 报表附注 | 22 |
| §8 投资组合报告 | 48 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 48 |

| | |
|--|-----------|
| 8.2 债券回购融资情况..... | 48 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 48 |
| 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..... | 49 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 49 |
| 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..... | 50 |
| 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离..... | 50 |
| 8.8 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..... | 50 |
| 8.9 投资组合报告附注..... | 51 |
| §9 基金份额持有人信息..... | 51 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 51 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 52 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| §10 开放式基金份额变动..... | 53 |
| §11 重大事件揭示..... | 53 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 53 |
| 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..... | 53 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 54 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 54 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 54 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 55 |
| 11.9 其他重大事件..... | 55 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 57 |
| §13 备查文件目录..... | 57 |
| 13.1 备查文件目录..... | 57 |
| 13.2 存放地点..... | 57 |
| 13.3 查阅方式..... | 58 |

§ 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 | 2,149,379,545.81 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 | 797,494.73 份 | 2,148,582,051.08 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 | 姓名 | 赵霖 |
| | 联系电话 | 021-38556613 |
| | | 曾麓燕 |
| | | 021-52629999-212040 |

| | | | |
|--------|------|-------------------------------------|----------------------|
| 人 | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn | zengluyan@cib.com.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 | 上海市银城路 167 号 4 楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200041 |
| 法定代表人 | | 范宇 | 陶以平（代为履行法定代表人职责） |

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 | 2019 年 | | 2018 年 | | 2017 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 | 125,547.82 | 92,145,566.96 | 162,355.95 | 240,552,778.83 | 395,484.61 | 269,568,486.83 |
| 本期利润 | 125,547.82 | 92,145,566.96 | 162,355.95 | 240,552,778.83 | 395,484.61 | 269,568,486.83 |

| | | | | | | |
|---------------|------------|------------------|--------------|------------------|--------------|------------------|
| 本期净值收益率 | 2.2412% | 2.4900% | 3.2876% | 3.5359% | 3.6319% | 3.8890% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年末 | | 2018 年末 | | 2017 年末 | |
| 期末基金资产净值 | 797,494.73 | 2,148,582,051.08 | 6,221,615.68 | 5,774,228,079.71 | 1,301,290.03 | 6,472,021,807.29 |
| 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 | 2019 年末 | | 2018 年末 | | 2017 年末 | |
| 累计净值收益率 | 9.8837% | 10.7319% | 7.4750% | 8.0416% | 4.0541% | 4.3518% |

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 | 0.5419% | 0.0019% | 0.3403% | 0.0000% | 0.2016% | 0.0019% |

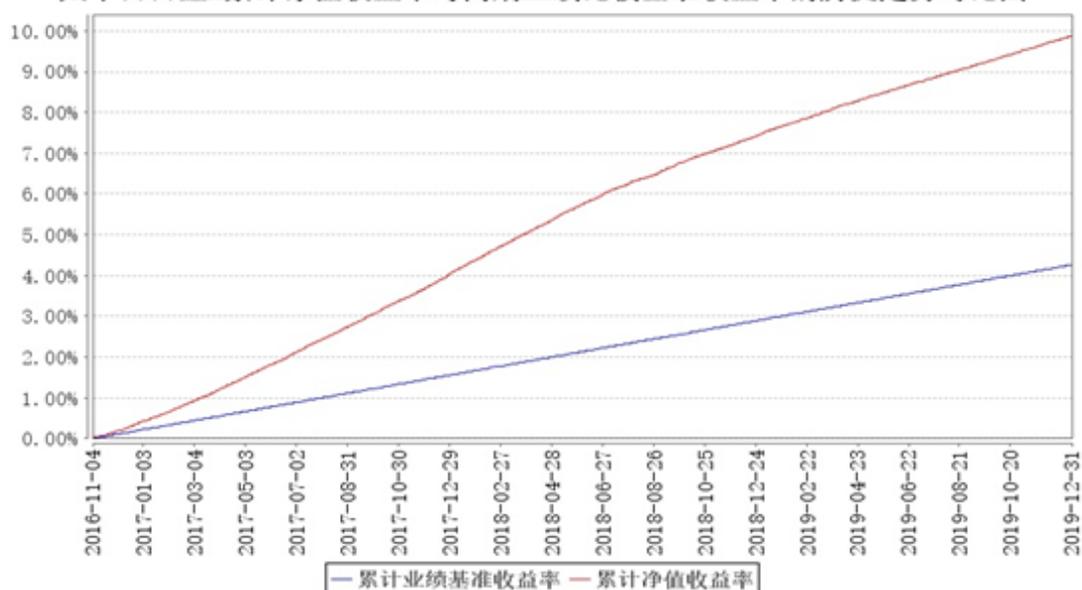
| | | | | | | |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去六个月 | 1.0659% | 0.0016% | 0.6805% | 0.0000% | 0.3854% | 0.0016% |
| 过去一年 | 2.2412% | 0.0023% | 1.3500% | 0.0000% | 0.8912% | 0.0023% |
| 过去三年 | 9.4378% | 0.0028% | 4.0500% | 0.0000% | 5.3878% | 0.0028% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.8837% | 0.0028% | 4.2645% | 0.0000% | 5.6192% | 0.0028% |

