

# 太平日日鑫货币市场基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 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

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期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 2024 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                 | 2         |
| 1.2 目录.....                                   | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                          | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                               | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                               | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                          | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                               | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                               | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                          | 7         |
| 3.2 基金净值表现.....                               | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                         | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                         | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....               | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                  | 11        |
| 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.....              | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....              | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                 | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                  | 12        |
| 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.....        | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                         | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                   | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....  | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....       | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表.....                                | 13        |
| 6.2 利润表.....                                  | 14        |
| 6.3 净资产变动表.....                               | 15        |
| 6.4 报表附注.....                                 | 17        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                        | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                           | 40        |
| 7.2 债券回购融资情况.....                             | 40        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限.....                         | 41        |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....          | 42        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                     | 42        |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细..... | 42        |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....       | 43        |
| 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资   |           |

|   |           |
|---|-----------|
| 明细.....                                 | 43        |
| 7.9 投资组合报告附注.....                       | 43        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                | <b>44</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 44        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....             | 44        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 44        |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 45        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                | <b>45</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                  | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 46        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....   | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 46        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 46        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 46        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....              | 47        |
| 10.9 其他重大事件.....                        | 47        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>          | <b>48</b> |
| 11.1 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..... | 48        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 48        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                  | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 48        |
| 12.2 存放地点.....                          | 49        |
| 12.3 查阅方式.....                          | 49        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 太平日日鑫货币市场基金        |                    |
| 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      | 7,606,035,336.30 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 | 239,391,841.23 份   | 7,366,643,495.07 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 | <p>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。</p> <p>1、资产配置策略<br/>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组合，并适时进行动态调整。</p> <p>2、利率预期策略<br/>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。</p> <p>3、期限配置策略<br/>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。</p> <p>4、流动性管理策略<br/>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。</p> <p>5、套利策略本基金根据对货币市场变动趋势、各市场和品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</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>作，力争提高资产收益率，具体策略包括跨市场套利和跨期限套利等。</p> <p>6、资产支持证券的投资策略</p> <p>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积极调整投资策略，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。</p> <p>7、非金融企业债务融资工具的投资策略</p> <p>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。</p> <p>8、同业存单的投资策略</p> <p>本基金将结合商业银行的不同资质和同业存单剩余期限进行同业存单的投资，注重同业存单的安全性、交易的流动性和收益率的比较，严格恪守法律法规和基金合同的约定。</p> |
| 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<br>负责人 | 姓名   | 赵霖                          | 袁耀光                |
|             | 联系电话 | 021-38556613                | 010-58560666       |
|             | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn  | tgxxpl@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 021-61560999/400-028-8699   | 95568              |
| 传真          |      | 021-38556677                | 010-57093382       |
| 注册地址        |      | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室   | 北京市西城区复兴门内大街 2 号   |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号   |
| 邮政编码        |      | 200120                      | 100031             |
| 法定代表人       |      | 焦艳军                         | 高迎欣                |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》                     |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.taipingfund.com.cn      |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼 |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                        |
|--------|------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 太平基金管理有限公司 | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼 |

### § 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(2024年1月1日-2024年6月30日) |                |
|---------------|---------------------------|----------------|
|               | 太平日日鑫 A                   | 太平日日鑫 B        |
| 本期已实现收益       | 2,875,120.23              | 62,709,821.41  |
| 本期利润          | 2,875,120.23              | 62,709,821.41  |
| 本期净值收益率       | 0.8784%                   | 0.9995%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024年6月30日)          |                |
|               | 期末基金资产净值                  | 239,391,841.23 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                    | 1.0000         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2024年6月30日)          |                |
|               | 累计净值收益率                   | 19.0688%       |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

| 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 | 0.1382%  | 0.0017%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0272% | 0.0017% |

|            |          |         |         |         |         |         |
|------------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去三个月      | 0.3969%  | 0.0012% | 0.3366% | 0.0000% | 0.0603% | 0.0012% |
| 过去六个月      | 0.8784%  | 0.0017% | 0.6732% | 0.0000% | 0.2052% | 0.0017% |
| 过去一年       | 1.8303%  | 0.0023% | 1.3537% | 0.0000% | 0.4766% | 0.0023% |
| 过去三年       | 5.5553%  | 0.0021% | 4.0537% | 0.0000% | 1.5016% | 0.0021% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.0688% | 0.0036% | 9.8568% | 0.0000% | 9.2120% | 0.0036% |

