

平安日增利货币市场基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
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
§4 管理人报告	9
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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 债券回购融资情况	48
7.3 基金投资组合平均剩余期限	48
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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	49
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	50
7.8 期末按实际利率计算的账面价值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.....	50
7.9 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	58
10.9 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安日增利货币市场基金	
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	
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	168,860,143,422.66 份	
基金合同存续期	不定期	
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	161,399,265,591.40 份	7,460,877,831.26 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。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	LISHUAISHUAI130@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	中国证券报
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(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B
本期已实现收益	1,500,014,822.73	88,973,240.97
本期利润	1,500,014,822.73	88,973,240.97
本期净值收益率	0.9303%	1.0504%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末基金资产净值	161,399,265,591.40	7,460,877,831.26
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(2022年6月30日)	
累计净值收益率	30.1573%	4.1794%

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

平安日增利货币 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	0.1387%	0.0014%	0.1125%	0.0000%	0.0262%	0.0014%
过去三个月	0.4282%	0.0012%	0.3413%	0.0000%	0.0869%	0.0012%
过去六个月	0.9303%	0.0013%	0.6788%	0.0000%	0.2515%	0.0013%
过去一年	1.9858%	0.0012%	1.3688%	0.0000%	0.6170%	0.0012%
过去三年	6.4407%	0.0013%	4.1100%	0.0000%	2.3307%	0.0013%
自基金合同生效起至今	30.1573%	0.0036%	11.7450%	0.0000%	18.4123%	0.0036%

平安日增利货币 B

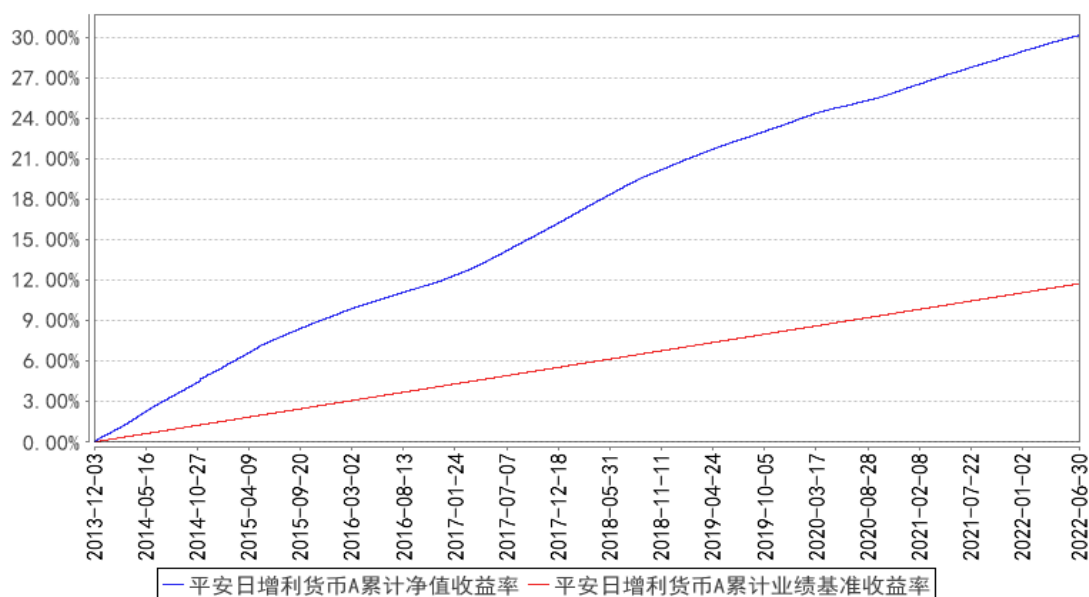
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1585%	0.0014%	0.1125%	0.0000%	0.0460%	0.0014%
过去三个月	0.4884%	0.0012%	0.3413%	0.0000%	0.1471%	0.0012%
过去六个月	1.0504%	0.0013%	0.6788%	0.0000%	0.3716%	0.0013%
过去一年	2.2306%	0.0012%	1.3688%	0.0000%	0.8618%	0.0012%

自基金合同生效起 至今	4.1794%	0.0013%	2.4300%	0.0000%	1.7494 %	0.0013 %
----------------	---------	---------	---------	---------	-------------	-------------