太平日日金 B

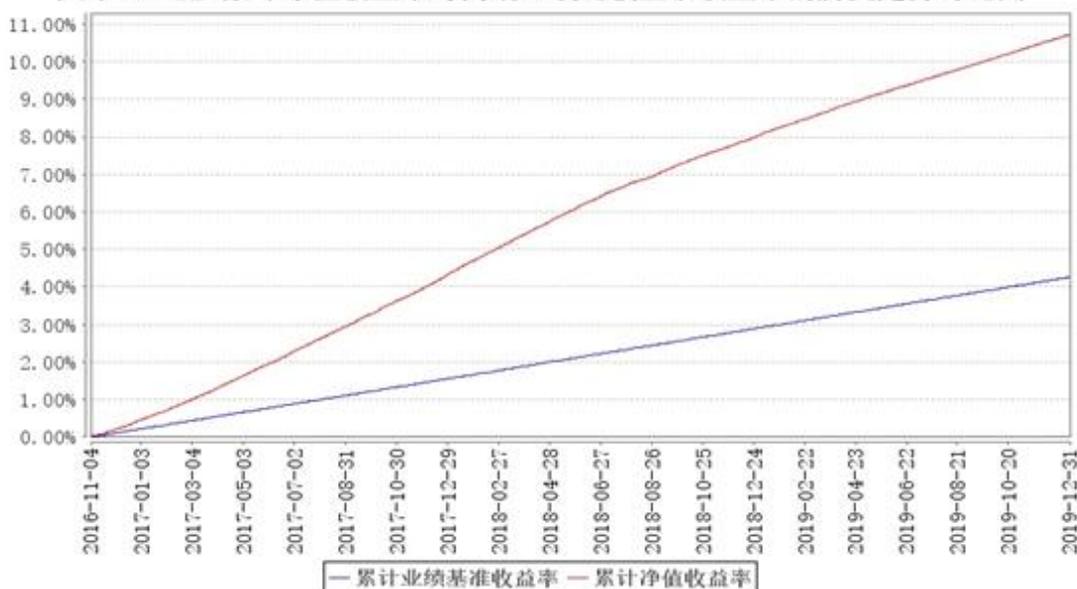
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 0.6054% | 0.0019% | 0.3403% | 0.0000% | 0.2651% | 0.0019 |
| 过去六个月 | 1.1909% | 0.0016% | 0.6805% | 0.0000% | 0.5104% | 0.0016 |
| 过去一年 | 2.4900% | 0.0023% | 1.3500% | 0.0000% | 1.1400% | 0.0023 |
| 过去三年 | 10.2408% | 0.0028% | 4.0500% | 0.0000% | 6.1908% | 0.0028 |
| 自基金合同 | 10.7319% | 0.0028% | 4.2645% | 0.0000% | 6.4674% | 0.0028 |

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A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



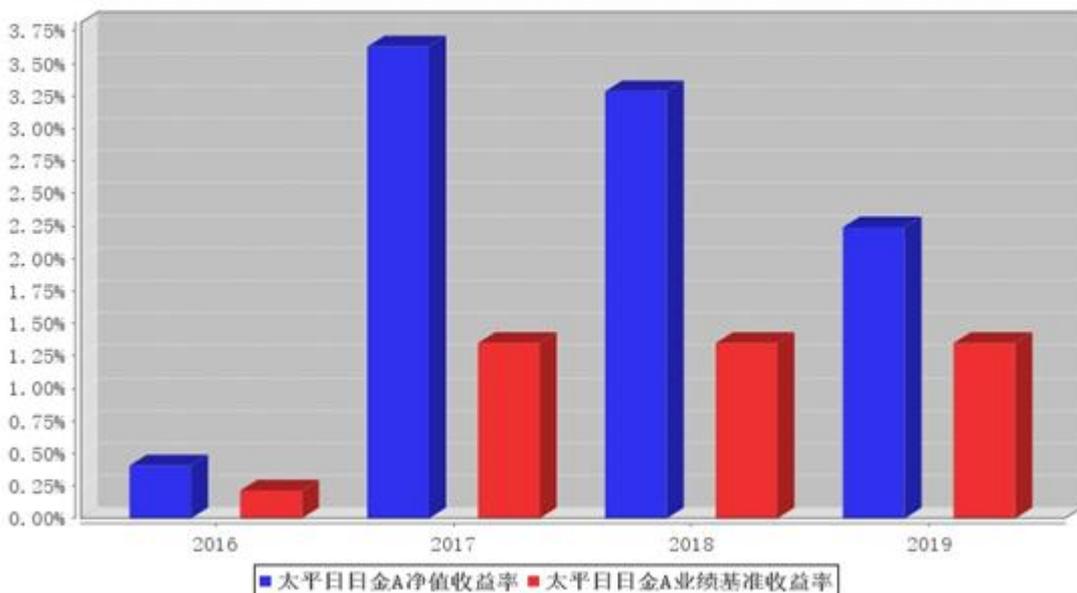
太平日日金B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

