

平安交易型货币市场基金 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 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：2020 年 4 月 22 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 2020 年 04 月 21 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 2020 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安货币 ETF
场内简称	场内货币（扩位证券简称：场内货币 ETF）
基金主代码	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	23,920,175,494.83 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
下属分级基金的交易代码	003034	511700
报告期末下属分级基金的份额总额	23,917,917,009.48 份	2,258,485.35 份

注: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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 3 月 31 日)	
	平安日鑫 A	场内货币
1. 本期已实现收益	187,776,929.32	4,682,995.19
2. 本期利润	187,776,929.32	4,682,995.19
3. 期末基金资产净值	23,917,917,009.48	225,848,535.05

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

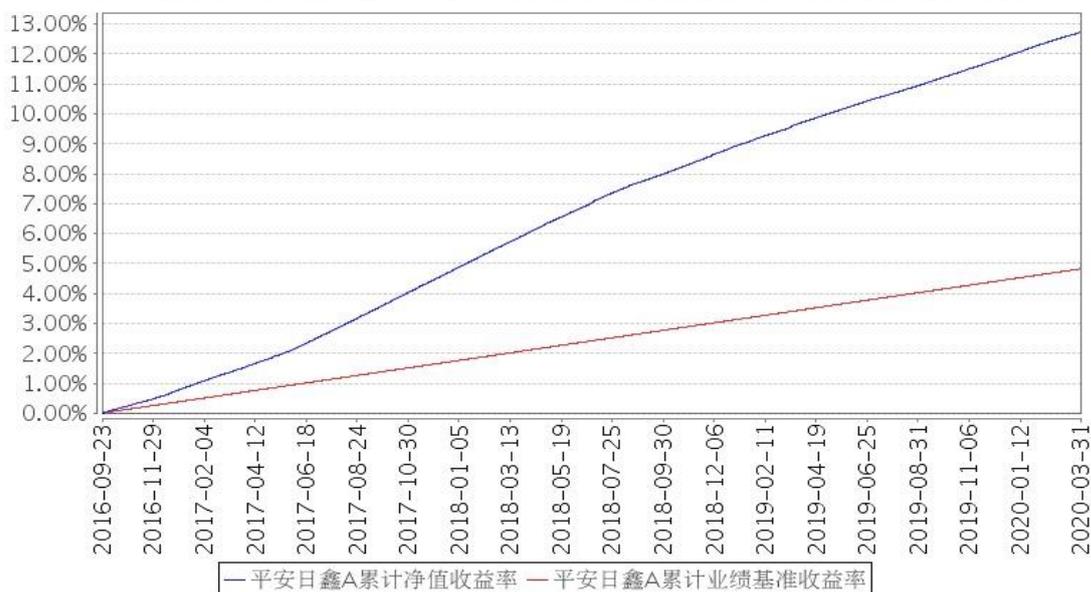
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6799%	0.0019%	0.3413%	0.0000%	0.3386%	0.0019%

场内货币

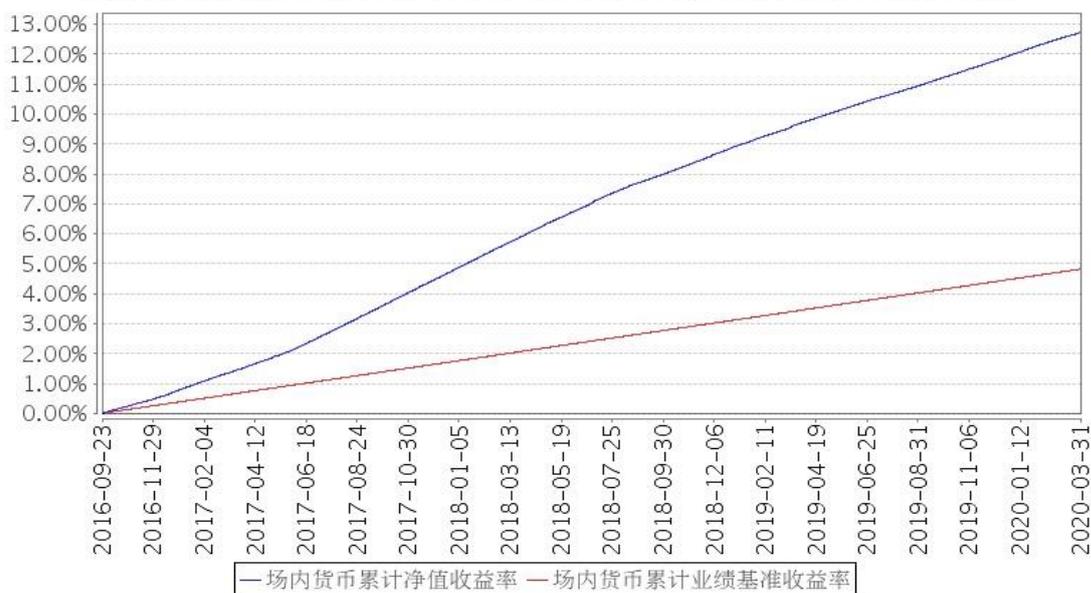
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6798%	0.0019%	0.3413%	0.0000%	0.3385%	0.0019%

