

# 平安日增利货币市场基金 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 月 22 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 04 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	平安日增利货币	
基金主代码	000379	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 12 月 3 日	
报告期末基金份额总额	142,201,170,430.43 份	
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	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。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。	
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	
下属分级基金的基金简称	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B
下属分级基金的交易代码	000379	010208
报告期末下属分级基金的份额总额	134,323,480,045.88 份	7,877,690,384.55 份

## § 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 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日）	
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B
1. 本期已实现收益	680,933,195.06	57,494,787.25
2. 本期利润	680,933,195.06	57,494,787.25
3. 期末基金资产净值	134,323,480,045.88	7,877,690,384.55

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。

### 3.2 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

平安日增利货币 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	0.5592%	0.0012%	0.3375%	0.0000%	0.2217%	0.0012%
过去六个月	1.1350%	0.0014%	0.6825%	0.0000%	0.4525%	0.0014%
过去一年	1.9916%	0.0015%	1.3688%	0.0000%	0.6228%	0.0015%
过去三年	7.9814%	0.0020%	4.1100%	0.0000%	3.8714%	0.0020%
过去五年	15.2936%	0.0022%	6.8475%	0.0000%	8.4461%	0.0022%
自基金合同生效起至今	26.9633%	0.0036%	10.0350%	0.0000%	16.9283%	0.0036%

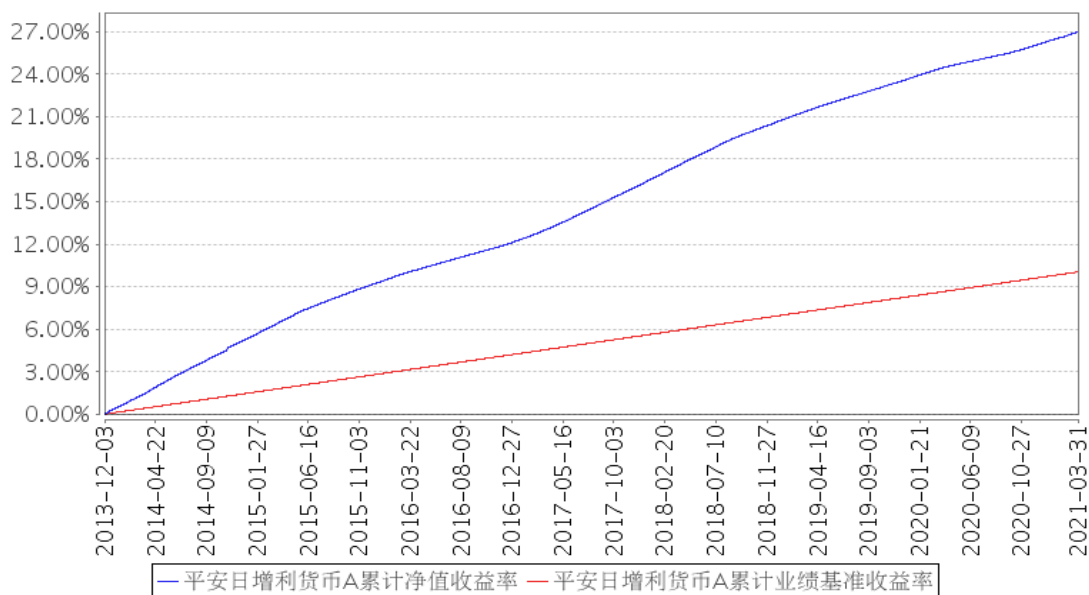
平安日增利货币 B

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	0.6186%	0.0012%	0.3375%	0.0000%	0.2811%	0.0012%
过去六个月	1.2558%	0.0014%	0.6825%	0.0000%	0.5733%	0.0014%
自基金合同生效起至今	1.3188%	0.0014%	0.7200%	0.0000%	0.5988%	0.0014%

