

平安交易型货币市场基金 2021 年中期报告

2021 年 6 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

送出日期：2021 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 27 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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
§ 4 管理人报告	9
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.....	12
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
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 债券回购融资情况.....	42
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	42
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.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 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.....	44
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	44

7.8 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	45
7.9 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.5 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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	51
10.9 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安交易型货币市场基金	
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	
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	
报告期末基金份 额总额	22,961,823,086.60 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2016 年 10 月 17 日	
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	22,959,557,818.00 份	2,265,268.60 份

注：本基金 A 类份额净值为 1.00 元，E 类份额净值为 100.00 元

2.2 基金产品说明

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	本基金的业绩比较基准为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。

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		平安基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	胡凯
	联系电话	0755-22626828	021-38037354
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	hukai@gtjas.com
客户服务电话		400-800-4800	021-38917599-5
传真		0755-23997878	021-38677819
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	中国（上海）自由贸易试验区 商城路 618 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	上海市静安区新闻路 669 号博 华广场 19 楼
邮政编码		518048	200041
法定代表人		罗春风	贺青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

§ 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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	平安日鑫 A	场内货币
本期已实现收 益	276,167,880.10	3,046,831.80
本期利润	276,167,880.10	3,046,831.80
本期净值收益 率	1.2900%	1.2900%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	22,959,557,818.00	226,526,860.46
期末基金份额净值	1.0000	100.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	16.1303%	16.1302%

注：1. 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。

2. 本基金按日结转份额。

3. 本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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

平安日鑫 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	0.2138%	0.0024%	0.1125%	0.0000%	0.1013%	0.0024%
过去三个月	0.6464%	0.0020%	0.3413%	0.0000%	0.3051%	0.0020%
过去六个月	1.2900%	0.0017%	0.6788%	0.0000%	0.6112%	0.0017%
过去一年	2.5292%	0.0018%	1.3688%	0.0000%	1.1604%	0.0018%
过去三年	8.4805%	0.0022%	4.1100%	0.0000%	4.3705%	0.0022%

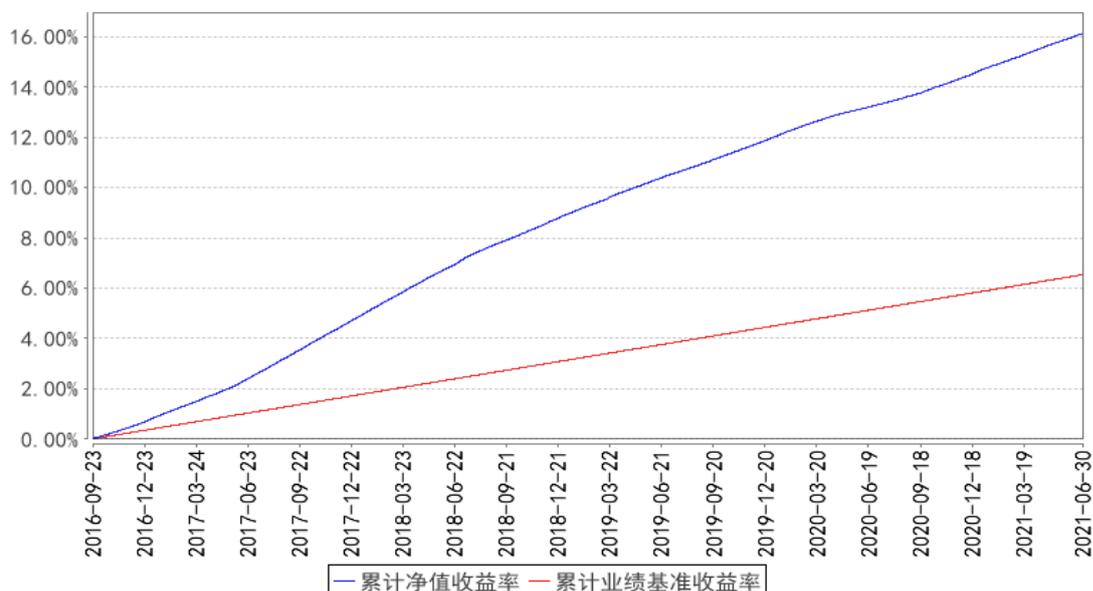
自基金合同生效 起至今	16.1303 %	0.0027%	6.5325%	0.0000%	9.5978 %	0.0027 %
----------------	--------------	---------	---------	---------	-------------	-------------

