

# 平安日增利货币市场基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度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 03 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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>

8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 债券回购融资情况.....	49
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	49
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
8.6 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 .....	50
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	51
8.8 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 .....	51
8.9 投资组合报告附注.....	52
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	53
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
9.4 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 .....	53
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况.....	54
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	54
11.2 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 .....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
11.4 基金投资策略的改变.....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	56
11.9 其他重大事件.....	56
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</b>
12.1 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 .....	59
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
13.1 备查文件目录.....	59
13.2 存放地点.....	59
13.3 查阅方式.....	59

## § 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	145,209,813,620.91 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	139,152,573,047.84 份	6,057,240,573.07 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年		2020 年	2020 年 9 月 14 日(基金合同 生效日)-2020 年 12 月 31 日	2019 年	
	平安日增利货 币 A	平安日增利货 币 B	平安日增利货 币 A	平安日增利货 币 B	平安日增利货 币 A	平安 日 增 利 货 币 B
本期已实	2,755,677,425 .38	311,520,343. 89	2,264,633,351 .66	41,766,164.9 3	3,305,683,986 .47	-

现收益						
本期利润	2,755,677,425.38	311,520,343.89	2,264,633,351.66	41,766,164.93	3,305,683,986.47	-
本期净值收益率	2.1387%	2.3840%	2.0279%	0.6959%	2.5417%	-
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末基金资产净值	139,152,573,047.84	6,057,240,573.07	113,295,926,666.66	4,694,391,658.76	108,306,221,675.33	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末	2021 年末		2020 年末		2019 年末	

指标						
累计净值收益率	28.9576%	3.0965%	26.2573%	0.6959%	23.7479%	-

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	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
过去三个月	0.5313%	0.0010%	0.3450%	0.0000%	0.1863%	0.0010%
过去六个月	1.0457%	0.0010%	0.6900%	0.0000%	0.3557%	0.0010%
过去一年	2.1387%	0.0010%	1.3688%	0.0000%	0.7699%	0.0010%
过去三年	6.8587%	0.0013%	4.1100%	0.0000%	2.7487%	0.0013%
过去五年	14.9886%	0.0024%	6.8475%	0.0000%	8.1411%	0.0024%
自基金合同生效起至今	28.9576%	0.0036%	11.0663%	0.0000%	17.8913%	0.0036%

平安日增利货币 B

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

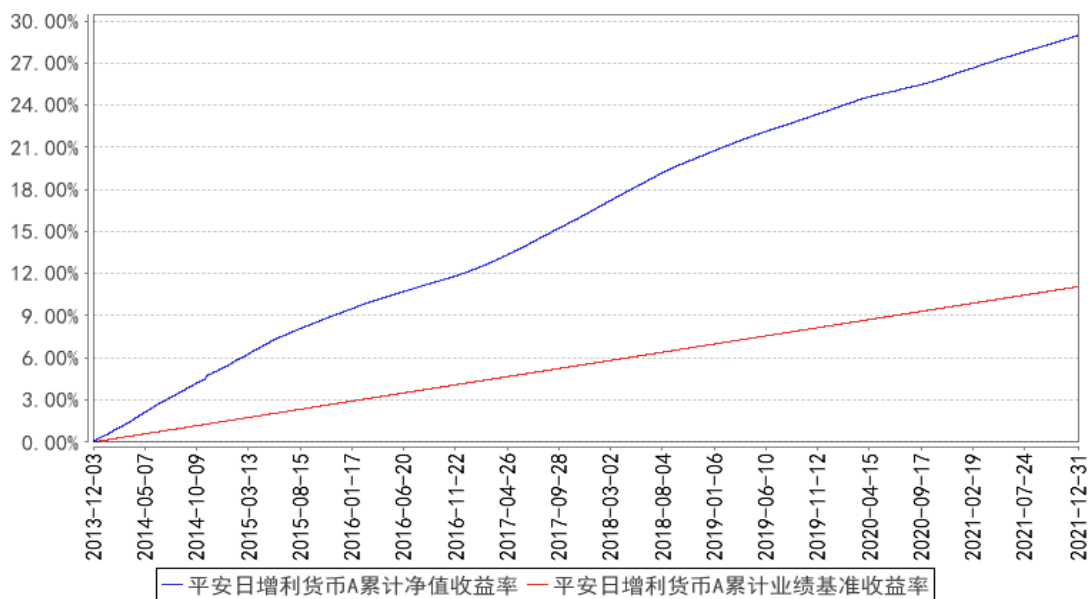


	值收益 率①	收益率标 准差②	准收益率③	收益率标准 差④		
过去三个月	0.5921%	0.0010%	0.3450%	0.0000%	0.2471%	0.0010%
过去六个月	1.1679%	0.0010%	0.6900%	0.0000%	0.4779%	0.0010%
过去一年	2.3840%	0.0010%	1.3688%	0.0000%	1.0152%	0.0010%
自基金合同生效起 至今	3.0965%	0.0012%	1.7513%	0.0000%	1.3452%	0.0012%

