

B036 信息披露 | Disclosure

（上接B035版）

办公地址：深圳市南山区高新南七道惠康二期A18室
 公司电话：http://www.bnyfund.com
 法定代表人：齐小波
 联系人：刘贤
 电话：0755-83090907
 传真：0755-83090926
 邮政编码：220081
 客服电话：0755-83090907
 网址：www.bnyfund.com
 (69) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
 注册地址：湖北省武汉市江宁区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7层B3层1号、4号
 办公地址：湖北省武汉市江宁区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7层B2层1号、4号
 法定代表人：陈捷
 联系人：孔繁
 电话：027-87700609
 网址：http://www.bnyfund.com
 客服电话：400-027-9899

(70) 大泰金石投资管理有限公司
 注册地址：南京市建邺区江东中路369号
 办公地址：上海市浦东新区虹桥路1366号文广大厦16楼
 法定代表人：袁敬明
 联系人：何庭宇
 电话：13912725742
 传真：021-22268089
 客服电话：021-22267936/400-928-2286
 网址：www.dtfund.com

(71) 珠海盈米财富管理有限公司
 注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号
 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南楼12楼
 法定代表人：肖雯
 联系人：吴越雄
 电话：020-89620021
 传真：020-89629011
 客服电话：020-89623066
 网址：www.yingmicn.com
 (72) 和耕承基基金销售有限公司
 注册地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6层
 办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6层
 法定代表人：李海晨
 联系人：方良治
 电话：0371-56213196
 客服电话：400-066-5671
 网址：http://www.hgpcpb.com

(73) 类丰金融服务(深圳)有限公司
 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
 办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦115、1116及1307室
 法定代表人：ATAM YIK KUAN
 联系人：郑显昌
 电话：0755-8946 0500
 传真：0755-2617 4453
 客服电话：400-684-0500
 网址：www.ltfsp.com

(74) 深圳市小中投资咨询有限公司
 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
 办公地址：深圳市福田区彩田路2009号森大厦17楼
 法定代表人：黄俊杰
 联系人：秦晓
 电话：0755-23981999
 客服电话：400-669-5666
 网址：www.wne06.com.cn

(75) 北京微众金融信息服务有限公司
 注册地址：北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119
 办公地址：北京市朝阳区四惠东慈惠通融产社区4区1111号
 法定代表人：齐良辰
 联系人：宋翔宇
 电话：15902171060
 网址：www.lmiao21.com

(76) 京东金融-北京特商财富投资管理有限公司
 注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
 办公地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
 法定代表人：陈超
 联系人：赵德辉
 电话：010-8888816
 客服电话：05118
 网址：http://fund.jd.com

(77) 上海云湾投资管理有限公司
 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
 法定代表人：董晓峰
 联系人：江慧
 电话：021-20630224
 传真：021-20638999
 客服电话：400-820-1515
 网址：www.zhengtongfund.com

(78) 深圳市金多子资产管理有限公司
 注册地址：深圳市南山区智慧广场A栋11层1101-02
 办公地址：深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼
 法定代表人：陈姚捷
 联系人：陈豪豪
 电话：0755-33655588
 网址：www.keynesasset.com
 客服电话：400-804-8688

(82) 上海华夏时联投资管理有限公司
 注册地址：北京市西城区金融街33号通泰大厦B座8层
 办公地址：北京市西城区金融街33号通泰大厦B座8层
 法定代表人：李一梅
 电话：www.amcfund.com
 客服电话：400-817-5666

(83) 深圳盈信基金销售有限公司
 注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1
 办公地址：广东省东莞市中城区南山路165号南山1910大厦A3-1
 法定代表人：李海斌
 网站：www.tundfund.com
 客服电话：4007-903-688

(84) 深圳信诚基金销售有限公司
 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
 办公地址：深圳市福田区时代富大厦第49A层
 客服电话：0755-23984679
 传真：0755-82799693
 E-mail:service@cepfund.com
 网址：www.cepfund.com