场内货币

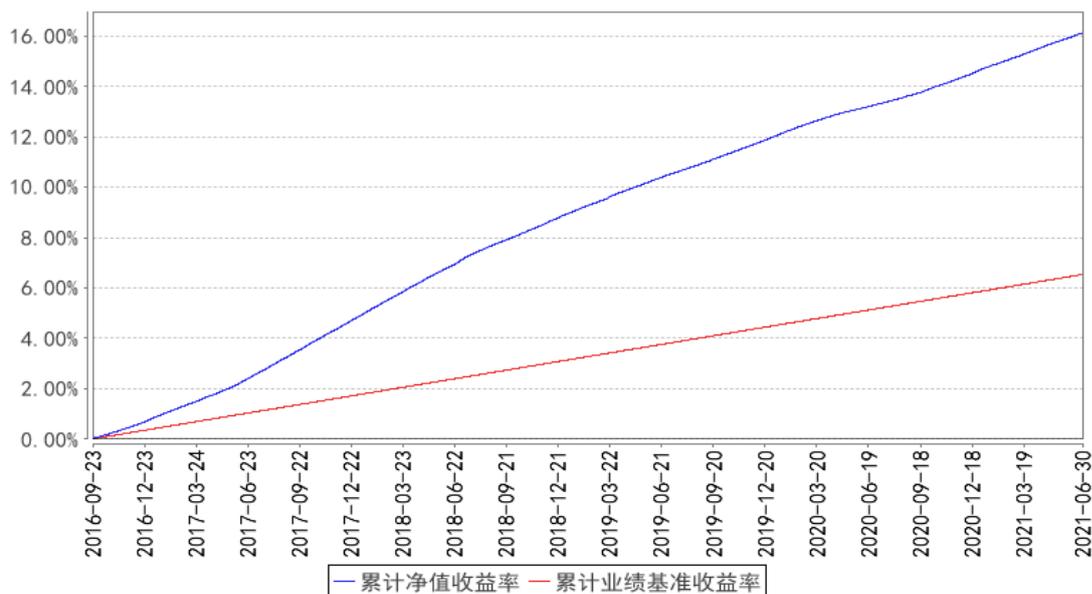
阶段	份额净值 收益 率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2138%	0.0024%	0.1125%	0.0000%	0.1013 %	0.0024 %
过去三个月	0.6464%	0.0020%	0.3413%	0.0000%	0.3051 %	0.0020 %
过去六个月	1.2900%	0.0017%	0.6788%	0.0000%	0.6112 %	0.0017 %
过去一年	2.5292%	0.0018%	1.3688%	0.0000%	1.1604 %	0.0018 %
过去三年	8.4802%	0.0022%	4.1100%	0.0000%	4.3702 %	0.0022 %
自基金合同生效 起至今	16.1302 %	0.0027%	6.5325%	0.0000%	9.5977 %	0.0027 %

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

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。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 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

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2021 年 6 月 30 日，平安基金共管理 138 只公募基金，公募资产管理总规模约为 3,831 亿元人民币。

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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
田元强	平安交易型货币市场基金经理	2018 年 11 月 26 日	-	8 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级部分分析师、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、平安合信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠铭纯债债券型证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合进 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
罗薇	平安交易型货币市场基金经理助理	2021 年 2 月 23 日	-	8 年	罗薇女士，新南威尔士大学金融会计学专业硕士，曾任红塔红土基金管理有限公司固定收益交易员、基金经理助理、基金经理，2020 年 11 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安日增利货币市场基金、平安交易型货币市场基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金基金经理助理。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、

中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

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 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

上半年“出口+地产”双轮驱动推动经济稳健复苏，基建与制造业投资表现平稳，消费受疫情影响有所波动但仍在持续修复，上半年国内经济表现出良好的复苏态势。货币政策聚焦防风险和为经济复苏维持良好环境，流动性环境整体偏宽松。年初以来海外疫情波动与国内“碳中和”催动大宗商品价波动推动 PPI 快速上行，但 PPI 向 CPI 传导受阻，猪肉价格起到通胀“压舱石”作用，维持 CPI 处于低位。尽管对流动性收紧和对通胀预期升温的担忧对市场产生扰动，但综合而言，上半年债市收益率整体下行，短端资产收益率下行明显。报告期内，本基金的投资操作以流动性管理为基础原则，结合市场变化动态调整组合剩余期限、杠杆水平，调整大类资产的配置比例，以维护产品收益。

4.4.2 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 1.2900%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%；本报告期场内货币的基金份额净值收益率为 1.2900%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%。

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，融资受限对地产投资形成负面影响，海外供给恢复对国内出口形成挤出效应，而国内消费和制造业投资的修复相对平缓，综合而言，下半年经济存在结构性和周期性压力并存的局面。货币政策关注重点仍在中小企业和困难行业融资问题，预计流动性环境仍将保持宽松。经济承压之下，“稳增长”政策有望发力，上半年财政政策趋于紧缩，主要与地方政府控杠杆、防风险有关，下半年财政支出和债券发行有望加速。债券市场方面，当前股份制银行存单发行收益率已接近疫情前水平，在政策利率没有出现大幅下调的情况下，收益率下行空间有限，但考虑到基本面边际走弱，流动性易松难紧，收益率上行空间亦不大；预计下半年市场以震荡为主，货币基金不仅需要把握市场波动捕捉资产配置机会，也需要做好流动性风险管理。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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、资本市场风险监控室及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金基金合同的规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人，并按照自然日结转至基金份额持有人的基金账户。本报告期内应分配收益 279,214,711.90 元，实际分配收益 279,214,711.90 元。

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

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低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安交易型货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：平安交易型货币市场基金

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	855,217,499.03	6,607,662,228.22
结算备付金		72,799,156.99	65,150,591.18
存出保证金		239,227.75	79,456.70
交易性金融资产	6.4.7.2	20,324,605,850.08	15,612,215,690.85
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		19,915,605,850.08	15,249,215,690.85
资产支持证券投资		409,000,000.00	363,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,706,352,379.54	5,020,781,752.67

