

平安交易型货币市场基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 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：2022 年 1 月 21 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 2022 年 01 月 20 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 2021 年 10 月 01 日起至 12 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	28,215,872,953.01 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	28,213,758,762.98 份	2,114,190.03 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（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）	
	平安日鑫 A	场内货币
1. 本期已实现收益	172,983,095.72	1,352,593.70
2. 本期利润	172,983,095.72	1,352,593.70
3. 期末基金资产净值	28,213,758,762.98	211,419,003.40

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

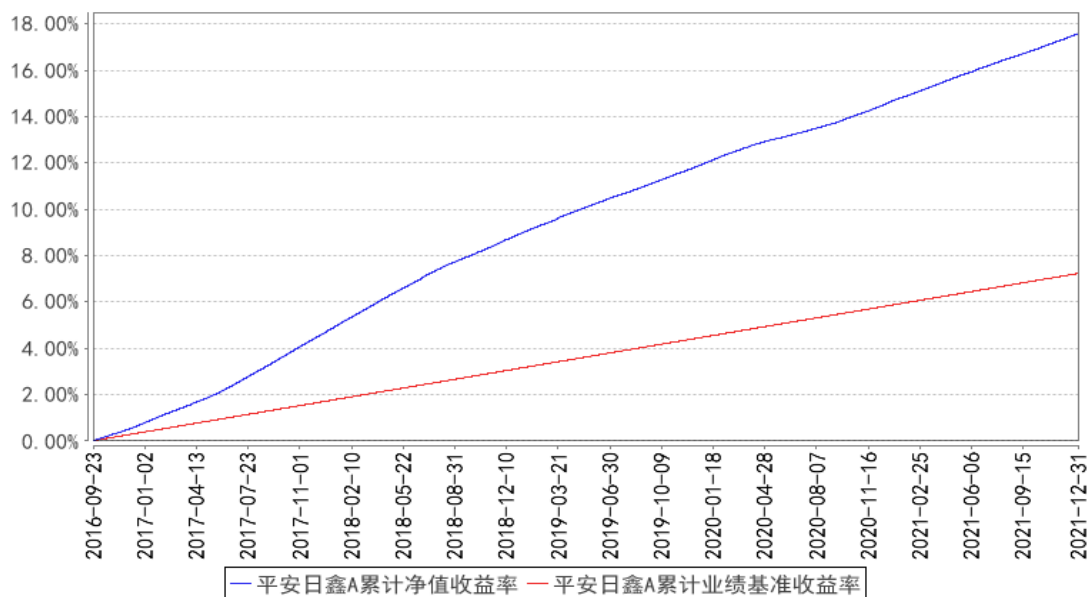
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6437%	0.0023%	0.3450%	0.0000%	0.2987%	0.0023%
过去六个月	1.2493%	0.0018%	0.6900%	0.0000%	0.5593%	0.0018%
过去一年	2.5554%	0.0018%	1.3688%	0.0000%	1.1866%	0.0018%
过去三年	7.9791%	0.0018%	4.1100%	0.0000%	3.8691%	0.0018%
过去五年	16.6946%	0.0027%	6.8475%	0.0000%	9.8471%	0.0027%
自基金合同 生效起至今	17.5811%	0.0027%	7.2225%	0.0000%	10.3586%	0.0027%

场内货币

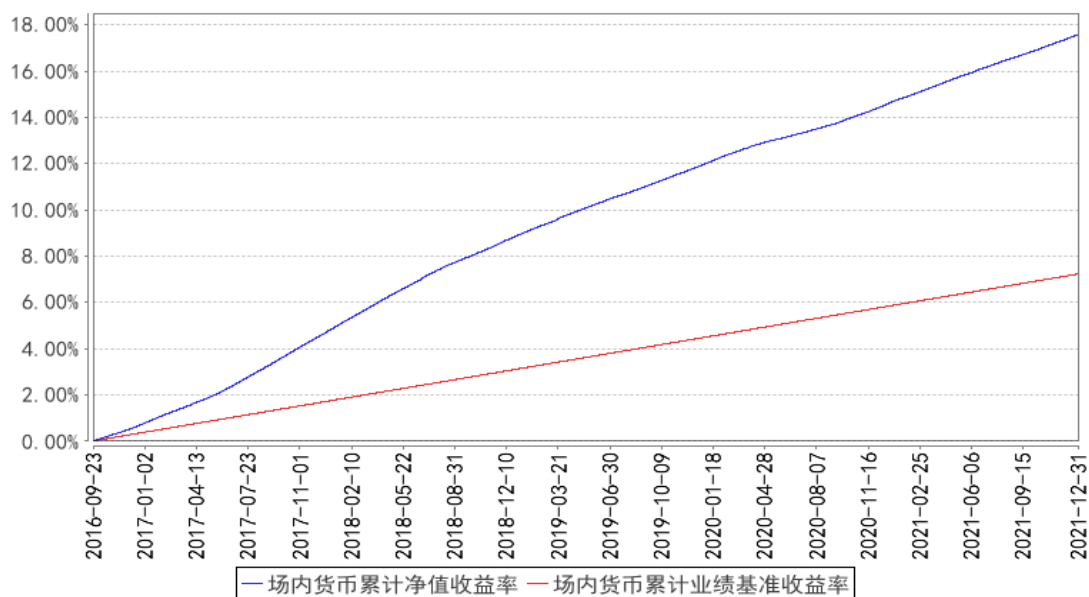
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6437%	0.0023%	0.3450%	0.0000%	0.2987%	0.0023%
过去六个月	1.2493%	0.0018%	0.6900%	0.0000%	0.5593%	0.0018%
过去一年	2.5554%	0.0018%	1.3688%	0.0000%	1.1866%	0.0018%
过去三年	7.9789%	0.0018%	4.1100%	0.0000%	3.8689%	0.0018%
过去五年	16.6944%	0.0027%	6.8475%	0.0000%	9.8469%	0.0027%
自基金合同 生效起至今	17.5810%	0.0027%	7.2225%	0.0000%	10.3585%	0.0027%