(85) 上海攀赢基金销售有限公司
 注册地址：上海市闸北区长江西路1207楼300室
 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路488号平安金大厦603室
 法定代表人：申健
 联系人：宋楠
 客服电话：021-20292031
 网址：https://www.wyq.com.cn

(87) 中民财富管理(上海)有限公司
 注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19楼
 办公地址：上海市黄浦区中山南路100号17层05单元
 法定代表人：冯妮妮
 联系人：黄静
 电话：021-33563333
 客服电话：021-63363757
 网址：www.cwmw.com.cn

(88) 赣州银行股份有限公司
 注册地址：江西省赣州市赣江大道东号
 办公地址：江西省赣州市赣江大道26号
 法定代表人：谢华林
 联系人：李世伟
 客服电话：0797-96296
 网址：www.gzccb.com

(89) 佛山农村商业银行股份有限公司
 注册地址：广东省佛山市禅城区远东路86号
 办公地址：广东省佛山市禅城区远东路86号
 法定代表人：李川
 联系人：洪燕
 客服电话：06138
 网址：www.foshanbnc.com

(90) 通华银行（上海）基金销售有限公司
 注册地址：上海市虹口区吴淞路667号107号201室
 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场高南路799号3号9楼
 法定代表人：王翔
 联系人：杨德祥
 电话：021-60618249
 客服电话：06156
 网址：www.tonghuafund.com

(91) 万利证券股份有限公司
 注册地址：海口市南沙路49号通信广场二楼
 办公地址：深圳市深南大道7028号时代科技大厦20层西
 法定代表人：朱海理
 联系人：郭东森
 电话：020-62830333-115
 电话：0755-26170907
 客服电话：4008-2882-2882
 网址：www.wanhesec.com

(92) 北京信基基金销售有限公司
 注册地址：北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67
 办公地址：北京市朝阳区惠康国际大厦10号
 法定代表人：于龙
 联系人：吴鹏
 电话：010-5607 7515
 客服电话：4008020123
 网站：www.zhixin-inv.com

(93) 世纪证券有限责任公司
 注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
 办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
 邮编：518000
 联系人：袁晓军
 电话：010-6677 96296
 客服电话：4008-322-000/047
 (94) 南京基金销售有限公司
 注册地址：上海黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室
 办公地址：上海浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
 联系人：杨一

电话：021-50260603
 传真：021-50260603
 客服电话：021-50260603
 公司网站：http://www.wandec.com
 (95) 华安证券股份有限公司
 注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
 办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
 法定代表人：李工
 联系人：范琳
 客服电话：06318
 网址：www.haazq.com

(96) 弘业期货股份有限公司
 注册地址：南京市中华路60号
 办公地址：南京市中华路60号
 法定代表人：周剑秋
 联系人：郭晓辉
 电话：025-68509525
 传真：025-62313068
 客服电话：400-828-1288
 网址：http://www.hyl.com.cn/etrading/

(97) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司
 注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
 办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
 法定代表人：钱昊旻
 联系人：徐晨
 电话：010-59369339
 传真：010-59369300
 客服电话：4008909998
 网址：www.jincn.com

(98) 济安财富（北京）基金销售有限公司
 注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号院1号楼3层307
 办公地址：北京市朝阳区望京太阳宫中路16号院1号楼3层307
 法定代表人：杨健
 联系人：李海燕
 客服电话：400-673-7010
 网址：www.jiandaoit.com

(99) 上海大泰基金销售有限公司
 注册地址：上海市徐汇区龙阳路195号2号楼2层
 办公地址：上海市徐汇区龙阳路195号302楼7层
 法定代表人：钱昊旻
 联系人：徐晨
 电话：010-59369339
 传真：010-59369300
 客服电话：4008909998
 网址：www.jincn.com

(100) 江苏汇林保大基金销售有限公司
 注册地址：南京市高淳区经济开发区广济大道47号
 办公地址：江苏省南京市江宁区上江北路105号中环国际1413室
 法定代表人：吴月华
 电话：025-66046166/87837
 传真：025-66663409
 客服电话：025-66693409
 网址：www.huilinbd.com