应收证券清算款		83,315,238.20	81,255,726.67
应收利息	6.4.7.5	111,781,872.14	135,447,970.69
应收股利		-	-
应收申购款		278,480,881.39	56,332,031.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		27,432,792,105.12	27,578,925,448.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,160,216,954.78	3,499,913,460.11
应付证券清算款		80,018,390.12	81,023,505.10
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,557,778.13	2,859,177.58
应付托管费		852,592.71	953,059.21
应付销售服务费		170,518.55	190,611.83
应付交易费用	6.4.7.7	180,554.30	218,473.47
应交税费		486,056.60	349,478.49
应付利息		832,609.64	592,368.87
应付利润		1,263,957.09	1,856,339.61
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	128,014.74	239,000.00
负债合计		4,246,707,426.66	3,588,195,474.27
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	23,186,084,678.46	23,990,729,974.08
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		23,186,084,678.46	23,990,729,974.08
负债和所有者权益总计		27,432,792,105.12	27,578,925,448.35

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 22,961,823,086.60 份，其中平安日鑫 A 基金份额总额 22,959,557,818.00 份，基金份额净值 1.0000 元。场内货币基金份额总额 2,265,268.60 份，基金份额净值 100 元。

6.2 利润表

会计主体：平安交易型货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

一、收入		322,254,363.97	371,276,969.57
1. 利息收入		318,795,641.00	362,306,277.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,150,313.68	36,320,007.95
债券利息收入		211,070,589.07	213,332,366.76
资产支持证券利息收入		6,022,460.58	6,444,981.69
买入返售金融资产收入		52,552,277.67	106,208,921.53
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,458,722.97	8,970,691.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,458,722.97	8,970,691.64
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		43,039,652.07	39,774,744.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,271,170.02	21,755,824.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,423,723.37	7,251,941.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,084,744.70	1,450,388.29
4. 交易费用	6.4.7.19	-150.00	391.93
5. 利息支出		19,839,260.47	8,995,570.16
其中：卖出回购金融资产支出		19,839,260.47	8,995,570.16
6. 税金及附加		285,958.77	182,682.88
7. 其他费用	6.4.7.20	134,944.74	137,944.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		279,214,711.90	331,502,225.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		279,214,711.90	331,502,225.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安交易型货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	23,990,729,974.08	-	23,990,729,974.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	279,214,711.90	279,214,711.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-804,645,295.62	-	-804,645,295.62
其中：1. 基金申购款	45,665,698,728.05	-	45,665,698,728.05
2. 基金赎回款	-46,470,344,023.67	-	-46,470,344,023.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-279,214,711.90	-279,214,711.90
五、期末所有者权益（基金净值）	23,186,084,678.46	-	23,186,084,678.46
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,849,816,004.97	-	22,849,816,004.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	331,502,225.46	331,502,225.46
三、本期基金份额	-6,951,735,000.04	-	-6,951,735,000.04

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	56,119,161,456.62	-	56,119,161,456.62
2. 基金赎回款	-63,070,896,456.66	-	-63,070,896,456.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-331,502,225.46	-331,502,225.46
五、期末所有者权益(基金净值)	15,898,081,004.93	-	15,898,081,004.93

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:

罗春风

林婉文

张南南

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

平安交易型货币市场基金(原名为平安大华交易型货币市场基金,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]1380号《关于准予平安大华交易型货币市场基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于2018年10月25日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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1,590,518,565.34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(2016)第1210号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华交易型货币市场基金基金合同》于2016年9月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,590,527,400.09份基金份额,其中认购资金利息折合8,834.75份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》，平安大华交易型货币市场基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安交易型货币市场基金。

根据《平安交易型货币市场基金基金合同》和《平安交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人平安基金管理有限公司在基金合同生效日当日，即 2016 年 9 月 23 日为本基金 E 类基金份额办理份额折算。本基金 E 类基金份额募集认购金额为 1,384,657,000.00 元，折算前基金份额总额为 1,384,657,000.00 份，折算前基金份额净值为 1.00 元；根据本基金的基金份额折算方法，折算后 E 类基金份额总额为 13,846,570.00 份，折算后基金份额净值为 100.00 元。本基金 E 类基金份额的注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2016 年 9 月 26 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证自律监管决定书[2016]246 号文审核同意，本基金 E 类基金份额于 2016 年 10 月 17 日在上交所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安交易型货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在一年以内(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、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；以及中国证监会、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。本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安交易型货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	5,217,499.03
定期存款	850,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	100,000,000.00
存款期限3个月以上	750,000,000.00
其他存款	-
合计	855,217,499.03

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	596,898,536.84	596,220,000.00	-678,536.84	- 0.0029
	银行间市场	19,318,707,313.24	19,334,088,600.00	15,381,286.76	0.0663
	合计	19,915,605,850.08	19,930,308,600.00	14,702,749.92	0.0634
资产支持证券		409,000,000.00	410,663,000.00	1,663,000.00	0.0072
合计		20,324,605,850.08	20,340,971,600.00	16,365,749.92	0.0706

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

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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 2021年6月30日
----	-------------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,680,000,000.00	-
银行间市场	3,026,352,379.54	-
合计	5,706,352,379.54	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	21,198.27
应收定期存款利息	4,614,999.31
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	29,680.99
应收债券利息	97,212,814.43
应收资产支持证券利息	8,477,500.49
应收买入返售证券利息	1,425,581.72
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	96.93
合计	111,781,872.14