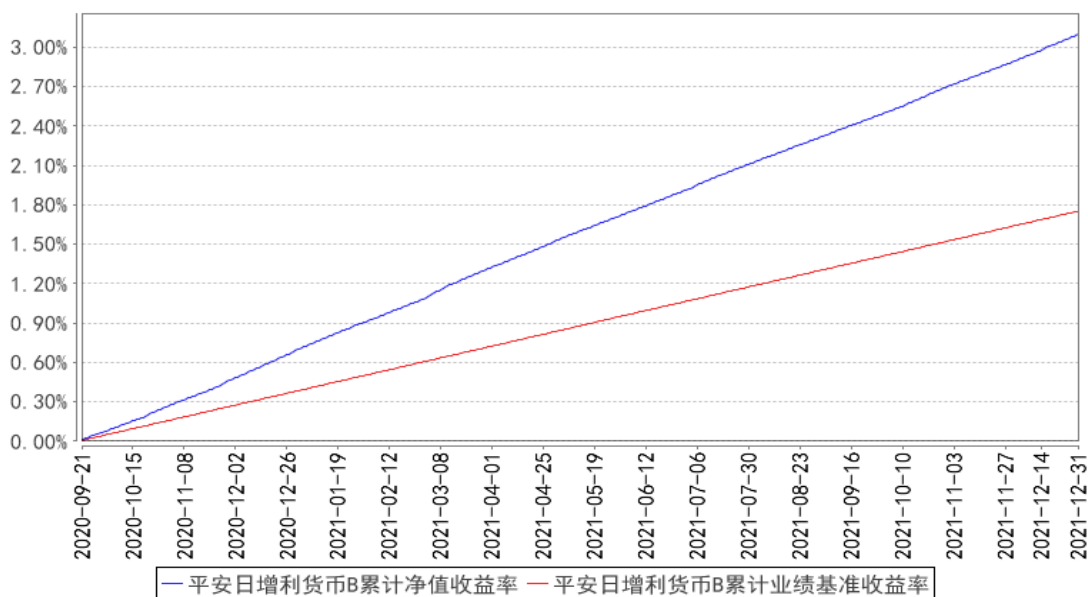
注：平安日增利 B 类份额“自基金合同生效日至今”指 2020 年 09 月 21 日至 2021 年 12 月 31 日

### 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



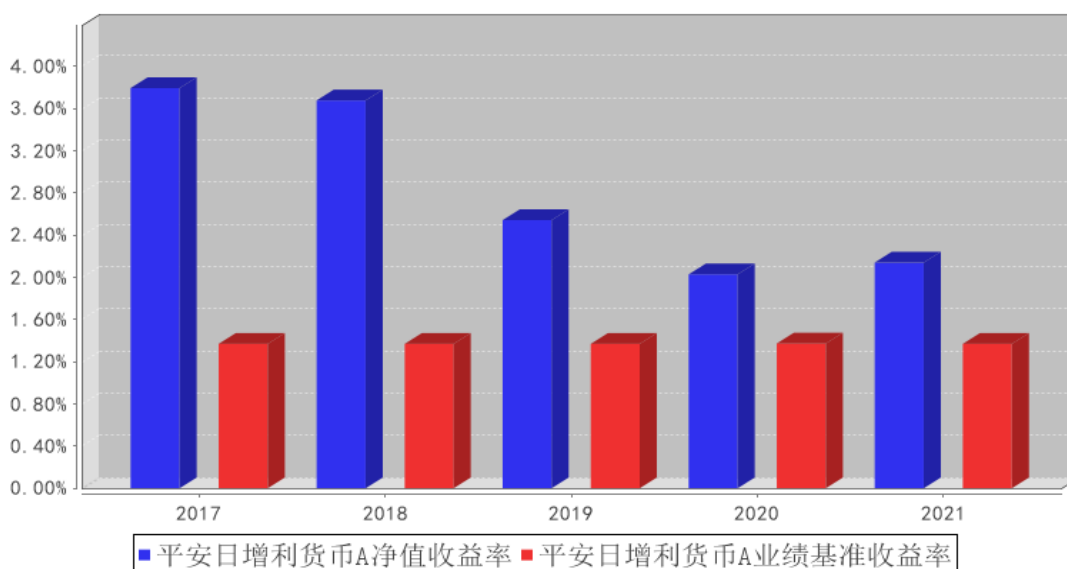
注：1、本基金基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效；