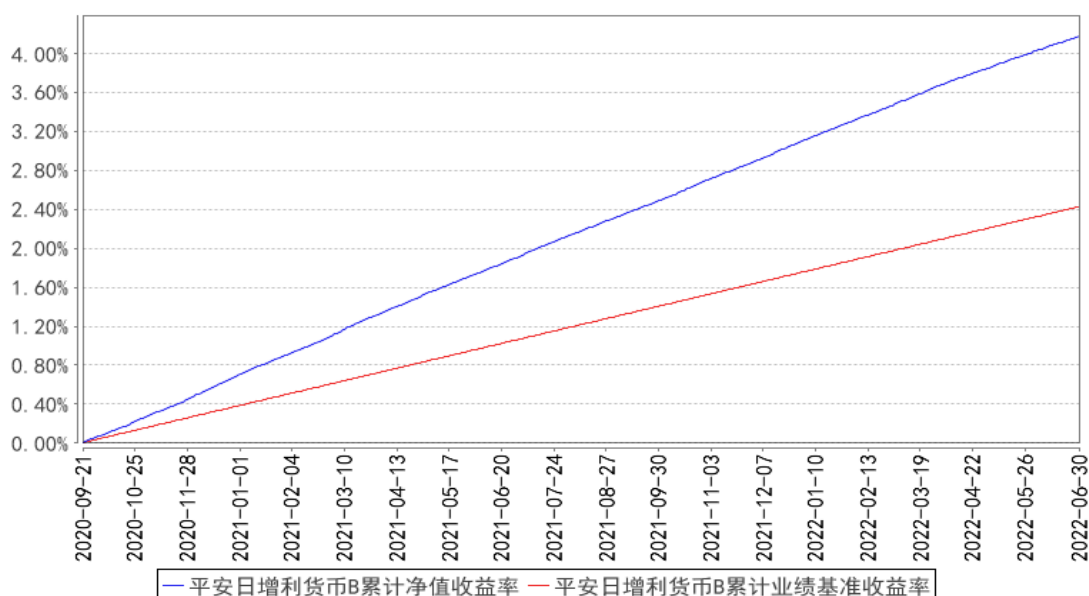
注：平安日增利 B 类份额“自基金合同生效日至今”指 2020 年 09 月 21 日至 2022 年 06 月 30 日

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，所以以上 B 类份额走势图从 2020 年 09 月 21 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成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 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（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。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 2022 年 6 月 30 日，平安基金共管理 169 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5504 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		
罗薇	平安日增利货币市场基金基金经理	2022 年 6 月 13 日	-	9 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，曾担任平安日增利货币市场基金、平安交易型货币市场基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金、平安双债添益债券型证券投资基金、平安恒鑫混合型证券投资基金、平安双季盈 6 个月持有期债券型证券投资基

					金基金经理助理。现担任平安如意中短债债券型证券投资基金、平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金、平安双季增享 6 个月持有期债券型证券投资基金、平安惠铭纯债债券型证券投资基金、平安惠澜纯债债券型证券投资基金基金经理助理。同时担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基金经理。
田元强	平安日增利货币市场基金基金经理	2019 年 3 月 21 日	2022 年 6 月 13 日	9 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、平安惠融纯债债券型证券投资基金基金经理。
罗薇	平安日增利货币市场基金基金经理助理	2021 年 2 月 23 日	2022 年 6 月 12 日	9 年	罗薇女士，新南威尔士大学金融会计专业硕士，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，曾担任平安日增利货币市场基金、平安交易型货币市场基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金、平安双债添益债券型证券投资基金、平安恒鑫混合型证券投资基金、平安双季盈 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理助理。现担任平安如意中短债债券型证券投资基金、平安季享裕三个月

					定期开放债券型证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金、平安双季增享 6 个月持有期债券型证券投资基金、平安惠铭纯债债券型证券投资基金、平安惠澜纯债债券型证券投资基金基金经理助理。同时担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合规守信情况的说明

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

2022 年上半年，宏观经济承受来自地产和疫情的双重拖累，央行通过降准等措施维护宽松流动性环境，货币市场收益率整体呈震荡下行。具体来看，2021 年末降准所释放流动性在一季度初期为市场提供宽松货币环境，货币市场收益快速下行；但随着稳增长政策铺开，经济进入复苏通道，资产收益率自一季度中期震荡上行，带动收益率曲线陡峭化；货币市场收益率在一季度整体呈现 V 型走势。二季度初期国内一线城市疫情延缓经济复苏进度，货币市场收益持续下行；至二季度中期疫情基本得到控制，市场关注点转向宏观经济基本面所承受下行压力，各地稳增长政策持续出台，经济企稳预期升温，长短端资产收益出现分化，货币资产收益率在充裕的流动性环境下呈区间盘整；货币市场收益率在二季度整体呈现震荡下行走势。

报告期内，本基金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。

4.4.2 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 0.9303%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%；本报告期平安日增利货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0504%，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，经济处于复苏进程中，从各项稳增长政策落地到经济增速实际显现出好转迹象仍需时间积累，在宏观数据未见明显改善的情况下，央行仍有动力呵护流动性，货币政策大概率不会出现急转弯。拆分经济“三驾马车”：投资方面，地产政策拐点已现，企业融资回暖到投资改善的链条仍待时日；财政从“休养生息”过度到逐步发力，基建仍将作为托底经济的重要调节项；产业政策落地，有利于制造业投资维持良好景气度。消费方面，防疫政策调整，消费复苏仍有空间。出口方面，加息拖累海外主要经济体增速回落，对国内出口形成潜在负面影响。

经济增速的斜率决定宽松货币政策退出的节奏，当前复苏仍缓慢，短期货币政策转向概率较低，需要持续观察宽信用传导进度和经济修复力度，从央行近期重提“不搞大水漫灌”来看，结构性货币政策仍是央行向实体投放流动性的主要途径。综合来看，经济基本面修复、通胀、汇率压力在阶段性对市场形成调整压力，而当前充裕的流动性环境对货币市场收益率形成支撑，预计下半年市场以震荡为主，货币基金不仅需要把握市场波动捕捉资产配置机会，也需要做好流动性

风险管理。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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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、风险管理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。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