(101) 腾安基金销售（深圳）有限公司
 注册地址：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
 办公地址：深圳市福田区福海街道福海社区福海一路2号33号腾讯大厦海大
 法定代表人：黄俊杰
 联系人：秦晓
 电话：0755-23981999
 客服电话：400-669-5666
 网址：www.wne06.com.cn

(102) 苏州蚂蚁基金销售有限公司
 注册地址：苏州工业园区华园路188918幢1003室
 办公地址：苏州姑苏区苏润路1559号7楼1101室
 法定代表人：高志华
 联系人：张君
 电话：0512-68603767、18516765123
 客服电话：0512-68603767
 网址：www.zaif.com

(103) 上海凯石财富基金销售有限公司
 注册地址：上海市黄浦区金陵路190号凯石大厦
 办公地址：上海市浦东新区延安东路1号凯石大厦
 法定代表人：陈健武
 联系人：高洁群
 联系电话：021-63333389
 客服电话：400 643 3389
 网站：http://www.wstonewealth.com

(104) 国盛证券有限责任公司
 注册地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼
 办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼
 法定代表人：徐锦峰
 联系人：占文斌
 联系电话：0917-86283372
 客服电话：4008222111
 网址：http://www.gsyzq.com

(105) 上海浦东发展银行股份有限公司
 注册地址：上海市浦东新区银城中路200号18楼1814032室
 办公地址：上海市浦东新区世纪大道1196号世纪广场二座20层16层
 法定代表人：陈志英
 联系人：唐淑丽
 电话：021-63398816
 网站：http://www.pudongfund.com/

(二) 注册基金管理人
 名称：平安基金管理有限公司
 注册地址：深圳市福田區福田街道益田路033号平安金融中心34层
 办公地址：深圳市福田区福田街道益田路033号平安金融中心34层
 法定代表人：罗春香
 电话：0755-22620131
 传真：0755-23090088
 联系人：张平

(三) 出具法律意见书的律师事务所
 律师事务所：北京市京伦律师事务所
 地址：北京市海淀区长安门大街1号韦信时代中心C座1910
 负责人：曹冀
 电话：010-1110200110651368
 传真：010-68938189
 联系人：唐淑丽

(四) 基金名称
 平安日增利货币市场基金
 五、基金的投资
 货币市场基金
 六、基金的投资方式
 契约型开放式

(一) 投资目标
 在严格控制基金资产净值投资风险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。

(二) 投资范围
 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，期限一年以内（含一年）的银行存款、同业存单、债券回购、中期票据、短期融资券、资产支持证券、中国证监会允许基金管理人进行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，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入本基金投资范围。

(三) 投资策略
 本基金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，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的资产配置比例，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。

1. 整体资产配置策略
 本基金通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、短期资金市场状况等因素的分析，综合判断未来短期利率变动，对投资组合的平均剩余期限进行控制。

(1) 利率预期分析
 通过对利率预期、GDP、货币供应量、国际利率水平、金融监管政策取向等跟踪分析，形成对基本面的内部研判，同时，结合宏观经济运行、主要利率期限结构、银行间市场利率走势，主要机构投资者对短期投资倾向、债券供给、回购质押数量等，合理预期货币市场利率波动动态变化。

(2) 动态调整投资组合平均剩余期限
 根据利率预期分析，动态调整并控制投资组合平均剩余期限在120天以内。当市场利率看跌时，适度调整投资组合平均剩余期限，以赚取利率期限较长投资品种和利率期限较短品种之间的利差收益，把握无风险套利机会，包括：期限较短品种利率期限较长品种，降低组合整体利率风险，当市场利率上升时，则对延长投资组合平均剩余期限，增持利率剩余期限的投资品种，获取超额收益。