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；

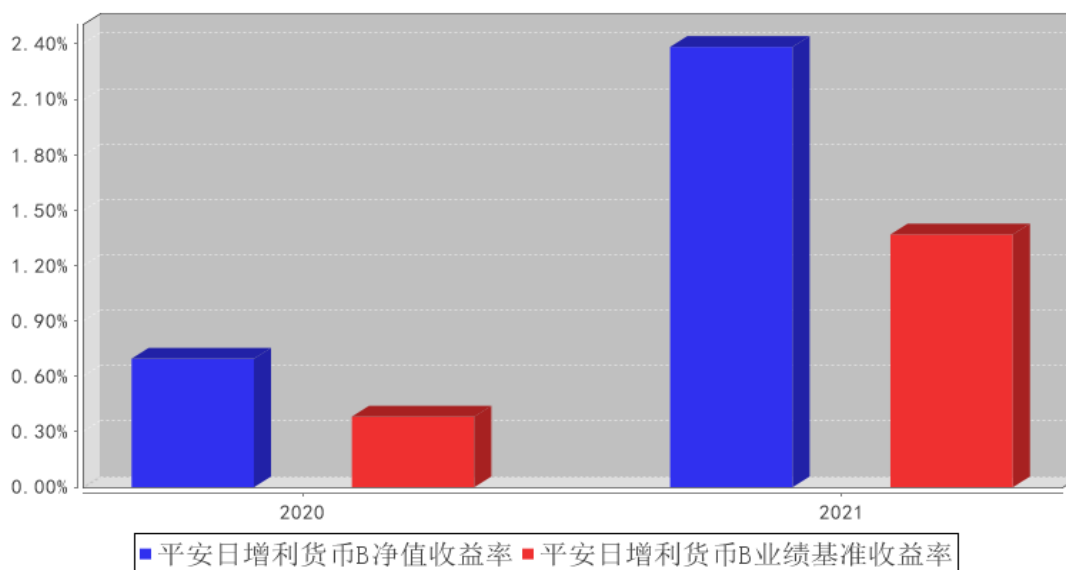
3、本基金于 2020 年 09 月 14 日增设 B 类份额，B 类份额从 2020 年 09 月 21 日开始有份额，所以以上 B 类份额走势图从 2020 年 09 月 21 日开始。

### 3.2.3 过去五年基金每年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基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



平安日增利货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

平安日增利货币 A

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2021 年	2,755,773,419.90	-	-95,994.52	2,755,677,425.38	-
2020 年	2,263,741,904.45	-	891,447.21	2,264,633,351.66	-
2019 年	3,309,488,304.56	-	-3,804,318.09	3,305,683,986.47	-
合计	8,329,003,628.91	-	-3,008,865.40	8,325,994,763.51	-

平安日增利货币 B

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2021 年	311,498,420.18	-	21,923.71	311,520,343.89	-
2020 年	41,392,042.87	-	374,122.06	41,766,164.93	-
合计	352,890,463.05	-	396,045.77	353,286,508.82	-

## § 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 2021 年 12 月 31 日，平安基金共管理 158 只公募基金，公募资产管理总规模约为 4,561.10 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助理	2021 年 2 月 23 日	-	8 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基金经理助理。
田元强	平安日增利货币市场基金基金经理	2019 年 3 月 21 日	-	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分析师、生命保险资产管理有限公司信用评级部分分析师、中国中投证券有限责任公司研究总部分析员。2016 年 11 月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心固定收益高级研究员。现担任平安交易型货币市场基金、平安 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安合信 3 个月定期

					开放债券型发起式证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合进 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠信 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公

司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

回顾 2021 年，宏观经济复苏进程边际放缓，但整体表现稳健。上半年“出口+地产”双轮驱动推动经济稳健复苏，基建与制造业投资表现平稳，消费受疫情影响有所波动但仍在持续修复。下半年经济增长动能有所趋弱，房地产行业下行承压，环保“双降”政策推升上游大宗价格，疫情反复扰动延缓消费复苏进度，海外经济复苏延续对出口持续形成支撑，经济相对上半年略显疲弱，但仍保持增长。通胀方面，海外疫情波动与国内“碳中和”催动大宗商品价格一路上行，推动 PPI 快速上行；猪肉价格成为国内通胀“压舱石”，CPI 维持低位。货币政策聚焦防风险和为经济复苏维持良好环境，市场流动性环境整体偏宽松。在此背景下，全年债市收益率震荡下行。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，灵活调整大类资产的配置比例，以维护产品收益。

#### 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 2.1387%，同期业绩比较基准收益率为 1.3688%；本报告期平安日增利货币 B 的基金份额净值收益率为 2.3840%，同期业绩比较基准收益率为 1.3688%。

#### 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 2022 年，政策重心逐渐转向稳增长，尽管短期内经济增长面临的困难逐渐增大，但随着稳健货币政策与积极财政政策落地，全年来看经济增速企稳无忧。通胀方面，国内通胀有望延续温和态势，基数效应以及猪油周期错位影响下 CPI 与 PPI 的分化趋于缓和，下半年 CPI 中枢存在抬升空间。货币政策方面，稳信用需要宽货币配合，国内宽松货币政策空间逐步打开，流动性环境有望维持整体充裕。基于以上基本面及政策面判断，我们预计债券市场可能出现前高后低的震荡行情，年初基本面与货币环境对债券市场相对友好，随着稳增长政策效果显现，市场可能存在调整空间。策略上我们将继续谨慎操作，结合市场变化动态灵活调整产品久期杠杆，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。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、资本市场风险监控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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中

央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 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 3,067,197,769.27 元，实际分配收益 3,067,197,769.27 元。

#### 4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 21158 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安日增利货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会



	<p>(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了平安日增利货币基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于平安日增利货币基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>平安日增利货币基金的基金管理人平安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估平安日增利货币基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算平安日增利货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安日增利货币基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对平安日增利货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致平安日增利货币基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	郭素宏	李崇
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 30 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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: 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	43,353,074,664.71	39,335,154,946.74
结算备付金		313,000,736.14	324,508,544.55
存出保证金		72,278.12	150,225.19
交易性金融资产	7.4.7.2	89,942,457,274.68	66,093,844,659.36
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		89,820,436,909.63	65,183,675,794.72
资产支持证券投资		122,020,365.05	910,168,864.64
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	22,563,897,347.84	19,526,534,149.80
应收证券清算款		-	111,488,987.29
应收利息	7.4.7.5	506,349,005.79	603,885,205.37
应收股利		-	-
应收申购款		119,240,534.86	8,396,885.32