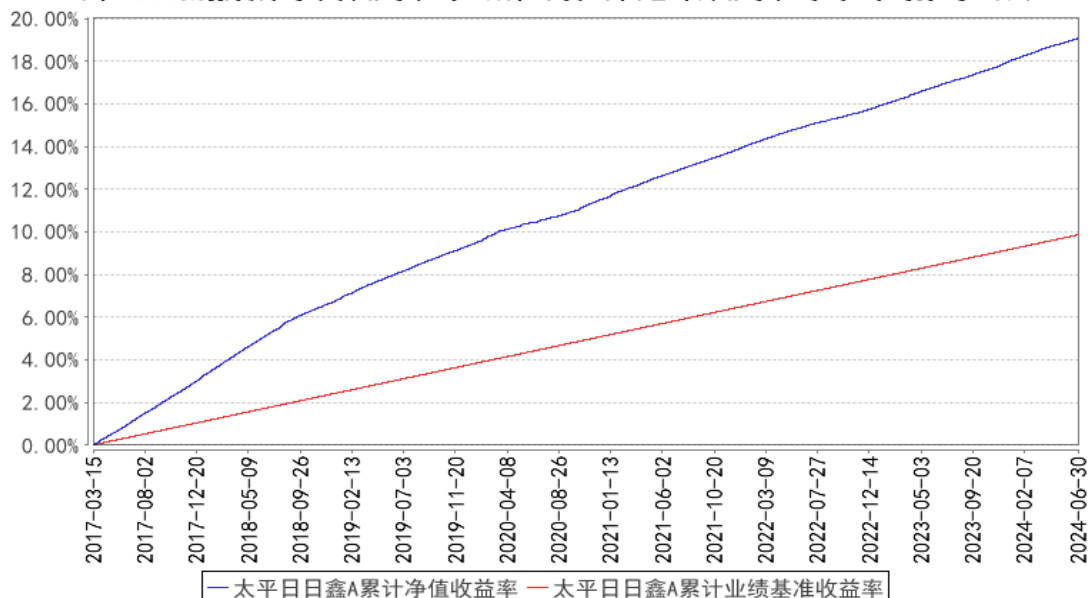
太平日日鑫 B

| 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      | 0.1579%  | 0.0017%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0469%  | 0.0017% |
| 过去三个月      | 0.4570%  | 0.0012%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.1204%  | 0.0012% |
| 过去六个月      | 0.9995%  | 0.0017%     | 0.6732%    | 0.0000%       | 0.3263%  | 0.0017% |
| 过去一年       | 2.0761%  | 0.0023%     | 1.3537%    | 0.0000%       | 0.7224%  | 0.0023% |
| 过去三年       | 6.3192%  | 0.0021%     | 4.0537%    | 0.0000%       | 2.2655%  | 0.0021% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.1800% | 0.0036%     | 9.8568%    | 0.0000%       | 11.3232% | 0.0036% |

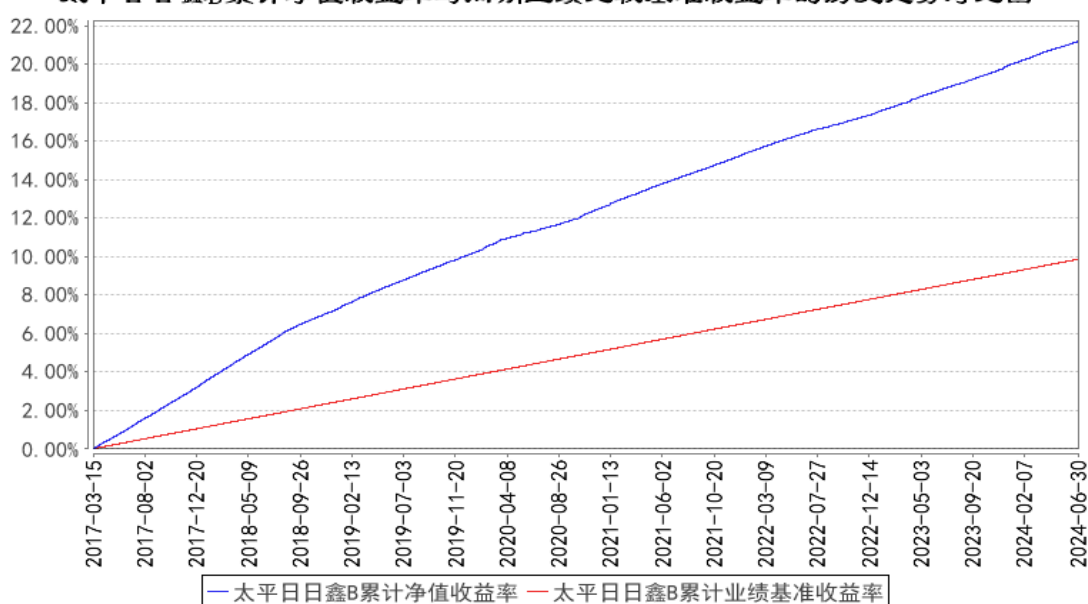


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

太平日日鑫A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



太平日日鑫B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2017 年 3 月 15 日生效。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，2016 年 8 月 22 日更名为太平基金管理有限公司。截至本报告期末，公司注册资本为人民币 6.5 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 56.31%，太平人寿保险有限公司出资占注册资本 38.46%，安石投资管理有限公司出资占注册资本 5.23%。

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。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 39 只证券投资基金。

#### 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 |        |  |
| 朱燕琼 | 本基金的基金经理 | 2023 年 4 月 10 日 | -    | 10 年   | 北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013 年 7 月起先后任埃克森美孚（中国）投资有限公司财务分析师、兴业国际信托有限公司投资经理、平安证券股份有限公司投资经理。2022 年 8 月加入本公司，现任固定收益投资部基金经理。2023 年 3 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。2023 年 4 月 10 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。2023 年 7 月 13 日起任太平恒睿纯债债券型证券投资基金基金经理。 |

注：1、基金经理的任职日期、离任日期一般情况下根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；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、证券基金从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定；

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

#### 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 1 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

2024 年上半年，资金面平稳偏松，债券市场收益率整体下行。一季度，债券市场在资金面、基本面、供求关系等因素推动下，1-2 月利率顺畅下行，长端期限利差持续压缩，3 月由于经济边际改善、央行减少 OMO 投放量、机构行为等因素，利率由快速下行进入盘整阶段。二季度，基本面走弱，PMI 5-6 月再次下行至荣枯线之下，外需有所回落，内需相对不足。结构上较一季度有所变化，利率债中短端强于长端，曲线牛陡。非银偏好品种表现相对更强，政金债表现好于国债，信用债表现好于利率债，信用利差压缩至历史低位。

本基金以同业存单、存款、高等级信用债和逆回购等资产为主要投资标的，根据市场情况综合比较各类资产的性价比，灵活调整各类资产的配置比例和期限分布。报告期内，本基金在遵守基金合同、控制风险的前提下，为投资者取得了符合货币基金特征的风险收益比。