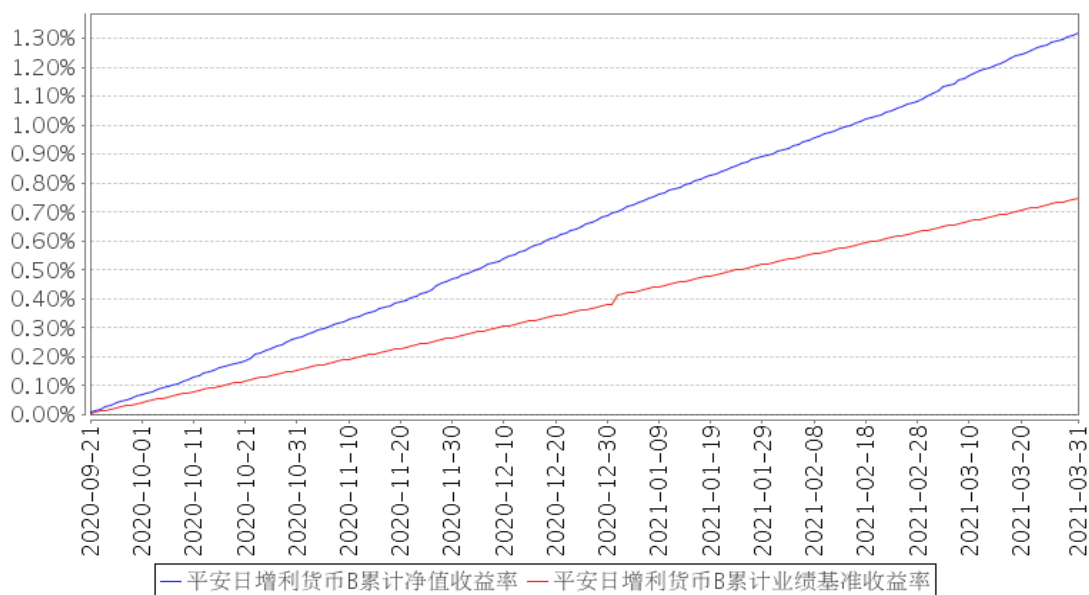
注：平安日增利 B 类份额“自基金合同生效日至今”指 2020 年 09 月 21 日至 2021 年 03 月 31 日。

#### 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

平安日增利货币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



平安日增利货币B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 2013 年 12 月 3 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 2020 年 09 月 14 日增设 B 类份额，B 类份额从 2020 年 09 月 21 日开始有份额，所以上 B 类份额走势图从 2020 年 09 月 21 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		
田元强	平安日增利货币市场基金基金经理	2019年3月21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析师、生命保险资产管理有限公司信用评估部分析师、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、平安如意中短债债券型证券投资基金、平安合信3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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遵规守信情况说明

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

一季度，经济延续复苏态势。疫苗接种、疫情控制，海外经济修复，带动出口维持强势；疫情恐慌逐步消散，国内消费继续修复；对冲政策逐步退出，投资边际走弱，但制造业投资修复趋势未变，房地产投资尽管面对严厉政策约束，但销售热、竣工强，短期韧性仍强。价格方面，商品价格大幅上涨，带动 PPI 回升较快，但 CPI 维持低位。货币政策目标聚焦防风险和为经济复苏维持良好环境，整体偏宽松。在此背景下，债市收益率偏震荡为主，利率债受制于经济复苏预期小幅调整，信用债得益于较高的票息维持强势。报告期内，本基金的投资操作以流动性管理为基础原则，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。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

本报告期平安日增利货币 A 的基金份额净值收益率为 0.5592%，本报告期平安日增利货币 B 的基金份额净值收益率为 0.6186%，同期业绩基准收益率为 0.3375%。

#### 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	77,913,465,128.08	51.95
	其中：债券	77,160,882,860.86	51.45
	资产支持证券	752,582,267.22	0.50
2	买入返售金融资产	38,078,034,607.11	25.39
	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	32,950,381,101.97	21.97
4	其他资产	1,031,164,308.14	0.69
5	合计	149,973,045,145.30	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	2.30	
	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	7,190,555,324.55	5.06
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	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	74

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金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	36.07	5.40
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天 (含) — 60 天	12.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天 (含) — 90 天	15.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天 (含) — 120 天	6.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天 (含) — 397 天 (含)	35.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.02	5.40

### 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	1,158,221,647.89	0.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,080,180,874.26	4.28
	其中：政策性金融债	6,080,180,874.26	4.28
4	企业债券	868,432,608.86	0.61
5	企业短期融资券	24,824,719,622.28	17.46
6	中期票据	2,615,804,334.93	1.84
7	同业存单	41,613,523,772.64	29.26
8	其他	-	-
9	合计	77,160,882,860.86	54.26
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	180409	18 农发 09	15,200,000	1,523,883,868.35	1.07
2	200211	20 国开 11	12,000,000	1,198,210,073.78	0.84
3	200308	20 进出 08	8,200,000	819,387,908.15	0.58
4	112003170	20 农业银行 CD170	8,000,000	795,294,609.59	0.56
5	112104002	21 中国银行 CD002	7,000,000	698,043,018.07	0.49
6	2103667	21 进出 667	6,600,000	657,452,091.67	0.46
7	112008331	20 中信银行 CD331	6,000,000	600,000,000.00	0.42
8	112109074	21 浦发银行 CD074	6,000,000	597,685,423.59	0.42
9	112106077	21 交通银行 CD077	6,000,000	596,789,928.55	0.42
10	091918001	19 农发清发 01	5,400,000	540,819,362.02	0.38

