太平日日鑫货币市场基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:太平基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2019年8月24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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	太平日日鑫货币	
基金主代码	004330	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月15日	
基金管理人	太平基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,825,142,638.36份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	太平日日鑫A	太平日日鑫B
下属分级基金的交易代码	004330	004331
报告期末下属分级基金的份额总额	52,174,354.84份	3,772,968,283.52份

2.2 基金产品说明

投资目标	在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。 1、资产配置策略 本基金通过对货币政策、宏观经济运行状况、利率走势、资金供求变化情况进行深入研究,评估各类投资品种的流动性和风险收益特征,确定各类投资品种的配置比例及期限结合,并适时进行动态调整。 2、利率预期策略 本基金通过跟踪和分析各类宏观经济指标、资金供求状况等因素,对短期利率变化趋势进行评估并形成合理预期,动态配置货币资产。 3、期限配置策略 本基金在短期利率期限结构分析的基础上,分析和评估各类投资品种的收益性和流动性,构建合理期限结构的投资组合。如预期市场利率水平上升,适度缩短投资组合的平均剩余期限;如预期市场利率水平下降,适度延长投资组合的平均剩余期限。 4、资产流动性管理策略 本基金将会紧密关注申购/赎回现金流变化情况、市场资金流动状况等影响货币市场基金流动性管理的因素,动态调整并有效分配本基金的现金流,以满足基金资产的日常流动性需求。 5、套利策略 本基金根据对货币市场变动趋势,各市场利息种之间的风险收益差异的充分研究和论证,适当进行跨市场或跨品种套利操作,力争提高资产收益率,具体策略包括跨市场套利和期限结构套利等。 6、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化和检调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 7、非金融企业债务融资工具的投资策略 本基金将通过宏观经济、中观产业、微观个券等综合判断,并结合资金面变化进行非金融企业债务融资工具的投资,严格遵守法律法规和基金合同的约定,兼顾安全性、流动性和收益性。 8、回业存单的投资策略 本基金将结合商业银行的不同资质和回业存单剩余期限进行回业存单的投资,注重回业存单的安全性、交易的流动性和风险溢率的比较,严格恪守法律法规和基金合同的约定。
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王刚	罗菲菲
	联系电话	021-38566787	010-58560666
	电子邮箱	wanggang@taipingfund.com.cn	tgbfxjtzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		021-61569999	95568
传真		021-38566677	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

§ 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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	太平日日鑫A	太平日日鑫B
本期已实现收益	3,079,114.69	51,899,136.48
本期利润	3,079,114.69	51,899,136.48
本期净值收益率	1.2910%	1.4168%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	太平日日鑫A	太平日日鑫B
期末基金资产净值	52,174,354.84	3,772,968,283.52
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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

太平日日鑫A

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	0.1872%	0.0013%	0.1110%	0.0000%	0.0762%	0.0013%
过去三个月	0.5896%	0.0016%	0.3366%	0.0000%	0.2520%	0.0016%
过去六个月	1.2910%	0.0027%	0.6695%	0.0000%	0.6215%	0.0027%
过去一年	2.8231%	0.0037%	1.3500%	0.0000%	1.4731%	0.0037%
自基金合同生效起至今	8.1450%	0.0035%	3.0995%	0.0000%	5.0455%	0.0035%

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

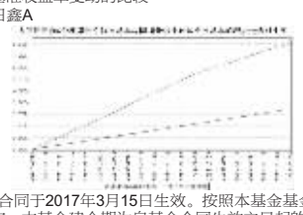
太平日日鑫B

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	0.2070%	0.0013%	0.1110%	0.0000%	0.0960%	0.0013%
过去三个月	0.6491%	0.0016%	0.3366%	0.0000%	0.3125%	0.0016%
过去六个月	1.4168%	0.0029%	0.6695%	0.0000%	0.7473%	0.0029%
过去一年	3.0728%	0.0038%	1.3500%	0.0000%	1.7228%	0.0038%
自基金合同生效起至今	8.7482%	0.0035%	3.0995%	0.0000%	5.6487%	0.0035%