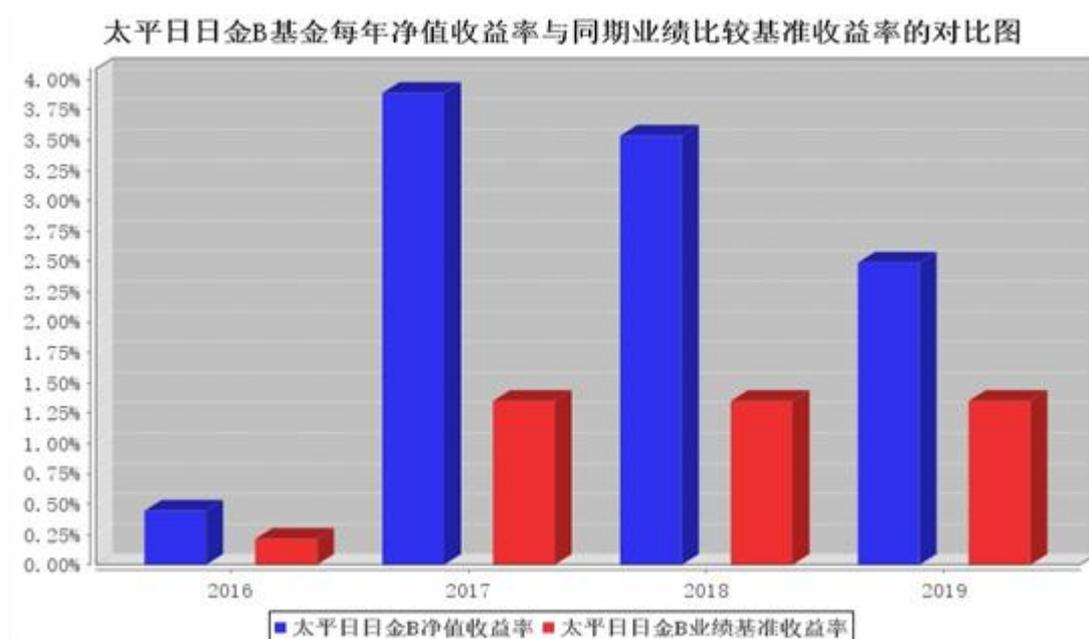


注:按照本基金基金合同和招募说明书的约定,本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

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

太平日日金A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图





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

单位：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 |
|--------|--------------|---------------|-----------|------------|----|
| 2019 年 | 126,099.18 | 0.00 | -551.36 | 125,547.82 | - |
| 2018 年 | 161,909.87 | 0.00 | 446.08 | 162,355.95 | - |
| 2017 年 | 404,933.51 | 0.00 | -9,448.90 | 395,484.61 | - |
| 合计 | 692,942.56 | 0.00 | -9,554.18 | 683,388.38 | - |

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 |
|--------|----------------|---------------|---------------|----------------|----|
| 2019 年 | 92,576,228.99 | 0.00 | -430,662.03 | 92,145,566.96 | - |
| 2018 年 | 240,809,502.38 | 0.00 | -256,723.55 | 240,552,778.83 | - |
| 2017 年 | 270,017,811.84 | 0.00 | -449,325.01 | 269,568,486.83 | - |
| 合计 | 603,403,543.21 | 0.00 | -1,136,710.59 | 602,266,832.62 | - |

§ 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 91.5%，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 8 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。

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。 |
| 甘源 | 本基金的基金经理助理、太平日日鑫货币市场型基金基金经理助理 | 2019 年 12 月 23 日 | - | 4 年 | 清华大学金融硕士，具有证券投资基金从业资格。2015 年 7 月起先后任职于中信证券、方正证券研究所、恒大智库，从事宏观经济研究。2019 年 11 月加入本公司。2019 年 12 月 23 日起任太平日日金货币市场型基金、太平日日鑫货币市场型基金基金经理助理。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，判断货币市场总体仍然保持稳健偏宽松的的总体趋势，货币政策持续性较强，在货币基金配置上采取了稳健的运作方式。从仓位配置上，由于短融超短融性价比有所提升，因此增加了短久期信用的配置，提高了组合的收益。在久期控制上，采取了平均久期配置，既保证了货币基金的流动性，也提高了整体收益水平。在品种选择上，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，保持组合收益稳健提升。在杠杆方面，本报告期相对提升了杠杆率，有效利用货币环境宽松的优势，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 2.2412%，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 2.4900%，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

2019 年无论经济与政策都是处于震荡的一年，在中美贸易摩擦、国内金融供给侧改革、猪肉价格暴涨带动通胀上涨的大背景下，债券市场全年虽然最终实际变动较小，但过程却较为跌宕，出现了几波上涨与下跌。