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：1、本基金基金合同于 2016 年 9 月 23 日正式生效；

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		
张文平	固定收益投资中心投资执行总经理，平安交易型货币市场基金基金经理	2019年6月14日	-	8年	<p>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、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。</p> <p>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、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</p>

					券投资基金、平安 5-10 年期政策性金融债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基金经理	2018 年 11 月 26 日	-	7 年	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分析师、生命保险资产管理有限公司信用评估部分分析师、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 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、平安合信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

注: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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

回顾一季度,国内及海外疫情先后发酵,经济基本停滞,消费、出口被严重拖累,投资明显放缓,实际 GDP 增速明显下行;总需求不振、经济预期悲观、企业投资意愿缺失,宏观经济持续走弱。货币政策持续宽松,降成本持续推进。基本面走弱、货币政策宽松背景下,债券市场表现强势。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,以维护产品收益。我们将继续稳健操作,力争在保障安全性、流动性的情况下,为客户创造良好的收益。

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 0.6799%,本报告期场内货币的基金份额净值收益率为 0.6798%,同期业绩基准收益率为 0.3413%。

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	17,999,774,090.30	64.79
	其中：债券	17,838,773,905.24	64.21
	资产支持证 券	161,000,185.06	0.58
2	买入返售金融资产	5,918,088,400.91	21.30
	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	2,034,603,907.15	7.32
4	其他资产	1,829,540,087.54	6.59
5	合计	27,782,006,485.90	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	3.56	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值 比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	3,630,313,323.50	15.04
	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

注：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	84
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	74

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 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	47.27	15.04
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	18.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	10.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	33.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	114.69	15.04

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

注：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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,409,233,188.63	5.84
	其中：政策性金融债	1,368,656,267.57	5.67
4	企业债券	1,001,911.71	-
5	企业短期融资券	4,902,947,390.09	20.31
6	中期票据	495,982,721.95	2.05
7	同业存单	11,029,608,692.86	45.68
8	其他	-	-
9	合计	17,838,773,905.24	73.89
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名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	111914153	19 江苏银行 CD153	5,000,000	498,741,906.71	2.07
2	111989564	19 长沙银行 CD206	3,000,000	299,780,417.15	1.24
3	111973162	19 贵阳银行 CD146	3,000,000	296,782,117.39	1.23
4	190211	19 国开 11	2,800,000	279,991,009.51	1.16
5	041900377	19 深能源 CP002	2,700,000	270,286,104.98	1.12
6	111989556	19 郑州银行 CD215	2,500,000	249,817,014.44	1.03
7	112093038	20 东莞银行 CD062	2,500,000	249,083,945.39	1.03
8	112092906	20 长沙银行 CD025	2,500,000	249,083,945.39	1.03
9	011902296	19 首钢 SCP010	2,400,000	241,119,436.06	1.00
10	111987365	19 河北银行 CD113	2,400,000	238,564,648.92	0.99

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	0.1806%
报告期内偏离度的最低值	0.0471%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0961%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：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

注：本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

5.8 报告期末按摊余成本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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	159555	19 绿城 A1	720,000	72,000,000.00	0.30
2	139651	永熙 3 优 1	280,000	28,000,000.00	0.12
3	139653	天著优 02	240,000	24,000,000.00	0.10
4	139812	天著优 04	240,000	24,000,000.00	0.10
5	139601	绿城 11 优	130,000	13,000,185.06	0.05

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

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 本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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	228.05
2	应收证券清算款	1,736,882,878.77
3	应收利息	92,372,626.24
4	应收申购款	284,354.48
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,829,540,087.54

