

平安交易型货币市场基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安货币 ETF	
场内简称	-	
交易代码	511700	
基金运作方式	契约型、交易型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 23 日	
报告期末基金份额总额	12,650,477,299.09 份	
投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。	
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安日鑫 A	场内货币
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	003034	511700
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	12,624,183,857.37 份	26,293,441.72 份

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年7月1日—2019年9月30日）	
	平安日鑫 A	场内货币
1. 本期已实现收益	82,574,966.62	14,598,561.95
2. 本期利润	82,574,966.62	14,598,561.95
3. 期末基金资产净值	12,624,183,857.37	2,629,344,172.47

注：1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安日鑫 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6539%	0.0008%	0.3450%	0.0000%	0.3089%	0.0008%

业绩比较基准：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）

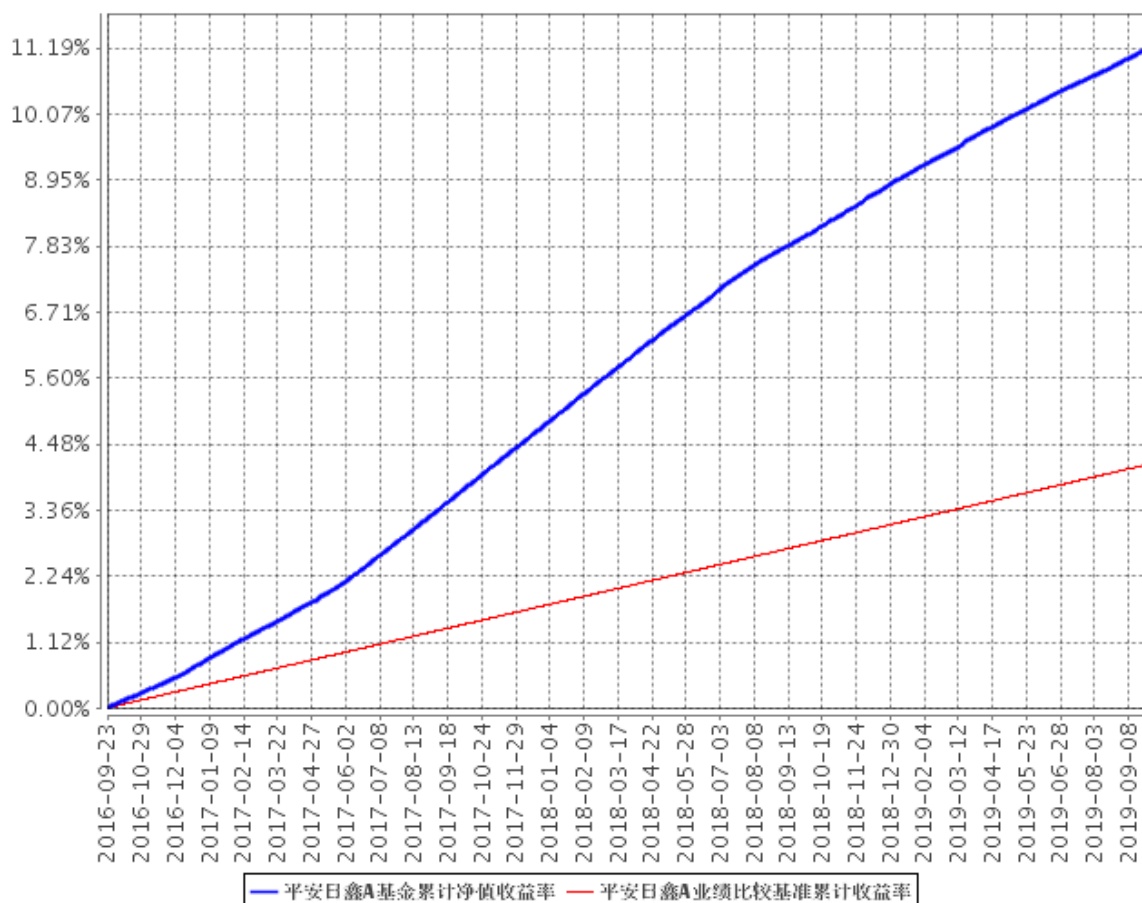
场内货币

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6539%	0.0008%	0.3450%	0.0000%	0.3089%	0.0008%