展望 2020 年，经济增速向下破 6% 几乎不可避免，尤其在开年遭遇新冠肺炎疫情导致经济活动遭受较大冲击，疫情与复工将成为上半年市场关注的主线。通胀方面 2020 年较大概率将呈现前高后低的走势，由于猪价仍然处在高位，主要受基数影响，CPI 将在上半年见顶，下半年将显著回落。货币政策预计仍将保持宽松态势，充分体现逆周期调节作用，尤其在上半年经济遭受疫情负面冲击情况下货币环境大概率保持灵活偏宽松的状态。财政政策在节奏上预计会前倾，提早发力对冲疫情影响。

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。

4.8 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：125,547.82 元，B 级分配收益 92,145,566.96 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

本托管人依据《太平日日金货币市场基金合同》与《太平日日金货币市场基金托管协议》，自 2016 年 11 月 04 日起托管太平日日金货币市场基金（以下称本基金）的全部资产。

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

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 | 普华永道中天审字(2020)第 22122 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 | 我们审计了太平日日金货币市场基金(以下简称“太平日日金货币基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度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。 我们认为,后附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 |

| | |
|-----------------|---|
| | <p>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,公允反映了太平日日金货币基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>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。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。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。</p> <p>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。</p> |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | - |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>太平日日金货币基金的基金管理人太平基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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。</p> <p>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,除非基金管理人管理层计划清算太平日日金货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>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。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>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。</p> <p>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:</p> <p>(一) 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。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程</p> |

| | |
|-----------|--|
| | <p>序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 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。</p> <p>(四) 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。</p> <p>(五) 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。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 陈熹 金诗涛 |
| 会计师事务所的地址 | 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 |
| 审计报告日期 | 2020-03-24 |

§ 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 2,738,784.12 | 856,456,157.51 |
| 结算备付金 | | 23,200,000.01 | 32,814,090.90 |
| 存出保证金 | | - | 2,263.93 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,700,010,537.42 | 3,541,214,126.14 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,700,010,537.42 | 3,541,214,126.14 |
| 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 | 613,500,164.10 | 1,582,009,345.01 |
| 应收证券清算款 | | 60,073,849.32 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 2,162,098.38 | 12,136,266.03 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,401,685,433.35 | 6,024,632,249.52 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 250,799,303.80 | 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 | | 671,251.39 | 1,695,497.27 |
| 应付托管费 | | 203,409.51 | 513,787.05 |
| 应付销售服务费 | | 20,760.38 | 52,158.67 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 43,168.59 | 61,628.84 |
| 应交税费 | | 4,779.83 | 6,228.99 |
| 应付利息 | | 61,496.34 | 144,217.83 |
| 应付利润 | | 174,188.91 | 605,402.30 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 327,528.79 | 226,574.52 |
| 负债合计 | | 252,305,887.54 | 244,182,554.13 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 2,149,379,545.81 | 5,780,449,695.39 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 2,149,379,545.81 | 5,780,449,695.39 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,401,685,433.35 | 6,024,632,249.52 |

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,149,379,545.81 份。其中 A 类基金份额的份额总额 797,494.73 份，B 类基金份额的份额总额 2,148,582,051.08 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019年1月1日至2019 年12月31日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日 |
|------------------------|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 一、收入 | | 114,795,699.24 | 277,267,173.05 |
| 1. 利息收入 | | 112,791,774.76 | 275,178,535.44 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 5,976,196.09 | 40,048,488.75 |
| 债券利息收入 | | 71,590,004.86 | 164,093,549.63 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 35,225,573.81 | 71,036,497.06 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列) | | 2,003,924.48 | 2,088,637.61 |
| 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 | 2,003,924.48 | 2,088,637.61 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 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 | - | - |
| 减：二、费用 | | 22,524,584.46 | 36,552,038.27 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 12,250,169.00 | 22,713,140.23 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 3,712,172.44 | 6,882,769.75 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 384,613.77 | 700,072.89 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | - | - |
| 5. 利息支出 | | 5,849,331.86 | 5,905,209.15 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 5,849,331.86 | 5,905,209.15 |
| 6. 税金及附加 | | 19,270.24 | 52,833.52 |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.19 | 309,027.15 | 298,012.73 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 92,271,114.78 | 240,715,134.78 |
| 减：所得税费用 | | - | - |

| | | | |
|-------------------|--|---------------|----------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 92,271,114.78 | 240,715,134.78 |
|-------------------|--|---------------|----------------|

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：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 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) | 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) | - | 92,271,114.78 | 92,271,114.78 |
| 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) | -3,631,070,149.58 | - | -3,631,070,149.58 |
| 其中：1. 基金申购款 | 4,810,978,062.65 | - | 4,810,978,062.65 |
| 2. 基金赎回款 | -8,442,048,212.23 | - | -8,442,048,212.23 |
| 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) | - | -92,271,114.78 | -92,271,114.78 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,149,379,545.81 | - | 2,149,379,545.81 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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) | 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 | - | 240,715,134.78 | 240,715,134.78 |

| | | | |
|--|--------------------|-----------------|--------------------|
| 利润) | | | |
| 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) | -692,873,401.93 | - | -692,873,401.93 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 12,469,409,337.53 | - | 12,469,409,337.53 |
| 2. 基金赎回款 | -13,162,282,739.46 | - | -13,162,282,739.46 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -240,715,134.78 | -240,715,134.78 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 5,780,449,695.39 | - | 5,780,449,695.39 |

