

# 平安大华财富宝货币市场基金 2018年半年度报告摘要

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  
送出日期:2018年8月24日

## § 1 重要提示

1.1 重要提示  
基金管理人、董事会、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法律责任,本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。  
基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8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,也不保证基金份额净值不出现连续下降,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2018年1月1日起至6月30日止。  
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华财富宝货币市场基金
基金代码	000759
新增交易代码	
信息披露网址	http://www.fundjng.com.cn
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2014年8月21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
报告期末基金份额总额	43,968,521,178.47
基金合同期限	不定期
基金业绩比较基准	人民币计价的活期存款利率(税后)
上市日期	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	资产控制基金资产投资风险和保持基金资产流动性的基础上,力争实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金采取稳健的资产配置策略,确定和调整基金投资组合中各类资产配置比例,主要投资于货币市场工具,在严格控制风险的前提下,适当参与信用债、可转债、资产支持证券等固定收益类金融工具,力争实现基金资产的持续稳定增值。
业绩比较基准	人民币计价的活期存款利率(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均低于股票基金、混合基金、债券基金。

### 2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	平安大华基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
负责人	杨宇光	王胜
注册地址	深圳市福田区福田街道福安社区平安大厦16楼	广东省深圳市罗湖区宝安南路1881号平安大厦26楼
办公地址	深圳市福田区福田街道福安社区平安大厦16楼	广东省深圳市罗湖区宝安南路1881号平安大厦26楼
电话	0755-22696788	0755-22193388
传真	0755-22696788	0755-22193388

### 2.4 信息披露方式

基金年度报告及半年度报告的备查地点	http://www.fundjng.com.cn
基金年度报告及半年度报告的备查日期	基金管理人、基金托管人办公时间

### § 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

项目	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期利润总额	780,722,059.86
本期净利润	780,722,059.86
净资产收益率	2.1581%

#### 3.2 基金净值表现

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. 2.1 基金净值表现

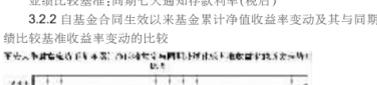
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	超额收益	①-②	②-①
过去一个月	0.0340%	0.0000%	0.0340%	0.0300%	0.0000%
过去三个月	1.0692%	0.0011%	0.3413%	0.7189%	0.0011%
过去六个月	2.1581%	0.0010%	0.6788%	0.0000%	0.0010%
过去一年	4.4292%	0.0008%	1.3688%	3.2694%	0.0008%
过去三年	11.7125%	0.0043%	4.1105%	0.0000%	0.0043%
过去五年	16.4445%	0.0056%	5.2979%	0.0000%	0.0056%

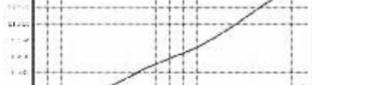
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



#### 3.2.3 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的比较



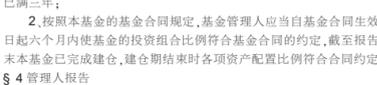
#### 3.2.4 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



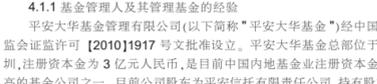
#### 3.2.5 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



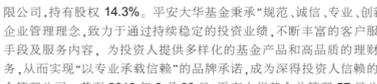
#### 3.2.6 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



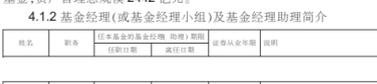
#### 3.2.7 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



#### 3.2.8 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的比较



#### 3.2.9 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的比较



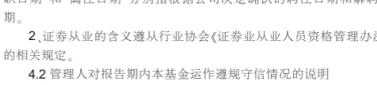
#### 3.2.10 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



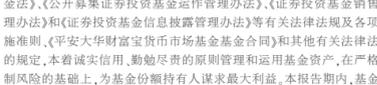
#### 3.2.11 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



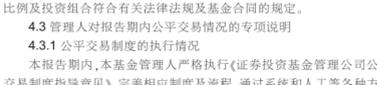
#### 3.2.12 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