#### 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 0.8784%，同期业绩比较基准为 0.6732%；太平日日鑫 B 的净值收益率为 0.9995%，同期业绩比较基准为 0.6732%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济仍是弱复苏状态，实体经济有效融资需求不足，企业、居民加杠杆意

愿偏低。随着稳增长压力有所加大，宏观政策调控力度或将加强，货币政策预计仍将平稳偏松，支持实体经济、配合财政发力。上半年利率债一级供给进度不及预期，预计下半年将加快进度，缓解今年以来债券市场的阶段性供需失衡。总体来看，下半年债券市场整体风险不大，但估值愈发极致下市场波动或将加剧。可以适当博弈市场波动带来的波段性交易机会。

#### 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，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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。公司管理层下设立估值委员会，常任委员由公司总经理、分管投资部门、研究部、运营部高管及稽核风控部、投资部门（含权益投资部、专户业务部、固定收益投资部）、研究部、基金运营部等部门负责人担任。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《太平日日鑫货币市场基金基金合同》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 2,875,120.23 元，B 级分配收益 62,709,821.41 元，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，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，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，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关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约定进行。

## 5.3 托管人对本中期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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 货币资金       | 6.4.7.1 | 1,290,029,878.01       | 289,175,102.81           |
| 结算备付金      |         | -                      | 9,290,132.71             |
| 存出保证金      |         | 21,887.54              | 18,160.18                |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 3,741,244,061.36       | 5,181,164,000.67         |
| 其中：股票投资    |         | -                      | -                        |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 3,711,687,773.01       | 5,139,824,588.33         |
| 资产支持证券投资   |         | 29,556,288.35          | 41,339,412.34            |
| 贵金属投资      |         | -                      | -                        |
| 其他投资       |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | 2,494,447,675.61       | 2,766,449,249.02         |
| 债权投资       | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 其中：债券投资    |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 其他投资       |         | -                      | -                        |
| 其他债权投资     | 6.4.7.6 | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资   | 6.4.7.7 | -                      | -                        |
| 应收清算款      |         | -                      | -                        |
| 应收股利       |         | -                      | -                        |
| 应收申购款      |         | 82,200,067.88          | 28,044,980.47            |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 7,607,943,570.40          | 8,274,141,625.86            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2023年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>   |            |                           |                             |
| 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     |            | -                         | 75,213,939.77               |
| 应付清算款         |            | -                         | 3,058,646.71                |
| 应付赎回款         |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 1,301,808.70              | 1,011,181.41                |
| 应付托管费         |            | 260,361.74                | 202,236.26                  |
| 应付销售服务费       |            | 100,858.91                | 127,878.18                  |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | 52,208.79                 | 65,048.18                   |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 192,995.96                | 295,092.25                  |
| 负债合计          |            | 1,908,234.10              | 79,974,022.76               |
| <b>净资产:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 7,606,035,336.30          | 8,194,167,603.10            |
| 未分配利润         | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 净资产合计         |            | 7,606,035,336.30          | 8,194,167,603.10            |
| 负债和净资产总计      |            | 7,607,943,570.40          | 8,274,141,625.86            |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 7,606,035,336.30 份，其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，A 类基金份额 239,391,841.23 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，B 类基金份额 7,366,643,495.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：太平日日鑫货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目            | 附注号      | 本期<br>2024年1月1日至2024<br>年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023<br>年6月30日 |
|----------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b> |          | 78,204,931.32                  | 74,361,877.88                       |
| 1. 利息收入        |          | 34,853,667.71                  | 22,036,308.61                       |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.12 | 11,997,476.93                  | 213,490.39                          |
| 债券利息收入         |          | -                              | -                                   |
| 资产支持证券利息       |          | -                              | -                                   |

|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 收入                         |            |               |               |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 22,856,190.78 | 21,822,818.22 |
| 其他利息收入                     |            | -             | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 43,351,263.61 | 52,325,569.27 |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.13   | -             | -             |
| 基金投资收益                     |            | -             | -             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.14   | 42,803,441.88 | 52,210,445.60 |
| 资产支持证券投资                   | 6.4.7.15   | 547,821.73    | 115,123.67    |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.16   | -             | -             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.17   | -             | -             |
| 股利收益                       | 6.4.7.18   | -             | -             |
| 其他投资收益                     |            | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.19   | -             | -             |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.20   | -             | -             |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 12,619,989.68 | 12,895,950.81 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 8,259,506.88  | 7,353,203.83  |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -             | -             |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 1,651,901.37  | 1,470,640.78  |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 721,796.79    | 526,527.10    |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -             |
| 5. 利息支出                    |            | 1,855,301.90  | 3,410,901.38  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 1,855,301.90  | 3,410,901.38  |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.21   | -             | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | 26,358.12     | 36,102.68     |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.22   | 105,124.62    | 98,575.04     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 65,584,941.64 | 61,465,927.07 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 65,584,941.64 | 61,465,927.07 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 65,584,941.64 | 61,465,927.07 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：太平日日鑫货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日      |        |                |                    |
|--|--|--------|----------------|--------------------|
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                                | 8,194,167,603.10                           | -      | -              | 8,194,167,603.10   |
| 二、本期期初净资产                                | 8,194,167,603.10                           | -      | -              | 8,194,167,603.10   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -588,132,266.80                            | -      | -              | -588,132,266.80    |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | 65,584,941.64  | 65,584,941.64      |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -588,132,266.80                            | -      | -              | -588,132,266.80    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 11,913,171,115.96                          | -      | -              | 11,913,171,115.96  |
| 2. 基金赎回款                                 | -12,501,303,382.76                         | -      | -              | -12,501,303,382.76 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -  | -      | -65,584,941.64 | -65,584,941.64     |
| 四、本期期末净资产                                | 7,606,035,336.30                           | -      | -              | 7,606,035,336.30   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |        |                |                    |
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                                | 10,747,061,607.21                          | -      | -              | 10,747,061,607.21  |
| 二、本期期初净资产                                | 10,747,061,607                             | -      | -              | 10,747,061,607     |



