

太平日日金货币市场基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 31 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。本中期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 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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 主要财务指标和基金净值表现	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 其他指标	错误!未定义书签。
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 债券回购融资情况	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限	38
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	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38

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	39
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	39
7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	40
7.9 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	44
10.9 其他重大事件	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 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	1,839,044,900.90 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	15,019,689.88 份	1,824,025,211.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求保持基金资产安全性和高流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对短期金融工具的积极投资管理，在有效控制投资风险和保持流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准，人民币七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益和预期风险水平低于债券型、混合型和股票型基金，属于预期收益和预期风险偏低的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		太平基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵霖	吴玉婷
	联系电话	021-38556613	021-52629999
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn	xywyt@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 号楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		范宇	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	太平基金管理有限公司	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)	
	太平日日金 A	太平日日金 B
本期已实现收益	84,491.07	20,178,643.22
本期利润	84,491.07	20,178,643.22
本期净值收益率	0.8514%	0.9712%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	15,019,689.88	1,824,025,211.02
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	10.8192%	11.8073%

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

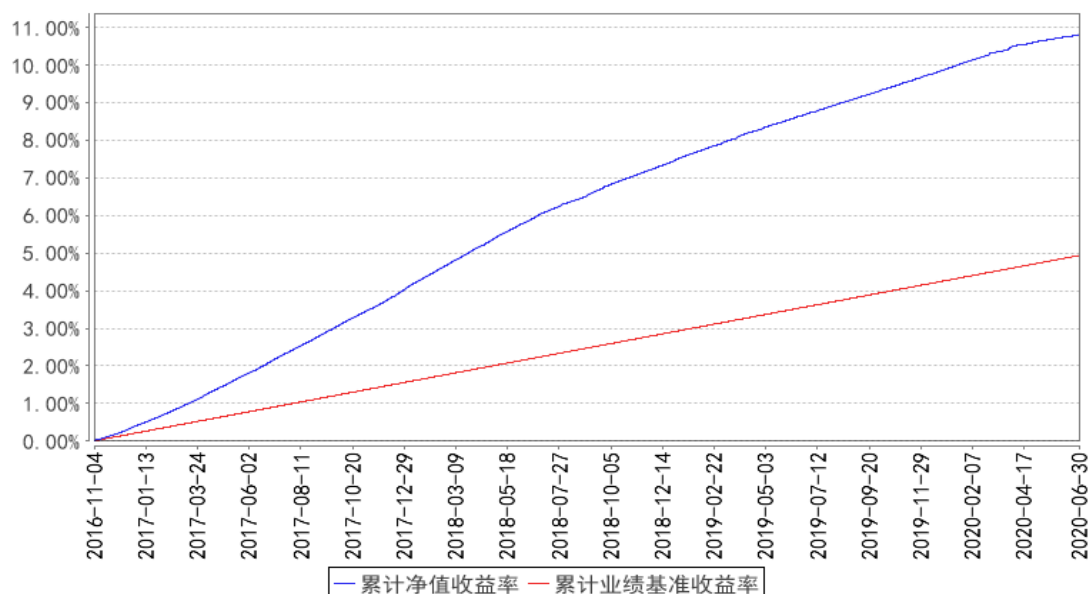
阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.0904%	0.0014%	0.1110%	0.0000%	-0.0206%	0.0014%
过去三个月	0.2968%	0.0024%	0.3366%	0.0000%	-0.0398%	0.0024%
过去六个月	0.8514%	0.0039%	0.6732%	0.0000%	0.1782%	0.0039%
过去一年	1.9263%	0.0031%	1.3537%	0.0000%	0.5726%	0.0031%
过去三年	8.5368%	0.0033%	4.0537%	0.0000%	4.4831%	0.0033%
自基金合同生效起至	10.8192%	0.0032%	4.9377%	0.0000%	5.8815%	0.0032%