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	20,912,175,961.52	19,376,400.43
报告期期间基金总申购份额	31,525,551,010.59	598,512.20
报告期期间基金总赎回份额	28,519,809,962.63	17,716,427.28
报告期期末基金份额总额	23,917,917,009.48	2,258,485.35

注：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	红利再投	2020-01-02	8,042.88	8,042.88	-
2	红利再投	2020-01-03	4,045.05	4,045.05	-
3	红利再投	2020-01-06	11,126.38	11,126.38	-
4	红利再投	2020-01-07	3,880.19	3,880.19	-
5	红利再投	2020-01-08	3,821.20	3,821.20	-
6	红利再投	2020-01-09	3,816.15	3,816.15	-
7	红利再投	2020-01-10	3,831.11	3,831.11	-
8	红利再投	2020-01-13	11,855.20	11,855.20	-
9	红利再投	2020-01-14	4,407.96	4,407.96	-
10	红利再投	2020-01-15	4,078.44	4,078.44	-
11	红利再投	2020-01-16	3,820.17	3,820.17	-
12	红利再投	2020-01-17	6,268.65	6,268.65	-
13	红利再投	2020-01-20	12,559.58	12,559.58	-
14	红利再投	2020-01-21	3,986.44	3,986.44	-
15	红利再投	2020-01-22	4,038.06	4,038.06	-
16	红利再投	2020-01-23	4,062.11	4,062.11	-
17	红利再投	2020-02-03	46,358.02	46,358.02	-
18	红利再投	2020-02-04	4,016.62	4,016.62	-
19	红利再投	2020-02-05	3,933.48	3,933.48	-
20	红利再投	2020-02-06	3,965.22	3,965.22	-
21	红利再投	2020-02-07	3,909.93	3,909.93	-
22	红利再投	2020-02-10	11,351.52	11,351.52	-
23	红利再投	2020-02-11	4,016.40	4,016.40	-
24	红利再投	2020-02-12	3,713.17	3,713.17	-
25	红利再投	2020-02-13	3,628.07	3,628.07	-
26	红利再投	2020-02-14	3,657.16	3,657.16	-

27	红利再投	2020-02-17	11,120.90	11,120.90	-
28	红利再投	2020-02-18	3,674.49	3,674.49	-
29	红利再投	2020-02-19	3,608.20	3,608.20	-
30	红利再投	2020-02-20	3,594.65	3,594.65	-
31	红利再投	2020-02-21	3,574.97	3,574.97	-
32	红利再投	2020-02-24	11,276.32	11,276.32	-
33	红利再投	2020-02-25	4,015.52	4,015.52	-
34	红利再投	2020-02-26	3,871.23	3,871.23	-
35	红利再投	2020-02-27	3,719.72	3,719.72	-
36	红利再投	2020-02-28	3,649.93	3,649.93	-
37	红利再投	2020-03-02	11,375.05	11,375.05	-
38	红利再投	2020-03-03	3,560.52	3,560.52	-
39	红利再投	2020-03-04	3,478.84	3,478.84	-
40	红利再投	2020-03-05	3,471.68	3,471.68	-
41	红利再投	2020-03-06	3,326.06	3,326.06	-
42	红利再投	2020-03-09	10,037.80	10,037.80	-
43	红利再投	2020-03-10	3,438.01	3,438.01	-
44	红利再投	2020-03-11	3,273.39	3,273.39	-
45	红利再投	2020-03-12	4,277.89	4,277.89	-
46	红利再投	2020-03-13	3,566.99	3,566.99	-
47	红利再投	2020-03-16	11,584.61	11,584.61	-
48	红利再投	2020-03-17	3,190.59	3,190.59	-
49	红利再投	2020-03-18	3,179.44	3,179.44	-
50	红利再投	2020-03-19	2,919.42	2,919.42	-
51	红利再投	2020-03-20	3,048.47	3,048.47	-
52	红利再投	2020-03-23	9,188.87	9,188.87	-
53	红利再投	2020-03-24	2,971.90	2,971.90	-
54	红利再投	2020-03-25	3,045.78	3,045.78	-

55	红利再投	2020-03-26	3,137.74	3,137.74	-
56	红利再投	2020-03-27	2,926.98	2,926.98	-
57	红利再投	2020-03-30	9,740.63	9,740.63	-
58	红利再投	2020-03-31	11,482.58	11,482.58	-
合计			350,518.33	350,518.33	

注: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 2020 年第 1 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,客户服务热线:4008004800(免长途话费)

平安基金管理有限公司
2020 年 4 月 22 日