|  |                    |   |                |                    |
|--|--------------------|---|----------------|--------------------|
|  | .21                |   |                | 21                 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -5,546,657,558.88  | - | -              | -5,546,657,558.88  |
| (一)、综合收益总额                               | -                  | - | 61,465,927.07  | 61,465,927.07      |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -5,546,657,558.88  | - | -              | -5,546,657,558.88  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 8,337,546,502.06   | - | -              | 8,337,546,502.06   |
| 2. 基金赎回款                                 | -13,884,204,060.94 | - | -              | -13,884,204,060.94 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                  | - | -61,465,927.07 | -61,465,927.07     |
| 四、本期期末净资产                                | 5,200,404,048.33   | - | -              | 5,200,404,048.33   |

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：

曹琦

邓先虎

王瑞瑾

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》注册,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,因此形成不同的基金份额类别。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)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 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财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024年6月30日 |
|----|-------------------|
|----|-------------------|

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 活期存款           | 1,198,647.23     |
| 等于：本金          | 1,197,817.80     |
| 加：应计利息         | 829.43           |
| 减：坏账准备         | -                |
| 定期存款           | 1,288,831,230.78 |
| 等于：本金          | 1,284,000,000.00 |
| 加：应计利息         | 4,831,230.78     |
| 减：坏账准备         | -                |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 44,007,223.34    |
| 存款期限 1-3 个月    | 200,082,083.34   |
| 存款期限 3 个月以上    | 1,044,741,924.10 |
| 其他存款           | -                |
| 等于：本金          | -                |
| 加：应计利息         | -                |
| 减：坏账准备         | -                |
| 合计             | 1,290,029,878.01 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 |        | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |                  |              |         |
|----|--------|------------------------|------------------|--------------|---------|
|    |        | 按实际利率计算的账面价值           | 影子定价             | 偏离金额         | 偏离度 (%) |
| 债券 | 交易所市场  | 90,722,851.42          | 90,723,535.89    | 684.47       | 0.0000  |
|    | 银行间市场  | 3,620,964,921.59       | 3,623,091,011.54 | 2,126,089.95 | 0.0280  |
|    | 合计     | 3,711,687,773.01       | 3,713,814,547.43 | 2,126,774.42 | 0.0280  |
|    | 资产支持证券 | 29,556,288.35          | 29,581,288.35    | 25,000.00    | 0.0003  |
|    | 合计     | 3,741,244,061.36       | 3,743,395,835.78 | 2,151,774.42 | 0.0283  |

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金于本报告期末未持有任何期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金于本报告期末未持有任何黄金衍生品。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                 | -         |
| 银行间市场 | 2,494,447,675.61  | -         |
| 合计    | 2,494,447,675.61  | -         |

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末未计提减值准备。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

## 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|             | 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -               |
| 应付赎回费       | -               |
| 应付证券出借违约金   | -               |
| 应付交易费用      | 97,171.34       |
| 其中：交易所市场    | -               |
| 银行间市场       | 97,171.34       |
| 应付利息        | -               |
| 预提信息披露费     | 59,672.34       |
| 预提审计费       | 26,852.28       |
| 预提账户维护费     | 9,300.00        |
| 合计          | 192,995.96      |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 太平日日鑫 A

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 580,418,715.37                        | 580,418,715.37  |
| 本期申购          | 467,154,212.14                        | 467,154,212.14  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -808,181,086.28                       | -808,181,086.28 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -               |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -               |
| 本期申购          | -                                     | -               |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -               |
| 本期末           | 239,391,841.23                        | 239,391,841.23  |

## 太平日日鑫 B

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                    |
|---------------|---------------------------------------|--------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额               |
| 上年度末          | 7,613,748,887.73                      | 7,613,748,887.73   |
| 本期申购          | 11,446,016,903.82                     | 11,446,016,903.82  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -11,693,122,296.48                    | -11,693,122,296.48 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -                  |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -                  |
| 本期申购          | -                                     | -                  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                  |
| 本期末           | 7,366,643,495.07                      | 7,366,643,495.07   |

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

## 太平日日鑫 A

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 2,875,120.23  | -     | 2,875,120.23  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -             | -     | -             |
| 其中：基金申购款       | -             | -     | -             |
| 基金赎回款          | -             | -     | -             |
| 本期已分配利润        | -2,875,120.23 | -     | -2,875,120.23 |
| 本期末            | -             | -     | -             |

## 太平日日鑫 B

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 上年度末           | -              | -     | -              |
| 本期期初           | -              | -     | -              |
| 本期利润           | 62,709,821.41  | -     | 62,709,821.41  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -              | -     | -              |
| 其中：基金申购款       | -              | -     | -              |
| 基金赎回款          | -              | -     | -              |
| 本期已分配利润        | -62,709,821.41 | -     | -62,709,821.41 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

## 6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 活期存款利息收入  | 14,302.66            |
| 定期存款利息收入  | 11,957,147.81        |
| 其他存款利息收入  | -                    |
| 结算备付金利息收入 | 25,792.48            |
| 其他        | 233.98               |
| 合计        | 11,997,476.93        |

## 6.4.7.13 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

## 6.4.7.14 债券投资收益

## 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                   |
|------------------------------|----------------------|
|                              | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 38,619,347.53        |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,184,094.35         |

|                |               |
|----------------|---------------|
| 债券投资收益——赎回差价收入 | -             |
| 债券投资收益——申购差价收入 | -             |
| 合计             | 42,803,441.88 |

