

# 平安金管家货币市场基金 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 30 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

<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.....	5
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>6</b>
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
<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遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
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.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
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.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	40
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	40

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 .....	41
7.9 投资组合报告附注 .....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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 .....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	49
10.9 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安金管家货币市场基金	
基金简称	平安金管家货币	
基金主代码	003465	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 7 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	22,840,997,135.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安金管家货币 A	平安金管家货币 C
下属分级基金的交易代码	003465	007730
报告期末下属分级基金的份额总额	22,803,783,235.61 份	37,213,899.91 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格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稳定回报。
投资策略	本基金根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限及平均剩余存续期。对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼

邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	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)		
	平安金管家货币 A	平安金管家货币 C	
本期已实现收益	272,580,331.75	430,216.36	
本期利润	272,580,331.75	430,216.36	
本期净值收益率	1.2811%	1.1804%	
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	22,803,783,235.61	37,213,899.91
	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(2021年6月30日)		
	累计净值收益率	15.9189%	4.6083%

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 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

平安金管家货币 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	0.2045%	0.0034%	0.1125%	0.0000%	0.0920%	0.0034%
过去三个月	0.6174%	0.0032%	0.3413%	0.0000%	0.2761%	0.0032%
过去六个月	1.2811%	0.0028%	0.6788%	0.0000%	0.6023%	0.0028%
过去一年	2.5375%	0.0025%	1.3688%	0.0000%	1.1687%	0.0025%
过去三年	8.7443%	0.0023%	4.1100%	0.0000%	4.6343%	0.0023%
自基金合同生效起至今	15.9189%	0.0026%	6.2513%	0.0000%	9.6676%	0.0026%

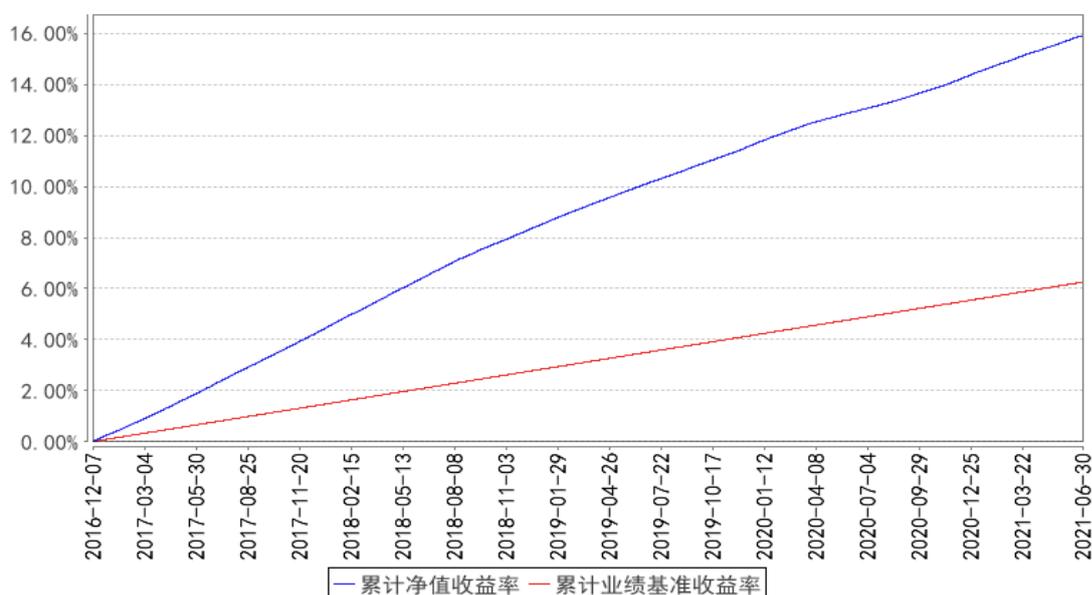
平安金管家货币 C

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	0.1878%	0.0034%	0.1125%	0.0000%	0.0753%	0.0034%
过去三个月	0.5671%	0.0032%	0.3413%	0.0000%	0.2258%	0.0032%