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

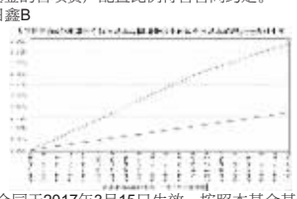
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、太平日日鑫A



注:本基金合同于2017年3月15日生效。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。

2、太平日日鑫B



注:本基金合同于2017年3月15日生效。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。

§ 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83%,中原证券股份有限公司的出资占注册资本的8.5%,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7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,太平日日金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,上海金鹏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,太平日日金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往来账核对及服工作;中国人保资产管理有限公司的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的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。

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遵规守信情况的说明

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。

4.3.2 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

2019年以来宏观经济基本保持稳定,一二季度数据出现一定的波动,总体区间仍然保持在宏观调控目标框架内。分季度来看,一季度经济显示出回暖迹象,经济数据略超市场预期,国外经济政治局势发生一定变化,贸易争端有所缓和,市场对于经济预期有所升温。一季度CPI较去年比有所上行,主要由食品价格上涨带动。PPI下行明显,原材料涨价压力较小。央行货币政策维持稳健偏宽松的态势,通过定向降准以及创新使用TMLF降低银行融资成本。货币传导机制进一步深化,不断推动宽信用进程,信用风险得到部分缓解。债券市场一季度表现一般,整体呈现震荡行情,市场风险偏好明显提升,权益类资产对债券市场压制明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,太平日日鑫A的净值收益率为1.2910%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%;太平日日鑫B的净值收益率为1.4168%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观基本面数据在二季度呈现走弱迹象。6月官方制造业PMI为49.4,与上月持平,持续低于50的荣枯线,同时大部分分项指标有恶化趋势。CPI继续上行,达到2.70%,为年内新高,果蔬以及猪肉价格的持续上涨给通胀带来一定压力。工业增加值也超预期下滑,叠加月中贸易摩擦,导致月中市场悲观预期升温。资金面6月超预期宽松,隔夜资金价格创出近年来新低,但同时也要注意到流动性分层现象的加剧,AA及以下品种融资能力下降明显,银行间质押式回购违约事件上升。债券市场受益于风险偏好下降,利率以及高评级信用债表现抢眼,资金面的宽松导致年内资产收益率下降明显。本基金在上半年仍然秉持"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,为投资者取得了与风险匹配的收益,符合货币基金的风险收益特征。

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。

4.7 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:3,079,114.69元,B级分配收益51,899,136.48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

本报告期内,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 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:太平日日鑫货币市场基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	3,205,925.05	118,173,816.12
结算备付金		16,612,500.00	9,760,454.55
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,672,023,978.05	3,188,517,127.54
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,672,023,978.05	3,188,517,127.54
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	1,027,395,713.70	1,437,329,293.49
应收证券清算款		211,569,750.00	-
应收利息	6.4.7.5	8,505,842.63	16,438,292.64
应收股利		-	-
应收申购款		5,900.00	5,313.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,939,319,609.43	4,770,224,297.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		110,949,524.24	669,972,075.04
应付证券清算款		1,992,097.26	1,959,335.62
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		770,809.79	863,930.32
应付托管费		154,161.96	172,786.05
应付销售服务费		40,969.63	173,252.37
应付交易费用	6.4.7.7	48,782.99	67,351.97
应交税费		11,019.11	11,887.22
应付利息		32,037.82	529,168.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	177,568.27	189,300.00
负债合计		114,176,971.07	673,939,086.90
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,825,142,638.36	4,096,285,210.44
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		3,825,142,638.36	4,096,285,210.44
负债和所有者权益总计		3,939,319,609.43	4,770,224,297.34

注:1、报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额3,825,142,638.36份,其中A级基金份额参考净值1.0000元,份额总额52,174,354.84份;B级基金份额参考净值1.0000元,份额总额3,772,968,283.52份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体:太平日日鑫货币市场基金