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 8,986,397,298.18           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 8,913,066,457.68           |
| 减：应计利息总额               | 69,146,746.15              |
| 减：交易费用                 | -                          |
| 买卖债券差价收入               | 4,184,094.35               |

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|--------------------------|----------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入         | 547,821.73                 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | -                          |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入       | -                          |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入       | -                          |
| 合计                       | 547,821.73                 |

##### 6.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 42,007,132.06              |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 40,640,000.00              |
| 减：应计利息总额       | 1,367,132.06               |
| 减：交易费用         | -                          |
| 资产支持证券投资收益     | -                          |



**6.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益申购差价收入。

**6.4.7.16 贵金属投资收益****6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益申购差价收入。

**6.4.7.17 衍生工具收益****6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

**6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益其他投资收益。

**6.4.7.18 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.19 公允价值变动收益**

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

**6.4.7.20 其他收入**

本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.21 信用减值损失**

本基金本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.22 其他费用**

单位：人民币元

| 项目    | 本期                   |
|-------|----------------------|
|       | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 审计费用  | 26,852.28            |
| 信息披露费 | 59,672.34            |

|           |            |
|-----------|------------|
| 证券出借违约金   | -          |
| 债券托管账户维护费 | 18,600.00  |
| 合计        | 105,124.62 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本基金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。

##### 6.4.9.2 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      |
| 太平人寿保险有限公司（“太平人寿”）     | 基金管理人的股东          |

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 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。

###### 6.4.10.1.4 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。

###### 6.4.10.1.5 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未有应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                  | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 8,259,506.88                    | 7,353,203.83                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 876,706.51                      | 496,116.77                      |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 7,382,800.37                    | 6,857,087.06                    |

注：支付基金管理人太平基金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×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,651,901.37                    | 1,470,640.78                    |

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×0.05%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 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                              |            |            |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 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         | 2,051.12                        | 260.59     | 2,311.71   |
| 太平基金直销         | 14,014.48                       | 269,593.42 | 283,607.90 |
| 合计             | 16,065.60                       | 269,854.01 | 285,919.61 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |            |            |
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 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   | 2,669.31                        | 254.32     | 2,923.63   |
| 太平基金管理有限公司     | 24,811.25                       | 231,343.81 | 256,155.06 |
| 合计             | 27,480.56                       | 231,598.13 | 259,078.69 |

注：支付销售机构的基金销售服务费按前一日太平日日鑫 A 类份额基金资产净值 0.25%和前一日

太平日日鑫 B 类份额基金资产净值 0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

太平日日鑫 A 日基金销售服务费=前一日 A 类基金资产净值×0.25%/当年天数

太平日日鑫 B 日基金销售服务费=前一日 B 类基金资产净值×0.01%/当年天

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6<br>月 30 日      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30<br>日      |
|---------------------------------|---|---|
|                                 | 太平日日鑫 A                                       | 太平日日鑫 B                                       |
| 基金合同生效日（2017 年 3 月 15 日）持有的基金份额 | -   | -   |
| 报告期初持有的基金份额                     | -   | 201,858,530.89                                |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -   | 1,936,770.73                                  |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -   | -   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份<br>额              | -   | 24,001,325.00                                 |
| 报告期末持有的基金份额                     | -   | 179,793,976.62                                |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例         | -   | 2.4406%                                       |
| 项目                              | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30<br>日 |
|                                 | 太平日日鑫 A                                       | 太平日日鑫 B                                       |
| 基金合同生效日（2017 年 3 月 15 日）持有的基金份额 | -   | -   |
| 报告期初持有的基金份额                     | -   | 247,013,763.00                                |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -   | 20,686,946.27                                 |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -   | -   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份<br>额              | -   | 10,000,636.89                                 |
| 报告期末持有的基金份额                     | -   | 257,700,072.38                                |

|                         |         |         |
|-------------------------|---------|---------|
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 0.0000% | 5.3008% |
|-------------------------|---------|---------|

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |           |
|--------|----------------------------|------------|---------------------------------|-----------|
|        | 期末余额                       | 当期利息收入     | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 中国民生银行 | 51,570,522.23              | 731,844.33 | 1,192,015.45                    | 13,500.95 |

注：本基金的活期银行存款及部分协议存款由基金托管人中国民生银行保管，活期存款按银行同业利率计息，协议存款按约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 太平日日鑫 A          |                   |              |               |    |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计  | 备注 |
| 2,875,120.23     | -                 | -            | 2,875,120.23  | -  |
| 太平日日鑫 B          |                   |              |               |    |
| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计  | 备注 |
| 62,709,821.41    | -                 | -            | 62,709,821.41 | -  |

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：债券 |                  |                       |             |                            |                  |                            |                              |                            |                            |        |
|----------------------|------------------|-----------------------|-------------|----------------------------|------------------|----------------------------|------------------------------|----------------------------|----------------------------|--------|
| 证券<br>代码             | 证<br>券<br>名<br>称 | 成<br>功<br>认<br>购<br>日 | 受<br>限<br>期 | 流<br>通<br>受<br>限<br>类<br>型 | 认<br>购<br>价<br>格 | 期<br>末<br>估<br>值<br>单<br>价 | 数<br>量<br>（<br>单<br>位：<br>张） | 期<br>末<br>成<br>本<br>总<br>额 | 期<br>末<br>估<br>值<br>总<br>额 | 备<br>注 |
| 148790               | 24               | 2024                  | 1-6个        | 新                          | 100.00           | 100.03                     | 200,000                      | 20,000,000.00              | 20,006,075.62              | -      |

|  |              |                  |      |                  |  |  |  |  |  |  |
|--|--------------|------------------|------|------------------|--|--|--|--|--|--|
|  | 广<br>发<br>D6 | 年 6<br>月 24<br>日 | 月(含) | 债<br>未<br>上<br>市 |  |  |  |  |  |  |
|--|--------------|------------------|------|------------------|--|--|--|--|--|--|