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:

| | | |
|-----------|-----------|-----------|
| <u>吴东</u> | <u>吴东</u> | <u>孙波</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

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 2020 年 3 月 24 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<年度报告和中期报告>》、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度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

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。

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。

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。当影子价格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自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日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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不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，于下一工作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)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限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[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于

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

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

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

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

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

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

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 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 2,738,784.12 | 26,456,157.51 |
| 定期存款 | - | 830,000,000.00 |
| 其中：存款期限1个月以内 | - | - |
| 存款期限1-3个月 | - | - |
| 存款期限3个月及以上 | - | 830,000,000.00 |
| 其他存款 | - | - |

| | | |
|----|--------------|----------------|
| 合计 | 2,738,784.12 | 856,456,157.51 |
|----|--------------|----------------|

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 2019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 | 1,700,010,537.42 | 1,700,974,400.00 | 963,862.58 | 0.0448 |
| | 合计 | 1,700,010,537.42 | 1,700,974,400.00 | 963,862.58 | 0.0448 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 1,700,010,537.42 | 1,700,974,400.00 | 963,862.58 | 0.0448 |
| 项目 | | 上年度末 2018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 | 10,003,469.51 | 10,008,000.00 | 4,530.49 | 0.0001 |
| | 银行间市场 | 3,531,210,656.63 | 3,533,426,000.00 | 2,215,343.37 | 0.0383 |
| | 合计 | 3,541,214,126.14 | 3,543,434,000.00 | 2,219,873.86 | 0.0384 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 3,541,214,126.14 | 3,543,434,000.00 | 2,219,873.86 | 0.0384 |

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 2019年12月31日 |
|----|--------------------|
| | |

| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
|-------|---------------------|-----------|
| 交易所市场 | 584,100,000.00 | - |
| 银行间市场 | 29,400,164.10 | - |
| 合计 | 613,500,164.10 | - |
| 项目 | 上年度末 2018年12月31日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 1,432,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | 150,009,345.01 | - |
| 合计 | 1,582,009,345.01 | - |

注：2019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(2018年12月31日：同)。

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 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 15,449.85 | 4,502.06 |
| 应收定期存款利息 | - | 2,159,277.69 |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 11,484.00 | 16,242.93 |
| 应收债券利息 | 1,897,247.24 | 8,310,591.32 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | 237,917.29 | 1,645,650.93 |
| 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 | - | 1.10 |
| 合计 | 2,162,098.38 | 12,136,266.03 |

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 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 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 | 43,168.59 | 61,628.84 |
| 合计 | 43,168.59 | 61,628.84 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 预提_账户维护费 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 预提审计费 | 111,000.00 | 130,000.00 |
| 预提信息披露费 | 200,000.00 | 80,000.00 |
| 债券账户维护费 | 11,000.00 | 11,000.00 |
| 应付银行手续费 | 5,528.79 | 5,574.52 |
| 合计 | 327,528.79 | 226,574.52 |

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 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 6,221,615.68 | 6,221,615.68 |
| 本期申购 | 6,447,370.69 | 6,447,370.69 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -11,871,491.64 | -11,871,491.64 |
| 本期末 | 797,494.73 | 797,494.73 |

太平日日金 B

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 5,774,228,079.71 | 5,774,228,079.71 |
| 本期申购 | 4,804,530,691.96 | 4,804,530,691.96 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,430,176,720.59 | -8,430,176,720.59 |
| 本期末 | 2,148,582,051.08 | 2,148,582,051.08 |

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 | 125,547.82 | - | 125,547.82 |
| 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 | -125,547.82 | - | -125,547.82 |
| 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 | 92,145,566.96 | - | 92,145,566.96 |
| 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 | -92,145,566.96 | - | -92,145,566.96 |
| 本期末 | - | - | - |

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 178,204.23 | 343,037.97 |
| 定期存款利息收入 | 5,399,486.18 | 39,178,448.27 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 398,464.62 | 526,986.41 |
| 其他 | 41.06 | 16.10 |
| 合计 | 5,976,196.09 | 40,048,488.75 |

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—买卖价差收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日 至 2019年12 月31日 | 上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年 12月31日 |
|---------------------------------|-----------------------------------|--|
| 卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成交总 额 | 17,573,391,791.40 | 19,802,392,569.41 |
| 减：卖出债券（、债转 股及债券到期兑付）成 本总额 | 17,530,284,766.25 | 19,719,236,497.82 |
| 减：应收利息总额 | 41,103,100.67 | 81,067,433.98 |
| 买卖债券差价收 入 | 2,003,924.48 | 2,088,637.61 |

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 -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。