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		156,798,091,842.14	126,003,963,603.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		11,490,462,794.30	7,823,760,704.57
应付证券清算款		-	110,027,135.35
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		42,020,879.92	34,242,556.16
应付托管费		10,186,880.00	8,301,225.72
应付销售服务费		29,368,380.79	24,338,255.46
应付交易费用	7.4.7.7	944,349.75	685,350.68
应交税费		2,259,995.68	2,031,335.71
应付利息		4,143,332.17	1,323,035.12
应付利润		8,582,608.62	8,656,679.43
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	309,000.00	279,000.00
负债合计		11,588,278,221.23	8,013,645,278.20
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	145,209,813,620.91	117,990,318,325.42
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		145,209,813,620.91	117,990,318,325.42
负债和所有者权益总计		156,798,091,842.14	126,003,963,603.62

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 145,209,813,620.91 份，其中下属 A 类基金份额 139,152,573,047.84 份，下属 B 类基金份额 6,057,240,573.07 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安日增利货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		4,077,031,998.82	3,144,502,576.93
1. 利息收入		3,944,734,140.05	3,069,709,925.23
其中：存款利息收入	7.4.7.11	920,777,239.62	703,374,425.56
债券利息收入		2,290,490,005.65	1,616,888,614.33
资产支持证券利息		24,769,155.47	102,033,752.13

收入			
买入返售金融资产收入		708,697,739.31	647,413,133.21
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		132,297,858.77	74,792,651.70
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	132,297,858.77	72,135,485.93
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	2,657,165.77
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		1,009,834,229.55	838,103,060.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	474,021,546.89	377,195,881.84
2. 托管费	7.4.10.2.2	114,914,314.42	91,441,425.91
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	327,033,222.80	281,838,725.44
4. 交易费用	7.4.7.19	59.83	722.52
5. 利息支出		90,529,261.54	85,220,014.86
其中：卖出回购金融资产支出		90,529,261.54	85,220,014.86
6. 税金及附加		3,003,124.07	2,099,089.77
7. 其他费用	7.4.7.20	332,700.00	307,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,067,197,769.27	2,306,399,516.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,067,197,769.27	2,306,399,516.59

### 7.3 所有者权益（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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	117,990,318,325.42	-	117,990,318,325.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,067,197,769.27	3,067,197,769.27
三、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)	27,219,495,295.49	-	27,219,495,295.49
其中: 1. 基金申购款	1,128,460,778,886.52	-	1,128,460,778,886.52
2. 基金赎回款	-1,101,241,283,591.03	-	-1,101,241,283,591.03
四、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)	-	-3,067,197,769.27	-3,067,197,769.27
五、期末所有者权益(基金净值)	145,209,813,620.91	-	145,209,813,620.91
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	108,306,221,675.33	-	108,306,221,675.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,306,399,516.59	2,306,399,516.59
三、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)	9,684,096,650.09	-	9,684,096,650.09
其中: 1. 基金申购款	663,118,622,940.08	-	663,118,622,940.08
2. 基金赎回款	-653,434,526,289.99	-	-653,434,526,289.99
四、本期向基金	-	-2,306,399,516.59	-2,306,399,516.59

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）			
五、期末所有者权益（基金净值）	117,990,318,325.42	-	117,990,318,325.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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或资产支持证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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合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，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基



金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

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。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；(3) “每日分配、按日支付”。本基金根据每日各类基金份额收益情况，以各类基金份额的每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算各

类基金份额当日收益并分配，每日结转。投资人当日各类基金份额收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；(4) 本基金根据各类基金份额每日收益情况，将当日各类基金份额收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；(5) 本基金每日进行各类基金份额收益计算并分配时，每日累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回相应类别的基金份额获得现金收益；若投资人在每日收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益；(7) 法律法规或监管机关另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 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，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证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、资产支持证券和私募债券除外)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、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数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。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 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 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	3,074,664.71	5,154,946.74
定期存款	43,350,000,000.00	39,330,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-	4,270,000,000.00
存款期限1-3个月	10,900,000,000.00	2,900,000,000.00
存款期限3个月以上	32,450,000,000.00	32,160,000,000.00
其他存款	-	-
合计	43,353,074,664.71	39,335,154,946.74

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	1,180,423,252.23	1,180,480,500.00	57,247.77	0.0000
	银行间市场	88,640,013,657.40	88,709,692,300.00	69,678,642.60	0.0480
	合计	89,820,436,909.63	89,890,172,800.00	69,735,890.37	0.0480
资产支持证券		122,020,365.05	122,333,200.00	312,834.95	0.0002
合计		89,942,457,274.68	90,012,506,000.00	70,048,725.32	0.0482
项目		上年度末 2020年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	1,550,636,479.43	1,545,365,650.00	-5,270,829.43	-0.0045
	银行间市场	63,633,039,315.29	63,710,393,200.00	77,353,884.71	0.0656
	合计	65,183,675,794.72	65,255,758,850.00	72,083,055.28	0.0611
资产支持证券		910,168,864.64	910,168,864.64	-	-
合计		66,093,844,659.36	66,165,927,714.64	72,083,055.28	0.0611