太平日日金 B

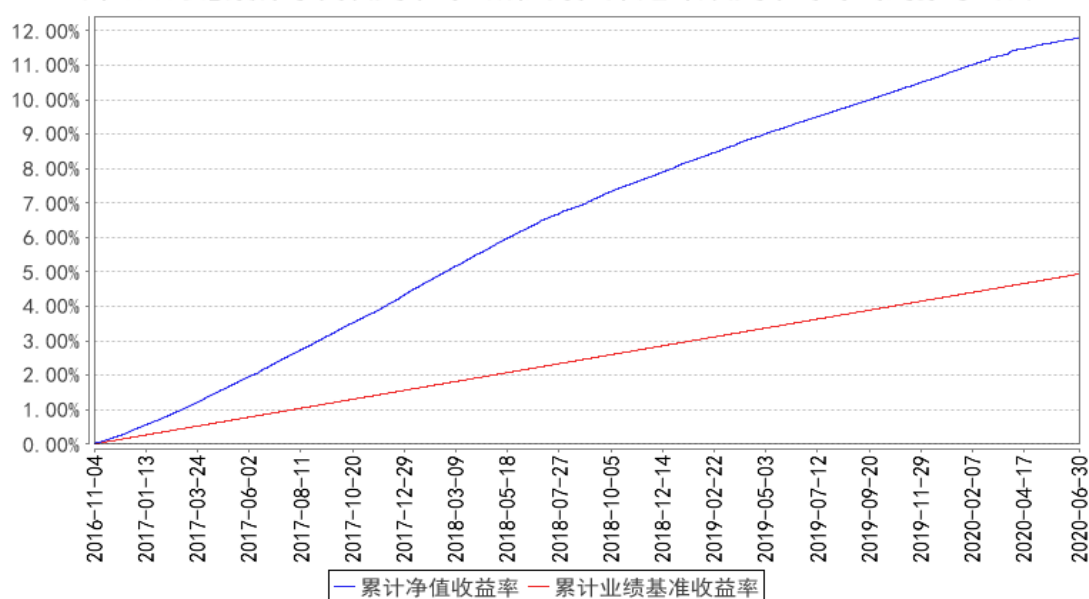
阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1101%	0.0014%	0.1110%	0.0000%	-0.0009%	0.0014%
过去三个月	0.3568%	0.0024%	0.3366%	0.0000%	0.0202%	0.0024%
过去六个月	0.9712%	0.0039%	0.6732%	0.0000%	0.2980%	0.0039%
过去一年	2.1737%	0.0031%	1.3537%	0.0000%	0.8200%	0.0031%
过去三年	9.3284%	0.0033%	4.0537%	0.0000%	5.2747%	0.0033%
自基金合同生效起至	11.8073%	0.0032%	4.9377%	0.0000%	6.8696%	0.0032%

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

§ 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 10 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金、太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金、太平恒利纯债债券型证券投资基金、太平睿盈混合型证券投资基金、太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金、太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金、太平恒睿纯债债券型证券投资基金、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴超	本基金的基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理、太平睿盈混合型证券投资基金基金经理、太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理	2018 年 02 月 12 日	-	7 年	美国本特利商学院金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013 年 5 月起曾在西部证券股份有限公司固定收益部、上海金懿投资有限公司担任部门经理、投资总监等职。2017 年 3 月加入本公司。2018 年 2 月 12 日起任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2019 年 3 月 25 日担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 27 日起任太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 28 日起任太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。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、太平恒睿纯债债券	2018 年 03 月 23 日	-	8 年	牛津大学工商管理硕士，具有证券投资基金从业资格。2004 年 6 月起曾就职于东京海上日动火灾保险株式会社非日系部、英国皇家太阳联合保险公司大客户部担任核保和客服工作；中国人保资产管理有限公司历任集中交易室交易员、固定收益部投资经理；南通农村商业银行股份有限公司历任金融市场部固收类投资经