本报告期:2019年1月1日 至 2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日
一、收入		64,211,033.17	81,929,612.53
1.利息收入		60,831,639.60	79,500,899.47
其中:存款利息收入	6.4.7.11	1,145,093.06	5,440,701.55
债券利息收入		41,003,602.38	56,285,025.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		18,682,944.16	17,775,159.79
其他利息收入		-	
2.投资收益(损失以"-"填列)		3,379,393.57	2,428,726.06
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	3,379,393.57	2,428,726.06
资产支持证券投资收益		-	-
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		9,232,782.00	7,314,380.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,876,727.60	4,484,452.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	975,345.60	896,890.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	468,686.66	195,881.08
4. 交易费用	6.4.7.19	-	509.00
5. 利息支出		2,785,526.02	1,597,516.70
其中:卖出回购金融资产支出		2,785,526.02	1,597,516.70
6. 税金及附加		19,353.15	21,921.04
7. 其他费用	6.4.7.20	107,142.97	117,210.15
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		54,978,251.17	74,615,231.69
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		54,978,251.17	74,615,231.69

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:太平日日鑫货币市场基金

本报告期:2019年1月1日 至 2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	4,096,285,210.44	-	4,096,285,210.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	54,978,251.17	54,978,251.17
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)	-271,142,572.08	-	-271,142,572.08
其中:1.基金申购款	1,648,082,913.17	-	1,648,082,913.17
2.基金赎回款	-1,919,225,485.25	-	-1,919,225,485.25
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)	-	-54,978,251.17	-54,978,251.17
五、期末所有者权益(基金净值)	3,825,142,638.36	-	3,825,142,638.36
项目	上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018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)	3,023,626,590.64	-	3,023,626,590.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	74,615,231.69	74,615,231.69
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)	489,318,962.23	-	489,318,962.23
其中:1.基金申购款	4,856,159,829.81	-	4,856,159,829.81
2.基金赎回款	-4,366,840,867.58	-	-4,366,840,867.58
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)	-	-74,615,231.69	-74,615,231.69
五、期末所有者权益(基金净值)	3,512,945,562.87	-	3,512,945,562.87

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:

邱宏斌 宋卫华 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

太平日日鑫货币市场基金(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")证监许可[2016]3071号《关于准予太平日日鑫货币市场基金注册的批复》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《太平日日鑫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5,509,836,323.34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(2017)第266号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《太平日日鑫货币市场基金基金合同》于2017年3月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,510,097,819.02份基金份额,其中认购资金利息折合261,495.68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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称"中国民生银行")。

根据《太平日日鑫货币市场基金基金合同》和《太平日日鑫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用,因此形成不同的基金份额类。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《太平日日鑫货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于现金,期限在一年以内(含一年)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、资产支持证券、非金融企业债务融资工具,以及法律法规或中国证监会、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:同期七天通知存款利率(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2019年8月22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(年度报告和半年度报告)》、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》、《太平日日鑫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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019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 差错更正的说明

本基金本报告期未发生重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票的转让收入免征增值税,对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,包括买卖股票的差价收入,股票的股息、红利收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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
中国民生银行股份有限公司("中国民生银行")	基金托管人、基金销售机构
中原证券股份有限公司("中原证券")	基金管理人的股东、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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,876,727.60	4,484,452.41
其中:支付销售机构的客户维护费	53,021.04	30,231.83

注:支付基金管理人太平基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%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:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	975,345.60	896,890.46

注:支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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 X 0.05% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平日日鑫A	太平日日鑫B	合计
中原证券股份有限公司	42.33	0.00	42.33
中国民生银行股份有限公司	8,493.82	535.65	9,029.47
太平基金管理有限公司	218,414.94	181,279.35	399,694.29
合计	226,951.09	181,815.00	408,766.09
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6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平日日鑫A	太平日日鑫B	合计
中国民生银行股份有限公司	3,369.67	517.83	3,887.50
太平基金管理有限公司	4,992.62	176,297.84	181,290.46
合计	8,362.29	176,815.67	185,177.96

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日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管理有限公司,再由太平基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。销售服务费的计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值 X 约定年费率 /当年天数。6.4.8.3 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,未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末,无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 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6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入