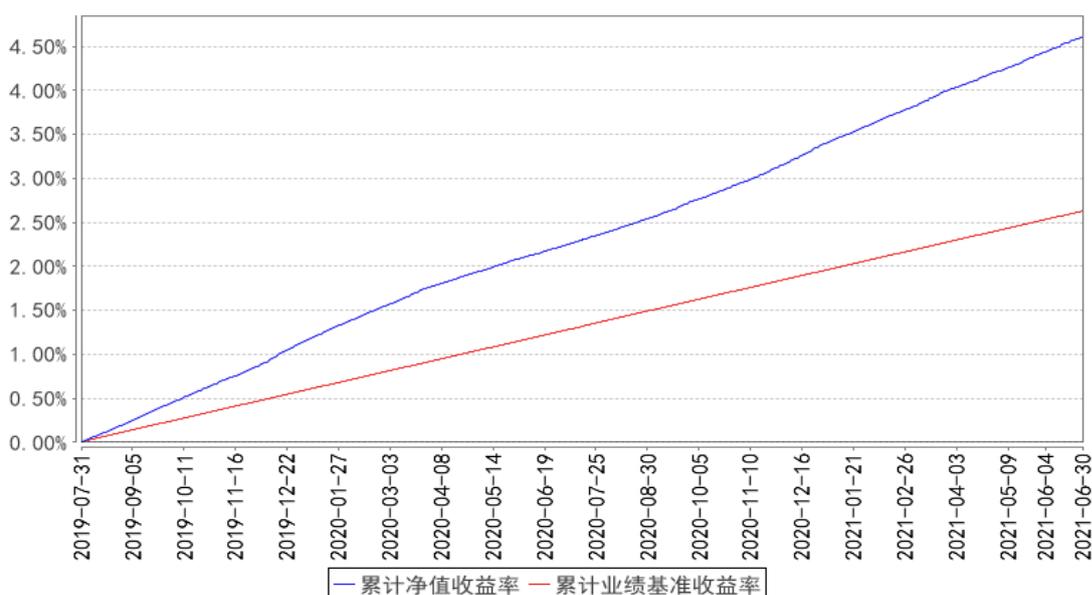
过去六个月	1.1804%	0.0028%	0.6788%	0.0000%	0.5016%	0.0028%
过去一年	2.3333%	0.0025%	1.3688%	0.0000%	0.9645%	0.0025%
自基金合同生效起至今	4.6083%	0.0023%	2.6288%	0.0000%	1.9795%	0.0023%

### 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

平安金管家货币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



平安金管家货币C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 12 月 07 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基金合同约定；

3、本基金于 2019 年 07 月 29 日增设 C 类份额，C 类份额从 2019 年 07 月 31 日开始有份额，所以上 C 类份额走势图从 2019 年 07 月 31 日开始。

### 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
段玮婧	平安金管家货币市场基金基金经理	2017 年 1 月 5 日	-	14 年	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，曾担任投资研究部固定收益组投资经理。现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、平安乐享一年定期开放债券型证券投资基金、平安乐顺 39 个月定期开放债券型证券投资基金、平安合聚 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合兴 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安高等级债债券型证券投资基金、平安惠涌纯债债券型证券投资

					资基金、平安惠文纯债债券型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。

#### 4.1.3 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

注：无。

#### 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《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《证券投资基金管理公司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

2021 年上半年债券市场整体表现较好，收益率在二月份上行至年内高点后震荡下行。宏观基本上，国内外均延续复苏态势。受益于海外经济的修复，出口对国内经济形成较强的支撑。消费方面，虽然有局部的疫情扰动影响，依然处于恢复过程中。投资方面，制造业持续明显，房地

产在政策严控的大背景下有放缓迹象，基建投资略低于预期。物价方面，PPI 受上游大宗商品涨价影响快速上行，CPI 在可接受的区间内温和回升。财政政策强调落实落细，货币政策保持合理充裕。报告期内，本基金的投资操作以安全性和流动性管理为主要原则，在有效控制偏离度的前提下，适度拉长久期，在关键时点增加杠杆操作，进一步调整大类资产的配置比例，提高组合整体收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期平安金管家货币 A 的基金份额净值收益率为 1.2811%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%；本报告期平安金管家货币 C 的基金份额净值收益率为 1.1804%，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，宏观经济恢复动能有边际走弱的迹象。政治局会议要求财政政策提升效能，推动形成实物工作量，预计将提振基建投资。货币政策依然保持合理充裕，同时强调跨周期调节和“以我为主”的政策中心。整体上看，下半年的政策思路依然是“宽货币+结构性紧信用”的基调，对债券市场较为友好。本基金将以加强流动性管理为主要原则，稳健操作，严控风险，密切关注各类资产价格的走势，把握市场配置机会，兼顾安全性和流动性的同时力争提高组合整体收益。