2. 类属资产配置策略
 类属资产配置指投资组合在各类投资品种如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例。作为现金管理工具本基金将选择各类投资品种的流动性、收益及风险特征，利用定价模型和定量分析方法，决定参与所投资品种和各类投资品种的资产配置比例及投资品种期限结构。

(1) 流动性分析
 通过对市场资金面、基金申赎期限的变化进行动态分析，确定本基金的流动性目标，在此基础上，基金管理人应在高流动性资产和相对流动性低资产之间寻找平衡，以满足组合的日常流动性需求。

(2) 收益-风险分析
 通过对各类投资品种的利差收益、利差变化、市场容量、信用等级情况、流动性风险、信用风险等因素来动态确定配置比例和投资组合，寻找具有投资价值、增持对低估值、价格将上升的，能给组合带来相对较高回报的类属，减持对高估值、价格将下降的，给组合带来相对较低回报的类属，借以取得较高的总回报。

3. 个券选择策略
 在个券选择层面，本基金将首先从安全性角度出发，优先选择利率、短期国债等高信用等级债券品种，以规避流动性风险。对于信用评级等级较高（符合法规规定的级别）的企业债、短期融资券等信用类债券，本基金也可以进行配置。除考虑安全性因素外，在其体的券种选择上，基金管理人将遵循以下原则：

(1) 根据到期期限的剩余期限、信用等级、流动性特征（流通总量、日均交易量）、流动性溢价等因素，选择流动性较好的品种；

(2) 根据个别债券的收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理）与同期限的配比，对照基金的投资收益要求决定是否纳入组合；

(3) 根据个别债券的流动性特征（发行总量、流通量、是否上市），决定投资总量。

(4) 若出现因市场原因所导致的收益率高于公允价值，则该券种价格出现低估，本基金将对该类低估值品种进行重点关注。

4. 流动性管理策略
 本基金作为现金管理工具，必须具备较高的流动性。基金管理人在密切关注基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日/月/年度等因素基础上，对投资组合的流动性进行优化管理。基金管理人将在遵循流动性优先的原则下，综合考虑基金资产流动性与收益性、流动性与信用风险的匹配比例，调整投资组合，持有高流动性的券种，正回购融资，降低组合久期等方式来调整基金资产流动性，以满足组合的基金资产要求。

5. 套利策略
 由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与差异，以及资金供求失衡导致的短期利率异常差异，使得货币市场上存在套利机会。本基金通过分析货币市场变动趋势、各市场利率品种之间的利差收益、把握无风险套利机会，包括：银行间和交易所市场利率的跨市场套利、在充分论证套利可行性的基础上的跨期限套利。基金管理人将在保证基金资产的安全性和流动性的前提下，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会，进行跨市、品种套利，以期获得安全的超额收益。

(四) 投资决策依据和决策程序
 1. 决策程序
 以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益为最高原则。

2. 决策程序
 (1) 公司可设立投资决策委员会，根据宏观经济和固定收益市场的具体情况决定基金固定收益资产的投资策略比例。

(2) 基金管理人应在投资决策委员会确定的战略资产配置比例下，根据市场情况对具体投资品种进行战术性调整；

(3) 基金应根据基金的投资目标、原则及比较基准，拟定各基金的资产配置和个别资产投资计划；

(4) 基金投资组合的建立和维护程序：【平安基金管理有限公司债券库管理制度】执行，基金管理人应在各基金债券库基础上构造本基金的投资组合；

(5) 集中交易策略按有关交易规则执行，并将有信息反馈给基金经理；

(6) 基金绩效评估和风险管理工作定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案；

(7) 风险管理委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况；基金绩效评估岗及风险管理岗重点监控基金投资组合的市场风险和流动性风险。

(五) 业绩比较基准
 本基金的业绩比较基准为：同期7天通知存款利率（税后）

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方可支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征，根据基金的投资范围、投资目标及流动性特征，选取同期7天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在中国证监会备案后变更业绩比较基准并基金公告。

(六) 风险控制
 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。

(七) 基金管理人代表基金行使权利的原则和方法
 1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2. 有利于基金财产的安全；

