

平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划

2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 日

基金管理人:平安证券股份有限公司  
基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司  
报告送出日期:2023 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划（以下简称：本计划）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。

本计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本计划合同规定，于2023年10月17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。

本计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本计划资产，但不保证本计划一定盈利。

本计划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计划的招募说明书。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》，原《平安证券现金宝集合资产管理计划》于2022年6月24日合同变更生效，变更后名称为《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划》。

本计划按照《基金法》及其他有关规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年7月1日起至2023年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	平安现金宝现金管理
基金主代码	970172
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年06月24日
报告期末基金份额总额	14,233,428,136.30份
投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	本集合计划投资策略包括：资产配置策略、杠杆投资策略、骑乘策略、类属和品种配置策略。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。
基金管理人	平安证券股份有限公司

基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
-------	----------------

### § 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（2023 年 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日）
1. 本期已实现收益	61,352,046.63
2. 本期利润	61,352,046.63
3. 期末基金资产净值	14,233,428,136.30

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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。

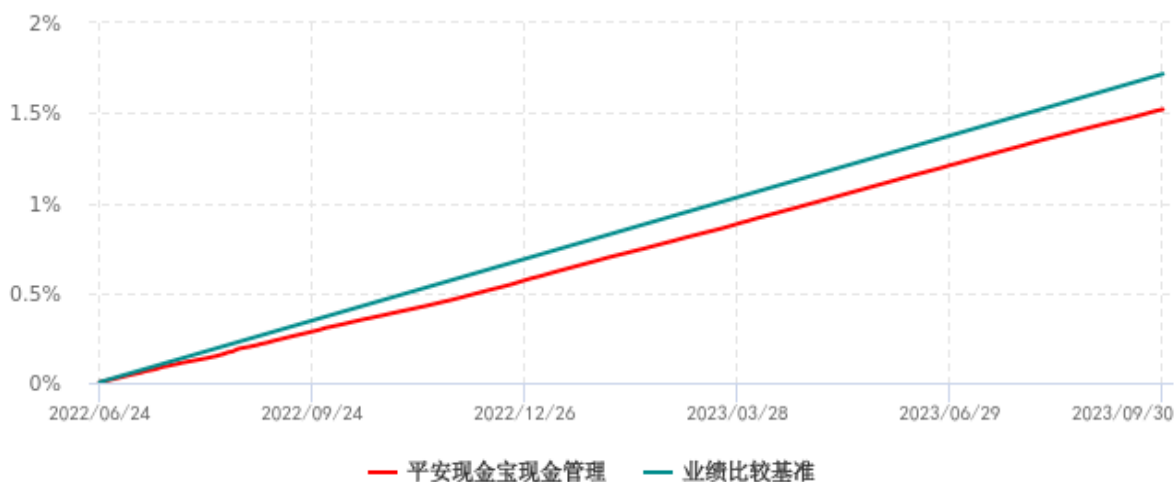
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

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	0.3042%	0.0003%	0.3403%	0.0000%	- 0.0361%	0.0003%
过去六个月	0.6218%	0.0003%	0.6768%	0.0000%	- 0.0550%	0.0003%
过去一年	1.2113%	0.0003%	1.3500%	0.0000%	- 0.1387%	0.0003%
自基金合同 生效起至今	1.5192%	0.0005%	1.7162%	0.0000%	- 0.1970%	0.0005%

##### 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

平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年06月24日-2023年09月30日)



## § 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		
阮毅	投资经理	2023-05-29	-	5年	阮毅，2011年6月加入上海浦东发展银行总行资产管理部，历任债券交易员、产品经理、投资经理和固收专户投资主管，专户管理规模超过1000亿，管理产品曾获证券时报评选最佳开发式产品奖项，2018年5月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司。2018年10月至2021年7月任华泰紫金智盈债券型证券投资基金基金经理。2019年5月至2021年7月任华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019年9月至2021年7月任华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金基金经