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 1,588,988,063.70 元，实际分配收益 1,588,988,063.70 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：平安日增利货币市场基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	57,651,959,701.43	43,353,074,664.71
结算备付金		254,866,336.99	313,000,736.14
存出保证金		138,236.32	72,278.12
交易性金融资产	6.4.7.2	74,118,110,415.10	89,942,457,274.68
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		74,118,110,415.10	89,820,436,909.63
资产支持证券投资		—	122,020,365.05
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	52,404,902,681.41	22,563,897,347.84
债权投资	6.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—	—
应收清算款		343,713,807.91	—
应收股利		—	—
应收申购款		106,681,984.34	119,240,534.86
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	506,349,005.79
资产总计		184,880,373,163.50	156,798,091,842.14
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
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		15,912,216,661.99	11,490,462,794.30
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		50,461,605.43	42,020,879.92
应付托管费		12,233,116.47	10,186,880.00
应付销售服务费		35,799,013.31	29,368,380.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		914,831.49	2,259,995.68
应付利润		6,666,748.06	8,582,608.62
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,937,764.09	5,396,681.92
负债合计		16,020,229,740.84	11,588,278,221.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	168,860,143,422.66	145,209,813,620.91
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		168,860,143,422.66	145,209,813,620.91
负债和净资产总计		184,880,373,163.50	156,798,091,842.14

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 168,860,143,422.66 份，其中平安日增利货币 A 基金份额总额 161,399,265,591.40 份，基金份额净值 1.0000 元。平安日增利货币 B 基金份额总额 7,460,877,831.26 份，基金份额净值 1.0000 元。

6.2 利润表

会计主体：平安日增利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,222,289,559.46	1,939,960,201.14
1. 利息收入		1,195,037,958.83	1,891,524,273.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	671,403,840.62	516,559,127.36
债券利息收入		-	1,065,320,583.22
资产支持证券利息收入		-	13,398,249.86
买入返售金融资产收入		523,634,118.21	296,246,312.64
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,027,251,600.63	48,435,928.06

其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,026,195,411.86	48,435,928.06
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	1,056,188.77	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		633,301,495.76	468,824,943.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	280,069,400.06	221,671,691.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	67,895,612.15	53,738,591.90
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	201,901,437.15	155,183,497.66
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		82,469,255.76	36,701,192.31
其中：卖出回购金融资产支 出		82,469,255.76	36,701,192.31
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		816,251.04	1,368,552.62
8. 其他费用	6.4.7.23	149,539.60	161,417.42
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		1,588,988,063.70	1,471,135,257.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		1,588,988,063.70	1,471,135,257.56
五、其他综合收益的税后净 额		-	-
六、综合收益总额		1,588,988,063.70	1,471,135,257.56

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安日增利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	145,209,813,620.91	-	-	145,209,813,620.91
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	145,209,813,620.91	-	-	145,209,813,620.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	23,650,329,801.75	-	-	23,650,329,801.75
(一)、综合收益总额	-	-	1,588,988,063.70	1,588,988,063.70
(二)、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)	23,650,329,801.75	-	-	23,650,329,801.75
其中:1.基金申购款	803,052,777,326.00	-	-	803,052,777,326.00
2.基金赎回款	-779,402,447,524.25	-	-	-779,402,447,524.25
(三)、	-	-	-1,588,988,063.70	-1,588,988,063.70

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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	168,860,143,422.66	-	-	168,860,143,422.66
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	117,990,318,325.42	-	-	117,990,318,325.42
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	117,990,318,325.42	-	-	117,990,318,325.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	10,558,772,574.57	-	-	10,558,772,574.57

(一)、 综合收益总额	-	-	1,471,135,257.56	1,471,135,257.56
(二)、 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)	10,558,772,574.57	-	-	10,558,772,574.57
其中:1. 基金申购款	494,614,172,926.11	-	-	494,614,172,926.11
2. 基金赎回款	-484,055,400,351.54	-	-	-484,055,400,351.54
(三)、 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)	-	-	-1,471,135,257.56	-1,471,135,257.56
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净资产(基 金净值)	128,549,090,899.99	-	-	128,549,090,899.99

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

平安日增利货币市场基金(原名为平安大华日增利货币市场基金,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[2013]1211号文核准,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《平安大华日增利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525,508,703.96元,业经安永华明会计师事务所安永华明(2013)验字第60937497_H01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华日增利货币市场基金基金合同》于2013年12月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为525,531,640.49份基金份额,其中认购资金利息折合22,936.53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》,平安大华日增利货币市场基金于2018年11月30日起更名为平安日增利货币市场基金。

根据《平安日增利货币市场基金招募说明书》,本基金根据基金份额持有人申购本基金的金额进行基金份额类别划分,设置A类和B类两类基金份额,两类基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,两类基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安日增利货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金,期限一年以内(含一年)的银行存款、同业存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,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:税后同期七天通知存款利率。

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》、《平安日增利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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 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估计与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计政策除了下述会计政策变更外，其余与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计政策的变更

6.4.4.1.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的金融资产主要为债务工具，是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损

益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时，以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每

日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息

继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.1.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.1.4 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为43,353,074,664.71元、313,000,736.14元、72,278.12元、22,563,897,347.84元、506,349,005.79元和119,240,534.86元。新金融工具准