### 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	0.0934%
报告期内偏离度的最低值	-0.0138%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0530%

### 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	169585	20 花 04A1	1,870,000	187,000,000.00	0.13
2	169515	弘花 05A	670,000	67,000,000.00	0.05
3	138918	招慧 09A	600,000	59,992,294.63	0.04
4	137116	20 睿成 01	560,000	56,000,000.00	0.04
5	179252	20 天圆 04	530,000	53,000,000.00	0.04
6	137115	20 合信 05	520,000	52,000,000.00	0.04
7	137137	链融 30A1	500,000	50,000,000.00	0.04
8	137597	天著优 11	380,000	38,000,000.00	0.03
9	137222	中借 05A	350,000	35,000,000.00	0.02
10	137647	21 弘基 1A	350,000	35,000,000.00	0.02

## 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。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。

### 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 2020 年 4 月 20 日做出银保监罚决字〔2020〕6 号处罚决定，由于交通银行股份有限公司（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以下违法违规行为：（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）信贷业务担保合同漏报；（五）分户账明细记录应报未报；（六）分户账账户数据应报未报；（七）关键且应报字段漏报或填报错误。根据相关规定对公司罚款 260 万元。本基金管理人对该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。我们对该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。

中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 4 月 20 日做出银保监罚决字〔2020〕4 号处罚决定，由于中国银行股份有限公司（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以下违法违规行为：（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。根据相关规定对公司罚款 270 万元。本基金管理人对该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。我们对该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。

中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 1 日做出银保监罚决字〔2020〕60 号，由于中国银行股份有限公司（以下简称“公司”）“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为主要包括：产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等。根据相关规定对公司罚款 5050 万元。本基金管理人对该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。我们对该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。

银保监会于 2020 年 4 月 20 日做出银保监罚决字〔2020〕9 号处罚决定，由于中信银行股份有限公司（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以下违法违规行为：（一）理财产品数量漏报；（二）信贷资产转让业务漏报；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。根据相关规定对公司罚款 160 万元。本基金管理人对该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。我们对该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。

中信银行股份有限公司（以下简称“公司”）因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，国家外汇管理局北京外汇管理部于 2020 年 8 月 25 日作出京汇罚〔2020〕17 号决定，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。本基金管理人对该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。我们对该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。

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。本基金管理人对该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。我们对该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。

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，对公司罚款 450 万元。本基金管理人对该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。我们对该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。

银保监会于 2020 年 4 月 22 日做出银保监罚决字（2020）12 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”）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）资金交易信息漏报严重；（二）信贷资产转让业务漏报；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。根据相关规定对公司罚款 230 万元。本基金管理人对该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。我们对该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。

银保监会于 2020 年 4 月 22 日做出银保监罚决字（2020）11 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）“两会一层”境外机构管理履职不到位；（二）国别风险管理不满足监管要求；（三）信贷资金被挪用作保证金；（四）未将集团成员纳入集团客户统一授信管理。根据相关规定对公司罚款 200 万元。本基金管理人对该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。我们对该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。

银保监会于 2020 年 7 月 13 日做出银保监罚决字（2020）36 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）向关系人发放信用贷款（二）批量处置不良资产未公告

(三) 批量处置不良资产未向监管部门报告 (四) 违规转让正常类贷款 (五) 个人住房贷款首付比例违规 (六) 流动资金贷款被用于固定资产投资 (七) 超过实际需求发放流动资金贷款 (八) 贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发 (九) 贷款用于偿还银行承兑汇票垫款 (十) 承兑业务贸易背景审查不严 (十一) 保理业务授权管理不到位 (十二) 贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人 (十三) 贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金 (十四) 信贷资金用于兑付到期理财资产 (十五) 信贷资金用于承接承销债券 (十六) 销售非保本理财产品违规出具承诺函 (十七) 提供与事实不符的报告 (十八) 理财产品相互交易、相互调节收益 (十九) 面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资 (二十) 将系统内资金纳入一般存款核算, 虚增存款 (二十一) 开立同业银行结算账户不合规 (二十二) 个别人员未经核准即履行高管人员职责 (二十三) 对小微企业不当收费 (二十四) 未按规定报送案件。根据相关规定没收公司违法所得 55.3 万元, 罚款 5260.3 万元, 罚没合计 5315.6 万元。本基金管理人对该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。我们对该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。

银保监会于 2020 年 12 月 7 日做出银保监罚决字(2020)66 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”): 收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费(含小额账户管理费)。根据相关规定没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元, 罚没金额合计 198.36 万元。本基金管理人对该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。我们对该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。