3. 通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利益关系的第三人牟取任何不当利益。

(八) 其他
 1. 投资组合
 (1) 投资组合遵守下列限制：
 ① 同一机构发行的债券，非金融企业债券融资工具及其作为原权益人持有的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过10%，国债、中央银行票据、政策性金融债除外；

(2) 本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

(3) 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，本基金投资组合中平均剩余期限不得超过交易日内日均不得超过120天，平均剩余期限不得超过240天；

(4) 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不得超过60 天，平均剩余存续期不得超过120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债等与56 个交易日内的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%；

(5) 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，投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债等与56 个交易日内的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；

(6) 本基金与由基金管理人管理的其他基金不得有一家公司的证券，不得超过该证券市值占基金资产净值的比例，不得超过该证券市值占基金资产净值的比例，不得超过该证券市值占基金资产净值的比例，不得超过该证券市值占基金资产净值的比例；

(7) 投资于具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的20%；投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的10%；

(8) 本基金持有的资产支持证券信用等级不得，不得超过该资产支持证券的信用评级；

(9) 中国证监会规定的其他比例限制。

(10) 中国证监会规定的其他比例限制。

(11) 中国证监会规定的其他比例限制。

(12) 中国证监会规定的其他比例限制。

(13) 中国证监会规定的其他比例限制。

(14) 中国证监会规定的其他比例限制。

(15) 中国证监会规定的其他比例限制。

(16) 中国证监会规定的其他比例限制。

(17) 中国证监会规定的其他比例限制。

(18) 中国证监会规定的其他比例限制。

(19) 中国证监会规定的其他比例限制。

(20) 中国证监会规定的其他比例限制。

(21) 中国证监会规定的其他比例限制。

(22) 中国证监会规定的其他比例限制。

(23) 中国证监会规定的其他比例限制。

(24) 中国证监会规定的其他比例限制。

(25) 中国证监会规定的其他比例限制。

(26) 中国证监会规定的其他比例限制。

(27) 中国证监会规定的其他比例限制。

1.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过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。

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	短期融资券	969,111,892.96	0.89
2	央行票据	—	—
3	金融债	6,762,466,980.07	4.80
	其中:政策性金融债	6,762,466,980.07	4.80
4	企业债	—	—
5	企业短期融资券	3,767,463,217.62	2.66
6	中期票据	111,643,590.42	0.08
7	同业存单	46,676,569,328.80	33.01
8	其他	—	—
9	合计	58,306,228,006.17	41.23
10	报告期内投资组合超过397天的浮动利率债券	258,798,666.43	0.18

1.6 报告期内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	102027	18国债177	23,600,000	2,360,076,387.69	1.67
2	11190059	CD059	15,000,000	1,491,386,105.66	1.06
3	11191606	19上银债行CD006	13,000,000	1,262,399,076.43	0.91
4	102029	18国债179	12,200,000	1,221,266,078.48	0.88
5	11181064	CD064	10,000,000	968,584,817.18	0.70
6	11191019	19上银债行CD109	9,000,000	896,142,129.92	0.63
7	160416	16国债16	8,000,000	800,189,401.57	0.57
8	11190008	CD008	7,000,000	696,649,968.80	0.49
9	11190004	19上银债行CD004	6,000,000	596,717,487.56	0.42
10	11180406	CD006	6,000,000	594,963,062.74	0.42

1.7 “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
报告期内偏离度的最大值(Et/254%-0.5%)的频次	0
报告期内偏离度的最小值	0.1228%
报告期内偏离度的平均值	0.0016%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的最大值	0.0091%

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%。

1.8 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

6	156126	国花01A	1,000,000.00	100,000,000.00	0.07
7	156087	花顺66A1	900,000.00	90,000,000.00	0.06
8	139485	信融05优	860,000.00	86,000,000.00	0.06
9	139248	万科26A1	800,000.00	80,052,436.13	0.06
10	116909	泓创01A	700,000.00	70,168,152.75	0.06