

# 平安交易型货币市场基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 07 月 01 日起至 09 月 30 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 ETF		
基金主代码	511700		
基金运作方式	契约型、交易型开放式		
基金合同生效日	2016 年 9 月 23 日		
报告期末基金份额总额	87,634,242,550.10 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	平安日鑫 C	场内货币
下属分级基金的交易代码	003034	015021	511700
报告期末下属分级基金的份额总额	86,585,515,214.39 份	1,045,822,069.78 份	2,905,265.93 份

注：本基金 A 类（平安日鑫 A）、C 类（平安日鑫 C）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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）		
	平安日鑫 A	平安日鑫 C	场内货币
1. 本期已实现收益	420,720,862.59	4,725,316.27	6,898,626.45
2. 本期利润	420,720,862.59	4,725,316.27	6,898,626.45
3. 期末基金资产净值	86,585,515,214.39	1,045,822,069.78	290,526,592.68

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（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金按照实际利率计算账面价值，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。

### 3.2 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	0.4832%	0.0006%	0.3450%	0.0000%	0.1382%	0.0006%
过去六个月	1.0232%	0.0006%	0.6863%	0.0000%	0.3369%	0.0006%
过去一年	2.3043%	0.0016%	1.3688%	0.0000%	0.9355%	0.0016%
过去三年	7.4893%	0.0017%	4.1100%	0.0000%	3.3793%	0.0017%
过去五年	15.3221%	0.0026%	6.8475%	0.0000%	8.4746%	0.0026%
自基金合同 生效起至今	19.5211%	0.0027%	8.2463%	0.0000%	11.2748%	0.0027%

平安日鑫 C

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	0.4224%	0.0006%	0.3450%	0.0000%	0.0774%	0.0006%
过去六个月	0.9027%	0.0006%	0.6863%	0.0000%	0.2164%	0.0006%
自基金合同 生效起至今	1.2026%	0.0007%	0.8738%	0.0000%	0.3288%	0.0007%

场内货币

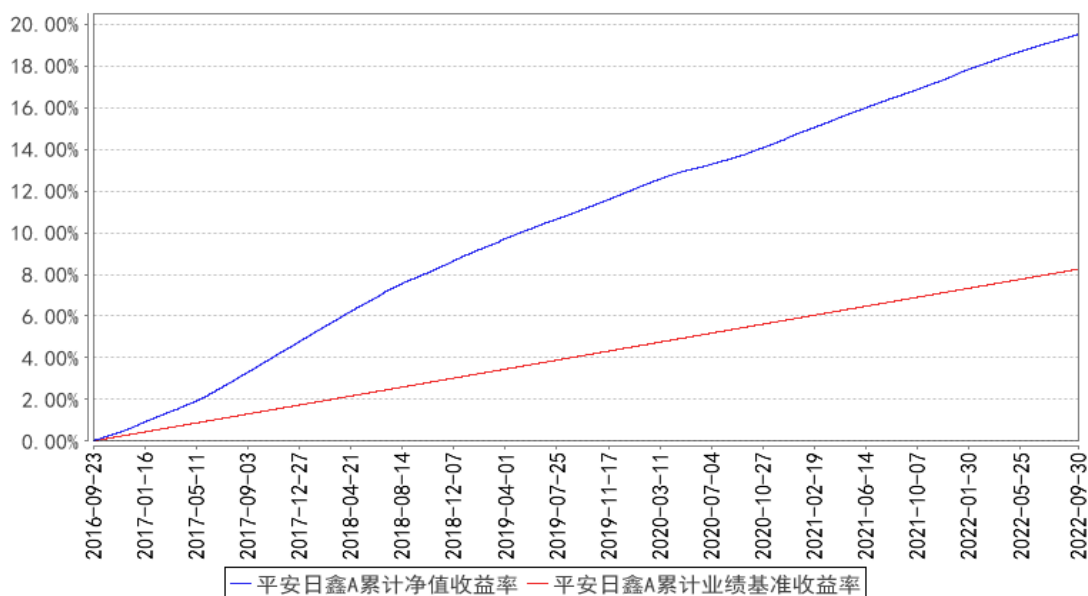
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4831%	0.0006%	0.3450%	0.0000%	0.1381%	0.0006%
过去六个月	1.0231%	0.0006%	0.6863%	0.0000%	0.3368%	0.0006%