则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 43,509,804,057.85 元、313,141,586.44 元、72,310.62 元、22,576,234,846.41 元、0.00 元和 119,240,534.86 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 89,942,457,274.68 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 90,279,598,505.96 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付利润、应付交易费用和应付利息，金额分别为 11,490,462,794.30 元、42,020,879.92 元、10,186,880.00 元、29,368,380.79 元、8,582,608.62 元、944,349.75 元和 4,143,332.17 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付利润、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为 11,494,606,126.47 元、42,020,879.92 元、10,186,880.00 元、29,368,380.79 元、8,582,608.62 元、944,349.75 元和 0.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	302,695,100.18
等于：本金	302,690,876.82
加：应计利息	4,223.36
减：坏账准备	—
定期存款	57,349,264,601.25
等于：本金	56,950,000,000.00
加：应计利息	399,264,601.25
减：坏账准备	—

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	57,349,264,601.25
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	57,651,959,701.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	1,039,417,022.55	1,038,800,463.57	-616,558.98	-0.0004
	银行间市场	73,078,693,392.55	73,144,373,885.99	65,680,493.44	0.0389
	合计	74,118,110,415.10	74,183,174,349.56	65,063,934.46	0.0385
资产支持证券		-	-	-	-
合计		74,118,110,415.10	74,183,174,349.56	65,063,934.46	0.0385

注：1. 偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；

2. 偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	26,967,289,040.06	-
银行间市场	25,437,613,641.35	-
合计	52,404,902,681.41	-

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	—
应付交易费用	1,794,872.96
其中：交易所市场	—
银行间市场	1,794,872.96
应付利息	—
预提费用	142,891.13
合计	1,937,764.09

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安日增利货币 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	139,152,573,047.84	139,152,573,047.84
本期申购	769,773,361,098.02	769,773,361,098.02
本期赎回（以“-”号填列）	-747,526,668,554.46	-747,526,668,554.46
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	161,399,265,591.40	161,399,265,591.40

平安日增利货币 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,057,240,573.07	6,057,240,573.07
本期申购	33,279,416,227.98	33,279,416,227.98
本期赎回（以“-”号填列）	-31,875,778,969.79	-31,875,778,969.79
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	7,460,877,831.26	7,460,877,831.26

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

平安日增利货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	1,500,014,822.73	-	1,500,014,822.73
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	-1,500,014,822.73	-	-1,500,014,822.73
本期末	-	-	-

平安日增利货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	88,973,240.97	-	88,973,240.97
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	-88,973,240.97	-	-88,973,240.97
本期末	-	-	-

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,040,435.30
定期存款利息收入	667,754,226.65
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,607,810.13
其他	1,368.54
合计	671,403,840.62

6.4.7.14 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	921,402,985.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	104,792,426.85
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	1,026,195,411.86

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	141,890,605,978.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	140,975,084,774.52

本总额	
减：应计利息总额	810,734,476.94
减：交易费用	-5,700.00
买卖债券差价收入	104,792,426.85

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	694,537.94
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	361,650.83
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,056,188.77

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	125,087,281.47
减：卖出资产支持证券成本总额	122,012,051.67
减：应计利息总额	2,713,578.97
减：交易费用	0.00
资产支持证券投资收益	361,650.83

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 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——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 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——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内无公允价值变动损益。

6.4.7.21 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	74,383.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	13,500.00
其他	2,148.47
合计	149,539.60

6.4.7.24 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

截至本财务报表批准报出日，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
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
平安信托有限责任公司	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
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
上海陆金所基金销售有限公司（“陆基金”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
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
广州平安好贷小额贷款有限公司（“平安好贷”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
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

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	280,069,400.06	221,671,691.67
其中：支付销售机构的客户维护费	90,423,730.76	42,610,517.09

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 0.33%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 × 0.33% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	67,895,612.15	53,738,591.90

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 0.08%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 × 0.08% / 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B	合计
陆基金	6,854,317.06	564.22	6,854,881.28
平安基金	33,489,318.20	238,771.98	33,728,090.18
平安银行	41,864,551.33	57,058.16	41,921,609.49
平安证券	1,138.66	—	1,138.66
合计	82,209,325.25	296,394.36	82,505,719.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B	合计

陆基金	2,517,613.26	-	2,517,613.26
平安基金	78,642,987.04	417,122.02	79,060,109.06
平安银行	18,557,526.62	64,227.27	18,621,753.89
平安证券	4,397.03	-	4,397.03
合计	99,722,523.95	481,349.29	100,203,873.24

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 0.25% 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：

A 类基金日销售服务费 = A 类基金前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

支付基金销售机构的销售服务费按 B 类基金前一日基金资产净值 0.01% 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：

B 类基金日销售服务费 = B 类基金前一日基金资产净值 × 0.01% / 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B
基金合同生效日（2013 年 12 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B
基金合同生效日（2013 年 12 月 3 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	0.00	—
报告期间申购/买入总份额	170,228,290.07	—
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	170,228,290.07	—
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

平安日增利货币 A

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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（%）
平安好贷	20,866,899.00	0.0129	20,674,154.43	0.0149
平安汇通	—	—	89,252,528.37	0.0641
平安人寿	601.42	0.0000	595.74	0.0000

份额单位：份

平安日增利货币 B

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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（%）
平安证券	—	—	504,199,852.74	8.3239

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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-定期	-	1,214,166.67	-	-
平安银行-活期	302,695,100.18	1,040,435.30	2,211,384.27	1,272,480.32