	型证券投资基金基金经理				理、投资总监。2018 年 2 月加入本公司。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。2020 年 3 月 12 日起担任太平恒睿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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

2020 年第二季度国内经济基本面反弹略超预期，受疫情冲击影响，一季度宏观基本面多项数据均创出历史新低，二季度随着国内有效控制住疫情，返工复工有序推进，经济最悲观预期阶段已经过去。但同时也要注意国外疫情控制远不及国内有效，全球整体经济仍然受到疫情严重影响，外需依然低迷，全球供应链体现依旧未恢复正常运转，预计仍将对国内经济产生一定的拖累。

资金方面二季度前半段依然延续前期疫情期间宽松状态，但随着国内疫情得到控制，经济开始出现明显复苏，资金面边际出现收紧。从央行公开市场操作上也可以明显看出从疫情期间的预防性宽松转向相机抉择式操作。尤其二季度后半段，从市场舆论中传递出对于“赤字货币化”的学术讨论也可以看出追求货币政策正常化的倾向明显，要保持政策定力，避免用“大水漫灌”解决眼前困难从而造成长期财政困局。债券市场对于货币政策环境的边际转向也较为灵敏，债券收益率尤其短端债券收益率出现明显上行，shibor3M 也从底部明显反弹，带动整体货币资金市场价格上扬。展望下半年，预计“六保”“六稳”的财政政策将继续发力，但仍需控制在“防风险”的前提之下，因此相对灵活适度偏中性的货币政策将成为下半年的常态。本基金将继续秉持“短久期、高评级、低杠杆”的投资思路，严格控制流动性风险，积极把握短期市场资金面波动带来的机会增加收益。本报告期内，本基金在遵守基金合同、控制风险的前提下，为投资者取得了符合货币基金特征的风险收益比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平日日金 A 的净值收益率为 0.8514%，同期业绩比较基准收益率为 0.6732%；太平日日金 B 的净值收益率为 0.9712%，同期业绩比较基准收益率为 0.6732%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年经历了新冠疫情这个黑天鹅之后经济在上半年走出一个 V 型走势，对于下半年而言，经济将会是一个相对明确的延续复苏的走势。从经济数据来看，工业生产、投资、消费等等都是在持续改善。地产销售也是显著超越市场预期，虽然地产调控政策依然没有松动，但整体对于下半年地产对于经济的拉动依旧乐观。国外而言，三季度疫情可能得到缓解，复工也会加快，届时可能会迎来国内外经济复苏的共振。

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负责人、固定收益投资部负责人、研究部负责人、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：84,491.07 元，B 级分配收益 20,178,643.22 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了中期报告中的财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,751,757.29	2,738,784.12
结算备付金		47,643,666.53	23,200,000.01
存出保证金		9,748.51	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,414,121,422.14	1,700,010,537.42
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,414,121,422.14	1,700,010,537.42
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	642,761,092.99	613,500,164.10
应收证券清算款		-	60,073,849.32
应收利息	6.4.7.5	5,822,859.94	2,162,098.38
应收股利		-	-
应收申购款		12,621.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,115,123,168.40	2,401,685,433.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		272,173,323.41	250,799,303.80
应付证券清算款		2,930,643.83	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		503,354.18	671,251.39
应付托管费		152,531.58	203,409.51
应付销售服务费		17,993.73	20,760.38

应付交易费用	6.4.7.7	35,272.30	43,168.59
应交税费		7,713.83	4,779.83
应付利息		32,145.64	61,496.34
应付利润		107,731.67	174,188.91
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	117,557.33	327,528.79
负债合计		276,078,267.50	252,305,887.54
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,839,044,900.90	2,149,379,545.81
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,839,044,900.90	2,149,379,545.81
负债和所有者权益总计		2,115,123,168.40	2,401,685,433.35

