平安大华交易型货币市场基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

基金管理人:平安大华基金管理有限公司
基金托管人:国泰君安证券股份有限公司
报告送出日期:2017年7月20日

§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责任。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年4月1日起至2017年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华交易型货币
场内简称	场内货币
交易代码	511700
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月23日
报告期末基金份额总额	10,173,617,719.31份
投资目标	在控制投资组合风险、保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
下属分级基金的基金简称	平安大华交易型货币A级 / 平安大华交易型货币E级
下属分级基金的场内简称	– / –
下属分级基金的交易代码	003034 / 511700
下属分级基金的前端交易代码	– / –
下属分级基金的后端交易代码	– / –
报告期末下属分级基金的份额总额	10,173,617,719.31份 / 2,101,455.11份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期（2017年4月1日 – 2017年6月30日）	
	平安大华交易型货币A级	平安大华交易型货币E级
1. 本期已实现收益	40,867,083.16	3,630,321.92
2.本期利润	40,867,083.16	3,630,321.92
3.期末基金资产净值	10,173,617,719.31	210,145,510.81

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益,由于本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。

2.本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

平安大华交易型货币A级

阶段	净值收益率①	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	0.9227%	0.0023%	0.3412%	0.0000%	0.5815%	0.0023%

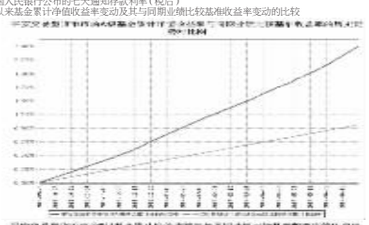
业绩比较基准:同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）

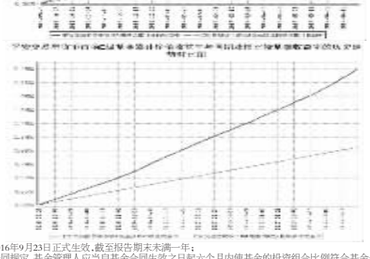
平安大华交易型货币E级

阶段	净值收益率①	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	0.9226%	0.0023%	0.3412%	0.0000%	0.5814%	0.0023%

业绩比较基准:同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）

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





1.本基金基金合同于2016年9月23日正式生效,截至报告期末未满一年;

2.按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末本基金已完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申俊华	平安大华交易型货币市场基金基金经理	2016年9月23日	–	8	申俊华女士,湖南大学金融学博士,8年证券基金从业经验,曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员,2012年加入平安大华基金管理有限公司,曾担任固定收益研究员,现担任平安大华财富宝货币市场基金、平安大华交易型货币市场基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、平安大华惠纯债债券型证券投资基金、平安大华惠纯债债券型证券投资基金基金经理。
段玮婧	平安大华交易型货币市场基金基金经理	2017年1月5日	–	10	段玮婧女士,中山大学硕士,10年证券基金从业经验,曾担任中国中投证券有限责任公司投资经理,2016年9月加入平安大华基金管理有限公司,担任投资研究部固定收益组投资经理。2017年1月起担任平安大华交易型货币市场基金、平安大华金管家货币市场基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华交易型货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内,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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年二季度,债券市场调整剧烈,收益率整体上行,四月份监管趋严直接导致了市场下跌;五月美联储加息预期再起,市场延续了调整的态势;及至六月初,央行出手呵护资金面,超量续作MLF,市场情绪有所好转,宽松局面维持至季末。

货币政策方面,当前央行通过公开市场操作工具与创新型货币市场工具的灵活搭配调节市场流动性,逆回购7天操作为主,MLF操作以1年期为主。临近半年末为呵护资金面,重启28天逆回购稳定市场情绪,减小季末考核带来的资金波动。