过去一年	2.3042%	0.0016%	1.3688%	0.0000%	0.9354%	0.0016%
过去三年	7.4891%	0.0017%	4.1100%	0.0000%	3.3791%	0.0017%
过去五年	15.3219%	0.0026%	6.8475%	0.0000%	8.4744%	0.0026%
自基金合同生效起至今	19.5208%	0.0027%	8.2463%	0.0000%	11.2745%	0.0027%

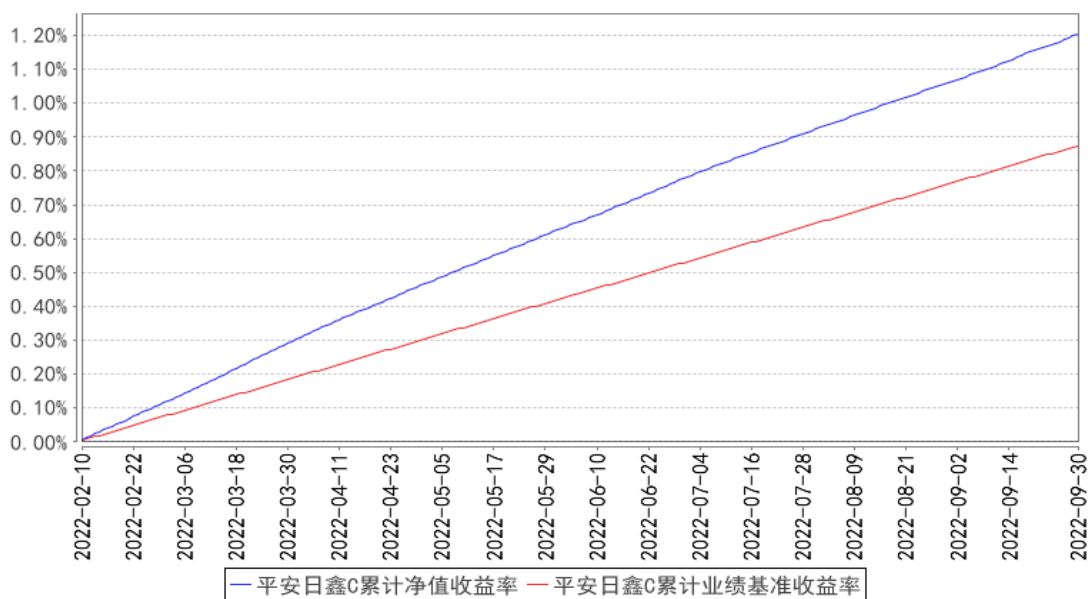
注：上述 C 类份额“自基金合同生效起至今”为 2022 年 02 月 10 日至 2022 年 09 月 30 日

### 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

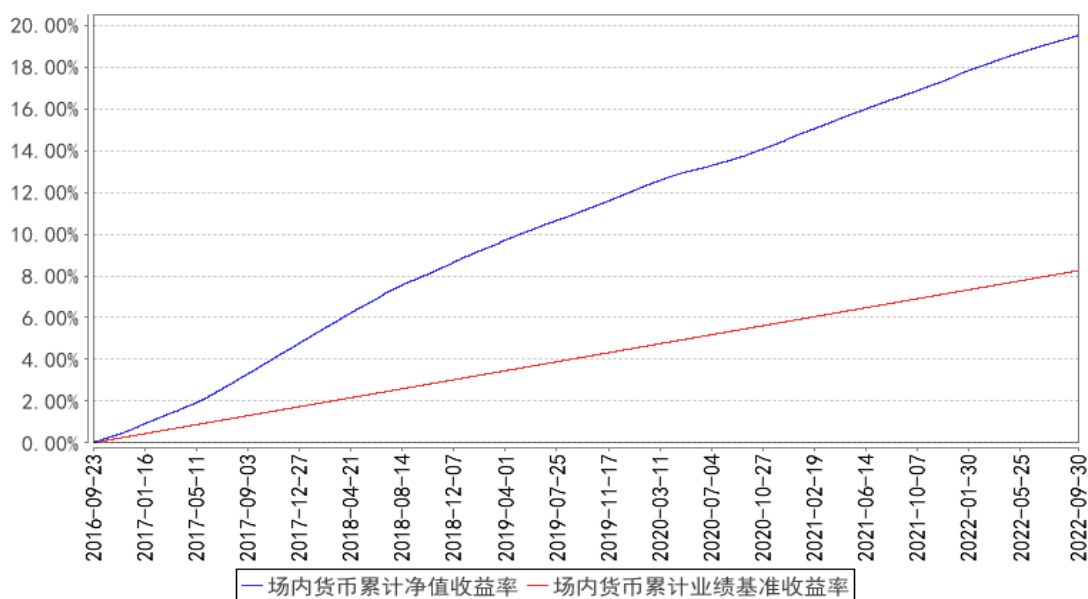
平安日鑫A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安日鑫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