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,839,044,900.90 元。其中 A 类基金份额的份额总额 15,019,689.88 份，B 类基金份额的份额总额 1,824,025,211.02 份。

6.2 利润表

会计主体：太平日日金货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		26,562,181.15	70,761,832.06
1. 利息收入		24,981,414.56	69,622,332.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	365,252.17	5,704,564.71
债券利息收入		17,406,217.43	43,349,863.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,209,944.96	20,567,904.70
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,580,766.59	1,139,499.25
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	1,580,766.59	1,139,499.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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		6,299,046.86	13,751,883.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,464,712.70	7,261,019.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,049,912.92	2,200,309.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	120,450.32	228,947.10
4. 交易费用	6.4.7.19	64.50	-
5. 利息支出		1,516,377.67	3,915,054.65
其中：卖出回购金融资产支出		1,516,377.67	3,915,054.65
6. 税金及附加		5,135.70	13,845.91
7. 其他费用	6.4.7.20	142,393.05	132,706.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,263,134.29	57,009,949.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,263,134.29	57,009,949.01

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	2,149,379,545.81	-	2,149,379,545.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,263,134.29	20,263,134.29
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）	-310,334,644.91	-	-310,334,644.91
其中：1. 基金申购款	2,073,317,397.81	-	2,073,317,397.81

2. 基金赎回款	-2,383,652,042.72	-	-2,383,652,042.72
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）	-	-20,263,134.29	-20,263,134.29
五、期末所有者权益（基金净值）	1,839,044,900.90	-	1,839,044,900.90
项目	上年度可比期间 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（净值减少以“-”号填列）	-2,571,778,217.21	-	-2,571,778,217.21
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

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：

尤象都

尤象都

孙波

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

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,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 8 月 31 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 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

本基金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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,751,757.29
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计	4,751,757.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	16,756,822.38	16,756,266.86	-555.52	-0.0000
	银行间市场	1,397,364,599.76	1,397,577,000.00	212,400.24	0.0115
	合计	1,414,121,422.14	1,414,333,266.86	211,844.72	0.0115
资产支持证券		—	—	—	—
合计		1,414,121,422.14	1,414,333,266.86	211,844.72	0.0115

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金报告期末（2020 年 6 月 30 日）未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	394,100,000.00	—
银行间市场	248,661,092.99	—
合计	642,761,092.99	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2020 年 6 月 30 日）未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,213.67
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	21,439.60
应收债券利息	5,585,869.00
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	213,333.27
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	4.40
合计	5,822,859.94

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2020 年 6 月 30 日）未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	—

银行间市场应付交易费用	35,272.30
合计	35,272.30

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付银行手续费	2,131.19
预提审计费	44,753.80
预提信息披露费	59,672.34
预提账户维护费	11,000.00
合计	117,557.33

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

太平日日金 A

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	797,494.73	797,494.73
本期申购	96,024,431.98	96,024,431.98
本期赎回（以“-”号填列）	-81,802,236.83	-81,802,236.83
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	15,019,689.88	15,019,689.88

太平日日金 B

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,148,582,051.08	2,148,582,051.08
本期申购	1,977,292,965.83	1,977,292,965.83
本期赎回（以“-”号填列）	-2,301,849,805.89	-2,301,849,805.89
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,824,025,211.02	1,824,025,211.02

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

6.4.7.10 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	84,491.07	-	84,491.07
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	-84,491.07	-	-84,491.07
本期末	-	-	-
太平日日金 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	20,178,643.22	-	20,178,643.22
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-20,178,643.22	-	-20,178,643.22
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	176,163.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	189,050.93
其他	37.36
合计	365,252.17

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,813,166,335.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,796,767,091.95
减：应收利息总额	14,818,477.10
买卖债券差价收入	1,580,766.59

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末未持有贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生金融工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动损益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	—
银行间市场交易费用	64.50
合计	64.50

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	—
银行划款手续费	19,366.91
债券托管账户费	18,600.00
合计	142,393.05