#### 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 273,010,548.11 元，实际分配收益

273,010,548.11 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：平安金管家货币市场基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,068,824,608.09	7,689,214,287.77
结算备付金		1,850,434.58	2,409,523.81
存出保证金		198,137.05	-
交易性金融资产	6.4.7.2	17,022,715,079.10	11,345,194,724.48
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		15,961,312,575.68	10,545,689,070.45

资产支持证券投资		1,061,402,503.42	799,505,654.03
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	500,076,910.12	7,418,535,867.81
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	160,777,899.14	104,354,809.69
应收股利		-	-
应收申购款		238,546,845.48	110,873,833.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		25,992,989,913.56	26,670,583,047.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020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		3,143,171,466.22	1,825,996,247.00
应付证券清算款		-	2,500,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,800,879.65	3,180,245.18
应付托管费		950,219.90	795,061.28
应付销售服务费		957,857.53	800,958.28
应付交易费用	6.4.7.7	162,585.65	167,337.70
应交税费		532,448.87	563,154.29
应付利息		1,161,927.87	191,906.32
应付利润		1,007,377.61	2,155,008.50
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	248,014.74	239,000.00
负债合计		3,151,992,778.04	4,334,088,918.55
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	22,840,997,135.52	22,336,494,128.67
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		22,840,997,135.52	22,336,494,128.67
负债和所有者权益总计		25,992,989,913.56	26,670,583,047.22

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 22,840,997,135.52 份，其中平安金管家货币 A 基金份额总额 22,803,783,235.61 份，基金份额净值 1.0000 元。平安金管家货币 C 基金份额总额 37,213,899.91 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 6.2 利润表

会计主体：平安金管家货币市场基金

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		312,919,314.65	245,721,359.71
1. 利息收入		310,287,026.76	248,715,872.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	88,489,410.68	49,882,667.64
债券利息收入		184,665,596.86	160,774,413.38
资产支持证券利息收入		14,235,319.83	23,026,179.58
买入返售金融资产收入		22,896,699.39	15,032,611.63
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,632,287.89	-2,994,512.52
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	2,632,287.89	-3,046,548.93
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	52,036.41
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		39,908,766.54	36,762,439.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,345,196.62	17,754,919.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,336,299.24	4,438,729.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,372,814.88	4,457,496.16
4. 交易费用	6.4.7.19	449.36	100.00
5. 利息支出		7,423,091.74	9,654,781.41
其中：卖出回购金融资产支出		7,423,091.74	9,654,781.41
6. 税金及附加		297,199.96	318,468.76
7. 其他费用	6.4.7.20	133,714.74	137,944.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		273,010,548.11	208,958,919.84
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		273,010,548.11	208,958,919.84
-------------------	--	----------------	----------------

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安金管家货币市场基金

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）	22,336,494,128.67	-	22,336,494,128.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	273,010,548.11	273,010,548.11
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）	504,503,006.85	-	504,503,006.85
其中：1. 基金申购款	35,324,786,936.48	-	35,324,786,936.48
2. 基金赎回款	-34,820,283,929.63	-	-34,820,283,929.63
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）	-	-273,010,548.11	-273,010,548.11
五、期末所有者权益（基金净值）	22,840,997,135.52	-	22,840,997,135.52
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）	16,370,382,762.69	-	16,370,382,762.69

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	208,958,919.84	208,958,919.84
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）	95,250,509.09	-	95,250,509.09
其中：1. 基金申购款	26,295,056,208.80	-	26,295,056,208.80
2. 基金赎回款	-26,199,805,699.71	-	-26,199,805,699.71
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）	-	-208,958,919.84	-208,958,919.84
五、期末所有者权益（基金净值）	16,465,633,271.78	-	16,465,633,271.78

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

平安金管家货币市场基金(原名为平安大华金管家货币市场基金，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]2152号《关于准予平安大华金管家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《平安大华金管家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1,486,372,865.79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1598号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华金管家货币市场基金基金合同》于2016年12月7日正式生效，基金合同生效日的

