平安大华金管家货币市场基金

2018 第二季度 报告

2018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:2018年7月18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2018年7月17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2018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	5,177,098,904.62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	本基金根据对未来短期利率变动的预期,确定和调整基金投资组合的平均剩余期限及平均剩余存续期,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,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(2018年4月1日 — 2018年6月30日)
1. 本期已实现收益	59,684,232.74
2. 本期利润	59,684,232.74
3. 期末基金资产净值	5,177,098,904.62

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。

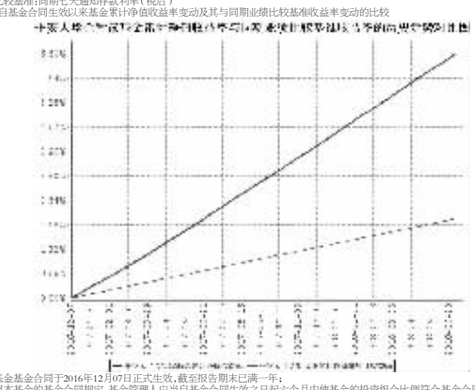
3.2 基金净值表现

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

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	1.0363%	0.0021%	0.3413%	0.0000%	0.6950%	0.0021%

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2016年12月07日正式生效,截至报告期末已满一年;

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,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的规定。

§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	平安大华金管家货币市场基金基金经理	2016年12月7日	-	9	申俊华女士,湖南大学金融学博士,9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、平安大华金管家货币市场基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫荣混合型证券投资基金、平安大华惠民纯债债券型证券投资基金、平安大华日增利货币市场基金基金经理。
段玮婧	平安大华金管家货币市场基金基金经理	2017年1月5日	-	11	段玮婧女士,中山大学硕士,11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、平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华合瑞定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华合裕定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华合盛定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。

1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确认的解聘日期;对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

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、《平安大华金管家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不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

二季度货币政策维持稳健中性,流动性"合理充裕",央行启动了降准置换MLF,边际放松逐象可循。总体资金面宽松,仅在税期和季末MPA考核下,出现短期资金价格波动。6月份美联储加息后,央行并未跟随上调政策利率,市场做多情绪高涨,利率债收益率迅速下行。报告期内,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,择时拉长组合剩余期限,适当调整同业存单和银行存款的配置比例,同时加强波段交易力度,提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为1.0363%,业绩比较基准收益率为0.3413%。

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	3,362,788,865.18	61.03
	其中:债券	3,362,788,865.18	59.95
	资产支持证券	60,000,000.00	1.09
2	买入返售金融资产	902,693,554.04	16.38
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,094,393,937.01	19.86
4	其他资产	149,742,747.85	2.72
5	合计	5,509,619,104.08	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	4.44
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	330,077,034.95	6.38
	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

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%。

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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	67

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	20.32	6.38
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	32.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	3.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	32.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.53	6.38

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	340,367,919.05	6.57
	其中:政策性金融债	340,367,919.05	6.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,020,145,194.27	19.70
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,942,275,751.86	37.52
8	其他	-	-
9	合计	3,302,788,865.18	63.80
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	180404	18农发04	1,500,000	150,292,357.77	2.90
2	111816158	18上海银行CD158	1,000,000	99,491,682.12	1.92
3	111897009	18江苏汇商农村商业银行CD054	1,000,000	99,485,766.52	1.92
4	111809148	18盛发银行CD148	1,000,000	99,390,441.74	1.92
5	111897728	18宁波银行CD090	1,000,000	99,363,777.25	1.92
6	111898031	18南京银行CD079	1,000,000	99,291,431.36	1.92
7	111898203	18宁波银行CD100	1,000,000	99,263,879.47	1.92
8	111812122	18北京银行CD122	1,000,000	99,247,047.27	1.92
9	111810263	18兴业银行CD263	1,000,000	99,197,871.85	1.92
10	111818147	18厦门银行CD147	1,000,000	99,197,535.51	1.92

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	0.2070%
报告期内偏离度的最低值	0.0503%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0926%

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

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149380	18花66A1	200,000.00	20,000,000.00	0.39
1	146421	借呗31A1	200,000.00	20,000,000.00	0.39
2	149086	借呗49A1	100,000.00	10,000,000.00	0.19
2	149251	花呗56A1	100,000.00	10,000,000.00	0.19

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,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00 元。