			<p>理。2019 年 9 月至 2021 年 7 月任华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月任华泰紫金智鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月任华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2021 年 8 月加入平安证券股份有限公司。2021 年 10 月至 2023 年 5 月任平安证券年年安 6 号单一资产管理计划投资经理。2021 年 10 月至 2023 年 5 月任平安证券星辰 1 号集合资产管理计划、平安证券星辰 3 号集合资产管理计划、平安证券星辰 5 号集合资产管理计划、平安证券星火 1 号集合资产管理计划、平安证券星火 2 号集合资产管理计划、平安证券星云 1 号集合资产管理计划投资经理。2021 年 10 月至 2022 年 4 月任平安证券星耀光银 1 号集合资产管理计划、平安证券成长 5 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券成长 6 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券成长 7 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券星耀光银 2 号集合资产管理计划、平安证券星耀光银 3 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 3 月至 2022 年 4 月任平安证券成长 8 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券成长 9 号 FOF 集合资产管理计划投资经理。2022 年 4 月至 2023 年 5 月任平安证券星虹工享 1 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 6 月至 2023 年 5 月任平安证券星耀泰乾 9 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 10 月至 2023 年</p>
--	--	--	--

					5 月任平安证券星耀稳世 1 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 11 月至 2023 年 5 月任平安证券星虹工享 2 号集合资产管理计划、平安证券星虹工享 3 号集合资产管理计划投资经理。自 2023 年 5 月 29 日起至今担任《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划》《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划》投资经理。
朱娟	投资经理	2022-09-14	-	7 年	朱娟，现任资产管理事业部投资经理， 硕士学历。2016 年 7 月加入平安证券股份有限公司，曾任固定收益投资经理助理。自 2020 年 4 月 20 日起至 2021 年 5 月 6 日担任平安证券现金宝集合资产管理计划、平安证券稳健资本一号集合资产管理计划（已更名为平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划）投资经理。2022 年 7 月 25 日至 2022 年 9 月 1 日担任平安证券弘利信享 1 号集合资产管理计划投资经理。自 2022 年 9 月 14 日起至今担任平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划投资经理。

## 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

报告期内，管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等有关法律法规及本计划资产管理合同、招募说明书等有关法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本计划资产，在控制风险的前提下，为本计划持有人谋求最大利益。报告期，本计划运作合法合规，不存在损害本计划持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

管理人通过建立完善规范、合规的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析等

手段，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度等，建立集中交易管理机制，并重视交易执行环节的公平交易措施，以时间优先、价格优先作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，确保公平对待各投资组合。报告期，管理人公平交易制度总体执行情况良好，未发现本计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本计划不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的其他资管计划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出现超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债市整体呈现 V 型走势。7 月上旬债市窄幅震荡，政策博弈依然是市场关注焦点；下旬政治局会议对地产等方面的一些新提法令债市承压，收益率有所调整。进入 8 月，随着偏弱信贷数据的公布以及超预期降息的到来，债市大幅走强；但随后在止盈压力以及稳增长举措的累积下有所回调。9 月，央行加大公开市场投放，并降准 0.25%。但季末信贷冲量、双节取现等影响下，跨季资金价格不断走高；加上地产优化政策开始实施并持续加码，多重利空影响下，收益率普遍上行，短端升幅更大。全季度看，收益率曲线平坦化上行，信用利差收窄。10 年国债到期收益率上行 4bp 至 2.68%，1 年国债到期收益率上行 30bp 至 2.17%，1 年 AAA 中短期票据到期收益率上行 8bp 至 2.55%，1 年 AAA 存单到期收益率上行 15bp 至 2.47%。

投资操作层面，在做好流动性管理的前提下，本基金灵活调整杠杆、久期水平，适度参与波段交易，以提高组合的综合收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末平安现金宝现金管理基金份额净值为 1.000 元，本报告期内，基金份额净值收益率为 0.3042%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满二百人或者资产净值低于五千万的情形。