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、本基金于2022年02月08日增设C类份额，C类份额从2022年02月10日开始有份额，所以以上C类份额走势图从2022年02月10日开始。

## § 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		
罗薇	平安交易型货币市场基金基金经理	2022年5月24日	-	10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，现任平安交易型货币市场基金、平安日增利货币市场基金、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠鸿纯债债券型证券投资基金、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠隆纯债债券型证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、平安财富宝货币市场基金基金经理。
李可颖	固定收益	2022年8月5日	-	11年	李可颖女士，南开大学法学专业硕士，曾

	投资中心 投资总监 助理兼现 金投资部 负责人， 平安交易 型货币市 场基金基 金经理	日		任渤海证券股份有限公司高级交易经 理、长盛基金管理有限公司高级债券交易 员、博时基金管理有限公司高级交易员、 鹏华基金管理有限公司基金经理、现金管 理部副总监。2021 年 9 月加入平安基金 管理有限公司，现任固定收益投资中心投 资总监助理兼现金投资部负责人，同时担 任平安日增利货币市场基金、平安交易型 货币市场基金、平安中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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

三季度，国内经济增长受地产行业和疫情拖累动能趋弱，尽管汽车消费政策和设备更新需求助力工业生产维持较好景气度，但疫情散发限制跨区物流，区域限电亦对工业生产形成冲击。投资方面，“保交楼”工作稳步推进，地产销售有回暖迹象但向投资传导仍待时日，基建维持托而不举，工业设备更新投资保持旺盛需求；消费方面，随着疫情管控成效显现人员流动回升，线下

消费维持温和复苏；出口方面，海外主要经济体在连续加息之后增速回落需求放缓，对国内出口形成负面影响。放储和生猪出栏加速减缓猪价上涨速度，海外需求放缓能源价格震荡下行，通胀预期回落。三季度，央行下调 MLF 利率 10bp，并通过逐步回笼公开市场投放以对冲财政投放所释放资金，流动性环境整体保持平稳，三季度下半期随着财政投放结束资金面有所收敛资金价格中枢小幅抬升。

三季度货币市场收益率呈先下后上走势，具体来看，7 月宽松的流动性环境推动货币市场经历了一波单边下行的行情；8 月财政投放行至尾声、缴税、缴准等因素均对资金面形成扰动，货币市场经历了 N 型震荡行情；9 月资金面收敛和银行负债意愿提升推动货币市场加速调整。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 0.4832%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%；本报告期平安日鑫 C 的基金份额净值收益率为 0.4224%，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 0.4831%，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	35,278,216,778.32	35.81
	其中：债券	35,278,216,778.32	35.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	34,001,863,959.47	34.52
	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	29,216,931,283.97	29.66
4	其他资产	4,427,073.69	0.00
5	合计	98,501,439,095.45	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	9.67	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	10,556,660,423.72	12.01
	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	78
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

### 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	63.17	12.01
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天 (含) —60 天	8.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天 (含) —90 天	10.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天 (含) —120 天	2.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天 (含) —397 天 (含)	26.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	111.66	12.01



#### 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	538,193,429.04	0.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,729,782,031.94	5.38
	其中：政策性金融债	4,627,952,798.58	5.26
4	企业债券	31,379,143.23	0.04
5	企业短期融资券	4,671,563,298.66	5.31
6	中期票据	1,442,759,422.73	1.64
7	同业存单	23,864,539,452.72	27.14
8	其他	-	-
9	合计	35,278,216,778.32	40.12
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	112216124	22 上海银行 CD124	13,000,000	1,277,143,036.79	1.45
2	220201	22 国开 01	10,100,000	1,025,934,492.33	1.17
3	112298008	22 杭州银行 CD114	10,000,000	986,338,434.03	1.12
4	112213065	22 浙商银行 CD065	10,000,000	985,692,753.15	1.12
5	112298023	22 重庆农村商行 CD072	9,500,000	948,632,210.18	1.08
6	112209118	22 浦发银行 CD118	9,000,000	885,434,123.62	1.01
7	112203062	22 农业银行 CD062	9,000,000	884,996,695.23	1.01
8	112283490	22 苏州银行 CD225	8,000,000	786,254,510.59	0.89
9	112283447	22 杭州银行 CD202	8,000,000	785,935,225.67	0.89
10	112283879	22 重庆银行 CD087	7,500,000	736,615,684.50	0.84