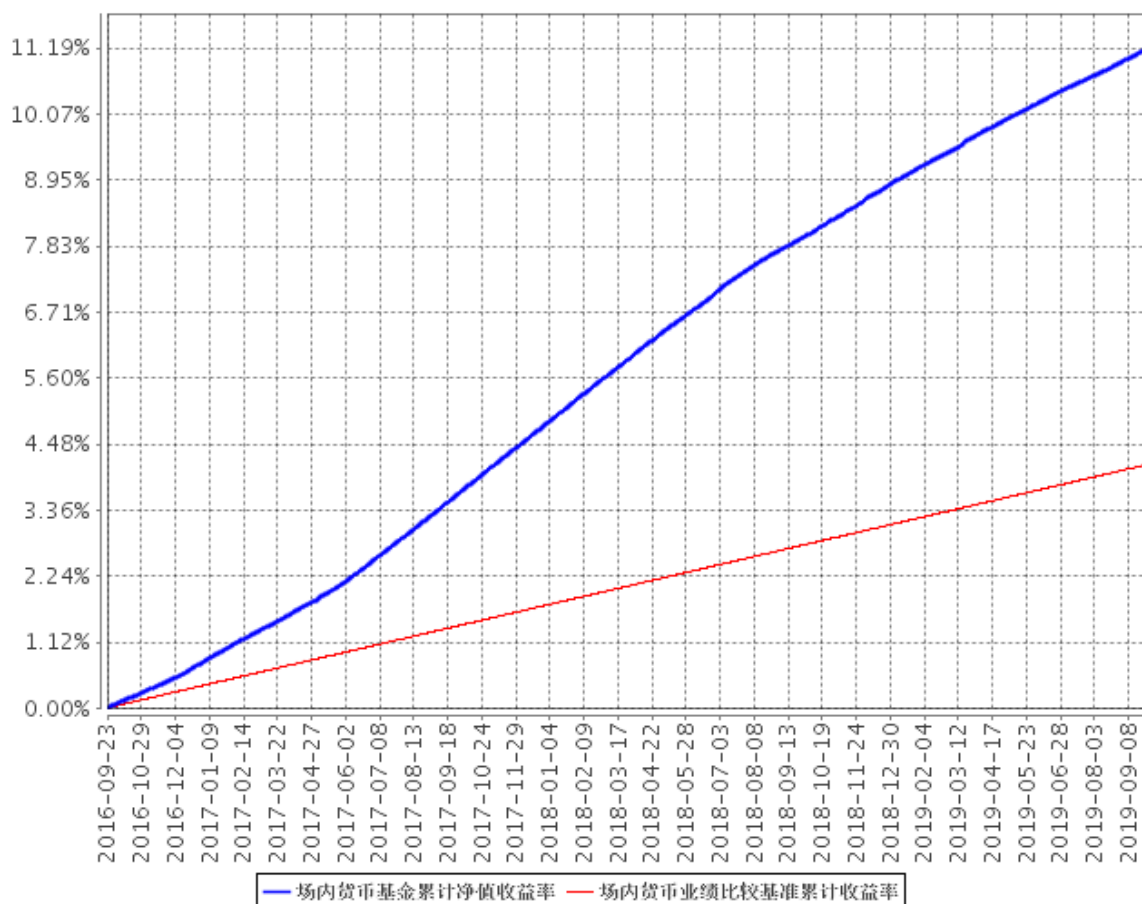
业绩比较基准：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）