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	180,554.30
合计	180,554.30

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-

预提费用	128,014.74
合计	128,014.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安日鑫 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,814,541,597.51	23,814,541,597.51
本期申购	45,290,407,611.16	45,290,407,611.16
本期赎回（以“-”号填列）	-46,145,391,390.67	-46,145,391,390.67
-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	22,959,557,818.00	22,959,557,818.00

场内货币

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,761,883.77	176,188,376.57
本期申购	3,752,911.16	375,291,116.89
本期赎回（以“-”号填列）	-3,249,526.33	-324,952,633.00
-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	2,265,268.60	226,526,860.46

注：1. 申购含红利再投份额及转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 根据《ETF 货币份额折算公告》，本基金 E 类基金份额折算日为基金合同生效当日，折算后 E 类基金份额净值为 100.00 元。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安日鑫 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	276,167,880.10	-	276,167,880.10
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	-276,167,880.10		-276,167,880.10
本期末			

场内货币

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末			
本期利润	3,046,831.80		3,046,831.80
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	-3,046,831.80		-3,046,831.80
本期末			

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	537,423.53
定期存款利息收入	47,723,582.45
其他存款利息收入	
结算备付金利息收入	887,466.07
其他	1,841.63
合计	49,150,313.68

6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,458,722.97
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	3,458,722.97

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	20,790,904,117.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,605,996,205.19
减：应收利息总额	181,449,188.98
买卖债券差价收入	3,458,722.97

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	10,291,134.25
减：卖出资产支持证券成本总额	10,000,000.00
减：应收利息总额	291,134.25
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	-150.00
合计	-150.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	15,330.00
其他	600.00
合计	134,944.74

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无须作披露的分部报告。

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

截至本财务报表批准报出日，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

本报告期内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
-------	---------

平安基金管理有限公司(“平安基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
国泰君安证券	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司(“平安信托”)	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司(“平安汇通”)	基金管理人的子公司
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
上海陆金所基金销售有限公司(“陆金所”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
深圳安创投资管理有限公司(“安创”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
桐乡市安豪投资管理有限公司(“安豪”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
上海安壹通电子商务有限公司(“安壹通”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安国际融资租赁(深圳)有限公司(“国际租赁深圳”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安国际融资租赁(天津)有限公司(“国际租赁天津”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
捷银国际旅行社(上海)有限公司(“捷银国际旅行社”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
京乾(北京)投资管理有限责任公司(“京乾投资”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳联新投资管理有限公司(“联新投资”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安不动产有限公司(“平安不动产”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安财产保险股份有限公司(“平安财险”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安付科技服务有限公司(“平安付”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安付电子支付有限公司(“平安付电子支付”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安国际融资租赁有限公司(“平安国际租赁”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安汇富资产管理有限公司(“平安汇富”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 的联营公司
平安普惠融资担保有限公司(“平安普惠融资担保”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 的联营公司
平安普惠投资咨询有限公司(“平安普惠投资咨询”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 的联营公司

平安融资担保(天津)有限公司(“平安融资担保”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的联营公司
深圳市平安一期基础设施产业基金合伙企业(有限合伙)(“平安一期基础设施产业”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安综合金融服务有限公司(“平安综合金融”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
上海捷银电子商务有限公司(“上海捷银”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳万里通网络信息技术有限公司(“万里通”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的联营公司
平安壹钱包电子商务有限公司(“壹钱包”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳鑫橙投资管理有限公司(“深圳鑫橙”)	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
国泰君安证券	892,700,260.00	100.00	274,982,300.00	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
国泰君安证券	118,610,100,000.00	100.00	189,661,877,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,271,170.02	21,755,824.60
其中：支付销售机构的客户维护 费	755,936.36	1,772,001.64

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,423,723.37	7,251,941.57

注：支付基金托管人国泰君安证券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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

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 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安日鑫 A	场内货币	合计
国泰君安证券	868.03	284.72	1,152.75
陆金所	7,874.50	-	7,874.50
平安基金	900,509.10	5,228.54	905,737.64
平安人寿	98.07	-	98.07
平安银行	55,218.91	-	55,218.91
平安证券	349.48	136.93	486.41
合计	964,918.09	5,650.19	970,568.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安日鑫 A	场内货币	合计
陆金所	15,270.58	-	15,270.58
平安基金	1,172,150.55	4,567.20	1,176,717.75
平安银行	114,156.71	-	114,156.71
平安证券	16.09	12,929.35	12,945.44
国泰君安证券	499.09	405.51	904.60
合计	1,302,093.02	17,902.06	1,319,995.08

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.01% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%/当年天数。

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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

国泰君安证券	25,002,520.55	-	495,000,000.00	248,132.84	200,000,000.00	19,233.70
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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 2021年1月1日至2021年6月30日	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
		平安日鑫 A
基金合同生效日（2016年9月23日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	80,339,938.61	-
报告期间申购/买入总份额	175,975,709.56	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	196,368,529.68	-
报告期末持有的基金份额	59,947,118.49	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2611%	-
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
		平安日鑫 A
基金合同生效日（2016年9月23日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	51,380,363.08	-
报告期间申购/买入总份额	20,553,469.92	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-

减：报告期内赎回/卖出总份额	71,933,833.00	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