#### 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	0.1123%

报告期内偏离度的最低值	0.0388%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0700%

### 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 基金计价方法说明

本基金按实际利率计算账面价值，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

中国人民银行于 2021 年 10 月 21 日作出银罚字（2021）27 号处罚决定，由于浙商银行股份有限公司（以下简称“公司”）违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，对公司罚款 65 万元。

国家外汇管理局上海市分局于 2021 年 11 月 15 日作出上海汇管罚字（2021）3121210802 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”）银行卡境外交易信息报送错误，根据相关规定，要求公司责令改正，给予警告、处 6 万元人民币的罚款。

中国银行保险监督管理委员会于 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。

中国银行保险监督管理委员会重庆监管局于 2021 年 12 月 21 日作出渝银保监罚决字（2021）41 号处罚决定，由于重庆银行股份有限公司（以下简称“公司”）存在以下违法违规行为：1. 贷前调查不尽职，形成“假按揭”贷款；2. 向关系人发放信用贷款；3. 信贷资产转让不规范，风险未完全转移，拨备提取不足，根据相关规定，对公司罚款 150 万元，没收违法所得 25225.63 元。

中国银行保险监督管理委员会重庆监管局于 2021 年 12 月 21 日作出渝银保监罚决字（2021）39 号处罚决定，由于重庆银行股份有限公司（以下简称“公司”）存在以下违法违规行为：1. 信

贷资金被挪用；2. 理财产品期限错配、滚动发售、混合运作；理财产品到期后由新发行的产品募集资金承接，掩盖风险；理财投资非标准化债权资产未比照自营贷款管理；3. 违规收取委托贷款手续费，根据相关规定，对公司罚款 280 万元。

中国银行保险监督管理委员会重庆监管局于 2022 年 1 月 25 日作出渝银保监罚决字（2022）5 号处罚决定，由于重庆农村商业银行股份有限公司：1. 信贷资金被挪用；2. 个人经营性贷款未按规定受托支付，根据相关规定，对其处以罚款 80 万元。

中国银行保险监督管理委员会上海监管局于 2022 年 2 月 14 日作出沪银保监罚决字（2022）13 号处罚决定，由于 2015 年 3 月至 7 月，上海银行股份有限公司同业投资业务违规接受第三方金融机构担保，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，对上海银行股份有限公司责令改正，并处罚款 240 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）8 号处罚决定，由于国家开发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差；五、未报送债券投资业务 EAST 数据；六、漏报权益类投资业务 EAST 数据；七、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；八、漏报保函业务 EAST 数据；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、漏报授信信息 EAST 数据；十三、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、EAST 系统《关联关系》表漏报；十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报；十七、理财产品登记不规范，根据《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，对国家开发银行罚款 440 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）12 号处罚决定，由于中国农业银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报贷款核销业务 EAST 数据；二、未报送权益类投资业务 EAST 数据；三、未报送公募基金投资业务 EAST 数据；四、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；五、其他担保类业务 EAST 数据存在偏差；六、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；七、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；八、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；九、漏报分户账 EAST 数据；十、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息；十一、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十二、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、EAST

系统《关联关系》表漏报；十六、理财产品登记不规范；十七、2018 年行政处罚问题依然存在，根据相关规定，对其处以罚款 480 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字(2022)27 号处罚决定，由于浙商银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报抵押物价值 EAST 数据；四、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；五、债券投资业务 EAST 数据存在偏差；六、未报送权益类投资业务 EAST 数据；七、未报送私募基金投资业务 EAST 数据；八、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；九、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；十、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；十一、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十二、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十三、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十四、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十五、EAST 系统《表外授信业务》表错报，根据相关规定，对其处以罚款 380 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字(2022)25 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”）监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，根据相关规定，对其处以罚款 420 万元。