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

平安日鑫A基金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



场内货币基金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



- 1、本基金基金合同于 2016 年 9 月 23 日正式生效，截至报告期末已满三年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
段玮婧	平安交易型货币市场基金基金经理	2017年1月5日	2019年7月12日	13	段玮婧女士，中山大学硕士。曾担任中国中投证券有限责任公司投资经理。2016年9月加入平安基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益组投资经理。2017年1月起担任平安金管家货币市场基金、平安短债债券型证券投资基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安乐享一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。
田元强	平安交易型货币市场基金的基金经理	2018年11月26日	-	6	田元强先生，西安交通大学工商管理硕士，曾先后担任鹏元资信评估有限公司信用评级部分析师、生命保险资产管理有限公司信用评估部分析师、中国中投证券有限责任公司研究总部分析员。2016年11月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心固定收益高级研究员。现担任平安交易型货币市场基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安3-5年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安如意中短债债券型证券投资基金基金经理。
张文平	平安交易型货币市场基金的基金经理；	2019年6月14日	-	8	张文平先生，南京大学硕士。先后担任毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理

	固定收益投资中心投资执行总经理；			有限公司固定收益部基金经理。2018 年 3 月加入平安基金管理有限公司，现任固定收益投资中心投资执行总经理。同时担任平安短债债券型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠轩纯债债券型证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安惠裕债券型证券投资基金、平安如意中短债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、平安交易型货币市场基金、平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
--	------------------	--	--	---

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安交易型货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公

司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内经济下行压力增加，投资、消费、出口均无起色，受猪肉价格影响通胀压力逐步提升，货币政策整体宽松但资金价格相对坚挺，中美贸易摩擦先恶化再缓和；基本面压力下，政策托底预期增强，债券市场经历了先走强再调整的走势，全季度无风险收益率基本持平。报告期内，本基金的投资操作以流动性管理为基础原则，在有效控制偏离度的前提下，适当保持杠杆比例，适当拉长组合剩余期限，调整大类资产的配置比例，使得基金净值保持了稳步增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期平安日鑫 A 的基金份额净值收益率为 0.6539%，本报告期场内货币的基金份额净值收益率为 0.6539%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	10,418,248,980.08	67.72
	其中：债券	10,015,123,941.28	65.10
	资产支持证券	403,125,038.80	2.62
2	买入返售金融资产	4,291,428,302.19	27.90
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

3	银行存款和结算备付金合计	629,845,263.67	4.09
4	其他资产	43,840,032.74	0.28
5	合计	15,383,362,578.68	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	4.66	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	125,199,612.20	0.82
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30 天以内	48.87	0.82
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	8.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天	-	-

	天的浮动利率债		
3	60 天(含)-90 天	4.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	5.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	32.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.56	0.82

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	249,814,087.55	1.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	661,137,957.09	4.33
	其中：政策性金融债	661,137,957.09	4.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,295,036,087.35	8.49
6	中期票据	120,467,674.93	0.79
7	同业存单	7,688,668,134.36	50.41
8	其他	-	-
9	合计	10,015,123,941.28	65.66
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111916264	19 上海银行 CD264	5,000,000	499,683,591.44	3.28
2	111916188	19 上海银行 CD188	3,500,000	349,731,101.35	2.29
3	111987439	19 苏州银行 CD252	3,000,000	299,786,432.68	1.97
4	111987577	19 重庆银行 CD109	3,000,000	299,762,712.36	1.97

5	111921304	19 渤海银行 CD304	3,000,000	298,818,098.29	1.96
6	111986015	19 江苏江南 农村商业银 行 CD105	3,000,000	296,350,405.26	1.94
7	111987365	19 河北银行 CD113	3,000,000	293,499,107.67	1.92
8	199915	19 贴现国债 15	2,500,000	249,814,087.55	1.64
9	111991656	19 汇丰银行 CD004	2,500,000	247,137,569.70	1.62
10	190201	19 国开 01	2,100,000	209,989,513.15	1.38