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,361,700,000.00	-
银行间市场	14,202,197,347.84	-
合计	22,563,897,347.84	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,520,000,000.00	-
银行间市场	5,006,534,149.80	-
合计	19,526,534,149.80	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	12,310.21	595,063.31
应收定期存款利息	156,717,082.93	167,568,681.74
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	140,850.30	146,028.80
应收债券利息	334,876,974.40	415,748,814.41
应收资产支持证券利息	2,264,256.88	11,845,921.04
应收买入返售证券利息	12,337,498.57	7,980,628.47
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	32.50	67.60
合计	506,349,005.79	603,885,205.37

### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	944,349.75	685,350.68
合计	944,349.75	685,350.68

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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	-	-
预提费用	309,000.00	279,000.00
合计	309,000.00	279,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安日增利货币 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	113,295,926,666.66	113,295,926,666.66
本期申购	1,011,432,270,130.83	1,011,432,270,130.83
本期赎回（以“-”号填列）	-985,575,623,749.65	-985,575,623,749.65
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	139,152,573,047.84	139,152,573,047.84

平安日增利货币 B

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,694,391,658.76	4,694,391,658.76
本期申购	117,028,508,755.69	117,028,508,755.69
本期赎回（以“-”号填列）	-115,665,659,841.38	-115,665,659,841.38
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	6,057,240,573.07	6,057,240,573.07

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

### 7.4.7.10 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
上年度末	-	-	-
本期利润	2,755,677,425.38	-	2,755,677,425.38
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	-2,755,677,425.38	-	-2,755,677,425.38
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
上年度末	-	-	-
本期利润	311,520,343.89	-	311,520,343.89
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	-311,520,343.89	-	-311,520,343.89
本期末	-	-	-

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	1,870,835.11	8,906,018.36
定期存款利息收入	912,699,523.42	688,553,209.23
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,202,198.11	5,897,454.59
其他	4,682.98	17,743.38
合计	920,777,239.62	703,374,425.56

### 7.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益。

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	132,297,858.77	72,135,485.93
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	132,297,858.77	72,135,485.93

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	258,483,822,463.73	199,908,673,127.11
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	256,322,363,234.84	198,714,190,325.94
减：应收利息总额	2,029,161,370.12	1,122,347,315.24
买卖债券差价收入	132,297,858.77	72,135,485.93

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	973,253,886.72	4,529,831,257.29
减：卖出资产支持证券成本总额	945,200,000.00	4,400,426,753.00
减：应收利息总额	28,053,886.72	126,747,338.52
资产支持证券投资收益	-	2,657,165.77

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。



**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无公允价值变动损益。

**7.4.7.18 其他收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他收入。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	59.83	722.52
合计	59.83	722.52

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	180,000.00	150,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	31,500.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	332,700.00	307,200.00

#### 7.4.7.21 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，无需作披露的分部报告。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
深圳安创投资管理有限公司（“安创”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安不动产有限公司（“平安不动产”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安创科投资管理有限公司（“平安创科”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
珠海横琴平安钱进小额贷款有限公司（“平安钱进小贷”）	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内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。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内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。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	474,021,546.89	377,195,881.84
其中：支付销售机构的客户维护费	104,548,024.55	41,246,673.81

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	114,914,314.42	91,441,425.91

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.08\% / \text{当年天数}$$

##### 7.4.10.2.3 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 2021年1月1日至2021年12月31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	8,547,487.39	-	8,547,487.39
平安基金	128,714,000.10	927,978.18	129,641,978.28
平安银行	53,024,901.91	152,190.39	53,177,092.30
平安证券	6,047.32	-	6,047.32
合计	190,292,436.72	1,080,168.57	191,372,605.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年12月31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
大华银行	3.66	-	3.66
陆基金	1,938,222.62	-	1,938,222.62
平安基金	221,920,624.85	144,143.94	222,064,768.79
平安银行	2,868,882.77	14,294.52	2,883,177.29
平安证券	4,773.26	-	4,773.26
合计	226,732,507.16	158,438.46	226,890,945.62

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31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	-
报告期内申购/买入总份额	170,228,290.07	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/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%	-
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 9 月 14 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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	19,453,704.86	-
报告期内申购/买入总份额	197,220,998.61	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	216,674,703.47	-
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。

#### 7.4.10.4.2 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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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（%）
平安不动产	-	-	41,263,232.64	0.0364

平安好贷	20,674,154.43	0.0149	20,240,957.09	0.0179
平安汇通	89,252,528.37	0.0641	-	-
平安集团	-	-	495,458.49	0.0004
平安钱进小贷	-	-	65,765,176.25	0.0580
平安人寿	595.74	0.0000	583.13	0.0000

份额单位：份

## 平安日增利货币 B

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020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(%)
安创	-	-	571,508.86	0.0122
平安创科	-	-	1,236,539.04	0.0263
平安证券	504,199,852.74	8.3239	-	-