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

份额单位：份

平安日鑫 A

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
安创	31,162.74	0.0001	30,765.15	0.0001
安豪	185,820.35	0.0008	183,449.58	0.0008
安壹通	100,000,000.00	0.4355	92,982,481.48	0.3904
国泰君安证券	-	-	200,767,911.63	0.8430
捷银国际旅行社	-	-	95,285,094.12	0.4001
京乾投资	731.76	0.0000	722.41	0.0000
联新投资	445,615.52	0.0019	439,930.11	0.0018
平安不动产	46,876.77	0.0002	46,278.47	0.0002
平安财险	19.37	0.0000	45,153.27	0.0002
平安付	100,000,000.00	0.4355	115,461,484.53	0.4848
平安付电子支付	-	-	34,120,347.54	0.1433
平安汇通	6,130,497.55	0.0267	23,394,657.55	0.0982
平安集团	-	-	27,880,048.17	0.1171
平安普惠融资担保	100,104,303.70	0.4360	50,040,099.79	0.2101
平安人寿	305,069,119.92	1.3287	301,176,888.75	1.2647
平安一期基础设施产业	10,785,119.61	0.0470	10,727,047.98	0.0450
平安银行	200,000,000.00	0.8711	-	-
平安综合金融	77,288,927.45	0.3366	9,745,172.36	0.0409
上海捷银	-	-	85,065,328.22	0.3572
深圳鑫橙	34,000,000.00	0.1481	-	-
万里通	-	-	551,663,548.27	2.3165
壹钱包	-	-	5,002,550.74	0.0210

份额单位：份

场内货币

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
国际租赁深圳	277.75	0.0123	274.21	0.0156
国际租赁天津	609.56	0.0269	601.79	0.0342
平安国际租赁	716.95	0.0317	707.80	0.0402
平安汇富	149.96	0.0066	148.04	0.0084
平安科技	-	-	234.85	0.0133
平安普惠投资咨询	81.95	0.0036	80.90	0.0046
平安人寿	1.24	0.0001	1.22	0.0001
平安融资担保	50.85	0.0022	50.20	0.0028
平安证券	-	-	1,532.96	0.0870

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
国泰君安证券-活期	5,217,499.03	537,423.53	8,864,926.71	5,764,934.45
平安银行-定期	-	-	300,000,000.00	367,500.00

注：本基金的活期银行存款由基金托管人国泰君安证券保管，按银行同业利率计息；定期存款由平安银行保管，按协议利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期因投资平安银行的同业存单而取得的利息收入为人民币 2,153,167.97 元 (2020 半年度：813,487.03 元)。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

平安日鑫 A				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
276,758,977.53	-	-591,097.43	276,167,880.10	-
场内货币				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
3,048,116.89	-	-1,285.09	3,046,831.80	-

注：本基金在本年度累计分配收益 279,214,711.9 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 277,950,754.81 元，无包含于赎回款的已分配未支付收益，计入应付收益科目 1,263,957.09 元。

6.4.12 期末(2021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

注：本基金本报告期末无因认购新发/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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金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 3,790,216,954.78 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
112109212	21 浦发银行 CD212	2021 年 7 月 1 日	99.43	2,564,000	254,933,638.52
112111147	21 平安银行 CD147	2021 年 7 月 1 日	99.41	2,128,000	211,536,626.86
112115056	21 民生银行 CD056	2021 年 7 月 1 日	98.77	2,000,000	197,546,919.33
112115096	21 民生银	2021 年 7 月	99.35	296,000	29,409,038.47

	行 CD096	1 日			
112118077	21 华夏银行 CD077	2021 年 7 月 1 日	99.39	3,000,000	298,180,364.98
112182839	21 宁波银行 CD161	2021 年 7 月 1 日	99.86	2,813,000	280,915,237.53
112193749	21 成都农商银行 CD014	2021 年 7 月 1 日	99.49	1,410,000	140,282,180.62
112194490	21 徽商银行 CD013	2021 年 7 月 1 日	99.45	2,000,000	198,903,370.25
112198105	21 徽商银行 CD028	2021 年 7 月 1 日	99.16	1,932,000	191,573,217.83
160218	16 国开 18	2021 年 7 月 1 日	100.53	600,000	60,318,958.62
190207	19 国开 07	2021 年 7 月 1 日	100.56	453,000	45,551,693.07
190216	19 国开 16	2021 年 7 月 1 日	100.12	483,000	48,359,711.55
200216	20 国开 16	2021 年 7 月 1 日	100.06	2,021,000	202,229,678.46
219901	21 贴现国债 01	2021 年 7 月 1 日	99.94	2,600,000	259,848,902.43
112116005	21 上海银行 CD005	2021 年 7 月 2 日	99.92	2,022,000	202,039,671.37
112118059	21 华夏银行 CD059	2021 年 7 月 2 日	99.43	2,062,000	205,031,231.34
112180183	21 青岛农商行 CD098	2021 年 7 月 2 日	98.19	253,000	24,842,872.78
112196179	21 江苏江南农村商业银行 CD060	2021 年 7 月 2 日	99.35	1,410,000	140,086,738.65
112198128	21 广州银行 CD029	2021 年 7 月 2 日	99.16	2,000,000	198,321,937.38
112008282	20 中信银行 CD282	2021 年 7 月 5 日	99.70	3,000,000	299,091,665.29
112111147	21 平安银行 CD147	2021 年 7 月 5 日	99.41	1,327,000	131,912,172.86
112115013	21 民生银行 CD013	2021 年 7 月 5 日	98.45	449,000	44,202,266.15
112084554	20 上海农商银行 CD092	2021 年 7 月 7 日	99.73	1,000,000	99,732,202.18