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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2022 年上半年度，本基金因投资托管人平安银行的同业存单而取得的利息收入为 15,501,498.25 人民币元(2021 年上半年度：10,470,971.87 元)。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有 2,500,000 张托管人平安银行的同业存单，账面价值为人民币 247,616,238.64 元，占基金资产净值的比例为 0.15%(2021 年 6 月 30 日：本基金持有 16,400,000 张托管人平安银行的同业存单，账面价值为人民币 1,632,315,452.58 元，占基金资产净值的比例为 1.27%)。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

平安日增利货币 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
1,501,876,146.77	-	-1,861,324.04	1,500,014,822.73	-
平安日增利货币 B				
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
89,027,777.49	-	-54,536.52	88,973,240.97	-

6.4.12 期末(2022 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：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

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 2022 年 06 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 15,912,216,661.99 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
------	------	-------	------------	-------	--------

012281433	22 中石化 SCP009	2022 年 7 月 1 日	100.35	1,862,000	186,848,892.77
091918002	19 农发清 发 02	2022 年 7 月 1 日	102.68	400,000	41,071,209.21
092103012	21 进出清 发 02	2022 年 7 月 1 日	99.47	1,700,000	169,094,869.19
092203002	22 进出清 发 02	2022 年 7 月 1 日	100.05	60,000	6,003,016.61
112109301	21 浦发银 行 CD301	2022 年 7 月 1 日	99.13	17,000	1,685,225.14
112110436	21 兴业银 行 CD436	2022 年 7 月 1 日	99.18	2,174,000	215,621,301.83
112118260	21 华夏银 行 CD260	2022 年 7 月 1 日	99.19	2,174,000	215,645,580.40
112204013	22 中国银 行 CD013	2022 年 7 月 1 日	98.38	2,826,000	278,035,567.99
112204025	22 中国银 行 CD025	2022 年 7 月 1 日	97.77	5,495,000	537,251,267.07
112207012	22 招商银 行 CD012	2022 年 7 月 1 日	99.49	7,586,000	754,716,828.75
112208064	22 中信银 行 CD064	2022 年 7 月 1 日	97.79	2,320,000	226,863,310.93
112218056	22 华夏银 行 CD056	2022 年 7 月 1 日	99.45	5,434,000	540,399,745.15
112221094	22 渤海银 行 CD094	2022 年 7 月 1 日	99.43	5,377,000	534,612,404.91
112221154	22 渤海银 行 CD154	2022 年 7 月 1 日	99.26	5,000,000	496,302,435.68
112292910	22 珠海华 润银行 CD025	2022 年 7 月 1 日	99.05	5,000,000	495,272,353.30
112295570	22 青岛银 行 CD027	2022 年 7 月 1 日	98.79	1,721,000	170,024,815.15
112297506	22 广州农 村商业银 行 CD057	2022 年 7 月 1 日	99.29	5,377,000	533,879,721.84
112297951	22 贵阳银 行 CD067	2022 年 7 月 1 日	99.26	5,000,000	496,318,477.82
112298973	22 江苏江 南农村商 业银行 CD047	2022 年 7 月 1 日	99.76	6,436,000	642,087,368.99
150221	15 国开 21	2022 年 7 月 1 日	103.00	1,000,000	103,004,966.13

170212	17 国开 12	2022 年 7 月 1 日	103.73	4,700,000	487,535,663.16
170412	17 农发 12	2022 年 7 月 1 日	103.90	1,400,000	145,458,420.31
190011	19 付息国债 11	2022 年 7 月 1 日	102.58	1,307,000	134,072,976.48
190214	19 国开 14	2022 年 7 月 1 日	102.38	5,400,000	552,827,486.97
190308	19 进出 08	2022 年 7 月 1 日	102.58	3,125,000	320,558,562.67
190407	19 农发 07	2022 年 7 月 1 日	103.03	3,200,000	329,688,151.33
200011	20 付息国债 11	2022 年 7 月 1 日	102.43	6,000,000	614,588,453.30
200312	20 进出 12	2022 年 7 月 1 日	102.74	2,900,000	297,952,154.64
210010	21 付息国债 10	2022 年 7 月 1 日	101.91	6,083,000	619,905,474.54
210016	21 付息国债 16	2022 年 7 月 1 日	101.65	1,500,000	152,478,499.70
210211	21 国开 11	2022 年 7 月 1 日	101.93	12,000,000	1,223,114,300.92
210216	21 国开 16	2022 年 7 月 1 日	101.56	2,900,000	294,538,348.91
210306	21 进出 06	2022 年 7 月 1 日	101.79	6,800,000	692,192,506.92
210308	21 进出 08	2022 年 7 月 1 日	101.26	2,000,000	202,521,140.97
210407	21 农发 07	2022 年 7 月 1 日	101.88	9,900,000	1,008,603,301.63
210411	21 农发 11	2022 年 7 月 1 日	101.56	2,300,000	233,576,637.87
220201	22 国开 01	2022 年 7 月 1 日	100.94	2,367,000	238,915,503.92
220206	22 国开 06	2022 年 7 月 1 日	100.00	1,000,000	100,002,406.09
220304	22 进出 04	2022 年 7 月 1 日	100.24	995,000	99,735,865.86
2203672	22 进出 672	2022 年 7 月 1 日	99.89	1,900,000	189,797,993.96
2203673	22 进出 673	2022 年 7 月 1 日	99.86	1,900,000	189,732,147.70
2203674	22 进出 674	2022 年 7 月 1 日	99.81	4,000,000	399,227,534.50