5.9.2

本组合投资的前十名证券的发行主体之一兴业银行于2018年4月19日被银保监公开处罚,主要违法违规事实包括:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资,中国银行保险监督管理委员会决定罚款兴业银行5870万元。

本组合投资的前十名证券的发行主体之一南京银行于2018年1月9日被中国银行业监督管理委员会江苏监管局处以行政处罚(苏银监罚决字【2018】1号),对南京银行镇江分行违规办理票据业务违反审慎经营原则的行为罚款3230万元人民币。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成 重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有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。

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	26,756,640.20
4	应收申购款	122,986,107.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	149,742,747.85

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	4,396,005,347.68
报告期期间基金总申购份额	11,218,681,737.42
报告期期间基金总赎回份额	10,437,588,180.48
报告期期末基金份额总额	5,177,098,904.62

§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	2018年5月28日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
2	红利再投	2018年5月29日	618.08	618.08	-
3	申购	2018年5月29日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
4	申购	2018年5月30日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
5	红利再投	2018年5月30日	1,023.63	1,023.63	-
6	申购	2018年5月31日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
7	红利再投	2018年5月31日	1,572.93	1,572.93	-
8	红利再投	2018年6月1日	2,011.20	2,011.20	-
9	申购	2018年6月1日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
10	申购	2018年6月4日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
11	红利再投	2018年6月4日	8,144.85	8,144.85	-
12	红利再投	2018年6月5日	3,321.88	3,321.88	-
13	红利再投	2018年6月6日	3,258.38	3,258.38	-
14	申购	2018年6月7日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
15	红利再投	2018年6月7日	3,155.22	3,155.22	-
16	红利再投	2018年6月8日	3,897.71	3,897.71	-
17	红利再投	2018年6月11日	10,821.91	10,821.91	-
18	申购	2018年6月12日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
19	红利再投	2018年6月12日	4,753.11	4,753.11	-
20	红利再投	2018年6月13日	4,693.73	4,693.73	-
21	红利再投	2018年6月14日	4,177.55	4,177.55	-
22	红利再投	2018年6月15日	6,589.39	6,589.39	-
23	红利再投	2018年6月19日	16,417.11	16,417.11	-
24	红利再投	2018年6月20日	5,773.74	5,773.74	-
25	红利再投	2018年6月21日	4,012.85	4,012.85	-
26	红利再投	2018年6月22日	4,252.53	4,252.53	-
27	红利再投	2018年6月25日	12,234.38	12,234.38	-
28	红利再投	2018年6月26日	6,677.30	6,677.30	-
29	红利再投	2018年6月27日	4,939.53	4,939.53	-
30	红利再投	2018年6月28日	5,001.43	5,001.43	-
31	红利再投	2018年6月29日	4,997.46	4,997.46	-
合计			40,122,345.90	40,122,345.90	-

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安大华金管家货币市场基金设立的文件

(2)平安大华金管家货币市场基金基金合同

(3)平安大华金管家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)报告期内平安大华金管家货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

8.3 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
2018年7月18日

平安大华交易型货币市场基金

2018 第二季度 报告

2018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:2018年7月18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2018年7月17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2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华货币ETF
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	232,885,911.35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	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	平安日鑫A 场内货币
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	229,768,742.53份 3,117,168.82份

本基金A类(平安日鑫A)份额净值为1.00元,E类(场内货币)份额净值为100.00元。

§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(2018年4月1日 — 2018年6月30日)		
		平安日鑫A	场内货币
1. 本期已实现收益		12,566,169.50	8,129,823.44
2. 本期利润		12,566,169.50	8,129,823.44
3. 期末基金资产净值		229,768,742.53	311,716,881.74

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

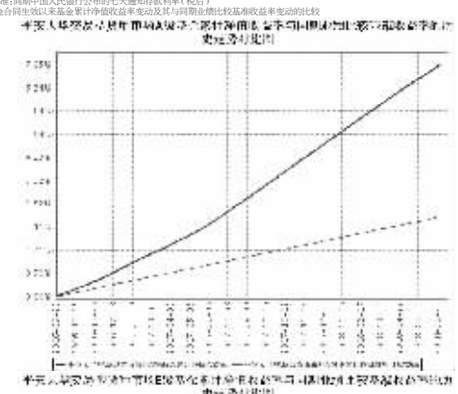
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0398%	0.0010%	0.3413%	0.0000%	0.6985%	0.0010%