7.4.7.16 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。

7.4.7.17 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。

7.4.7.18 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。

7.4.7.19 其他费用

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12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 审计费用 | 111,000.00 | 122,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 80,000.00 |
| 银行划款手续费 | 40,827.15 | 58,812.73 |
| 上市年费 | - | - |
| 债券账户维护费 | 37,200.00 | 37,200.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 合计 | 309,027.15 | 298,012.73 |

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

经本基金的基金管理人太平基金管理有限公司(以下简称“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)，太平基金管理有限公司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。

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 | 基金管理人的股东 |

| | |
|---------------------|----------|
| 管”) | |
| 中原证券股份有限公司 (“中原证券”) | 基金管理人的股东 |
| 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 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 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2019年1月1日至2019年 12月31日 | 2018年1月1日至2018 年12月31日 |
|-----------------|---------------------------|---------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 12,250,169.00 | 22,713,140.23 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 52,950.23 | 11,268.93 |

注：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：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×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 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2019年1月1日至2019年 12月31日 | 2018年1月1日至2018 年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,712,172.44 | 6,882,769.75 |

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×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 | | |
|--------------------|-----------------------|------------|------------|
| | 2019年1月1日至2019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 | 972.39 | - | 972.39 |
| 太平基金 | 11,219.45 | 367,560.28 | 378,779.73 |
| 合计 | 12,191.84 | 367,560.28 | 379,752.12 |
| 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 | 631.10 | - | 631.10 |

| | | | |
|------|----------|------------|------------|
| 太平基金 | 8,354.30 | 687,165.15 | 695,519.45 |
| 合计 | 8,985.40 | 687,165.15 | 696,150.55 |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额和 B 类基金份额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,再由太平基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 类基金份额的销售服务费约定年费率分别为 0.25%和 0.01%。其计算公式为:

日销售服务费=前一日 A/B 类基金资产净值 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

单位:人民币元

| 本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 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 | 49,592,557.69 | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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 | - | 19,911,787.33 | - | - | - | - |

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

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

于本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2019年1月1日至2019年12月31日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 | 2,738,784.12 | 217,093.12 | 26,456,157.51 | 3,050,368.53 |

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管行兴业银行保管，活期存款按银行同业利率计息，定期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

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 2019 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 3,606,684.35 元(上年度可比期间：1,611,118.02 元)。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有 2,900,000 张兴业银行的同业存单，账面价值为人民币 288,349,430.49 元，占基金资产净值的比例为 13.41%（2018 年 12 月 31 日：本基金未持有兴业银行的同业存单）。

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 |
| 126,099.18 | - | -551.36 | 125,547.82 | - |
| 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 |
| 92,576,228.99 | - | -430,662.03 | 92,145,566.96 | - |

7.4.12 期末(2019 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

截至本报告期末 2019 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 250,799,303.80 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值 单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|---------------|------------|------------|-----------|----------------|
| 111910138 | 19 兴业银行 CD138 | 2020-01-03 | 99.29 | 1,420,000 | 140,998,336.59 |
| 150011 | 15 附息国债 11 | 2020-01-03 | 100.24 | 300,000 | 30,072,634.94 |
| 190001 | 19 附息国债 01 | 2020-01-03 | 100.00 | 500,000 | 49,998,993.34 |
| 199950 | 19 贴现国债 50 | 2020-01-03 | 99.65 | 500,000 | 49,825,318.05 |
| 合计 | | | | 2,720,000 | 270,895,282.92 |

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,将风险控制可在可承受的范围内。

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;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,不投资于信用等级在 AA+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 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | 29,999,912.01 | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 130,819,216.90 | 570,721,238.46 |
| 合计 | 160,819,128.91 | 570,721,238.46 |

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

截至本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

| 短期信用评级 | 本期末 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 1,509,118,773.57 | 2,920,428,041.43 |
| 合计 | 1,509,118,773.57 | 2,920,428,041.43 |

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 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 30,072,634.94 | 50,064,846.25 |
| 合计 | 30,072,634.94 | 50,064,846.25 |

注：未评级债券为国债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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资产支持证券。

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 2019 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 250,799,303.80 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同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 2019 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 99.99%，本基金投资组合的平均剩余期限为 60 天，平均剩余存续期为 60 天。本基金持有的现金、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为 35.18%。

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

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 1.86%。

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。

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 2019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 | 2,738,784 .12 | - | - | - | - | - | 2,738,784.12 |
| 备付金 | 23,200,00 0.01 | - | - | - | - | - | 23,200,000.01 |
| 交易性金融 资产 | 160,924,9 15.77 | 1,104,219 ,342.30 | 434,866,2 79.35 | - | - | - | 1,700,010,537.42 |
| 买入返售 金融资产 | 613,500,1 64.10 | - | - | - | - | - | 613,500,164.10 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 2,162,098 .38 | 2,162,098.38 |
| 应收证券 清算款 | - | - | - | - | - | 60,073,84 9.32 | 60,073,849.32 |
| 资产总计 | 800,363,8 64.00 | 1,104,219 ,342.30 | 434,866,2 79.35 | - | - | 62,235,94 7.70 | 2,401,685,433.35 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理 人报酬 | - | - | - | - | - | 671,251.3 9 | 671,251.39 |