112111147	21 平安银行 CD147	2021 年 7 月 7 日	99.41	1,148,000	114,118,443.44
112183715	21 天津银行 CD266	2021 年 7 月 8 日	99.36	2,000,000	198,726,018.34
112198536	21 天津银行 CD156	2021 年 7 月 8 日	99.84	247,000	24,659,967.43
合计				41,218,000	4,102,354,725.73

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 370,000,000.00 元，截至 2021 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

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约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生

的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 82.56%（上年末：56.53%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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%。于本期末，本基金前 10 名份额持有人的合计占比为 30.04%，本基金投资组合的平均剩余期限为 89 天，平均剩余存续期为 89 天。

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公司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%。

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

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

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因市场利率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。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	655,217,499.03	200,000,000.00	-	-	-	855,217,499.03
结算备付金	72,799,156.99	-	-	-	-	72,799,156.99
存出保证金	239,227.75	-	-	-	-	239,227.75
交易性金融资产	16,653,225,273.43	3,671,380,576.65	-	-	-	20,324,605,850.08
买入返售金融资产	5,706,352,379.54	-	-	-	-	5,706,352,379.54
应收利息	-	-	-	-	111,781,872.14	111,781,872.14
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	278,480,881.39	278,480,881.39
应收证券清算款	-	-	-	-	83,315,238.20	83,315,238.20
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,087,833,536.74	3,871,380,576.65	-	-	473,577,991.73	27,432,792,105.12
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,557,778.13	2,557,778.13
应付托管费	-	-	-	-	852,592.71	852,592.71
应付证券清算款	-	-	-	-	80,018,390.12	80,018,390.12
卖出回购金融资产款	4,160,216,954.78	-	-	-	-	4,160,216,954.78
应付销售服务费	-	-	-	-	170,518.55	170,518.55
应付交易费用	-	-	-	-	180,554.30	180,554.30
应付利息	-	-	-	-	832,609.64	832,609.64
应付利润	-	-	-	-	1,263,957.09	1,263,957.09
应交税费	-	-	-	-	486,056.60	486,056.60
其他负债	-	-	-	-	128,014.74	128,014.74
负债总计	4,160,216,954.78	-	-	-	86,490,471.88	4,246,707,426.66
利率敏感度缺口	18,927,616,581.96	3,871,380,576.65	-	-	387,087,519.85	23,186,084,678.46

上年度末 2020 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	6,607,662,228.22	-	-	-	-	6,607,662,228.22
结算备付金	65,150,591.18	-	-	-	-	65,150,591.18
存出保证金	79,456.70	-	-	-	-	79,456.70
交易性金融资产	13,625,842,770.78	1,986,372,920.07	-	-	-	15,612,215,690.85
买入返售金融资产	5,020,781,752.67	-	-	-	-	5,020,781,752.67
应收利息	-	-	-	-	135,447,970.69	135,447,970.69
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	56,332,031.37	56,332,031.37
应收证券清算款	-	-	-	-	81,255,726.67	81,255,726.67
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	25,319,516,799.55	1,986,372,920.07	-	-	273,035,728.73	27,578,925,448.35
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,859,177.58	2,859,177.58
应付托管费	-	-	-	-	953,059.21	953,059.21
应付证券清算款	-	-	-	-	81,023,505.10	81,023,505.10
卖出回购金融资产款	3,499,913,460.11	-	-	-	-	3,499,913,460.11
应付销售服务费	-	-	-	-	190,611.83	190,611.83
应付交易费用	-	-	-	-	218,473.47	218,473.47
应付利息	-	-	-	-	592,368.87	592,368.87
应付利润	-	-	-	-	1,856,339.61	1,856,339.61
应交税费	-	-	-	-	349,478.49	349,478.49
其他负债	-	-	-	-	239,000.00	239,000.00
负债总计	3,499,913,460.11	-	-	-	88,282,014.16	3,588,195,474.27
利率敏感度缺口	21,819,603,339.44	1,986,372,920.07	-	-	184,753,714.57	23,990,729,974.08

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	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	13,201,952.31	8,631,316.03
	市场利率上升 25 个基点	-13,181,838.68	-8,612,578.70

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。本基金持有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

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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	20,324,605,850.08	74.09
	其中：债券	19,915,605,850.08	72.60
	资产支持证 券	409,000,000.00	1.49
2	买入返售金融资产	5,706,352,379.54	20.80
	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	928,016,656.02	3.38
4	其他各项资产	473,817,219.48	1.73
5	合计	27,432,792,105.12	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	5.80	
	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	4,160,216,954.78	17.94
	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：本基金本报告期债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	40.36	18.29
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天 (含) — 60 天	7.03	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天 (含) — 90 天	20.97	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天 (含) — 120 天	17.93	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天 (含) — 397 天 (含)	30.34	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	116.63	18.29