中国银行保险监督管理委员会青海银保监局于 2022 年 4 月 12 日作出青银保监罚决字(2022)12 号处罚决定，由于中国农业银行股份有限公司西宁城中五一路支行贷后检查不尽职，发放的经营性贷款流入房地产，根据相关规定，对其处以罚款 20 万元。

中国银行保险监督管理委员会青海银保监局于 2022 年 4 月 12 日作出青银保监罚决字(2022)11 号处罚决定，由于中国农业银行股份有限公司西宁分行贷后检查不尽职，发放的经营性贷款流入房地产，根据相关规定，对其处以罚款 20 万元。

中国人民银行杭州中心支行于 2022 年 5 月 23 日作出杭银处罚字（2022）30 号处罚决定，由于杭州银行股份有限公司（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. 未按规定履行大额和可疑交易报告义务；4. 与身份不明的客户进行交易，根据相关规定，对其处以罚款 580 万元。

中国银行保险监督管理委员会重庆监管局于 2022 年 5 月 24 日作出渝银保监罚决字（2022）13 号处罚决定，由于重庆银行股份有限公司（以下简称“公司”）存在以下违法违规行为：委托贷款资金违规流入房地产企业；同业投资项目资本金不充足，项目土地款超概算，投后管理不到位；同业投资资金投向不合规；贷款风险分类不准确；员工行为管理不到位，借用银行员工账户为贷款客户过渡资金，根据相关规定，对其处以罚款 230 万元。

中国人民银行重庆营业管理部于2022年6月8日作出渝银罚〔2022〕2号处罚决定，由于重庆农村商业银行股份有限公司（以下简称“公司”）1.未按照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，对其处以罚款255万元。

中国人民银行重庆营业管理部于2022年6月8日作出渝银罚〔2022〕7号处罚决定，由于重庆银行股份有限公司（以下简称“公司”）存在以下违法违规行为：1.未按照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，对其处以罚款395万元。

上海市市场监督管理局于2022年8月17日作出沪市监总处〔2022〕322021000345号处罚决定，由于上海浦东发展银行股份有限公司将奥林匹克标志用于广告宣传、商业展览、营业性演出以及其他商业活动中，根据相关规定给予合计0.5万元罚款的处罚。

国家外汇管理局上海市分局于2022年9月17日作出上海汇管罚字〔2022〕3111220601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、违规办理远期结汇业务；2、违规办理期权交易；3、违规办理内保外贷业务；4、违规办理房产佣金收、结汇业务；5、结售汇统计数据错报，根据相关规定，责令公司改正，给予警告、并对其处以933万元人民币的罚款，没收违法所得334.69万元人民币。

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	5,390.76
2	应收证券清算款	421,232.93
3	应收利息	-
4	应收申购款	4,000,450.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	4,427,073.69

### 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	平安日鑫 C	场内货币
报告期期初基金份额总额	72,719,858,131.69	1,059,120,308.67	6,505,201.50
报告期期间基金总申购份额	34,914,837,175.66	457,687,737.92	9,381,359.88
报告期期间基金总赎回份额	21,049,180,092.96	470,985,976.81	12,981,295.45
报告期期末基金份额总额	86,585,515,214.39	1,045,822,069.78	2,905,265.93

注：本基金 A 类（平安日鑫 A）、C 类（平安日鑫 C）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	2022-07-01	20,079.03	20,079.03	-
2	红利再投	2022-07-04	70,879.44	70,879.44	-
3	红利再投	2022-07-05	23,287.40	23,287.40	-
4	红利再投	2022-07-06	22,403.36	22,403.36	-
5	红利再投	2022-07-07	21,912.35	21,912.35	-
6	红利再投	2022-07-08	22,073.92	22,073.92	-
7	红利再投	2022-07-11	64,963.74	64,963.74	-
8	红利再投	2022-07-12	22,075.68	22,075.68	-
9	红利再投	2022-07-13	21,437.98	21,437.98	-
10	红利再投	2022-07-14	21,953.02	21,953.02	-
11	红利再投	2022-07-15	20,777.90	20,777.90	-
12	红利再投	2022-07-18	62,949.25	62,949.25	-
13	红利再投	2022-07-19	21,644.27	21,644.27	-