基金份额总额为 1,486,415,142.41 份基金份额，其中认购资金利息折合 42,276.62 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，基金托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

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》，平安大华金管家货币市场基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安金管家货币市场基金。

根据《平安金管家货币市场基金基金合同》和《平安基金管理有限公司关于平安金管家货币市场基金增设 C 类份额等相关事项的公告》，本基金根据销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。按照 0.05% 年费率计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；按照 0.25% 年费率计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码，并分别公布每万份基金净收益和 7 日年化收益率。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安金管家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 1 年以内（含 1 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，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》、《平安金管家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、会计估计与最近一年度报告一致。

#### 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 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	824,608.09
定期存款	8,068,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	1,504,000,000.00
存款期限3个月以上	6,564,000,000.00
其他存款	-
合计	8,068,824,608.09

##### 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	656,613,483.20	655,578,250.00	-1,035,233.20	- 0.0045
	银行间市场	15,304,699,092.48	15,320,001,600.00	15,302,507.52	0.0670
	合计	15,961,312,575.68	15,975,579,850.00	14,267,274.32	0.0625
	资产支持证券	1,061,402,503.42	1,063,910,400.00	2,507,896.58	0.0110
	合计	17,022,715,079.10	17,039,490,250.00	16,775,170.90	0.0734

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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	-	-
银行间市场	500,076,910.12	-

合计	500,076,910.12	-
----	----------------	---

#### 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	12,086.89
应收定期存款利息	41,175,300.91
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	749.43
应收债券利息	99,352,922.63
应收资产支持证券利息	20,092,561.75
应收买入返售证券利息	144,197.25
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	80.28
合计	160,777,899.14

#### 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	162,585.65
合计	162,585.65

#### 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	248,014.74
合计	248,014.74

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 平安金管家货币 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	22,290,887,060.41	22,290,887,060.41
本期申购	35,219,256,239.70	35,219,256,239.70
本期赎回（以“-”号填列）	-34,706,360,064.50	-34,706,360,064.50
-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	22,803,783,235.61	22,803,783,235.61

## 平安金管家货币 C

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	45,607,068.26	45,607,068.26
本期申购	105,530,696.78	105,530,696.78
本期赎回（以“-”号填列）	-113,923,865.13	-113,923,865.13
-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	37,213,899.91	37,213,899.91

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

## 平安金管家货币 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	272,580,331.75	-	272,580,331.75
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	-272,580,331.75	-	-272,580,331.75
本期末	-	-	-

## 平安金管家货币 C

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	430,216.36	-	430,216.36
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	-430,216.36	-	-430,216.36
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	447,385.18
定期存款利息收入	87,937,009.50
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	104,128.65
其他	887.35
合计	88,489,410.68

## 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期末持有股票。

## 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	2,632,287.89
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	2,632,287.89
----	--------------

#### 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	25,458,466,002.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	25,178,534,433.82
减：应收利息总额	277,299,280.31
买卖债券差价收入	2,632,287.89

#### 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	512,222,897.04
减：卖出资产支持证券成本总额	497,800,000.00
减：应收利息总额	14,422,897.04
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	449.36
合计	449.36

## 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	-
银行间账户维护费	14,100.00
其他	600.00
合计	133,714.74

## 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
平安银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	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
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
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
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
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
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
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
深圳市盛钧投资管理有限公司(“盛钧”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

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：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无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

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	21,345,196.62	17,754,919.07
其中：支付销售机构的客户维护 费	2,438,484.05	1,836,644.04

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 0.20% 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 × 0.20% / 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	5,336,299.24	4,438,729.79

注：支付基金托管行平安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 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		
	平安金管家货币 A	平安金管家货币 C	合计
陆金所	339,550.90	1,236.50	340,787.40
平安基金	3,601,038.29	95.70	3,601,133.99
平安人寿	3,033.24	8.32	3,041.56
平安银行	428,569.93	-	428,569.93

平安证券	221,482.04	-	221,482.04
合计	4,593,674.40	1,340.52	4,595,014.92
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		
	平安金管家货币 A	平安金管家货币 C	合计
	陆金所	135,949.67	-
平安基金	3,273,082.36	10.79	3,273,093.15
平安人寿	2,774.31	-	2,774.31
平安银行	509,000.63	-	509,000.63
平安证券	92,266.74	-	92,266.74
合计	4,013,073.71	10.79	4,013,084.50