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资于货币市场工具，每万份基金已实现收益会因为货币市场波动等因素产生波动。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。本基金面临的主要风险是市场风险、信用风险、流动性风险。其中本基金的市场风险主要是利率风险。本基金基金管理人风险管理的目标是通过对于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。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门在内的多级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会主要负责确定公司风险管理总体目标、制定公司风险管理战略和风险应对策略等事项。经营管理层及其下设的风险控制委员会负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告确定风险损失的限度和相应置信程度，及

时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人，其他定期存款存放在具有基金托管资格的华夏银行股份有限公司、上海银行股份有限公司以及广发银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交割和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 50,046,053.70          | 50,043,899.63            |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 876,429,685.44         | 1,192,237,173.08         |
| 合计     | 926,475,739.14         | 1,242,281,072.71         |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、短期未评级债券为金融债、短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 29,556,288.35          | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | -                      | -                        |

|    |               |   |
|----|---------------|---|
| 合计 | 29,556,288.35 | - |
|----|---------------|---|

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 2,000,894,705.30  | 3,218,070,577.57    |
| 合计     | 2,000,894,705.30  | 3,218,070,577.57    |

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 390,803,451.07    | 494,283,432.70      |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 393,513,877.50    | 185,189,505.35      |
| 合计     | 784,317,328.57    | 679,472,938.05      |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、长期未评级债券为政策性金融债等。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | -                 | 41,339,412.34       |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | -                 | 41,339,412.34       |

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者



连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于本期末，本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大；除此之外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；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，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；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在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 52.37%，本基金投资组合的平均剩余期限为 57 天，平均剩余存续期为 58 天。本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例大于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有流动性受限资产的市

值合计未超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本<br>期<br>末<br>202<br>4<br>年<br>6<br>月<br>30<br>日 | 1 个月以内           | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计               |
|---|------------------|--------|----------|-------|-------|-----|------------------|
| 资<br>产  |                  |        |          |       |       |     |                  |
| 货<br>币<br>资<br>金                                  | 1,290,029,878.01 | -      | -        | -     | -     | -   | 1,290,029,878.01 |
| 存   | 21,887.54        | -      | -        | -     | -     | -   | 21,887.54        |

|          |                  |                  |                |   |   |               |                  |
|----------|------------------|------------------|----------------|---|---|---------------|------------------|
| 出保证金     |                  |                  |                |   |   |               |                  |
| 交易性金融资产  | 304,227,746.45   | 2,606,964,272.46 | 830,052,042.45 | - | - | -             | 3,741,244,061.36 |
| 买入返售金融资产 | 2,494,447,675.61 | -                | -              | - | - | -             | 2,494,447,675.61 |
| 应收申购款    | -                | -                | -              | - | - | 82,200,067.88 | 82,200,067.88    |
| 资产总计     | 4,088,727,187.61 | 2,606,964,272.46 | 830,052,042.45 | - | - | 82,200,067.88 | 7,607,943,570.40 |
| 负债       |                  |                  |                |   |   |               |                  |
| 应付管理人报酬  | -                | -                | -              | - | - | 1,301,808.70  | 1,301,808.70     |
| 应付托管费    | -                | -                | -              | - | - | 260,361.74    | 260,361.74       |
| 应付销售     | -                | -                | -              | - | - | 100,858.91    | 100,858.91       |

|   |                  |                  |                |      |      |               |                  |
|---|------------------|------------------|----------------|------|------|---------------|------------------|
| 售<br>服<br>务<br>费                                    |                  |                  |                |      |      |               |                  |
| 应<br>交<br>税<br>费                                    | -                | -                | -              | -    | -    | 52,208.79     | 52,208.79        |
| 其<br>他<br>负<br>债                                    | -                | -                | -              | -    | -    | 192,995.96    | 192,995.96       |
| 负<br>债<br>总<br>计                                    | -                | -                | -              | -    | -    | 1,908,234.10  | 1,908,234.10     |
| 利<br>率<br>敏<br>感<br>度<br>缺<br>口                     | 4,088,727,187.61 | 2,606,964,272.46 | 830,052,042.45 | -    | -    | 80,291,833.78 | 7,606,035,336.30 |
| 上<br>年<br>度<br>末<br>202<br>3年<br>12<br>月<br>31<br>日 | 1个月以内            | 1-3个月            | 3个月-1年         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计               |
| 资<br>产  |                  |                  |                |      |      |               |                  |
| 货<br>币<br>资<br>金                                    | 289,175,102.81   | -                | -              | -    | -    | -             | 289,175,102.81   |
| 结<br>算<br>备<br>付<br>金                               | 9,290,132.71     | -                | -              | -    | -    | -             | 9,290,132.71     |
| 存   | 18,160.18        | -                | -              | -    | -    | -             | 18,160.18        |

|          |                  |                  |                  |   |   |                  |                  |
|----------|------------------|------------------|------------------|---|---|------------------|------------------|
| 出保证金     |                  |                  |                  |   |   |                  |                  |
| 交易性金融资产  | 407,311,953.74   | 3,223,778,122.32 | 1,550,073,924.61 | - | - | 5,181,164,000.67 |                  |
| 买入返售金融资产 | 2,766,449,249.02 | -                | -                | - | - | 2,766,449,249.02 |                  |
| 应收申购款    | -                | -                | -                | - | - | 28,044,980.47    | 28,044,980.47    |
| 资产总计     | 3,472,244,598.46 | 3,223,778,122.32 | 1,550,073,924.61 | - | - | 28,044,980.47    | 8,274,141,625.86 |
| 负债       |                  |                  |                  |   |   |                  |                  |
| 应付管理人报酬  | -                | -                | -                | - | - | 1,011,181.41     | 1,011,181.41     |
| 应付托管费    | -                | -                | -                | - | - | 202,236.26       | 202,236.26       |
| 应付清算     | -                | -                | -                | - | - | 3,058,646.71     | 3,058,646.71     |