2203675	22 进出 675	2022 年 7 月 1 日	99.79	1,600,000	159,659,533.08
2203676	22 进出 676	2022 年 7 月 1 日	99.76	1,000,000	99,761,420.58
220401	22 农发 01	2022 年 7 月 1 日	100.42	200,000	20,084,630.28
220404	22 农发 04	2022 年 7 月 1 日	99.89	1,500,000	149,832,012.07
229908	22 贴现国 债 08	2022 年 7 月 1 日	99.64	2,200,000	219,211,776.08
229913	22 贴现国 债 13	2022 年 7 月 1 日	99.45	500,000	49,725,536.97
229914	22 贴现国 债 14	2022 年 7 月 1 日	99.95	1,000,000	99,949,208.86
229915	22 贴现国 债 15	2022 年 7 月 1 日	99.91	500,000	49,957,080.57
229916	22 贴现国 债 16	2022 年 7 月 1 日	99.90	800,000	79,921,390.69
229917	22 贴现国 债 17	2022 年 7 月 1 日	99.38	4,000,000	397,505,378.96
229918	22 贴现国 债 18	2022 年 7 月 1 日	99.82	1,700,000	169,693,243.56
229920	22 贴现国 债 20	2022 年 7 月 1 日	99.94	2,000,000	199,877,115.12
合计				167,636,000	16,866,941,218.03

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发行的证券，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 37.60%（上年末：56.71%）。

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 3.23%，本基金投资组合的平均剩余期限为 89 天，平均剩余存续期为 89 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公司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 2022 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	48,980,150,723.84	8,671,808,977.59	-	-	-	57,651,959,701.43
结算备付金	254,866,336.99	-	-	-	-	254,866,336.99
存出保证金	138,236.32	-	-	-	-	138,236.32
交易性金融资产	60,059,481,074.38	14,058,629,340.72	-	-	-	74,118,110,415.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	52,404,902,681.41	-	-	-	-	52,404,902,681.41
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	106,681,984.34	106,681,984.34
应收清算款	-	-	-	-	343,713,807.91	343,713,807.91
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	161,699,539,052.94	22,730,438,318.31	-	-	450,395,792.25	184,880,373,163.50
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	50,461,605.43	50,461,605.43
应付托管费	-	-	-	-	12,233,116.47	12,233,116.47
应付清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	15,912,216,661.99	-	-	-	-	15,912,216,661.99
应付销售服务费	-	-	-	-	35,799,013.31	35,799,013.31
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	6,666,748.06	6,666,748.06

应交税费	-	-	-	-	914,831.49	914,831.49
其他负债	-	-	-	-	1,937,764.09	1,937,764.09
负债总计	15,912,216,661.99	-	-	-	108,013,078.85	16,020,229,740.84
利率敏感 度缺口	145,787,322,390.95	22,730,438,318.31	-	-	342,382,713.40	168,860,143,422.66
上年度末 2021 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	40,453,074,664.71	2,900,000,000.00	-	-	-	43,353,074,664.71
结算备付 金	313,000,736.14	-	-	-	-	313,000,736.14
存出保证 金	72,278.12	-	-	-	-	72,278.12
交易性金 融资产	81,942,601,214.64	7,999,856,060.04	-	-	-	89,942,457,274.68
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-
买入返售 金融资产	22,563,897,347.84	-	-	-	-	22,563,897,347.84
应收利息	-	-	-	-	506,349,005.79	506,349,005.79
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购 款	-	-	-	-	119,240,534.86	119,240,534.86
应收证券 清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	145,272,646,241.45	10,899,856,060.04	-	-	625,589,540.65	156,798,091,842.14
负债						
应付赎回 款	-	-	-	-	-	-
应付管理 人报酬	-	-	-	-	42,020,879.92	42,020,879.92
应付托管 费	-	-	-	-	10,186,880.00	10,186,880.00
应付证券 清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购 金融资产 款	11,490,462,794.30	-	-	-	-	11,490,462,794.30
应付销售 服务费	-	-	-	-	29,368,380.79	29,368,380.79
应付交易 费用	-	-	-	-	944,349.75	944,349.75

应付利息	-	-	-	-	4,143,332.17	4,143,332.17
应付利润	-	-	-	-	8,582,608.62	8,582,608.62
应交税费	-	-	-	-	2,259,995.68	2,259,995.68
其他负债	-	-	-	-	309,000.00	309,000.00
负债总计	11,490,462,794.30	-	-	-	97,815,426.93	11,588,278,221.23
利率敏感 度缺口	133,782,183,447.15	10,899,856,060.04	-	-	-527,774,113.72	145,209,813,620.91

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	27,050,281.25	41,692,734.48
	市场利率上升 25 个基点	-26,981,779.11	-41,610,623.24

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）。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	—	—
第二层次	74,118,110,415.10	89,942,457,274.68
第三层次	—	—
合计	74,118,110,415.10	89,942,457,274.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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	74,118,110,415.10	40.09
	其中：债券	74,118,110,415.10	40.09
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	52,404,902,681.41	28.35
	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	57,906,826,038.42	31.32
4	其他各项资产	450,534,028.57	0.24
5	合计	184,880,373,163.50	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	4.55	
	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	15,912,216,661.99	9.42
	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：在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%。