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止财务报表批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期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
安石投资管理有限公司（“安石投资”）	基金管理人的股东
中原证券股份有限公司（“中原证券”）	基金管理人的原股东、基金销售机构

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]2864 号文核准，基金管理人原股东中原证券股份有限公司将其持有的基金管理人的 8.5%股权转让给太平资产管理有限公司。本次股权变更于 2020 年 2 月 19 日完成工商注册变更，变更后太平资管、安石投资在太平基金的股权占比分别为 91.5%、8.5%。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,464,712.70	7,261,019.69
其中：支付销售机构的客户维护费	23,953.88	20,106.44

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 × 0.33% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,049,912.92	2,200,309.01

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。

6.4.10.2.3 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	1,785.76	0.00	1,785.76
太平基金管理有限公司	1,251.62	103,316.82	104,568.44
合计	3,037.38	103,316.82	106,354.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 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

本期末及上年度末，其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	4,751,757.29	176,163.88	1,291,453.46	96,606.79

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，活期存款按银行约定利率计息，定期存款按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 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
83,768.44	-	722.63	84,491.07	-
太平日日金 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
20,245,823.09	-	-67,179.87	20,178,643.22	-

6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末(2020 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末(2020 年 6 月 30 日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2020 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 271,173,323.41 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
111914208	19 江苏银 行 CD208	2020 年 7 月 1 日	99.42	500,000	49,710,809.42
111988160	19 苏州银 行 CD265	2020 年 7 月 1 日	99.37	600,000	59,621,728.48
112014007	20 江苏银 行 CD007	2020 年 7 月 1 日	98.98	242,000	23,952,449.03
170016	17 付息国	2020 年 7 月 1	100.14	300,000	30,042,549.91

	债 16	日			
200001	20 付息国 债 01	2020 年 7 月 1 日	100.56	200,000	20,112,961.85
2003666	20 进出 666	2020 年 7 月 1 日	98.99	500,000	49,495,574.26
209911	20 贴现国 债 11	2020 年 7 月 1 日	99.68	200,000	19,935,245.28
209920	20 贴现国 债 20	2020 年 7 月 1 日	99.89	300,000	29,967,289.73
合计				2,842,000	282,838,607.96

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2020 年 6 月 30 日，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,000,000.00 元，于 2020 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行兴业银行；定期存款存放在具有基金托管资格的广发银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司以及上海浦东发展银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	60,012,578.00	29,999,912.01
A-1 以下	-	-
未评级	379,572,303.19	130,819,216.90
合计	439,584,881.19	160,819,128.91

注：未评级债券为国债和短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末及上年度，基金未持有按短信用评级列示的资产支证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	837,133,148.15	1,509,118,773.57
合计	837,133,148.15	1,509,118,773.57

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	104,142,023.44	—
AAA 以下	—	—
未评级	33,261,369.36	30,072,634.94
合计	137,403,392.80	30,072,634.94

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.5 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，基金未持有按长期信用评级列示的资产支证券。

6.4.13.2.6 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，基金未持有按期长信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 272,173,323.41 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 99.64%，本基金投资组合的平均剩余期限为 45 天，平均剩余存续期为 45 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 50.41%。

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 2020 年 6 月 30 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 0%。