展望三季度,“稳健中性”依旧是主基调,但央行会维持市场流动性处于“不松不紧”的一个状态。同时,金融去杠杆仍在进行当中,仍需谨慎。

本基金认为,流动性相对宽松一定程度上增加了投资的难度,本基金的投资操作仍以加强流动性管理为主要原则,在有效控制负偏离度的前提下,适当增加债券比例的投资,同时通过优选存款交易对手,提升协议存款的收益,适时增加久期,提高货币基金长期收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期平安交易型货币市场A级的基金份额净值收益率为0.9227%,本报告期平安交易型货币市场E级的基金份额净值收益率为0.9226%,同期业绩比较基准收益率为0.3412%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人、基金资产净值低于5000万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	3,905,909,380.04	37.60
	其中:债券	3,905,909,380.04	37.60
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	475,600,153.41	4.58
	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	5,966,153,543.52	57.43
4	其他资产	41,426,729.58	0.40
5	合计	10,389,089,806.55	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	3.11
	其中:买断式回购融资	–
序号	项目	金额（元） / 占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	– / –
	其中:买断式回购融资	– / –

注:本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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2017年5月3日	26.36	基金触发“巨额赎回,连续3个交易日累计赎回20%以上,连续5个交易日累计赎回30%以上的情形”,通过债券正回购融资付赎回款	10个工作日
2	2017年5月4日	30.76	基金触发“巨额赎回,连续3个交易日累计赎回20%以上,连续5个交易日累计赎回30%以上的情形”,通过债券正回购融资付赎回款	10个工作日
3	2017年5月5日	24.77	基金触发“巨额赎回,连续3个交易日累计赎回20%以上,连续5个交易日累计赎回30%以上的情形”,通过债券正回购融资付赎回款	10个工作日

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	70
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告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	9.82	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)–60天	1.96	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)–90天	84.15	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)–120天	0.95	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)–397天（含）	2.78	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
合计		99.66	–

5.4 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存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	540,179,994.77	5.20
	其中:政策性金融债	540,179,994.77	5.20
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	3,365,729,385.27	32.41
8	其他	–	–
9	合计	3,905,909,380.04	37.62
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	111718190	17平夏银行CD190	10,000,000	991,536,008.18	9.55
1	111711218	17平安银行CD218	10,000,000	991,536,008.18	9.55
2	111798903	17徽商银行CD094	5,000,000	495,724,692.78	4.77
3	111798910	17武汉农商行CD006	5,000,000	495,681,723.52	4.77
4	120230	12国开30	4,000,000	400,046,242.92	3.85
5	111796813	17福建海峡银行CD021	1,500,000	143,823,584.24	1.39
6	120247	12国开47	1,000,000	100,105,871.16	0.96
7	111796734	17华融湘江银行CD038	1,000,000	99,636,163.28	0.96
8	111796707	17华融湘江银行CD037	1,000,000	98,409,572.00	0.95
9	130234	13国开34	400,000	40,027,880.69	0.39
10	111681092	16西安银行CD063	200,000	19,711,555.78	0.19

5.7 “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	0.0379%
报告期内偏离度的最低值	–0.0961%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0319%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报期末不持有资产支持证券投资情况。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	41,426,729.58
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	41,426,729.58

5.9.2 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	平安大华交易型货币A级	平安大华交易型货币E级
报告期期初基金份额总额	408,893,498.46	9,615,912.35
报告期期间基金总申购份额	19,663,235,230.83	7,414,757.95
报告期期间基金总赎回份额	9,898,511,009.98	14,929,215.19
报告期期末基金份额总额	10,173,617,719.31	2,101,455.11

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2017年5月18日	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00%
2	赎回	2017年6月7日	100,000,000.00	100,209,662.01	0.00%
合计			200,000,000.00	200,209,662.01	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金份额情况	
		持有基金份额比例达到或超过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	20170418–20170419	216,489,351.87	1,063,384.59	183,121,022.70	34,431,713.76	0.33%
	2	20170427–20170502	216,489,351.87	1,063,384.59	183,121,022.70	34,431,713.76	0.33%
	3	20170401–20170427	406,128,700.00	1,068,000.00	407,196,600.00	100.00	0.00%
	4	20170602–20170630	0.00	10,015,077,557.14	0.00	10,015,077,557.14	96.45%
个人	–	–	–	–	–	–	–
产品持有风险							
流动性风险							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1.经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第四十一次会议通过,同意推荐李兆良先生、李娟娟女士、刘雪山先生、潘汉腾先生为公司第三届董事会独立非执行董事候选人;推荐姚波先生、陈敬达先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生为公司第三届董事会非执行董事;推荐罗春凤先生、肖宇鹏先生为公司第三届董事会执行董事,并同意提交股东会审议。