## 7.4.10.5 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	-	855,555.56	-	8,693,889.04
平安银行-活期	3,074,664.71	1,870,835.11	5,154,946.74	8,906,018.36

注：本基金银行存款由基金托管人平安银行保管，活期存款按银行同业存款利率计息，定期存款按协议利率计息。

## 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2021 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人民币 32,980,289.31 元(2020 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人民币 31,550,904.76 元)。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 27,000,000 张托管人平安银行的同业存单，账面价值为人民币 2,665,573,551.97 元，占基金资产净值的比例为 1.84%(2020 年 12 月 31 日：本基金持有 1,000,000 张托管人平安银行的同业存单，账面价值为人民币 98,333,776.48 元，占基金资产净值的比例为 0.08%)。

## 7.4.11 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
2,755,773,419.90	-	-95,994.52	2,755,677,425.38	-
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
311,498,420.18	-	21,923.71	311,520,343.89	-

#### 7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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 11,490,462,794.30 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
012105241	21 电网 SCP027	2022 年 1 月 10 日	99.91	2,660,000	265,753,345.04
012105246	21 电网 SCP028	2022 年 1 月 10 日	99.92	2,659,000	265,691,317.02
112113115	21 浙商银 行 CD115	2022 年 1 月 10 日	99.48	1,239,000	123,252,848.13
112113182	21 浙商银 行 CD182	2022 年 1 月 10 日	99.41	1,301,000	129,332,754.72
112113209	21 浙商银 行 CD209	2022 年 1 月 10 日	99.18	2,000,000	198,359,793.56
112113212	21 浙商银 行 CD212	2022 年 1 月 10 日	99.17	3,000,000	297,518,192.54
112115311	21 民生银 行 CD311	2022 年 1 月 10 日	99.14	4,301,000	426,410,164.21
112115313	21 民生银 行 CD313	2022 年 1 月 10 日	99.14	4,301,000	426,410,164.26
112109090	21 浦发银 行 CD090	2022 年 1 月 4 日	99.57	2,174,000	216,464,955.77
112110105	21 兴业银	2022 年 1 月 4	99.57	1,305,000	129,938,734.58

	行 CD105	日			
112111275	21 平安银行 CD275	2022 年 1 月 4 日	99.38	7,745,000	769,675,714.14
112116211	21 上海银行 CD211	2022 年 1 月 4 日	99.02	1,137,000	112,590,238.14
112117049	21 光大银行 CD049	2022 年 1 月 4 日	99.56	1,304,000	129,820,574.78
112118045	21 华夏银行 CD045	2022 年 1 月 4 日	99.51	2,174,000	216,340,912.17
112172288	21 重庆农村商行 CD267	2022 年 1 月 4 日	99.13	6,452,000	639,616,178.93
112182729	21 重庆农村商行 CD147	2022 年 1 月 4 日	99.45	4,347,000	432,289,545.96
190207	19 国开 07	2022 年 1 月 4 日	100.28	10,102,000	1,012,998,662.35
210301	21 进出 01	2022 年 1 月 4 日	100.03	5,051,000	505,229,787.81
210404	21 农发 04	2022 年 1 月 4 日	99.95	3,572,000	357,013,264.56
219960	21 贴现国债 60	2022 年 1 月 4 日	99.59	3,646,000	363,105,072.57
219962	21 贴现国债 62	2022 年 1 月 4 日	99.49	5,102,000	507,612,522.30
210401	21 农发 01	2022 年 1 月 5 日	100.04	5,051,000	505,297,396.96
012105241	21 电网 SCP027	2022 年 1 月 6 日	99.91	4,640,000	463,569,744.73
112111123	21 平安银行 CD123	2022 年 1 月 6 日	100.00	4,167,000	416,700,000.00
120206	12 国开 06	2022 年 1 月 6 日	99.99	520,000	51,994,362.52
120213	12 国开 13	2022 年 1 月 6 日	100.40	900,000	90,358,611.79
150209	15 国开 09	2022 年 1 月 6 日	100.48	1,000,000	100,484,946.18
190207	19 国开 07	2022 年 1 月 6 日	100.28	698,000	69,993,374.22
190303	19 进出 03	2022 年 1 月 6 日	100.07	2,097,000	209,850,265.12
210001	21 付息国债 01	2022 年 1 月 6 日	100.01	1,000,000	100,011,989.55
210201	21 国开 01	2022 年 1 月 6 日	100.01	5,000,000	500,041,380.86



		日			
210206	21 国开 06	2022 年 1 月 6 日	100.01	5,000,000	500,061,082.92
210211	21 国开 11	2022 年 1 月 6 日	99.93	3,300,000	329,764,127.67
210301	21 进出 01	2022 年 1 月 6 日	100.03	749,000	74,919,245.91
210304	21 进出 04	2022 年 1 月 6 日	99.99	3,200,000	319,954,895.44
2103688	21 进出 688	2022 年 1 月 6 日	99.88	1,833,000	183,077,320.99
219942	21 贴现国 债 42	2022 年 1 月 6 日	99.60	453,000	45,117,524.69
219951	21 贴现国 债 51	2022 年 1 月 6 日	99.86	1,300,000	129,818,880.29
219954	21 贴现国 债 54	2022 年 1 月 6 日	99.77	834,000	83,208,964.03
219958	21 贴现国 债 58	2022 年 1 月 6 日	99.64	1,500,000	149,462,155.42
219961	21 贴现国 债 61	2022 年 1 月 6 日	99.54	1,500,000	149,317,367.50
合计				120,314,000	11,998,428,380.33

#### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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行合约责任，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 56.71%（上年末：50.49%）。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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 3.35%，本基金投资组合的平均剩余期限为 90 天，平均剩余存续期为 90 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发行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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
上年度末	6 个月以内	6 个月	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日		-1 年				
资产						
银行存款	39,335,154,946.74	-	-	-	-	39,335,154,946.74
结算备付金	324,508,544.55	-	-	-	-	324,508,544.55
存出保证金	150,225.19	-	-	-	-	150,225.19
交易性金融资产	55,553,250,413.14	10,540,594,246.22	-	-	-	66,093,844,659.36
买入返售金融资产	19,526,534,149.80	-	-	-	-	19,526,534,149.80
应收利息	-	-	-	-	603,885,205.37	603,885,205.37
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	8,396,885.32	8,396,885.32
应收证券清算款	-	-	-	-	111,488,987.29	111,488,987.29
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	114,739,598,279.42	10,540,594,246.22	-	-	723,771,077.98	126,003,963,603.62
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	34,242,556.16	34,242,556.16
应付托管费	-	-	-	-	8,301,225.72	8,301,225.72
应付证券清算款	-	-	-	-	110,027,135.35	110,027,135.35
卖出回购金融资产款	7,823,760,704.57	-	-	-	-	7,823,760,704.57
应付销售服务费	-	-	-	-	24,338,255.46	24,338,255.46
应付交易费用	-	-	-	-	685,350.68	685,350.68
应付利息	-	-	-	-	1,323,035.12	1,323,035.12
应付利润	-	-	-	-	8,656,679.43	8,656,679.43
应交税费	-	-	-	-	2,031,335.71	2,031,335.71
其他负债	-	-	-	-	279,000.00	279,000.00
负债总计	7,823,760,704.57	-	-	-	189,884,573.63	8,013,645,278.20
利率敏感度缺口	106,915,837,574.85	10,540,594,246.22	-	-	533,886,504.35	117,990,318,325.42

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	41,692,734.48	29,980,990.98
	市场利率上升 25 个基点	-41,610,623.24	-29,913,059.84

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 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）。

##### 7.4.13.4.3.2 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（上年末：同）。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日, 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中属于第二层次的余额为 89,942,457,274.68 元, 无属于第一或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日: 第二层次 65,183,675,794.72 元, 第三层次 910,168,864.64 元, 无第一层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下:

交易性金融资产

——资产支持证券投资

2021 年 1 月 1 日 910,168,864.64

购买 -

兑付 -910,168,864.64

出售 -

转入第三层级 -

转出第三层级 -

当期利得或损失总额 -

计入损益的利得或损失 -

2021 年 12 月 31 日 -

2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 -

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

交易性金融资产

——资产支持证券投资

2020 年 1 月 1 日 3,631,448,397.77

购买 1,685,966,720.78

兑付 -4,115,100,000.00

出售	-290,397,883.93
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-1,748,369.98
计入损益的利得或损失	-1,748,369.98
2020 年 12 月 31 日	910,168,864.64
2020 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2020 年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-

第三层次资产为在交易所挂牌转让的资产支持证券。根据中国证券投资基金业协会发布的《关于发布〈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〉的通知》，本基金管理人认为上述资产支持证券的成本能够近似体现公允价值，因此上述资产支持证券公允价值根据成本确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 根据财政部发布的《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》和《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”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	89,942,457,274.68	57.36
	其中：债券	89,820,436,909.63	57.28
	资产支持证 券	122,020,365.05	0.08
2	买入返售金融资产	22,563,897,347.84	14.39
	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	43,666,075,400.85	27.85
4	其他各项资产	625,661,818.77	0.40
5	合计	156,798,091,842.14	100.00

### 8.2 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	2.26	
	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	11,490,462,794.30	7.91
	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%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 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	91
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：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

#### 8.3.2 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	22.38	7.91
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	10.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	36.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	12.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	25.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	107.55	7.91

#### 8.4 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。

#### 8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,162,479,419.44	1.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,846,973,594.50	4.03
	其中：政策性 金融债	5,434,292,692.34	3.74
4	企业债券	1,186,482,525.18	0.82
5	企业短期融 资券	20,330,842,715.58	14.00
6	中期票据	2,424,378,923.31	1.67
7	同业存单	57,869,279,731.62	39.85
8	其他	-	-
9	合计	89,820,436,909.63	61.86
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