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0319%
报告期内偏离度的最低值	0.0049%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0173%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明 细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	159555	19 绿城 A1	720,000.00	72,000,000.00	0.47
2	139447	方碧 45 优	500,000.00	50,329,984.55	0.33
3	139446	恒融二 7A	400,000.00	40,072,698.21	0.26
4	139463	方碧 46 优	300,000.00	30,193,767.15	0.20
5	139568	方碧 48 优	300,000.00	30,132,303.14	0.20
6	139651	永熙 3 优 1	280,000.00	28,000,000.00	0.18
7	139433	方碧 44 优	250,000.00	25,158,109.35	0.16
8	139812	天著优 04	240,000.00	24,000,000.00	0.16
8	139653	天著优 02	240,000.00	24,000,000.00	0.16
9	139425	方碧 43 优	200,000.00	20,122,302.74	0.13
10	139406	一方碧 42	200,000.00	20,111,977.21	0.13

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。

5.9.2

银保监会于 2018 年 11 月 9 日做出银保监银罚决字（2018）9 号处罚决定，由于渤海银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）理财及自营投资资金违规用于缴交土地款；（三）理财业务风险隔离不到位；（四）为非保本理财产品提供保本承诺；（五）同业投资他行非保本理财产品审查不到位。根据相关规定对公司罚款 2530 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

上海银监局于 2018 年 10 月 8 日做出沪银监罚决字（2018）49 号处罚决定，由于上海银行股份有限公司（以下简称“公司”）：违规向其关系人发放信用贷款。根据相关规定对公司罚款约 109 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	20,517.68
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	43,819,503.90
4	应收申购款	11.16
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	43,840,032.74

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安日鑫 A	场内货币
报告期期初基金份额总额	11,096,223,795.13	4,670,726.97
报告期期间基金总申购份额	18,760,377,070.30	33,646,198.69
报告期期间基金总赎回份额	17,232,417,008.06	12,023,483.94
报告期期末基金份额总额	12,624,183,857.37	26,293,441.72

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

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利发放	2019 年 7 月 1 日	11,184.78	11,184.78	0.00%
2	红利发放	2019 年 7 月 2 日	3,488.10	3,488.10	0.00%
3	红利发放	2019 年 7 月 3 日	3,993.47	3,993.47	0.00%
4	红利发放	2019 年 7 月 4 日	3,585.58	3,585.58	0.00%
5	红利发放	2019 年 7 月 5 日	3,618.84	3,618.84	0.00%
6	红利发放	2019 年 7 月 8 日	9,433.52	9,433.52	0.00%
7	红利发放	2019 年 7 月 9 日	3,579.47	3,579.47	0.00%
8	红利发放	2019 年 7 月 10 日	2,976.94	2,976.94	0.00%
9	红利发放	2019 年 7 月 11 日	3,137.51	3,137.51	0.00%
10	红利发放	2019 年 7 月 12 日	3,093.73	3,093.73	0.00%
11	红利发放	2019 年 7 月 15 日	9,116.63	9,116.63	0.00%
12	红利发放	2019 年 7 月 16 日	3,013.01	3,013.01	0.00%
13	红利发放	2019 年 7 月 17 日	4,129.45	4,129.45	0.00%
14	红利发放	2019 年 7 月 18 日	3,421.90	3,421.90	0.00%
15	红利发放	2019 年 7 月 19 日	3,162.13	3,162.13	0.00%
16	红利发放	2019 年 7 月 22 日	10,031.87	10,031.87	0.00%
17	红利发放	2019 年 7 月 23 日	3,625.67	3,625.67	0.00%
18	红利发放	2019 年 7 月 24 日	4,162.79	4,162.79	0.00%
19	红利发放	2019 年 7 月 25 日	3,309.64	3,309.64	0.00%
20	红利发放	2019 年 7 月 26 日	3,404.91	3,404.91	0.00%
21	红利发放	2019 年 7 月 29 日	10,134.25	10,134.25	0.00%
22	红利发放	2019 年 7 月 30 日	3,418.30	3,418.30	0.00%
23	红利发放	2019 年 7 月 31 日	3,441.06	3,441.06	0.00%