注：支付基金销售机构的销售服务费按 A 类基金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：

A 类基金日销售服务费 = A 类基金前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金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：

C 类基金日销售服务费 = C 类基金前一日基金资产净值 × 0.25% / 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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 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
	平安金管家货币 A	平安金管家货币 C

基金合同生效日（2016年12月7日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	100,520,484.56	-
报告期间申购/买入总份额	1,136,884.89	-
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	83,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	18,657,369.45	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0818%	-
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
	平安金管家货币 A	平安金管家货币 C
基金合同生效日（2016年12月7日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	51,486,417.13	-
报告期间申购/买入总份额	598,978.14	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	52,085,395.27	-
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

##### 平安金管家货币 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	200,511.31	0.0009	-	-
联新投资	512,464.12	0.0022	372,702.31	0.0017

平安不动产	512.93	0.0000	506.41	0.0000
平安汇通	14,646,778.97	0.0642	14,460,762.19	0.0649
平安人寿	840.30	0.0000	829.55	0.0000
平安银行	806,073,237.70	3.5348	104,690,450.61	0.4697
平安综合金融	29,301,085.77	0.1285	197,692,172.36	0.8869
盛钧	194,068.28	0.0009	-	-

#### 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
平安银行-活期	824,608.09	447,385.18	886,167.03	1,800,784.94

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业存款利率计息，定期存款按协议利率计息。

#### 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

平安金管家货币 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
273,725,247.20	-	-1,144,915.45	272,580,331.75	-
平安金管家货币 C				
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
432,931.80	-	-2,715.44	430,216.36	-

注：本基金在本年度累计分配收益 273,010,548.11 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 272,003,170.50 元，计入应付收益科目 1,007,377.61 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 6 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 3,143,171,466.22 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
112006273	20 交通银行 CD273	2021 年 7 月 1 日	98.77	339,000	33,482,689.73
112009513	20 浦发银行 CD513	2021 年 7 月 1 日	98.58	972,000	95,817,895.78
112011323	20 平安银行 CD323	2021 年 7 月 1 日	100.00	1,607,000	160,700,000.00
112105038	21 建设银行 CD038	2021 年 7 月 1 日	98.05	1,000,000	98,053,547.30
112182189	21 重庆农村商行 CD137	2021 年 7 月 1 日	99.52	2,000,000	199,032,781.38
112182395	21 北京农商银行 CD150	2021 年 7 月 1 日	98.80	2,000,000	197,605,502.57
112183221	21 宁波银行 CD164	2021 年 7 月 1 日	99.41	2,585,000	256,975,268.51
112197748	21 徽商银行 CD026	2021 年 7 月 1 日	99.20	1,091,000	108,222,569.93
180212	18 国开 12	2021 年 7 月 1 日	100.19	2,984,000	298,966,612.31
190202	19 国开 02	2021 年 7 月 1 日	100.33	3,093,000	310,309,891.34

200010	20 附息国债 10	2021 年 7 月 1 日	100.01	2,100,000	210,014,764.17
112009513	20 浦发银行 CD513	2021 年 7 月 2 日	98.58	2,953,000	291,101,076.37
112018433	20 华夏银行 CD433	2021 年 7 月 2 日	98.94	62,000	6,134,564.12
112104013	21 中国银行 CD013	2021 年 7 月 2 日	98.09	1,500,000	147,137,776.76
112104019	21 中国银行 CD019	2021 年 7 月 2 日	98.73	500,000	49,367,094.16
112109212	21 浦发银行 CD212	2021 年 7 月 2 日	99.43	2,500,000	248,570,240.38
180212	18 国开 12	2021 年 7 月 2 日	100.19	25,000	2,504,747.09
210206	21 国开 06	2021 年 7 月 2 日	99.96	3,100,000	309,886,580.26
112007209	20 招商银行 CD209	2021 年 7 月 5 日	98.74	1,500,000	148,108,474.86
112009513	20 浦发银行 CD513	2021 年 7 月 5 日	98.58	75,000	7,393,356.16
112010485	20 兴业银行 CD485	2021 年 7 月 5 日	98.94	1,000,000	98,944,582.66
112015570	20 民生银行 CD570	2021 年 7 月 5 日	98.67	1,000,000	98,674,572.82
合计				33,986,000	3,377,004,588.66