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		
田元强	平安交易	2018 年 11 月	-	8 年	田元强先生，西安交通大学工商管理硕

	型货币市场基金基金经理	26 日		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、平安惠信 3 个月定期开放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。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度，国内经济增长持续承压，宏观调控政策着力稳增长。限电放松后工业生产反弹，制造业投资明显出现改善；地产调控趋缓，地产销售小幅改善同时地产投资下行斜率缓和；疫情反复之下，消费延续偏弱修复；海外经济仍处于复苏通道，国内进出口均维持高度景气。通胀方面，保供稳价政策效果显著，PPI 进入下行通道；低基数效应叠加猪肉价格回弹，CPI 小幅上行，PPI-CPI 剪刀差收敛。货币政策方面，降准落地，年末市场流动性整体充裕，央行延续跨周期调节思路，货政报告为宽货币打开政策空间。报告期内，本基金的投资操作以流动性管理为基础原则，选择具备良好信用资质的投资标的，结合市场变化动态灵活调整组合剩余期限、杠杆水平，调整大类资产的配置比例，以维护产品收益。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 0.6437%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%；本报告期场内货币的基金份额净值收益率为 0.6437%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 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	22,214,906,027.17	65.97
	其中：债券	22,178,906,027.17	65.86
	资产支持证券	36,000,000.00	0.11
2	买入返售金融资产	3,186,009,436.06	9.46
	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	7,564,742,703.30	22.46
4	其他资产	709,282,690.95	2.11
5	合计	33,674,940,857.48	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	7.34

	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	5,240,095,609.84	18.43
	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：本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 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	90
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	78

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。

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	25.97	18.43
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	7.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	34.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	15.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	31.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	115.97	18.43

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	468,469,012.43	1.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	940,763,541.57	3.31
	其中：政策性金融债	940,763,541.57	3.31
4	企业债券	356,446,655.19	1.25
5	企业短期融资券	7,810,553,456.40	27.48
6	中期票据	1,017,934,102.56	3.58
7	同业存单	11,584,739,259.02	40.76
8	其他	-	-
9	合计	22,178,906,027.17	78.03
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	112120299	21 广发银行 CD299	10,000,000	987,141,749.83	3.47
2	112172443	21 重庆农村商行 CD270	5,000,000	495,621,230.74	1.74
3	112108165	21 中信银行 CD165	5,000,000	494,838,822.77	1.74
4	112103019	21 农业银行 CD019	4,500,000	447,839,325.46	1.58
5	112104014	21 中国银行 CD014	4,000,000	398,257,712.22	1.40
6	112116208	21 上海银行 CD208	4,000,000	396,183,430.01	1.39
7	210301	21 进出 01	3,000,000	300,129,530.49	1.06
8	112108046	21 中信银行 CD046	3,000,000	298,525,667.50	1.05
9	112116168	21 上海银行 CD168	3,000,000	298,280,831.21	1.05
10	112116170	21 上海银行 CD170	3,000,000	298,246,288.09	1.05

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	0.1193%
报告期内偏离度的最低值	0.0550%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0859%

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	137597	天著优 11	360,000	36,000,000.00	0.13

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

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 1 月 19 日做出银保监罚决字（2021）1 号处罚决定，由于中国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）发生重要信息系统突发事件未报告（二）制卡数据违规明文留存（三）生产网络、分行无线互联网络保护不当（四）数据安全较粗放，存在数据泄露风险（五）网络信息系统存在较多漏洞（六）互联网门户网站泄露敏感信息，根据相关规定罚款 420 万元。

中国银行保险监督管理委员会北京监管局于 2021 年 12 月 8 日作出银保监罚决字（2021）38 号处罚决定，由于中国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”）一、制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权。二、公司河南分行和新疆分行转发并执行总行强制企业对公账户开通动账短信通知服务要求，违法行为情节较为严重，根据相关规定对公司罚款 150 万元。