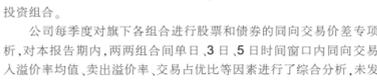
#### 3.2.13 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



#### 3.2.14 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的比较



#### 3.2.15 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的比较



违反公平交易原则的异常情况。  
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 管理人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业绩表现  
2018年上半年,投资、消费、进出口走弱,CPI冲高回落维持在2%以下,M2处于历史低位,社融持续回落,实体经济需求疲弱,贸易摩擦持续升级成为基本盘中超预期的因素。货币政策维持稳健中性,流动性合理充裕,央行先后通过定向降准、临时准备金动用安排、降准置换MLF、扩大MLF抵押品范围等措施,向市场注入流动性。同时资管新规落地后好于市场预期,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。债券市场收益率出现分化,利率债和高等级信用债整体下行,而受信用事件频发影响,低等级信用债收益率上行。  
报告期内,本基金的资产配置仍以加强流动性管理为主要原则,通过优选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2018年1月1日起至6月30日止。  
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

## 4.2 基金管理人

### 4.2.1 基金管理人

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.2 利润表

项目	本期	上期
一、营业收入	846,202,314.32	336,357,471.36
利息收入	645,716,186.50	337,915,186.56
投资收益	325,081,430.96	292,891,547.74
公允价值变动收益	407,202,848.24	77,836,826.56
资产减值损失	-2,173,748.20	-2,728,704.73
其他业务收入	111,243,301.02	47,453,006.36
其他收益	-	-3,104.48
二、营业成本	390,252.82	-1,555,725.21
利息支出	390,252.82	-1,555,725.21
其他费用	64,715.35	-
三、利润总额	846,202,314.32	336,357,471.36
减:所得税费用	-	-
四、净利润	846,202,314.32	336,357,471.36

### 6.3 所有者权益

项目	本期	上期
一、所有者权益	846,202,314.32	336,357,471.36
基金份额持有人权益	846,202,314.32	336,357,471.36
二、未分配利润	846,202,314.32	336,357,471.36

### 6.4 资产负债表

项目	本期	上期
一、资产	846,202,314.32	336,357,471.36
货币资金	17,212,169,645.45	16,651,117,947.79
结算备付金	16,422,897.29	-
拆出资金	-	-
交易性金融资产	24,866,002,300.17	14,368,037,865.00
其中:债权投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	24,866,002,300.17	14,287,759,483.50
其他金融资产	200,000,000.00	70,278,381.50
其他资产	-	-
二、负债	3,330,082,915.12	1,551,138,026.71
应付短期融资券	-	-
应付债券	181,427,639.60	223,820,338.89
其他负债	133,146,861.88	20,302,681.82
三、所有者权益	45,732,342,302.09	32,804,416,779.81
基金份额持有人权益	45,732,342,302.09	32,804,416,779.81

### 6.5 现金流量表

项目	本期	上期
一、经营活动产生的现金流量	1,741,968,228.38	916,178,446.30
收到利息、股息、红利收入	1,741,968,228.38	916,178,446.30
其他经营活动现金流入	-	-
经营活动现金流出	-	-
二、投资活动产生的现金流量	43,968,521,178.47	31,871,266,011.12
收回投资收到的现金	43,968,521,178.47	31,871,266,011.12
其他投资活动现金流入	-	-
投资活动现金流出	-	-
三、筹资活动产生的现金流量	43,968,521,178.47	31,871,266,011.12
发行债券收到的现金	43,968,521,178.47	31,871,266,011.12
其他筹资活动现金流入	-	-
筹资活动现金流出	-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	45,732,342,302.09	32,804,416,779.81

### 6.6 分部信息

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.7 关联方关系

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.8 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.9 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.10 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.11 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.12 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.13 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.14 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.15 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.16 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.17 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.18 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.19 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.20 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.21 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.22 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.23 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.24 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.25 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.26 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.27 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.28 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.29 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.30 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.31 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.32 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0000元,基金份额总额43,968,521,178.47份。

### 6.33 关联方交易

注:报告截止日2018年6月30日,平安大华财富宝货币市场基金基金份额净值1.0