#### 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 69.40%（上年末：45.77%）。

#### 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 11.62%，本基金投资组合的平均剩余期限为 105 天，平均剩余存续期为 105 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%。

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。

##### 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	7,568,824,608.09	500,000,000.00	-	-	-	8,068,824,608.09
结算备付金	1,850,434.58	-	-	-	-	1,850,434.58
存出保证金	198,137.05	-	-	-	-	198,137.05
交易性金融资产	15,667,325,164.43	1,355,389,914.67	-	-	-	17,022,715,079.10
买入返售金融资产	500,076,910.12	-	-	-	-	500,076,910.12
应收利息	-	-	-	-	160,777,899.14	160,777,899.14
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	238,546,845.48	238,546,845.48
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,738,275,254.27	1,855,389,914.67	-	-	399,324,744.62	25,992,989,913.56
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,800,879.65	3,800,879.65
应付托管费	-	-	-	-	950,219.90	950,219.90
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,143,171,466.22	-	-	-	-	3,143,171,466.22
应付销售服务费	-	-	-	-	957,857.53	957,857.53

应付交易费用	-	-	-	-	-	162,585.65	162,585.65
应付利息	-	-	-	-	-	1,161,927.87	1,161,927.87
应付利润	-	-	-	-	-	1,007,377.61	1,007,377.61
应交税费	-	-	-	-	-	532,448.87	532,448.87
其他负债	-	-	-	-	-	248,014.74	248,014.74
负债总计	3,143,171,466.22	-	-	-	-	8,821,311.82	3,151,992,778.04
利率敏感度缺口	20,595,103,788.05	1,855,389,914.67	-	-	-	390,503,432.80	22,840,997,135.52
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	7,489,214,287.77	200,000,000.00	-	-	-	-	7,689,214,287.77
结算备付金	2,409,523.81	-	-	-	-	-	2,409,523.81
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	9,303,965,224.84	2,041,229,499.64	-	-	-	-	11,345,194,724.48
买入返售金融资产	7,418,535,867.81	-	-	-	-	-	7,418,535,867.81
应收利息	-	-	-	-	-	104,354,809.69	104,354,809.69
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	110,873,833.66	110,873,833.66
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	24,214,124,904.23	2,241,229,499.64	-	-	-	215,228,643.35	26,670,583,047.22
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,180,245.18	3,180,245.18
应付托管费	-	-	-	-	-	795,061.28	795,061.28
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,500,000,000.00	2,500,000,000.00
卖出回购金融资产款	1,825,996,247.00	-	-	-	-	-	1,825,996,247.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	800,958.28	800,958.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	167,337.70	167,337.70
应付利息	-	-	-	-	-	191,906.32	191,906.32
应付利润	-	-	-	-	-	2,155,008.50	2,155,008.50
应交税费	-	-	-	-	-	563,154.29	563,154.29
其他负债	-	-	-	-	-	239,000.00	239,000.00

负债总计	1,825,996,247.00	-	-	-	2,508,092,671.55	4,334,088,918.55
利率敏感度缺口	22,388,128,657.23	2,241,229,499.64	-	-	-2,292,864,028.20	22,336,494,128.67

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	8,148,352.68	4,777,481.26
	市场利率上升 25 个基点	-8,124,613.87	-4,764,329.62

#### 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，所面临的重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	17,022,715,079.10	65.49
	其中：债券	15,961,312,575.68	61.41
	资产支持证券	1,061,402,503.42	4.08
2	买入返售金融资产	500,076,910.12	1.92
	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	8,070,675,042.67	31.05
4	其他各项资产	399,522,881.67	1.54
5	合计	25,992,989,913.56	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	2.89	
	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	3,143,171,466.22	13.76
	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**

### 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	105

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	75

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本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	18.50	13.76
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	30.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	39.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	112.05	13.76