| | | | | | | | |
|---------------------|------------------|------------------|----------------|------|------|---------------|------------------|
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 203,409.51 | 203,409.51 |
| 卖出回购金融资产款 | 250,799,303.80 | - | - | - | - | - | 250,799,303.80 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 20,760.38 | 20,760.38 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 43,168.59 | 43,168.59 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | 4,779.83 | 4,779.83 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 61,496.34 | 61,496.34 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | 174,188.91 | 174,188.91 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 327,528.79 | 327,528.79 |
| 负债总计 | 250,799,303.80 | - | - | - | - | 1,506,583.74 | 252,305,887.54 |
| 利率敏感度缺口 | 549,564,560.20 | 1,104,219,342.30 | 434,866,279.35 | - | - | 60,729,363.96 | 2,149,379,545.81 |
| 上年度末 2018年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 26,456,157.51 | 830,000,000.00 | - | - | - | - | 856,456,157.51 |
| 结算备付金 | 32,814,090.90 | - | - | - | - | - | 32,814,090.90 |
| 存出保证金 | 2,263.93 | - | - | - | - | - | 2,263.93 |
| 交易性金融资产 | 89,902,420.10 | 3,214,535,913.00 | 236,775,793.04 | - | - | - | 3,541,214,126.14 |
| 买入返售金融资产 | 1,582,009,345.01 | - | - | - | - | - | 1,582,009,345.01 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 12,136,266.03 | 12,136,266.03 |
| 资产总计 | 1,731,184,277.45 | 4,044,535,913.00 | 236,775,793.04 | - | - | 12,136,266.03 | 6,024,632,249.52 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,695,497.27 | 1,695,497.27 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 513,787.05 | 513,787.05 |
| 应付证券 | - | - | - | - | - | 20,631,829.00 | 20,631,829.00 |

| | | | | | | | |
|-----------|------------------|------------------|----------------|---|---|----------------|------------------|
| 清算款 | | | | | | 9.03 | 03 |
| 卖出回购金融资产款 | 220,245,229.63 | - | - | - | - | - | 220,245,229.63 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 52,158.67 | 52,158.67 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 61,628.84 | 61,628.84 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | 6,228.99 | 6,228.99 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 144,217.83 | 144,217.83 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | 605,402.30 | 605,402.30 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 226,574.52 | 226,574.52 |
| 负债总计 | 220,245,229.63 | - | - | - | - | 23,937,324.50 | 244,182,554.13 |
| 利率敏感度缺口 | 1,510,939,047.82 | 4,044,535,913.00 | 236,775,793.04 | - | - | -11,801,058.47 | 5,780,449,695.39 |

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

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 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 2,799.97 | 1,590,540.35 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -2,791.00 | -1,585,929.43 |

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) 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 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 1,700,010,537.42 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 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(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) 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。

§ 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 | 1,700,010,537.42 | 70.78 |
| | 其中：债券 | 1,700,010,537.42 | 70.78 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 613,500,164.10 | 25.54 |
| | 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 | 25,938,784.13 | 1.08 |
| 4 | 其他各项资产 | 62,235,947.70 | 2.59 |
| 5 | 合计 | 2,401,685,433.35 | 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 | 6.44 | |
| | 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 | 250,799,303.80 | 11.67 |
| | 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 | 60 |
| 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 | 19 |

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 | 38.17 | 11.67 |
| | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天 (含) —60 天 | 26.42 | - |
| | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天 (含) —90 天 | 26.81 | - |
| | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天 (含) —120 天 | 6.92 | - |
| | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天 (含) —397 天 (含) | 13.31 | - |
| | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 111.64 | 11.67 |

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 | 129,896,946.33 | 6.04 |
| 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 | 60,994,817.52 | 2.84 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 1,509,118,773.57 | 70.21 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,700,010,537.42 | 79.09 |
| 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：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 | 111910138 | 19 兴业银行 CD138 | 2,000,000 | 198,589,206.46 | 9.24 |
| 2 | 111912013 | 19 北京银行 CD013 | 1,000,000 | 99,646,119.57 | 4.64 |
| 3 | 111913104 | 19 浙商银行 CD104 | 1,000,000 | 99,644,889.07 | 4.64 |
| 4 | 111914055 | 19 江苏银行 CD055 | 1,000,000 | 99,528,773.50 | 4.63 |
| 5 | 111915612 | 19 民生银行 CD612 | 1,000,000 | 99,346,759.50 | 4.62 |
| 6 | 111906119 | 19 交通银行 CD119 | 1,000,000 | 99,125,024.12 | 4.61 |
| 7 | 111913114 | 19 浙商银行 CD114 | 1,000,000 | 98,836,341.16 | 4.60 |
| 8 | 111992136 | 19 杭州银行 CD030 | 800,000 | 79,640,890.63 | 3.71 |
| 9 | 111912022 | 19 北京银行 CD022 | 800,000 | 79,578,651.19 | 3.70 |
| 10 | 190001 | 19 附息国债 01 | 500,000 | 49,998,993.34 | 2.33 |