中国农业银行股份有限公司(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、第四十六条第五项和相关审慎经营规则, 中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 1 月 19 日作出银保监罚决字(2021)1 号, 对公司罚款 420 万元。本基金管理人对该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。我们对该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。

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。本基金管理人对该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。我们对该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。

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。本基金管理人对该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。我们对该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。

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。本基金管理人对该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。我们对该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	318,876.20
2	应收证券清算款	400,000,000.00
3	应收利息	551,058,513.12
4	应收申购款	79,786,918.82
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,031,164,308.14

### 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	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B
报告期期初基金份额总额	113,295,926,666.66	4,694,391,658.76
报告期期间基金总申购份额	238,602,765,225.36	24,145,720,997.41
报告期期间基金总赎回份额	217,575,211,846.14	20,962,422,271.62
报告期期末基金份额总额	134,323,480,045.88	7,877,690,384.55

## § 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	申购	2021-01-20	100,000,000.00	100,000,000.00	-
2	红利再投	2021-01-22	5,796.45	5,796.45	-
3	红利再投	2021-01-25	17,486.71	17,486.71	-
4	红利再投	2021-01-26	8,960.61	8,960.61	-
5	红利再投	2021-01-27	5,675.06	5,675.06	-
6	红利再投	2021-01-28	5,394.58	5,394.58	-
7	红利再投	2021-01-29	5,201.80	5,201.80	-
8	红利再投	2021-02-01	13,078.21	13,078.21	-
9	红利再投	2021-02-02	5,597.59	5,597.59	-
10	红利再投	2021-02-03	5,857.61	5,857.61	-
11	红利再投	2021-02-04	5,652.22	5,652.22	-
12	红利再投	2021-02-05	5,884.95	5,884.95	-
13	红利再投	2021-02-08	17,951.86	17,951.86	-
14	红利再投	2021-02-09	5,909.96	5,909.96	-
15	红利再投	2021-02-10	6,189.61	6,189.61	-
16	红利再投	2021-02-18	44,825.16	44,825.16	-
17	红利再投	2021-02-19	6,600.18	6,600.18	-
18	红利再投	2021-02-22	16,208.88	16,208.88	-

19	红利再投	2021-02-23	5,763.28	5,763.28	-
20	赎回	2021-02-23	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
21	红利再投	2021-02-24	5,425.94	5,425.94	-
22	红利再投	2021-02-25	5,551.60	5,551.60	-
23	红利再投	2021-02-26	4,720.73	4,720.73	-
24	红利再投	2021-03-01	15,479.07	15,479.07	-
25	赎回	2021-03-01	-6,000,000.00	-6,000,000.00	-
26	红利再投	2021-03-02	7,100.45	7,100.45	-
27	红利再投	2021-03-03	6,567.65	6,567.65	-
28	红利再投	2021-03-04	7,048.69	7,048.69	-
29	红利再投	2021-03-05	9,858.05	9,858.05	-
30	红利再投	2021-03-08	16,836.93	16,836.93	-
31	红利再投	2021-03-09	8,595.23	8,595.23	-
32	红利再投	2021-03-10	6,779.36	6,779.36	-
33	红利再投	2021-03-11	5,285.36	5,285.36	-
34	红利再投	2021-03-12	5,988.78	5,988.78	-
35	赎回	2021-03-12	-30,000,000.00	-30,000,000.00	-
36	红利再投	2021-03-15	16,441.26	16,441.26	-
37	红利再投	2021-03-16	3,696.58	3,696.58	-
38	赎回	2021-03-16	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
39	红利再投	2021-03-17	3,372.88	3,372.88	-
40	赎回	2021-03-17	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
41	红利再投	2021-03-18	2,468.60	2,468.60	-
42	红利再投	2021-03-19	1,712.74	1,712.74	-
43	红利再投	2021-03-22	4,345.34	4,345.34	-
44	红利再投	2021-03-23	1,709.26	1,709.26	-
45	红利再投	2021-03-24	1,742.94	1,742.94	-
46	红利再投	2021-03-25	1,328.34	1,328.34	-

47	红利再投	2021-03-26	1,424.04	1,424.04	-
48	赎回	2021-03-26	-24,335,663.17	-24,335,663.17	-
49	红利再投	2021-03-29	4,148.63	4,148.63	-
合计			-	-	

注：基金管理人运用自有资金申购平安日增利货币市场基金 A 类份额。

## § 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) 中国证监会核准平安日增利货币市场基金募集的文件
- (2) 平安日增利货币市场基金基金合同
- (3) 平安日增利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  
2021 年 4 月 22 日