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	190207	19 国开 07	10,800,000	1,082,992,036.57	0.75
2	012105241	21 电网 SCP027	10,000,000	999,072,725.71	0.69
3	112111275	21 平安银行 CD275	10,000,000	993,771,096.37	0.68
4	112172238	21 北京农商银 行 CD226	10,000,000	991,388,503.54	0.68
5	112172288	21 重庆农村商 行 CD267	10,000,000	991,345,596.60	0.68
6	112172512	21 北京农商银 行 CD230	10,000,000	991,271,951.08	0.68
7	112172443	21 重庆农村商 行 CD270	10,000,000	991,240,681.62	0.68
8	112120269	21 广发银行 CD269	10,000,000	990,811,593.16	0.68
9	112116211	21 上海银行 CD211	10,000,000	990,239,561.45	0.68
10	112114146	21 江苏银行 CD146	10,000,000	990,200,953.48	0.68

### 8.7 “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%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0546%

### 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%。

### 8.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	189545	21 天圆 01	840,000	84,020,365.05	0.06
2	137597	天著优 11	380,000	38,000,000.00	0.03

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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 1.0000 元。

### 8.9.2 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

### 8.9.3 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	72,278.12
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	506,349,005.79
4	应收申购款	119,240,534.86
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	625,661,818.77

### 8.9.4 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	52,295,134	2,660.91	1,281,409,785.53	0.92	137,871,163,262.31	99.08

货币 A						
平安日增利货币 B	68	89,077,067.25	6,057,240,573.07	100.00	-	-
合计	52,295,197	2,776.73	7,338,650,358.60	5.05	137,871,163,262.31	94.95

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）。

## 9.2 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	其他机构	1,006,036,273.04	0.69
2	银行类机构	1,003,738,124.86	0.69
3	银行类机构	1,003,310,355.74	0.69
4	券商类机构	504,199,852.74	0.35
5	银行类机构	337,536,593.94	0.23
6	银行类机构	208,279,182.97	0.14
7	银行类机构	201,914,276.12	0.14
8	银行类机构	201,811,850.88	0.14
9	银行类机构	201,451,773.67	0.14
10	银行类机构	199,434,828.06	0.14

## 9.3 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	869,193.64	0.0006
	平安日增利货币 B	-	-
	合计	869,193.64	0.0006

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）。

## 9.4 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、基金投资和研发部门	平安日增利货币 A	10~50
	平安日增利货币 B	0

负责人持有本开放式基金		
	合计	10~50
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

**9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产**

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产
-	公募基金	0
	私募资产管理计划	0
	合计	0

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

**§ 10 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	113,295,926,666.66	4,694,391,658.76
本报告期基金总申购 份额	1,011,432,270,130.83	117,028,508,755.69
减：本报告期基金总 赎回份额	985,575,623,749.65	115,665,659,841.38
本报告期基金拆分变 动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份 额总额	139,152,573,047.84	6,057,240,573.07

**§ 11 重大事件揭示**

**11.1 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。

## 11.2 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

1. 2021 年 3 月 2 日，王金涛担任平安基金管理有限公司总经理助理。
2. 公司监事巢傲文先生因工作调动，经公司 2021 年 12 月 17 日召开的 2021 年第四次股东会审议，不再出任公司第四届监事会监事，并由许黎女士接替巢傲文先生任职公司的监事。
3. 2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 8 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 180,000.00 元。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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。

### 11.7.2 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	5,557,419,385.00	100.00%	899,645,926,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 11.9 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	平安基金管理有限公司 2020 年 12 月 31 日基金净值公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 01 日
2	平安基金管理有限公司关于暂停部分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	2021 年 01 月 22 日
3	平安日增利货币市场基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
4	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 27 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	2021 年 02 月 05 日
6	平安基金管理有限公司关于暂停部分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	2021 年 03 月 05 日
7	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 12 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 16 日
9	平安日增利货币市场基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 31 日
10	平安基金管理有限公司关于新增中国中金财富证券有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 06 日
11	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 09 日



12	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 12 日
13	平安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、定期定额投资起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 15 日
14	平安日增利货币市场基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 22 日
15	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	2021 年 04 月 23 日
16	平安基金管理有限公司关于终止与深圳市小牛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	2021 年 04 月 27 日
17	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增阳光人寿保险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	2021 年 05 月 18 日
18	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	2021 年 05 月 31 日
19	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	2021 年 05 月 31 日
20	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 02 日
21	关于终止苏州财路基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 03 日
22	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 07 日
23	平安基金管理有限公司关于暂停北京加和基金销售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	2021 年 06 月 21 日
24	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日
25	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日
26	平安基金管理有限公司关于暂停深圳市新兰德证券投资咨询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	2021 年 07 月 01 日
27	平安日增利货币市场基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 07 月 21 日

28	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 07 月 23 日
29	平安基金管理有限公司关于新增西部证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 09 日
30	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增众惠基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 23 日
31	平安基金管理有限公司关于新增江海证券有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 24 日
32	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 25 日
33	平安日增利货币市场基金 2021 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 31 日
34	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京懒猫基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 09 月 08 日
35	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大河财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 09 月 09 日
36	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富（北京）基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 09 月 14 日
37	平安日增利货币市场基金中秋节假期前暂停申购、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	2021 年 09 月 14 日
38	平安日增利货币市场基金国庆节假期前暂停申购、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	2021 年 09 月 27 日
39	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信百信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	2021 年 09 月 28 日
40	平安日增利货币市场基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 10 月 27 日
41	平安基金管理有限公司关于新增上海联泰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	2021 年 11 月 05 日
42	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海攀赢基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 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 3 月 31 日