2.经平安大华基金管理有限公司第二届监事会第九次会议通过,同意推荐巢撒文先生、冯方女士为公司第三届监事会股东监事候选人,并同意提交股东会审议。

3.经平安大华基金管理有限公司2017年第三次股东会议通过,选举姚波先生、罗春凤先生、陈敬达先生、肖宇鹏先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生、李兆良先生、李娟娟女士、刘雪山先生、潘汉腾先生为第三届董事会董事。

4.经平安大华基金管理有限公司2017年第三次股东会议通过,选举巢撒文先生、冯方女士为第三届监事会监事。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准平安大华交易型货币市场基金设立的文件

（2）平安大华交易型货币市场基金基金合同

（3）平安大华交易型货币市场基金托管协议

（4）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

（5）报告期内平安大华交易型货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 查阅方式

（1）投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

（2）投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司,客户服务电话:4008004800（免长途话费）

平安大华基金管理有限公司
2017年7月20日

平安大华日增利货币市场基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

基金管理人:平安大华基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2017年7月20日

§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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年4月1日起至2017年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华日增利货币
场内简称	–
交易代码	000379
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月3日
报告期末基金份额总额	72,490,711,499.06份
投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据对未来短期利率变动的预测,确定和调整基金投资组合的平均剩余期限,对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法,确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例,在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期（2017年4月1日 – 2017年6月30日）
1.本期已实现收益	651,121,902.76
2.本期利润	651,121,902.76
3.期末基金资产净值	72,490,711,499.06

注:1.本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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（不含公允价值变动损益）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损益,由于本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.本基金按日结转份额。

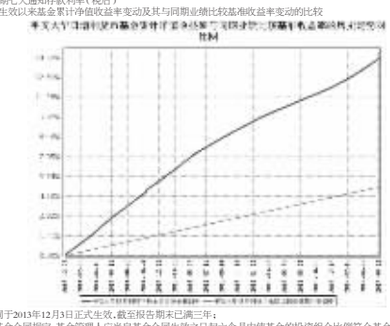
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值收益率①	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	0.9467%	0.0006%	0.3412%	0.0000%	0.6055%	0.0006%

业绩比较基准:同期七天通知存款利率（税后）

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



1.本基金基金合同于2013年12月3日正式生效,截至报告期末已满三年;

2.按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末本基金已完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙健	平安大华日增利货币市场基金基金经理	2013年12月3日	–	16	孙健先生,基金经理,硕士,1975年生,曾任潮财证券有限责任公司资产管理总部投资经理,中国太平人寿保险有限公司投资部,太平资产管理有限公司组合投资经理,摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理,银华货币市场证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金基金经理。2011年9月加入平安大华基金公司,任投资研究部固定收益研究员,现担任“平安大华添利债券型证券投资基金”、平安大华日增利货币市场基金”、平安大华保本混合型证券投资基金”、平安大华安心保本混合型证券投资基金”、平安大华安享保本混合型证券投资基金”、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金”、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金”、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华基金管理有限公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内,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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年二季度,债券市场调整剧烈,收益率整体上行,四月份监管趋严直接导致了市场下跌;五月美联储加息预期再起,市场延续了调整的态势;及至六月初,央行出手呵护资金面,超量续作MLF,市场情绪有所好转,宽松局面维持至季末。

货币政策方面,当前央行通过公开市场操作工具与创新型货币市场工具的灵活搭配调节市场流动性,逆回购7天操作为主,MLF操作以1年期为主。临近半年末为呵护资金面,重启28天逆回购稳定市场情绪,减小季末考核带来的资金波动。