### § 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	13,768,069,958.47	76.80
	其中：债券	13,768,069,958.47	76.80
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,458,727,186.29	8.14
	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	2,549,220,924.09	14.22
4	其他资产	150,006,183.30	0.84
5	合计	17,926,024,252.15	100.00

## 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	12.48
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	3,666,979,974.27	25.76
	其中：买断式回购融资	-	-

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2023-09-28	25.76	-	-

注：因产品规模变动。

## 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	117
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	99

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本计划报告期内未出现投资组合平均剩余期限违规超过 120 天的情形。

### 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	34.76	25.79
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	20.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-



3	60 天（含）—90 天	11.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	56.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	125.94	25.79

#### 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：本计划报告期内未涉及投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情形。

#### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,320,018,037.70	16.30
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	624,560,794.29	4.39
5	企业短期融资券	241,557,560.05	1.70
6	中期票据	1,105,547,753.95	7.77
7	同业存单	9,476,385,812.48	66.58
8	其他	-	-
9	合计	13,768,069,958.47	96.73
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	112315210	23 民生银行 CD210	3,500,000	344,760,086.74	2.42
2	CND1000648J8	23 广发银行 CD047	2,600,000	259,225,379.87	1.82
3	CND10005VL02	22 宁波银行 CD316	2,300,000	229,356,879.86	1.61
4	112315189	23 民生银行 CD189	2,200,000	216,917,336.33	1.52
5	112313036	23 浙商银行	2,000,000	199,479,048.70	1.40

		CD036			
6	CND10006NJG7	23 湖南银行 CD104	2,000,000	197,757,631.99	1.39
7	CND10001V0D4	18 陕煤化 MTN006	1,900,000	197,584,271.11	1.39
8	112383121	23 湖南银行 CD107	2,000,000	197,449,010.15	1.39
9	CND10003VZ32	20 江苏租赁 债 01	1,900,000	197,292,705.34	1.39
10	112314053	23 江苏银行 CD053	2,000,000	197,224,504.71	1.39

### 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	0.1011%
报告期内偏离度的最低值	-0.0455%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0636%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本计划报告期内未涉及负偏离度的绝对值达到 0.25%的情形。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本计划报告期内未涉及正偏离度的绝对值达到 0.5%的情形。

### 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：本计划报告期内未涉及资产支持证券投资。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 基金计价方法说明

本计划采用摊余成本法估值，并通过计算暂估收益率的方法每日确认各类金融工具的暂估收益，每万份集合计划暂估净收益和七日年化暂估收益率与分红日实际每万份集合计划净收益和七日年化收益率可能存在差异。

#### 5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会及其地方机构、中国银行保险监督管理委员会及其地方机构、中国保险监督管理委员会及其地方机构。宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国保险监

督管理委员会及其地方机构的处罚。浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会及其地方机构、中国保险监督管理委员会及其地方机构的处罚。江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会及其地方机构、中国人民银行的处罚。西部证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	682,330.51
2	应收证券清算款	149,293,364.99
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	30,487.80
7	其他	-
8	合计	150,006,183.30

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	16,986,931,100.09
报告期期间基金总申购份额	131,246,630,543.89
报告期期间基金总赎回份额	134,000,133,507.68
报告期期末基金份额总额	14,233,428,136.30

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：报告期内，管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

(1) 《关于准予平安证券现金宝集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]649

号);

- (2) 《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划资产管理合同》;
- (3) 《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划招募说明书》及《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划更新的招募说明书》;
- (4) 《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划托管协议》;
- (5) 《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划资产管理合同生效公告》;
- (6) 管理人业务资格批件和营业执照。

## 8.2 存放地点

广东省深圳市福田区福田街道福华三路 15 号与金田路交汇处卓越世纪中心 1 号楼 36 层。

## 8.3 查阅方式

- (1) 书面查阅：可在营业时间于管理人文件存放地点免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- (2) 网络查阅：管理人网站：<https://stock.pingan.com/>。

平安证券股份有限公司  
二〇二三年十月二十五日