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 | - |
| 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 | 0.0282% |

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

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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

本基金投资的前十名证券的发行主体或其分支机构中，兴业银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、交通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。

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 | 60,073,849.32 |
| 3 | 应收利息 | 2,162,098.38 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 62,235,947.70 |

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，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 | 379 | 2,104.21 | 58,620.13 | 7.35 | 738,874.60 | 92.65 |
| 太平日日金 B | 6 | 358,097,008.51 | 2,148,582,051.08 | 100.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 385 | 5,582,804.02 | 2,148,640,671.21 | 99.97 | 738,874.60 | 0.03 |

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 | 1,758,839,733.42 | 81.83 |
| 2 | 券商类机构 | 213,833,769.02 | 9.95 |
| 3 | 信托类机构 | 59,562,255.68 | 2.77 |
| 4 | 基金类机构 | 51,273,965.93 | 2.39 |
| 5 | 基金类机构 | 51,273,112.71 | 2.39 |
| 6 | 保险类机构 | 13,799,214.32 | 0.64 |
| 7 | 个人 | 257,756.22 | 0.01 |
| 8 | 个人 | 198,733.28 | 0.01 |
| 9 | 个人 | 52,081.78 | 0.00 |
| 10 | 保险类机构 | 35,613.03 | 0.00 |

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 | 13,989.47 | 1.7542 |
| | 太平日日金 B | 0.00 | 0.0000 |
| | 合计 | 13,989.47 | 0.0007 |

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 |
| | 太平日日金 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 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 | 6,221,615.68 | 5,774,228,079.71 |
| 本报告期基金总申 购份额 | 6,447,370.69 | 4,804,530,691.96 |
| 减: 本报告期基金 总赎回份额 | 11,871,491.64 | 8,430,176,720.59 |
| 本报告期基金拆分 变动份额(份额减 少以“-”填列) | - | - |
| 本报告期末基金 份额总额 | 797,494.73 | 2,148,582,051.08 |

§ 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 2018 年第二届董事会第十四次会议审议通过, 自 2019 年 7 月 1 日起岳冲先生担任太平基金管理有限公司副总经理职务。上述事件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 2019 年 7 月 3 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三届董事会 2019 年第一次会议审议通过, 自 2019 年 9 月 9 日起, 邱宏斌先生不再担任太平基金管理有限公司总经理职务; 副总经理吴东先生自 2019 年 9 月 9 日起代任公司总经理。上述事件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 2019 年 9 月 11 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》。

(3) 经太平基金管理有限公司第二届董事会 2019 年第十次会议审议通过, 并获上海证监

局出具的无异议函后，原副总经理岳冲先生自 2019 年 9 月 16 日起转任太平基金管理有限公司督察长职务，原督察长王健先生自 2019 年 9 月 16 日起转任太平基金管理有限公司副总经理职务。上述事件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 2019 年 9 月 17 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

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拾壹万壹仟元整。

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 | - | -% | - | -% | - |

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 | 50,135,000.00 | 100.00% | 52,661,800,000.00 | 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 | 关于太平日日金货币市场基金恢复大额申购及转换转入业务的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-01-11 |
| 2 | 关于太平日日金货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-01-15 |
| 3 | 太平日日金货币市场基金 2019 年“春节”假期前暂停申购、转换转入业务的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-01-30 |
| 4 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-02-21 |
| 5 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-03-09 |
| 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并参加相关费率优惠活动的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-03-18 |
| 7 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-03-23 |
| 8 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-04-03 |
| 9 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-04-09 |
| 10 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-04-10 |

| | | | |
|----|--|--------------|------------|
| 11 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-04-24 |
| 12 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-04-25 |
| 13 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-05-08 |
| 14 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-05-09 |
| 15 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-05-10 |
| 16 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-05-11 |
| 17 | 关于太平日日金货币市场基金暂停大额申购、转换转入业务的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-05-29 |
| 18 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-07-04 |
| 19 | 关于太平日日金货币市场基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-07-10 |
| 20 | 关于太平日日金货币市场基金恢复大额申购及转换转入业务的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-08-05 |
| 21 | 太平基金管理有限公司关于在网上直销平台开通定期定额投资业务的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-08-14 |
| 22 | 太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构并参加相关费率优惠活动的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-08-20 |
| 23 | 太平基金管理有限公司关于开展直销渠道基金转换及定投费率优惠的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-08-29 |
| 24 | 关于太平日日金货币市场基金 2019 年“国庆节”假期前暂停大额申购、转换转入业务的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-09-26 |

§ 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 | 20190101-20191231 | 2,727,956,867.27 | 60,948,250.16 | 1,030,065,384.01 | 1,758,839,733.42 | 81.830 |
| 机构 | 2 | 20190101-20190325 | 1,501,868,091.74 | 10,997,410.65 | 1,512,865,502.39 | 0.000 | 0.000 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</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：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司
二〇二〇年三月二十五日