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	89
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	68

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	各期限负债占基金资产
----	--------	------------	------------

		净值的比例 (%)	净值的比例 (%)
1	30 天以内	39.58	9.42
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	13.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	14.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	32.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		108.99	9.42

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,798,158,573.55	1.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,820,446,764.21	4.63
	其中：政策性 金融债	7,820,446,764.21	4.63
4	企业债券	1,039,417,022.55	0.62
5	企业短期融 资券	19,539,388,335.46	11.57
6	中期票据	2,074,233,037.60	1.23
7	同业存单	40,846,466,681.73	24.19
8	其他	-	-
9	合计	74,118,110,415.10	43.89
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值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）	按实际利率计算的 账面价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112295575	22 徽商银行 CD025	25,000,000	2,485,971,813.46	1.47
2	112215163	22 民生银行 CD163	24,000,000	2,396,972,409.89	1.42
3	112213065	22 浙商银行 CD065	15,000,000	1,469,655,886.00	0.87
4	042280238	22 电网 CP004	14,000,000	1,399,779,335.81	0.83
5	112218056	22 华夏银行 CD056	14,000,000	1,392,270,230.41	0.82
6	112299021	22 重庆农村商 行 CD079	13,000,000	1,297,005,730.48	0.77
7	210211	21 国开 11	12,000,000	1,223,114,300.92	0.72
8	112208064	22 中信银行 CD064	12,000,000	1,173,430,918.59	0.69
9	112299009	22 宁波银行 CD122	11,000,000	1,097,477,653.40	0.65
10	112299058	22 杭州银行 CD131	11,000,000	1,097,477,653.40	0.65

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	—
报告期内偏离度的最高值	0.0810%
报告期内偏离度的最低值	0.0082%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0457%

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 期末按实际利率计算的账面价值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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。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

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）26 号决定，由于中国民生银行股份有限公司逾期未履行行政义务，内部制度不完善，违规经营等，根据相关规定对其处以罚款 11450 万元。

中国人民银行宁波市中心支行于 2021 年 7 月 13 日作出甬银处罚字（2021）2 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）1. 违规为存款人多头开立银行结算账户；2. 超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料；3. 占压财政存款；4. 未按照规定履行客户身份识别义务；5. 未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告；6. 与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户，根据相关规定，对其处以罚款 286.2 万元。

国家外汇管理局浙江省分局于 2021 年 7 月 26 日作出浙外管罚[2021]1 号决定，浙商银行股份有限公司因违规经营，被责令改正，给予警告，合计没收违法所得 560.3 万元，处 267 万元罚款。

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2021 年 7 月 30 日作出甬银保监罚决字（2021）57 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储；开发贷款支用审核不严；房地产贷款放款和支用环节审核不严；贷款资金违规流入房市；房地产贷款资金回流借款人；票据业务开展不审慎，根据相关规定，对其处以罚款 275 万元。

中国人民银行于 2021 年 8 月 13 日作出银罚字（2021）25 号处罚决定，由于华夏银行股份有限公司（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，根据相关规定对公司罚款 486 万元。

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。

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2021 年 12 月 29 日作出甬银保监罚决字（2021）81 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）信用卡业务管理不到位，根据相关规定，对其处以罚款 30 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〕20 号处罚决定，由于民生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、未报送贸易融资业务 EAST 数据；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、债券投资业务 EAST 数据存在偏差；五、未报送权益类投资业务 EAST 数据；六、未报送公募基金投资业务 EAST 数据；七、未报送其他担保类业务 EAST 数据；八、未报送不可无条件撤销的贷款承诺业务 EAST 数据；九、漏报委托贷款业务 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《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、报送不实数据；十六、面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产，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，对中国民生银行股份有限公司罚款 490 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〕17 号处罚决定，由于中信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、漏报抵押物价值 EAST 数据；二、未报送权益类投资业务 EAST 数据；三、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；四、漏报其他担保类业务 EAST 数据；五、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；六、EAST 系统《关联关系》表漏报；七、面向非机构客户发行的理财产品投资不

良资产；八、2018 年行政处罚问题依然存在，根据相关规定，对其处以罚款 290 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）19 号处罚决定，由于华夏银行股份有限公司（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、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差二、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差三、漏报贸易融资业务 EAST 数据四、漏报抵押物价值 EAST 数据五、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据六、漏报债券投资业务 EAST 数据七、未报送权益类投资业务 EAST 数据八、漏报公募基金投资业务 EAST 数据九、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据十、漏报贷款承诺业务 EAST 数据十一、漏报委托贷款业务 EAST 数据十二、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差十三、EAST 系统分户账与总账比对不一致十四、漏报分户账 EAST 数据十五、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报十六、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报十七、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报十八、EAST 系统《关联关系》表漏报，依据《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，对华夏银行股份有限公司处以罚款 460 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2022 年 4 月 11 日作出甬银保监罚决字（2022）28 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位，根据相关规定，对其处以罚款 220 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2022 年 4 月 11 日作出甬银保监罚决字（2022）30 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）代理保险销售不规范，根据相关规定，对其处以罚款 30 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2022 年 4 月 21 日作出甬银保监罚决字（2022）35 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、绿色信贷政策执行不到位、授信管理不审慎、资金用途管控不严、贷款风险分类不准确、票据业务管控不严、非现场统计数据差错，根据相关规定，对其处以罚款 270 万元。