展望三季度,“稳健中性”依旧是主基调,但央行会维持市场流动性处于“不松不紧”的一个状态。同时,金融去杠杆仍在进行当中,仍需谨慎。

本基金认为,流动性相对宽松一定程度上增加了投资的难度,本基金的投资操作仍以加强流动性管理为主要原则,在有效控制负偏离度的前提下,适当增加债券比例的投资,同时通过优选存款交易对手,提升协议存款的收益,适时增加久期,提高货币基金长期收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为0.9467%,同期业绩基准增长率为0.3412%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人、基金资产净值低于5000万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	16,330,360,491.54	21.44
	其中:债券	15,709,918,208.94	20.63
	资产支持证券	620,442,282.60	0.81
2	买入返售金融资产	3,207,108,610.66	4.21
	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	56,302,366,983.47	73.93
4	其他资产	313,579,859.88	0.41
5	合计	76,153,415,945.55	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	0.57
	其中:买断式回购融资	–
序号	项目	金额（元） / 占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	3,555,993,680.40 / 4.91
	其中:买断式回购融资	– / –

注:本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

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告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	9.52	4.91
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.63	–
2	30天(含)–60天	16.47	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.28	–
3	60天(含)–90天	46.55	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.19	–
4	90天(含)–120天	3.54	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.32	–
5	120天(含)–397天（含）	28.54	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
合计		104.62	4.91

5.4 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存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	3,607,160,877.42	4.98
	其中:政策性金融债	3,607,160,877.42	4.98
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	5,647,769,947.86	7.79
6	中期票据	–	–
7	同业存单	6,454,987,383.66	8.90
8	其他	–	–
9	合计	15,709,918,208.94	21.67
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	1,024,418,129.18	1.41

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	170204	17国开04	5,100,000	507,789,417.16	0.70
2	111798468	17盛京银行CD114	4,600,000	456,764,406.72	0.63
3	111794765	17广州农村商业银行CD065	4,300,000	425,258,444.63	0.59
4	111793647	17长沙银行CD027	4,000,000	396,368,351.55	0.55
5	111799543	17重庆农村商行CD123	4,000,000	395,911,391.00	0.55
6	111780125	17贵阳银行CD082	4,000,000	382,120,693.79	0.53
7	111799517	17贵阳银行CD067	3,800,000	376,040,747.45	0.52
8	130234	13国开34	3,600,000	359,530,043.11	0.50
9	111797876	17江苏江南农村商业银行CD071	3,000,000	298,193,963.74	0.41
10	111798052	17九江银行CD095	3,000,000	298,092,544.71	0.41

5.7 “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	0.0812%
报告期内偏离度的最低值	0.0375%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0581%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报期末不持有资产支持证券投资情况。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。

5.9.2

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	295,101,606.69
4	应收申购款	18,478,253.19
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	313,579,859.88

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	57,142,399,701.79
报告期期间基金总申购份额	188,833,034,395.13
报告期期间基金总赎回份额	173,484,722,597.86
报告期期末基金份额总额	72,490,711,499.06

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第四十一次会议通过,同意推荐李兆良先生、李娟娟女士、刘雪山先生、潘汉腾先生为公司第三届董事会独立非执行董事候选人;推荐姚波先生、陈敬达先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生为公司第三届董事会非执行董事;推荐罗春凤先生、肖宇鹏先生为公司第三届董事会执行董事,并同意提交股东会审议。

2.经平安大华基金管理有限公司第二届监事会第九次会议通过,同意推荐巢撒文先生、冯方女士为公司第三届监事会股东监事候选人,并同意提交股东会审议。

3.经平安大华基金管理有限公司2017年第三次股东会议通过,选举姚波先生、罗春凤先生、陈敬达先生、肖宇鹏先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生、李兆良先生、李娟娟女士、刘雪山先生、潘汉腾先生为第三届董事会董事。

4.经平安大华基金管理有限公司2017年第三次股东会议通过,选举巢撒文先生、冯方女士为第三届监事会监事。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准平安大华日增利货币市场基金设立的文件

（2）平安大华日增利货币市场基金基金合同

（3）平安大华日增利货币市场基金托管协议

（4）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

（5）报告期内平安大华日增利货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 查阅方式

（1）投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

（2）投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司,客户服务电话:4008004800（免长途话费）

平安大华基金管理有限公司
2017年7月20日

平安大华金管家货币市场基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

基金管理人:平安大华基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2017年7月20日

§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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2017年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华金管家货币
场内简称	–
交易代码	003465
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月7日
报告期末基金份额总额	2,833,331,066.05份
投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略