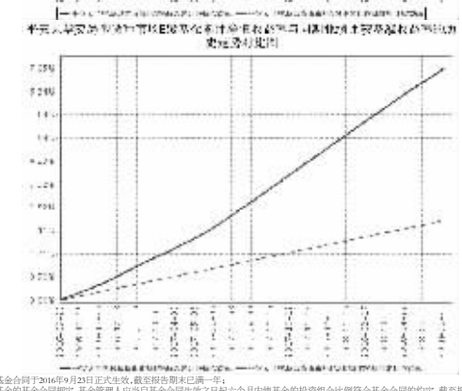
业绩比较基准:同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)

阶段	场内货币					
	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	1.0399%	0.0010%	0.3413%	0.0000%	0.6986%	0.0010%

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,截至报告期末已满一年;

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,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的规定。

§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		
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	-	11	段玮婧女士,中山大学硕士,11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、平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华合瑞定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华合裕定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华合盛定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安大华合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。
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	-	9	申俊华女士,湖南大学金融学博士,9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、平安大华金管家货币市场基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫荣混合型证券投资基金、平安大华惠民纯债债券型证券投资基金、平安大华日增利货币市场基金基金经理。

1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确认的解聘日期;对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

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不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

二季度货币政策维持稳健中性,流动性"合理充裕",央行启动了降准置换MLF,边际放松逐象可循。总体资金面宽松,仅在税期和季末MPA考核下,出现短期资金价格波动。6月份美联储加息后,央行并未跟随上调政策利率,市场做多情绪高涨,利率债收益率迅速下行。报告期内,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,择时拉长组合剩余期限,适当调整同业存单和短期融资券的配置比例,提高组合长期收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期平安大华交易型货币市场A级的基金份额净值收益率为1.0398%,本报告期平安大华交易型货币市场E级的基金份额净值收益率为1.0399%,同期业绩比较基准收益率为0.3413%。

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	471,922,352.37	71.79
	其中:债券	461,922,352.37	70.27
	资产支持证券	10,000,000.00	1.52
2	买入返售金融资产	45,045,187.57	6.85
	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	134,916,472.83	20.52
4	其他资产	5,456,790.02	0.83
5	合计	657,340,802.79	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	5.35
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	115,279,742.36	21.29
	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	2018年6月26日	32.12	产品遭遇巨额赎回	10个工作日
2	2018年6月27日	33.51	产品遭遇巨额赎回	10个工作日
3	2018年6月28日	25.47	产品遭遇巨额赎回	10个工作日
4	2018年6月29日	21.29	产品遭遇巨额赎回	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	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

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	30.46	21.29
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	64.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	3.69	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	21.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	120.39	21.29

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	114,993,910.03	21.24
	其中:政策性金融债	114,993,910.03	21.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,001,250.91	11.08
6	中期票据	-	-
7	同业存单	286,927,191.43	52.99
8	其他	-	-
9	合计	461,922,352.37	85.31
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	111810238	18兴业银行CD238	1,000,000	99,390,703.57	18.36
2	150418	15农发18	500,000	49,990,388.28	9.23
3	111806142	18交通银行CD142	500,000	49,695,220.88	9.18
4	111898031	18南京银行CD079	500,000	49,645,715.66	9.17
5	111892949	18厦门国际银行CD028	500,000	48,948,888.69	9.04
6	170207	17国开07	350,000	35,000,447.98	6.46
7	170410	17农发10	300,000	30,003,073.77	5.54
8	011800349	18七宝通SCP001	200,000	20,000,452.25	3.69
9	011800730	18海国鑫泰SCP002	200,000	20,000,441.59	3.69
10	011800938	18中航租赁SCP004	200,000	20,000,357.07	3.69

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	0.1309%
报告期内偏离度的最低值	0.0108%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0365%

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149086	借呗49A1	100,000.00	10,000,000.00	1.84

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,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00 元。

5.9.2

本组合投资的前十名证券的发行主体之一兴业银行,于2018年4月19日被银保监公开处罚,主要违法违规事实包括:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资,中国银行保险监督管理委员会决定罚款兴业银行5870万元。

本组合投资的前十名证券的发行主体之一南京银行于2018年1月9日被中国银行业监督管理委员会江苏监管局处以行政处罚(苏银监罚决字【2018】1号),对南京银行镇江分行违规办理票据业务违反审慎经营原则的行为罚款3230万元人民币。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成 重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有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。

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	5,456,789.02