24	红利发放	2019 年 8 月 1 日	3,698.37	3,698.37	0.00%
25	红利发放	2019 年 8 月 2 日	3,453.87	3,453.87	0.00%
26	红利发放	2019 年 8 月 5 日	10,257.47	10,257.47	0.00%
27	红利发放	2019 年 8 月 6 日	3,482.07	3,482.07	0.00%
28	红利发放	2019 年 8 月 7 日	3,465.88	3,465.88	0.00%
29	红利发放	2019 年 8 月 8 日	3,351.91	3,351.91	0.00%
30	红利发放	2019 年 8 月 9 日	3,405.59	3,405.59	0.00%
31	红利发放	2019 年 8 月 12 日	10,131.71	10,131.71	0.00%
32	红利发放	2019 年 8 月 13 日	3,745.74	3,745.74	0.00%
33	红利发放	2019 年 8 月 14 日	3,572.22	3,572.22	0.00%
34	红利发放	2019 年 8 月 15 日	3,606.30	3,606.30	0.00%
35	红利发放	2019 年 8 月 16 日	3,605.57	3,605.57	0.00%
36	红利发放	2019 年 8 月 19 日	10,803.28	10,803.28	0.00%
37	红利发放	2019 年 8 月 20 日	3,793.88	3,793.88	0.00%
38	红利发放	2019 年 8 月 21 日	3,606.84	3,606.84	0.00%
39	红利发放	2019 年 8 月 22 日	3,597.57	3,597.57	0.00%
40	红利发放	2019 年 8 月 23 日	3,596.20	3,596.20	0.00%
41	红利发放	2019 年 8 月 26 日	10,753.81	10,753.81	0.00%
42	红利发放	2019 年 8 月 27 日	4,470.77	4,470.77	0.00%
43	红利发放	2019 年 8 月 28 日	3,891.08	3,891.08	0.00%
44	红利发放	2019 年 8 月 29 日	3,633.46	3,633.46	0.00%
45	红利发放	2019 年 8 月 30 日	3,661.58	3,661.58	0.00%
46	红利发放	2019 年 9 月 2 日	10,944.22	10,944.22	0.00%
47	红利发放	2019 年 9 月 3 日	4,636.68	4,636.68	0.00%
48	红利发放	2019 年 9 月 4 日	3,546.61	3,546.61	0.00%
49	红利发放	2019 年 9 月 5 日	4,052.47	4,052.47	0.00%
50	红利发放	2019 年 9 月 6 日	3,563.77	3,563.77	0.00%
51	红利发放	2019 年 9 月 9 日	10,460.70	10,460.70	0.00%
52	红利发放	2019 年 9 月 10 日	3,691.33	3,691.33	0.00%
53	红利发放	2019 年 9 月 11 日	3,609.79	3,609.79	0.00%
54	红利发放	2019 年 9 月 12 日	3,618.78	3,618.78	0.00%
55	红利发放	2019 年 9 月 16 日	14,765.30	14,765.30	0.00%
56	红利发放	2019 年 9 月 17 日	6,262.78	6,262.78	0.00%
57	红利发放	2019 年 9 月 18 日	3,643.50	3,643.50	0.00%
58	红利发放	2019 年 9 月 19 日	3,565.18	3,565.18	0.00%
59	红利发放	2019 年 9 月 20 日	4,829.26	4,829.26	0.00%
60	红利发放	2019 年 9 月 23 日	11,202.59	11,202.59	0.00%
61	红利发放	2019 年 9 月 24 日	3,785.50	3,785.50	0.00%
62	红利发放	2019 年 9 月 25 日	3,567.25	3,567.25	0.00%
63	红利发放	2019 年 9 月 26 日	3,682.91	3,682.91	0.00%

64	红利发放	2019 年 9 月 27 日	3,692.36	3,692.36	0.00%
65	红利发放	2019 年 9 月 30 日	11,631.25	11,631.25	0.00%
合计			338,800.95	338,800.95	

基金管理人运用自有资金申购平安交易型货币市场基金 A 类份额（平安日鑫 A）。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安交易型货币市场基金设立的文件
- (2) 平安交易型货币市场基金基金合同
- (3) 平安交易型货币市场基金托管协议
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 平安交易型货币市场基金 2019 年第 3 季度报告原文

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

8.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2019 年 10 月 25 日