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 2,890 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 3 月 17 日做出银保监罚决字（2021）5 号处罚决定，由于中信银行股份有限公司（以下简称“公司”）：一、客户信息保护体制机制不健全；柜面非密查询客户账户明细缺乏规范、统一的业务操作流程与必要的内部控制措施，乱象整治自查不力二、客户信息收集环节管理不规范；客户数据访问控制管理不符合业务“必须知道”和“最小授权”原则；查询客户账户明细事由不真实；未经客户本人授权查询并向第三方提供其个人银行账户交

易信息三、对客户敏感信息管理不善，致其流出至互联网；违规存储客户敏感信息四、系统权限管理存在漏洞，重要岗位及外包机构管理存在缺陷，根据相关规定对公司罚款 450 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日做出银保监罚决字（2021）11 号，由于中国银行股份有限公司：向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款、违规向关系人发放信用贷款、向无资金缺口企业发放流动资金贷款、存款月末冲时点、为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票等。根据相关规定对公司罚款 8761.355 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 7 月 13 日作出银保监罚决字（2021）31 号决定，由于中国进出口银行违规经营，罚没 7345.6 万元。

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	83,389.17
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	145,977,121.26
4	应收申购款	563,222,180.52
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	709,282,690.95

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	23,425,128,599.14	2,024,159.24
报告期期间基金总申购份额	19,810,653,577.94	301,533.97
报告期期间基金总赎回份额	15,022,023,414.10	211,503.18

报告期期末基金份额总额	28,213,758,762.98	2,114,190.03
-------------	-------------------	--------------

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	2021-10-08	9,595.84	9,595.84	-
2	红利再投	2021-10-11	3,584.65	3,584.65	-
3	红利再投	2021-10-12	1,387.47	1,387.47	-
4	红利再投	2021-10-13	1,712.40	1,712.40	-
5	申购	2021-10-14	35,000,000.00	35,000,000.00	-
6	红利再投	2021-10-14	1,253.17	1,253.17	-
7	红利再投	2021-10-15	1,192.39	1,192.39	-
8	红利再投	2021-10-18	9,894.62	9,894.62	-
9	红利再投	2021-10-19	8,049.94	8,049.94	-
10	红利再投	2021-10-20	5,975.50	5,975.50	-
11	红利再投	2021-10-21	4,740.03	4,740.03	-
12	红利再投	2021-10-22	3,070.54	3,070.54	-
13	红利再投	2021-10-25	9,923.27	9,923.27	-
14	红利再投	2021-10-26	6,417.46	6,417.46	-
15	红利再投	2021-10-27	3,751.65	3,751.65	-
16	红利再投	2021-10-28	4,507.31	4,507.31	-
17	红利再投	2021-10-29	2,967.57	2,967.57	-
18	红利再投	2021-11-01	9,899.92	9,899.92	-
19	红利再投	2021-11-02	5,830.30	5,830.30	-
20	红利再投	2021-11-03	4,433.55	4,433.55	-
21	红利再投	2021-11-04	3,232.12	3,232.12	-
22	红利再投	2021-11-05	2,877.06	2,877.06	-
23	红利再投	2021-11-08	9,485.29	9,485.29	-

24	红利再投	2021-11-09	3,841.10	3,841.10	-
25	红利再投	2021-11-10	2,973.84	2,973.84	-
26	红利再投	2021-11-11	3,547.78	3,547.78	-
27	红利再投	2021-11-12	2,885.87	2,885.87	-
28	红利再投	2021-11-15	11,102.72	11,102.72	-
29	红利再投	2021-11-16	4,328.18	4,328.18	-
30	红利再投	2021-11-17	3,138.15	3,138.15	-
31	红利再投	2021-11-18	3,268.45	3,268.45	-
32	红利再投	2021-11-19	3,174.65	3,174.65	-
33	红利再投	2021-11-22	11,982.41	11,982.41	-
34	红利再投	2021-11-23	2,831.30	2,831.30	-
35	红利再投	2021-11-24	3,641.05	3,641.05	-
36	红利再投	2021-11-25	3,040.82	3,040.82	-
37	红利再投	2021-11-26	3,405.30	3,405.30	-
38	红利再投	2021-11-29	11,754.25	11,754.25	-
39	赎回	2021-11-29	-55,219,193.73	-55,219,193.73	-
40	红利再投	2021-11-30	4,614.11	4,614.11	-
41	申购	2021-12-23	35,000,000.00	35,000,000.00	-
42	申购	2021-12-23	15,337,466.10	15,337,466.10	-
43	红利再投	2021-12-27	12,260.94	12,260.94	-
44	红利再投	2021-12-28	7,093.42	7,093.42	-
45	红利再投	2021-12-29	2,863.38	2,863.38	-
46	红利再投	2021-12-30	3,341.99	3,341.99	-
47	红利再投	2021-12-31	2,676.77	2,676.77	-
合计			30,339,820.90	30,339,820.90	

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 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
2022 年 1 月 21 日