14	红利再投	2022-07-20	20,942.67	20,942.67	-
15	红利再投	2022-07-21	20,933.60	20,933.60	-
16	红利再投	2022-07-22	20,558.26	20,558.26	-
17	红利再投	2022-07-25	62,261.61	62,261.61	-
18	红利再投	2022-07-26	22,567.28	22,567.28	-
19	赎回	2022-07-26	-60,000,000.00	-60,000,000.00	-
20	红利再投	2022-07-27	22,036.64	22,036.64	-
21	赎回	2022-07-27	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
22	红利再投	2022-07-28	18,080.39	18,080.39	-
23	红利再投	2022-07-29	17,285.84	17,285.84	-
24	申购	2022-07-29	60,000,000.00	60,000,000.00	-
25	红利再投	2022-08-01	51,338.40	51,338.40	-
26	红利再投	2022-08-02	19,939.88	19,939.88	-
27	红利再投	2022-08-03	20,050.20	20,050.20	-
28	红利再投	2022-08-04	19,728.19	19,728.19	-
29	红利再投	2022-08-05	19,358.89	19,358.89	-
30	红利再投	2022-08-08	59,207.19	59,207.19	-
31	红利再投	2022-08-09	19,570.45	19,570.45	-
32	红利再投	2022-08-10	19,450.07	19,450.07	-
33	红利再投	2022-08-11	19,280.34	19,280.34	-
34	红利再投	2022-08-12	24,894.99	24,894.99	-
35	红利再投	2022-08-15	56,241.95	56,241.95	-
36	红利再投	2022-08-16	19,324.77	19,324.77	-
37	红利再投	2022-08-17	20,680.27	20,680.27	-
38	红利再投	2022-08-18	17,854.48	17,854.48	-
39	红利再投	2022-08-19	18,850.59	18,850.59	-
40	赎回	2022-08-19	-40,000,000.00	-40,000,000.00	-
41	红利再投	2022-08-22	56,515.91	56,515.91	-

42	红利再投	2022-08-23	18,936.07	18,936.07	-
43	红利再投	2022-08-24	17,517.99	17,517.99	-
44	红利再投	2022-08-25	17,330.47	17,330.47	-
45	红利再投	2022-08-26	17,179.58	17,179.58	-
46	红利再投	2022-08-29	52,485.89	52,485.89	-
47	红利再投	2022-08-30	16,696.13	16,696.13	-
48	红利再投	2022-08-31	17,867.38	17,867.38	-
49	红利再投	2022-09-01	18,917.64	18,917.64	-
50	红利再投	2022-09-02	15,318.77	15,318.77	-
51	红利再投	2022-09-05	50,888.73	50,888.73	-
52	红利再投	2022-09-06	19,509.91	19,509.91	-
53	申购	2022-09-06	130,000,000.00	130,000,000.00	-
54	红利再投	2022-09-07	17,463.85	17,463.85	-
55	红利再投	2022-09-08	24,200.66	24,200.66	-
56	红利再投	2022-09-09	23,341.28	23,341.28	-
57	红利再投	2022-09-13	96,613.67	96,613.67	-
58	红利再投	2022-09-14	28,258.51	28,258.51	-
59	红利再投	2022-09-15	26,498.59	26,498.59	-
60	赎回	2022-09-15	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
61	红利再投	2022-09-16	28,595.11	28,595.11	-
62	红利再投	2022-09-19	82,325.96	82,325.96	-
63	红利再投	2022-09-20	24,894.40	24,894.40	-
64	红利再投	2022-09-21	20,226.63	20,226.63	-
65	赎回	2022-09-21	-70,000,000.00	-70,000,000.00	-
66	红利再投	2022-09-22	20,734.50	20,734.50	-
67	红利再投	2022-09-23	17,243.22	17,243.22	-
68	红利再投	2022-09-26	55,758.50	55,758.50	-
69	赎回	2022-09-26	-70,000,000.00	-70,000,000.00	-



70	红利再投	2022-09-27	26,569.00	26,569.00	-
71	红利再投	2022-09-28	23,455.30	23,455.30	-
72	红利再投	2022-09-29	17,221.49	17,221.49	-
73	赎回	2022-09-29	-50,000,000.00	-50,000,000.00	-
74	红利再投	2022-09-30	17,181.40	17,181.40	-
合计			-138,103,379.17	-138,103,379.17	

注：基金管理人运用固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，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2022 年 10 月 25 日