中国人民银行合肥中心支行于 2022 年 5 月 6 日作出（合银）罚字（2022）3 号处罚决定，由于徽商银行股份有限公司（以下简称“公司”）1. 单位银行结算账户未向或未在规定时间内向人民币结算账户管理系统备案；2. 单位银行结算账户未经人民银行核准；3. 个人银行结算账户未向或未在规定时间内向账户管理系统备案；4. 单位商户使用个人银行账户作为收单结算账户，根据相关规定，对公司提出警告并处罚款人民币 9 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波监管局于 2022 年 5 月 27 日作出甬银保监罚决字（2022）44 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位、违规办理衍生产品交易业务、信用证议付资金用于购买本行理财、违规办理委托贷款业务、非银融资业务开展不规范、内控管理不到位、数据治理存在欠缺，根据相关规定，对其处以罚款 290 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. 未按照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。

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	138,236.32

2	应收清算款	343,713,807.91
3	应收利息	—
4	应收申购款	106,681,984.34
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	450,534,028.57

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 级 别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
平 安 日 增 利 货 币 A	46,887,697	3,442.25	2,234,864,991.35	1.38	159,164,400,600.05	98.62
平 安 日 增 利 货 币 B	157	47,521,514.85	7,460,877,831.26	100.00	—	—
合 计	46,887,848	3,601.36	9,695,742,822.61	5.74	159,164,400,600.05	94.26

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	3,506,803,253.23	2.08

2	银行类机构	1,016,210,685.39	0.60
3	银行类机构	210,220,963.17	0.12
4	银行类机构	203,814,544.61	0.12
5	券商类机构	150,908,037.16	0.09
6	信托类机构	91,702,042.57	0.05
7	信托类机构	84,212,002.33	0.05
8	券商类机构	80,003,951.96	0.05
9	券商类机构	60,702,621.63	0.04
10	券商类机构	57,502,840.47	0.03

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有本基金	平安日增利货币 A	1,324,453.03	0.0008
	平安日增利货币 B	—	—
	合计	1,324,453.03	0.0008

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安日增利货币 A	50~100
	平安日增利货币 B	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	平安日增利货币 A	0~10
	平安日增利货币 B	0
	合计	0~10

§9 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
基金合同生效日 （2013 年 12 月 3 日） 基金份额总额	525,531,640.49	—
本报告期期初基金份额总额	139,152,573,047.84	6,057,240,573.07

本报告期基金总申购份额	769,773,361,098.02	33,279,416,227.98
减：本报告期基金总赎回份额	747,526,668,554.46	31,875,778,969.79
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	161,399,265,591.40	7,460,877,831.26

§ 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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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 (%)	
国信证券	2	—	—	—	—	—

注：1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、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

3、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 (%)
国信证券	1,428,595,760.00	100.00	386,414,300.00	100.00	-	-

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	关于旗下证券投资基金实施新会计准则等相关事宜的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 01 日
2	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国民生银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 10 日
3	平安基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“平安基金”名义进行诈骗的风险提示	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 12 日
4	平安日增利货币市场基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 24 日
5	平安日增利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	2022 年 01 月 25 日
6	平安基金管理有限公司关于调整平安日增利货币市场基金持有人单个基金账户累计持有份额上限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 02 月 15 日
7	平安基金管理有限公司关于新增中证金牛（北京）基金销售有限公司为平安日增利货币市场基金 B 类份额销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 02 月 23 日
8	平安日增利货币市场基金清明节假期	中国证监会规定报刊及	2022 年 03 月 25 日

	前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	网站	
9	平安日增利货币市场基金 2021 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 03 月 31 日
10	平安基金管理有限公司关于调整公司旗下公募基金产品风险评级相关事项的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 02 日
11	平安基金管理有限公司关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 21 日
12	平安日增利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	2022 年 04 月 22 日
13	平安日增利货币市场基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 22 日
14	平安基金管理有限公司关于新增兴业银行股份有限公司为平安日增利货币市场基金 B 类份额销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 05 月 10 日
15	平安基金管理有限公司关于暂停民商基金销售（上海）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 05 月 23 日
16	平安基金管理有限公司关于暂停深圳市金海九州基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司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	2022 年 05 月 30 日
17	平安基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司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	2022 年 05 月 30 日
18	平安基金管理有限公司关于新增中银国际证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 05 月 31 日
19	关于旗下基金在深圳新华信通基金销售有限公司开通费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 05 月 31 日
20	平安日增利货币市场基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 05 月 31 日
21	平安日增利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	2022 年 05 月 31 日
22	平安基金管理有限公司关于暂停中证金牛（北京）基金销售有限公司、北京微动利基金销售有限公司、喜鹊财富基金销售有限公司、上海挖财基金销售有限公司、大河财富基金销售有	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 06 月 02 日

	限公司销售机构办理相关销售业务的公告		
23	平安日增利货币市场基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 06 月 14 日
24	平安日增利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	2022 年 06 月 14 日
25	平安日增利货币市场基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 06 月 14 日
26	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 06 月 30 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

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

2022 年 8 月 31 日