### 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	210,014,764.17	0.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	981,742,972.73	4.30
	其中：政策性金融债	961,571,686.04	4.21
4	企业债券	656,613,483.20	2.87
5	企业短期融资券	5,091,746,451.45	22.29
6	中期票据	798,779,990.24	3.50
7	同业存单	8,222,414,913.89	36.00
8	其他	-	-
9	合计	15,961,312,575.68	69.88
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	112183221	21 宁波银行 CD164	4,500,000	447,345,728.55	1.96
2	112009513	20 浦发银行 CD513	4,000,000	394,312,328.30	1.73
3	190202	19 国开 02	3,300,000	331,077,478.64	1.45
4	180212	18 国开 12	3,200,000	320,607,627.14	1.40
5	210206	21 国开 06	3,100,000	309,886,580.26	1.36
6	112011323	20 平安银行 CD323	3,000,000	300,000,000.00	1.31
7	112116113	21 上海银行 CD113	3,000,000	299,393,298.83	1.31
8	112116103	21 上海银行 CD103	2,500,000	248,587,213.14	1.09
9	112109212	21 浦发银行 CD212	2,500,000	248,570,240.38	1.09
10	200010	20 付息国债 10	2,100,000	210,014,764.17	0.92

### 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	0.1112%
报告期内偏离度的最低值	0.0017%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0744%

#### 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	137231	蚁信 16A	1,270,000	127,000,000.00	0.56
2	138984	20 合信 02	900,000	90,251,038.20	0.40
3	137363	链诚 3A1	770,000	77,270,585.29	0.34
4	169269	20 花呗 3A	680,000	68,000,000.00	0.30
5	169212	20 花 03A1	650,000	65,000,000.00	0.28
6	179211	20 信易 5A	605,000	60,500,000.00	0.26
7	179252	20 天圆 04	520,000	52,000,000.00	0.23
8	137604	招慧 10A	405,000	40,500,000.00	0.18
9	137234	链融 32A1	400,000	40,239,025.66	0.18
10	137478	瑞新 23A1	400,000	40,137,131.12	0.18

**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。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

**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 第 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	198,137.05
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	160,777,899.14
4	应收申购款	238,546,845.48
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	399,522,881.67

### 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	持有人户 数（户）	户均持有 的基金份	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

级别		额	持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比 例 (%)
平安金管家货币 A	1,031,240	22,112.97	18,482,723,537.04	81.05	4,321,059,698.57	18.95
平安金管家货币 C	5,812	6,402.94	8,464.78	0.02	37,205,435.13	99.98
合计	1,036,106	22,045.04	18,482,732,001.82	80.92	4,358,265,133.70	19.08

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	312,952,951.49	1.37
2	银行类机构	310,945,791.75	1.36
3	保险类机构	306,442,708.71	1.34
4	银行类机构	302,651,541.34	1.33
5	银行类机构	300,231,055.21	1.31
6	其他机构	252,806,766.71	1.11
7	银行类机构	226,718,952.17	0.99
8	基金类机构	222,794,194.41	0.98
9	银行类机构	209,096,885.08	0.92
10	银行类机构	207,653,067.97	0.91

## 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（%）
基金管理人所有从业人员持	平安金管家货币 A	1,566,932.80	0.0069
	平安金管家货币 C	216.97	0.0006

有本基金			
	合计	1,567,149.77	0.0069

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）。

#### 8.4 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	平安金管家货币 A	>100
	平安金管家货币 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	平安金管家货币 A	0
	平安金管家货币 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安金管家货币 A	平安金管家货币 C
基金合同生效日 (2016年12月7日)基金份额总额	1,486,415,142.41	-
本报告期期初基金份额总额	22,290,887,060.41	45,607,068.26
本报告期基金总申购份额	35,219,256,239.70	105,530,696.78
减：本报告期基金总赎回份额	34,706,360,064.50	113,923,865.13
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	22,803,783,235.61	37,213,899.91

## §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。

2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

## 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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 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

2. 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
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	2,629,025,089.16	100.00%	8,323,800,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

### 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	平安金管家货币市场基金 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	平安金管家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
5	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽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 03 月 12 日
6	平安金管家货币市场基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 31 日
7	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
8	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
9	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
10	平安基金管理有限公司关于平安金管家货币市场基金 C 类份额新增北京蛋卷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 16 日
11	平安金管家货币市场基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 22 日
12	平安金管家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
13	平安金管家货币市场基金基金产品	中国证监会规定报刊及	2021 年 05 月 31 日

	资料概要更新	网站	
14	平安金管家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 05 月 31 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	关于终止苏州财路基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 03 日
17	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
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	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 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

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金管家货币市场基金募集注册的文件
- (2) 平安金管家货币市场基金基金合同
- (3) 平安金管家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 31 日