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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，与本基金相关的市场风险主要是利率风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	4,751,757.29	-	-	-	-	-	4,751,757.29
备付金	47,643,666.53	-	-	-	-	-	47,643,666.53
存出保证金	9,748.51	-	-	-	-	-	9,748.51
交易性金融资产	379,808,590.36	660,930,555.01	373,382,276.77	-	-	-	1,414,121,422.14
买入返售金融资产	642,761,092.99	-	-	-	-	-	642,761,092.99
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	5,822,859.94	5,822,859.94
应收申购款	-	-	-	-	-	12,621.00	12,621.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,074,974,855.68	660,930,555.01	373,382,276.77	-	-	5,835,480.94	2,115,123,168.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	503,354.18	503,354.18
应付托管费	-	-	-	-	-	152,531.58	152,531.58
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,930,643.83	2,930,643.83
卖出回购金融资产款	272,173,323.41	-	-	-	-	-	272,173,323.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,993.73	17,993.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	35,272.30	35,272.30
应付税费	-	-	-	-	-	7,713.83	7,713.83
应付利息	-	-	-	-	-	32,145.64	32,145.64
应付利润	-	-	-	-	-	107,731.67	107,731.67
其他应付款	-	-	-	-	-	2,131.19	2,131.19

其他负债	-	-	-	-	-	115,426.14	115,426.14
负债总计	272,173,323.41	-	-	-	-	3,904,944.09	276,078,267.50
利率敏感度缺口	802,801,532.27	660,930,555.01	373,382,276.77	-	-	1,930,536.85	1,839,044,900.90
上年度末 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
结算备付金	23,200,000.01	-	-	-	-	-	23,200,000.01
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	160,924,915.77	1,104,219,342.30	434,866,279.35	-	-	-	1,700,010,537.42
买入返售金融资产	613,500,164.10	-	-	-	-	-	613,500,164.10
应收利息	-	-	-	-	-	2,162,098.38	2,162,098.38
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	60,073,849.32	60,073,849.32
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	800,363,864.00	1,104,219,342.30	434,866,279.35	-	-	62,235,947.70	2,401,685,433.35
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	671,251.39	671,251.39
应付托管费	-	-	-	-	-	203,409.51	203,409.51
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产	250,799,303.80	-	-	-	-	-	250,799,303.80

款							
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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,401,248.83	2,799.97
	市场利率上升 25 个基点	-1,395,626.22	-2,791.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	1,414,121,422.14	66.86
	其中：债券	1,414,121,422.14	66.86
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	642,761,092.99	30.39
	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	52,395,423.82	2.48
4	其他各项资产	5,845,229.45	0.28
5	合计	2,115,123,168.40	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	7.50	
	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	272,173,323.41	14.80
	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银行间市场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	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	63
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

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	57.37	14.96
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	27.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	10.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	11.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		114.69	14.96

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 (%)
1	国家债券	100,102,662.57	5.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	82,214,616.20	4.47
	其中：政策性金融债	59,445,301.21	3.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	340,124,083.12	18.49

6	中期票据	50,303,421.36	2.74
7	同业存单	837,133,148.15	45.52
8	其他	4,243,490.74	0.23
9	合计	1,414,121,422.14	76.89
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：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产 净值比例 （%）
1	111909282	19 浦发银行 CD282	1,100,000	109,805,541.46	5.97
2	012000664	20 中电投 SCP005	1,000,000	100,100,853.43	5.44
3	111918250	19 华夏银行 CD250	1,000,000	99,911,064.46	5.43
4	111988160	19 苏州银行 CD265	600,000	59,621,728.48	3.24
5	012000327	20 中电投 SCP002	500,000	50,054,287.27	2.72
6	041900253	19 沪港务 CP002	500,000	50,012,022.91	2.72
7	112096226	20 汇丰银行 CD019	500,000	49,997,338.53	2.72
8	012001588	20 邮政 SCP002	500,000	49,995,588.72	2.72
9	111914123	19 江苏银行 CD123	500,000	49,983,898.19	2.72
10	111917054	19 光大银行 CD054	500,000	49,948,358.75	2.72

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	0.1473%
报告期内偏离度的最低值	-0.0167%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0769%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

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

本基金投资的前十名证券的发行主体或其分支机构中，中国光大银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、上海浦东发展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	9,748.51
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	5,822,859.94
4	应收申购款	12,621.00
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	5,845,229.45