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

注: 本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	309,819,746.34	1.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	871,484,126.71	3.76
	其中: 政策性金融债	871,484,126.71	3.76
4	企业债券	596,898,536.84	2.57
5	企业短期融资券	5,965,655,570.42	25.73
6	中期票据	1,145,921,172.42	4.94
7	同业存单	11,025,826,697.35	47.55
8	其他	-	-
9	合计	19,915,605,850.08	85.89
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	112111147	21 平安银行 CD147	9,500,000	944,359,941.35	4.07
2	200216	20 国开 16	3,600,000	360,230,995.77	1.55
3	112116005	21 上海银行 CD005	3,000,000	299,762,123.69	1.29
4	112182839	21 宁波银行 CD161	3,000,000	299,589,659.65	1.29
5	112120120	21 广发银行 CD120	3,000,000	299,583,536.46	1.29
6	112008282	20 中信银行 CD282	3,000,000	299,091,665.29	1.29
7	112118059	21 华夏银行 CD059	3,000,000	298,299,560.63	1.29
8	112109212	21 浦发银行 CD212	3,000,000	298,284,288.44	1.29
9	112118077	21 华夏银行 CD077	3,000,000	298,180,364.98	1.29
10	219901	21 贴现国债 01	2,600,000	259,848,902.43	1.12

7.7 “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	0.1067%
报告期内偏离度的最低值	-0.0363%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0685%

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%。

7.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	169585	20 花 04A1	800,000	80,000,000.00	0.35
2	169515	弘花 05A	670,000	67,000,000.00	0.29
3	137116	20 睿成 01	560,000	56,000,000.00	0.24
4	137137	链融 30A1	500,000	50,000,000.00	0.22
5	137115	20 合信 05	400,000	40,000,000.00	0.17
6	137222	中借 05A	400,000	40,000,000.00	0.17
7	137597	天著优 11	360,000	36,000,000.00	0.16
8	137647	21 弘基 1A	200,000	20,000,000.00	0.09
9	169522	东借 07A1	200,000	20,000,000.00	0.09

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

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

上海银保监局于 2020 年 8 月 10 日做出沪银保监银罚决字（2020）12 号处罚决定，由于上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）：1. 未按专营部门制规定开展同业业务；2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3. 延迟支付同业投资资金吸收存款；4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制；6. 个人消费贷款贷后管理未尽职；7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模；8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；9. 办理无真实贸易背景的贴现业务；10. 委托贷款资金来源审查未尽职；11. 未按权限和程序办理委托贷款业务；12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务。根据相关规定对公司罚款 2100 万元。

上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 5 月至 2019 年 1 月期间，未按规定开展代销业务，中国银行保险监督管理委员会上海监管局根据相关规定作出沪银保监罚决字（2021）29 号处罚决定，要求公司责令改正，并处罚款共计 760 万元。

上海银行股份有限公司（以下简称“公司”）因违反《中华人民共和国商业银行法》第七十三条第四项、第七十四条第八项、第八十条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第一项、第五项、第四十七条，中国银行保险监督管理委员会上海监管局于 2020 年 8 月 14 日作出沪银保监银罚决字（2020）14 号，要求公司责令改正，没收违法所得 27.155092 万元，罚款 1625 万

元，罚没合计 1652.155092 万元。

国家外汇管理局北京外汇管理部于 2020 年 8 月 25 日做出京汇罚〔2020〕17 号处罚决定，由于中信银行股份有限公司（以下简称“公司”）存在以下违法违规行为：违规办理内保外贷业务；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理售汇业务；违反外汇账户管理规定。根据相关规定对公司给予警告，没收违法所得 14857527.66 元人民币，并处 1177.04 万元人民币罚款。

中国人民银行于 2021 年 2 月 5 日作出银罚字〔2021〕1 号处罚决定，由于中信银行股份有限公司（以下简称“公司”）：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；3. 未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；4. 与身份不明的客户进行交易。根据相关规定对公司罚款 2890 万元。

中信银行股份有限公司（以下简称“公司”）因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则、《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 3 月 17 日作出银保监罚决字〔2021〕5 号处罚决定，对公司罚款 450 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 6 月 29 日作出银保监罚决字〔2020〕14 号处罚决定，由于广发银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）向关系人发放信用贷款；（二）对个人贷款资金使用未做到有效跟踪监控，使消费性贷款用于支付购房首付款；（三）违规办理无真实贸易背景银行承兑汇票；（四）对银行承兑汇票贸易背景审查不规范；（五）信贷资金购买本行理财产品；（六）以贷款资金作为保证金发放贷款；（七）不良贷款转让不规范；（八）违规向房地产开发企业发放流动资金贷款；（九）违规向资本金不到位的房地产开发企业发放贷款；（十）资金以同业投资形式违规投向房地产领域；（十一）理财资金违规投向房地产企业；（十二）面向不合格个人投资者发行理财产品投资权益性资产；（十三）未按规定向投资者披露理财产品投资非标准化债权资产情况；（十四）向地方政府违规融资，要求地方政府违规提供担保承诺；（十五）投资交易本行主承销债券超规定比例；（十六）信用卡透支用于非消费领域；（十七）案件信息报送不规范；（十八）未经任职资格核准履行高级管理人员职责；（十九）违规提前发放应延期支付的绩效薪酬；（二十）股东违规提名董事及监事；（二十一）股权质押管理不到位。根据相关规定没收公司违法所得 511.53 万元，罚款 8771.53 万元，罚没合计 9283.06 万元。