|           |                  |                  |                  |   |   |               |                  |
|-----------|------------------|------------------|------------------|---|---|---------------|------------------|
| 算款        |                  |                  |                  |   |   |               |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 75,213,939.77    | -                | -                | - | - | -             | 75,213,939.77    |
| 应付销售服务费   | -                | -                | -                | - | - | 127,878.18    | 127,878.18       |
| 应交税费      | -                | -                | -                | - | - | 65,048.18     | 65,048.18        |
| 其他负债      | -                | -                | -                | - | - | 295,092.25    | 295,092.25       |
| 负债总计      | 75,213,939.77    | -                | -                | - | - | 4,760,082.99  | 79,974,022.76    |
| 利率敏感度缺口   | 3,397,030,658.69 | 3,223,778,122.32 | 1,550,073,924.61 | - | - | 23,284,897.48 | 8,194,167,603.10 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                       |
|----|---------------------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况           |
|    | 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之 |

|    |                                    |                             |                        |
|----|------------------------------------|-----------------------------|------------------------|
|    | 外的其他市场变量保持不变                       |                             |                        |
|    | 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动 |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动                          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                    | 本期末（2024 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点                   | 2, 131, 808. 23             | 2, 997, 330. 49        |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点                   | -2, 125, 022. 58            | -2, 987, 726. 58       |

#### 6. 4. 13. 4. 2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6. 4. 13. 4. 4 采用风险价值法管理风险

无。

### 6. 4. 14 公允价值

#### 6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

|               |                        |                          |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|

|      |                  |                  |
|------|------------------|------------------|
| 第一层次 | -                | -                |
| 第二层次 | 3,741,244,061.36 | 5,181,164,000.67 |
| 第三层次 | -                | -                |
| 合计   | 3,741,244,061.36 | 5,181,164,000.67 |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                    | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-----------------------|------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资                | 3,741,244,061.36 | 49.18         |
|    | 其中：债券                 | 3,711,687,773.01 | 48.79         |
|    | 资产支持证<br>券            | 29,556,288.35    | 0.39          |
| 2  | 买入返售金融资产              | 2,494,447,675.61 | 32.79         |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                | -             |
| 3  | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 1,290,029,878.01 | 16.96         |
| 4  | 其他各项资产                | 82,221,955.42    | 1.08          |
| 5  | 合计                    | 7,607,943,570.40 | 100.00        |

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元



| 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 | 2.79           |                |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              |                |
| 序号 | 项目           | 金额             | 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：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银行间市场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

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 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    | 57 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 60 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 43 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 7.3.2 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                 | 39.77               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 12.41               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 30.84               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 2.76                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 13.16               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 98.94               | -                   |

#### 7.4 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期限未超过 240 天。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种                 | 按实际利率计算的账面价值     | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券                 | -                | -             |
| 2  | 央行票据                 | -                | -             |
| 3  | 金融债券                 | 750,085,205.41   | 9.86          |
|    | 其中：政策性金融债            | 392,946,359.04   | 5.17          |
| 4  | 企业债券                 | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券              | 825,646,880.40   | 10.86         |
| 6  | 中期票据                 | 135,060,981.90   | 1.78          |
| 7  | 同业存单                 | 2,000,894,705.30 | 26.31         |
| 8  | 其他                   | -                | -             |
| 9  | 合计                   | 3,711,687,773.01 | 48.80         |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -             |

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量(张)   | 按实际利率计算的账面价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|-----------|-----------------|---------------|
| 1  | 210409    | 21 农发 09      | 2,500,000 | 250,514,058.18  | 3.29          |
| 2  | 012481074 | 24 电网 SCP012  | 1,000,000 | 100,464,188.90  | 1.32          |
| 3  | 112303179 | 23 农业银行 CD179 | 1,000,000 | 99,772,508.42   | 1.31          |
| 4  | 112385154 | 23 广州银行 CD072 | 1,000,000 | 99,760,286.94   | 1.31          |
| 5  | 112405193 | 24 建设银行 CD193 | 1,000,000 | 99,595,021.66   | 1.31          |
| 6  | 112414131 | 24 江苏银行 CD131 | 1,000,000 | 99,585,798.77   | 1.31          |
| 7  | 112410180 | 24 兴业银行 CD180 | 1,000,000 | 99,561,815.61   | 1.31          |
| 8  | 112403166 | 24 农业银行 CD166 | 1,000,000 | 99,556,337.90   | 1.31          |
| 9  | 112497765 | 24 南京银行       | 1,000,000 | 99,379,699.11   | 1.31          |

|    |           |                  |           |               |      |
|----|-----------|------------------|-----------|---------------|------|
|    |           | CD095            |           |               |      |
| 10 | 112317254 | 23 光大银行<br>CD254 | 1,000,000 | 99,370,594.13 | 1.31 |

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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                   | 0.0683% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0283% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0485% |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

### 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（份）   | 按实际利率计算的<br>账面价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|------------------|--------------|
| 1  | 261155 | 工瑞 4A31 | 200,000 | 19,496,145.88    | 0.26         |
| 2  | 261866 | 工瑞 3A32 | 100,000 | 10,060,142.47    | 0.13         |

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。

#### 7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、广州银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 21,887.54 |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 2 | 应收清算款 | -             |
| 3 | 应收利息  | -             |
| 4 | 应收申购款 | 82,200,067.88 |
| 5 | 其他应收款 | -             |
| 6 | 待摊费用  | -             |
| 7 | 其他    | -             |
| 8 | 合计    | 82,221,955.42 |

#### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别    | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额     | 持有人结构            |            |                |            |
|---------|-----------|---------------|------------------|------------|----------------|------------|
|         |           |               | 机构投资者            |            | 个人投资者          |            |
|         |           |               | 持有份额             | 占总份额比例 (%) | 持有份额           | 占总份额比例 (%) |
| 太平日日鑫 A | 32,045    | 7,470.49      | 20,517,175.17    | 8.5705     | 218,874,666.06 | 91.4295    |
| 太平日日鑫 B | 81        | 90,946,215.99 | 7,366,643,495.07 | 100.0000   | -              | 0.0000     |
| 合计      | 32,126    | 236,756.38    | 7,387,160,670.24 | 97.1224    | 218,874,666.06 | 2.8776     |

注：在同一基金账号同时持有 A 类份额和 C 类份额的情况下，按一户统计持有人户数。

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额 (份)       | 占总份额比例 (%) |
|----|-------|----------------|------------|
| 1  | 银行类机构 | 823,957,696.83 | 10.8329    |
| 2  | 银行类机构 | 502,392,674.56 | 6.6052     |
| 3  | 券商类机构 | 500,032,848.68 | 6.5742     |
| 4  | 券商类机构 | 456,435,927.22 | 6.0010     |
| 5  | 其他机构  | 327,712,773.12 | 4.3086     |
| 6  | 银行类机构 | 303,836,223.22 | 3.9947     |
| 7  | 银行类机构 | 300,353,129.84 | 3.9489     |
| 8  | 券商类机构 | 288,907,552.94 | 3.7984     |
| 9  | 银行类机构 | 251,083,154.25 | 3.3011     |
| 10 | 其他机构  | 227,788,528.17 | 2.9948     |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目  | 份额级别    | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|-----|---------|------------|--------------|
| 基金管 | 太平日日鑫 A | 2,075.26   | 0.0009       |

|               |         |          |        |
|---------------|---------|----------|--------|
| 理人所有从业人员持有本基金 | 太平日日鑫 B | -        | -      |
|               | 合计      | 2,075.26 | 0.0000 |

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别    | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|---------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 太平日日鑫 A | 0                 |
|                                | 太平日日鑫 B | 0                 |
|                                | 合计      | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 太平日日鑫 A | 0                 |
|                                | 太平日日鑫 B | 0                 |
|                                | 合计      | 0                 |

注：报告期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理均未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                | 太平日日鑫 A        | 太平日日鑫 B           |
|-----------------------------------|----------------|-------------------|
| 基金合同生效日<br>(2017年3月15日)<br>基金份额总额 | 69,728,252.02  | 5,440,369,567.00  |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 580,418,715.37 | 7,613,748,887.73  |
| 本报告期基金总申购份额                       | 467,154,212.14 | 11,446,016,903.82 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 808,181,086.28 | 11,693,122,296.48 |
| 本报告期基金拆分变动份额                      | -              | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额                      | 239,391,841.23 | 7,366,643,495.07  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本公司及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 中金公司 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

注：1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

(1) 公司信誉及财务状况良好，经营状况稳定。最近一年未出现亏损或审计机构无法出具无保留意见的审计报告等情形；

(2) 经营行为规范。最近一年未因重大违规行为而受到监管部门处罚；

(3) 合规风控能力较强。内部管理规范、严格，具备健全的内控和风控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。最近一年证监会对证券公司分类结果为 BB 类以上（含）；

(4) 交易服务能力较强。具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需 要。重点参考最近一个年度券商交易量市场排名；

(5) 研究服务能力较强。设置固定的研究机构，拥有专业的研究人员，能够及时全面地提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他信息服务等。

(6) 与公司签订综合服务协议。

基金管理人的总经理办公会根据上述标准确定可以合作的券商名单，由投资决策委员会在上述名单内确定租用的交易单元，并签订交易单元租用协议。

## 2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

报告期内未新增交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |                  | 债券回购交易           |                    | 权证交易 |                  |
|------|----------------|------------------|------------------|--------------------|------|------------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 中金公司 | 150,109,400.00 | 100.00           | 1,778,950,000.00 | 100.00             | -    | -                |

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期本基金不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式    | 法定披露日期          |
|----|--|-----------|-----------------|
| 1  | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加招商银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 1 月 18 日 |
| 2  | 太平日日鑫货币市场基金 2023 年第四季度报告                     | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 1 月 22 日 |
| 3  | 太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为销             | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 3 月 13 日 |

|    |  |           |                 |
|----|--|-----------|-----------------|
|    | 售机构并参加其费率优惠的公告                               |           |                 |
| 4  | 太平日日鑫货币市场基金 2023 年年度报告                       | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 3 月 30 日 |
| 5  | 太平日日鑫货币市场基金 (B 类份额) 基金产品资料概要更新               | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 6  | 太平日日鑫货币市场基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新               | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 7  | 太平日日鑫货币市场基金招募说明书 (更新) (2024 年第 1 号)          | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 8  | 太平日日鑫货币市场基金 2024 年第一季度报告                     | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 9  | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加国投证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 6 月 20 日 |
| 10 | 太平日日鑫货币市场基金恢复大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告            | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 6 月 21 日 |
| 11 | 太平日日鑫货币市场基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告            | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 6 月 27 日 |
| 12 | 太平日日鑫货币市场基金 (B 类份额) 基金产品资料概要更新               | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 6 月 28 日 |
| 13 | 太平日日鑫货币市场基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新               | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 6 月 28 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

无

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平日日鑫货币市场基金基金合同》
- 3、《太平日日鑫货币市场基金招募说明书》
- 4、《太平日日鑫货币市场基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照



6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼，503A）

## 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：[www.taipingfund.com.cn](http://www.taipingfund.com.cn)

太平基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日