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	1, 128	13, 315. 33	5, 028, 981. 42	33. 4826	9, 990, 708. 46	66. 5174
太 平 日 日 金 B	4	456, 006, 3 02. 76	1, 824, 025, 211. 0 2	100. 0000	0. 00	0. 0000
合计	1, 132	1, 624, 597 . 97	1, 829, 054, 192. 4 4	99. 4567	9, 990, 708. 46	0. 5433

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	保险类机构	1, 685, 758, 022. 64	91. 6649
2	其他机构	101, 281, 183. 21	5. 5073
3	其他机构	23, 052, 454. 23	1. 2535
4	保险类机构	13, 933, 550. 94	0. 7577
5	券商类机构	4, 001, 845. 95	0. 2176
6	券商类机构	1, 004, 439. 26	0. 0546
7	个人	1, 002, 734. 90	0. 0545
8	个人	889, 010. 20	0. 0483
9	个人	804, 759. 47	0. 0438
10	个人	701, 914. 41	0. 0382

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	6, 981. 98	0. 0465
	太平日日金 B	0. 00	0. 0
	合计	6, 981. 98	0. 0004

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、	太平日日金 A	0

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 B	0
	合计	0
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	797,494.73	2,148,582,051.08
本报告期基金总申购份额	96,024,431.98	1,977,292,965.83
减：本报告期基金总赎回份额	81,802,236.83	2,301,849,805.89
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	15,019,689.88	1,824,025,211.02

§ 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

（1）本基金管理人于 2020 年 1 月 23 日发布公告，自 2020 年 1 月 22 日起：范宇先生担任公司董事长；汤海涛先生因组织调动，不再担任公司董事长职务；王健先生、金芳女士、宋卫华先生均不再担任公司副总经理职务。

（2）本基金管理人于 2020 年 3 月 7 日发布公告，自 2020 年 3 月 6 日起公司法定代表人变更为范宇先生。

(3) 本基金管理人于 2020 年 4 月 24 日发布公告, 自 2020 年 4 月 22 日起尤象都先生担任公司总经理。

(4) 本基金管理人于 2020 年 4 月 30 日发布公告, 自 2020 年 4 月 29 日起季勇先生担任公司副总经理。

(5) 本基金管理人于 2020 年 6 月 24 日发布公告, 自 2020 年 6 月 22 日起史彦刚先生担任公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部分无重大人事变动。

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, 基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日(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。

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	
中国国际	1	-	-	-	-	-

中信证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注:1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准:

- (1) 市场形象及财务状况良好。
- (2) 经营行为规范,内控制度健全,最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (3) 内部管理规范、严格,具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (4) 研究实力较强,具有专门的研究机构和专职研究人员,能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

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

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本报告期为基金租用证券公司交易单元无变化。

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	139,903,460.89	100.00%	26,306,200,000.00	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。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于太平日日金货币市场基金 2020 年“春节”假期前暂停大额申购、转换转入业务的	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 1 月 21 日
2	太平基金旗下基金在 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放时间等相关安排	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 1 月 31 日
3	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加汇林保大为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 2 月 20 日
4	太平基金管理有限公司关于旗下基金	指定报刊、基金管理人	2020 年 3 月 12 日

	增加上海中正达广基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	网站	
5	太平基金管理有限公司关于调整旗下基金在部分销售机构费率优惠活动的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 3 月 17 日
6	太平基金管理有限公司关于公司旗下基金定投、转换业务及相关费率优惠活动的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 3 月 31 日
7	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	2020 年 4 月 29 日
8	关于太平日日金货币市场基金恢复大额申购、转换转入业务的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 5 月 6 日
9	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加大连网金基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 5 月 11 日
10	关于太平日日金货币市场基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 6 月 23 日

§ 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	20200101-20200630	1,758,839,733.42	16,921,231.93	90,002,942.71	1,685,758,022.64	91.6649
-	-	-	-	-	-	-	-
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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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）

12.3 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

2020 年 8 月 31 日