银保监会于 2020 年 7 月 13 日作出银保监罚决字〔2020〕24 号处罚决定，由于华夏银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）内控制度执行不到位，严重违反审慎经营规则；（二）生产系统存在重大风险隐患，严重违反审慎经营规则；（三）账务管理工作存在重大错漏，长期未发现

异常挂账情况，严重违反审慎经营规则；（四）长期未处置风险监控预警信息，严重违反审慎经营规则。根据相关规定对公司罚款 110 万元。

银保监会于 2021 年 5 月 17 日作出银保监罚决字（2021）19 号处罚决定，由于华夏银行股份有限公司（以下简称“公司”）违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、第四十七条和相关审慎经营规则，根据相关规定对公司罚款 9830 万元。

国家开发银行违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 25 日做出银保监罚决字（2020）67 号处罚决定，罚款 4880 万元。

国家开发银行海南省分行因擅自提供对外担保，违反《中华人民共和国外汇管理条例》（中华人民共和国国务院令 532 号）第四十三条相关规定，国家外汇管理局海南省分局于 2021 年 3 月 3 日作出琼汇检罚（2021）2 号处罚决定，对该分行给予警告，处人民币 4266.16 万元的罚款。

本基金管理人对上述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。我们对上述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。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	239,227.75
2	应收证券清算款	83,315,238.20
3	应收利息	111,781,872.14
4	应收申购款	278,480,881.39
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	473,817,219.48

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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(%)
平安日鑫A	189,059	121,441.23	21,860,241,548.58	95.21	1,099,316,269.42	4.79
场内货币	1,123	2,017.16	316,085.04	13.95	1,949,183.56	86.05
合计	190,166	120,746.21	21,860,557,633.62	95.20	1,101,265,452.98	4.80

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末上市基金前十名持有人

场内货币

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	建信基金—中信建投证券—建信基金—建信创鑫增强3号集合资产管理计划	63,300.00	2.79
2	陈爱陈	48,610.00	2.15
3	孙元勋	46,412.00	2.05
4	建信基金—中信建投证券—建信基金—建信创鑫增强1号集合资产管理计划	40,462.00	1.79
5	陈忠年	39,349.00	1.74
6	郁葱葱	38,660.00	1.71
7	孙永光	38,037.00	1.68
8	林结波	36,040.00	1.59
9	姚书新	32,860.00	1.45
10	上海格量资产管理有限公司—格量专享1号私募证券投资基金	30,158.00	1.33

8.3 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	1,143,089,690.43	4.93
2	银行类机构	1,004,354,589.44	4.33
3	其他机构	1,000,064,590.53	4.31
4	银行类机构	776,579,410.43	3.35
5	银行类机构	604,736,219.08	2.61
6	银行类机构	511,688,465.90	2.21
7	银行类机构	508,352,755.51	2.19
8	银行类机构	507,604,805.71	2.19
9	券商类机构	500,204,232.48	2.16
10	银行类机构	406,985,516.40	1.76

8.4 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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安日鑫 A	302,741.51	0.0013
	场内货币	-	-
	合计	302,741.51	0.0013

注：上述从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.5 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	平安日鑫 A	0
	场内货币	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安日鑫 A	0
	场内货币	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安日鑫 A	场内货币
基金合同生效日 (2016年9月23日) 基金份额总额	205,870,400.09	13,846,570.00

本报告期初基金份额总额	23,814,541,597.51	1,761,883.77
本报告期基金总申购份额	45,290,407,611.16	3,752,911.16
减：本报告期基金总赎回份额	46,145,391,390.67	3,249,526.33
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	22,959,557,818.00	2,265,268.60

注：本基金 A 类份额净值为 1.00 元，E 类份额净值为 100.00 元

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

2021 年 3 月 2 日，王金涛担任平安基金管理有限公司总经理助理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	
国泰君安证券	3	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

3、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

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
国泰君安证券	892,700,260.00	100.00%	118,610,100,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期内本基金偏离度绝对值未出现超过 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	平安基金管理有限公司 2020 年 12 月 31 日基金净值公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 01 日
2	平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
3	平安交易型货币市场基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
4	平安基金管理有限公司关于平安交	中国证监会规定报刊及	2021 年 02 月 03 日

	易型货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	网站	
5	平安交易型货币市场基金春节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 02 月 05 日
6	平安交易型货币市场基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 02 日
7	平安交易型货币市场基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 02 日
8	平安交易型货币市场基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 31 日
9	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 09 日
10	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 12 日
11	平安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、定期定额投资起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 15 日
12	平安交易型货币市场基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 21 日
13	平安交易型货币市场基金劳动节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 23 日
14	平安基金管理有限公司关于平安交易型货币市场基金 A 类份额新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为销售机构及开通定投业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 14 日
15	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 02 日
16	平安基金管理有限公司关于新增江海证券有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 09 日
17	关于平安交易型货币市场基金 A 类份额新增诺亚正行基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 23 日
18	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日
19	平安基金管理有限公司关于旗下部	中国证监会规定报刊及	2021 年 06 月 25 日

	分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构的公告	网站	
--	-----------------------------	----	--

§ 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

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安交易型货币市场基金募集注册的文件
- (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) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 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：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日