

# 平安交易型货币市场基金 2022 年年度报告

2022 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：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 29 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 28 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 2022 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.....	6
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 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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..	18
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.....	19
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>60</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	60

8.2 债券回购融资情况.....	60
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	60
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.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
8.6 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.....	62
8.7 “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.....	62
8.8 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.....	62
8.9 投资组合报告附注.....	63
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	66
9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	66
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
9.5 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.....	67
9.6 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.....	67
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>67</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
11.4 基金投资策略的改变.....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
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.....	错误!未定义书签。
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	69
11.9 其他重大事件.....	69
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>72</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.....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>72</b>
13.1 备查文件目录.....	72
13.2 存放地点.....	72
13.3 查阅方式.....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安交易型货币市场基金		
基金简称	平安货币 ETF		
场内简称	场内货币 ETF		
基金主代码	511700		
基金运作方式	契约型、交易型开放式		
基金合同生效日	2016 年 9 月 23 日		
基金管理人	平安基金管理有限公司		
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	73,970,783,769.02 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2016 年 10 月 17 日		
下属分级基金的基金简称	平安日鑫 A	平安日鑫 C	场内货币
下属分级基金的交易代码	003034	015021	511700
报告期末下属分级基金的份额总额	72,160,913,162.42 份	1,807,134,587.88 份	2,736,018.72 份

注：本基金 A 类（平安日鑫 A）、C 类（平安日鑫 C）份额净值为 1.00 元，E 类（场内货币）份额净值为 100.00 元

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

风险收益特征	本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
--------	--

### 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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	帅芳
	联系电话	0755-22626828	021-38031815
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	shuaifang@gtjas.com
客户服务电话		400-800-4800	021-38917599-5
传真		0755-23997878	021-38677819
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	中国（上海）自由贸易试验区商城路618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	上海市静安区新闸路669号博华广场19楼
邮政编码		518048	200041
法定代表人		罗春风	贺青

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 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	2022年		2022年	2021年		2020年			
	2022年2月8日(基金合同生效日)–2022年12月31日								
	平安日鑫 A	平安日鑫 C	场内货币	平安日鑫 A	平安日鑫 C	场内货币	平安日鑫 A	平安日鑫 C	场内货币

					日 鑫 C		日 鑫 C
本期已实现收益	1,466,124,263.86	30,043,641.77	15,632,849.98	628,412,276.05	5,745,369.45	558,765,575.79	7,826,039.18
本期利润	1,466,124,263.86	30,043,641.77	15,632,849.98	628,412,276.05	5,745,369.45	558,765,575.79	7,826,039.18
本期净值收益率	2.1550%	1.6659%	2.1549%	2.5554%	2.5554%	2.3929%	2.3928%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末			2021 年末		2020 年末	
期末基金资产净值	72,160,913,162.42	1,807,134,587.88	273,601,871.90	28,213,758,762.98	211,419,003.40	23,814,541,597.51	176,188,376.57
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	100.0000	1.0000	100.0000	1.0000	100.0000
3.1.3 累计期末指标	2022 年末			2021 年末		2020 年末	
累计净值收益率	20.1151%	1.6659%	20.1147%	17.5811%	17.5810%	14.6513%	14.6512%

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. 本基金于 2022 年 02 月 08 日增设 C 类份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安日鑫 A

阶段	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	0.4970%	0.0009%	0.3450%	0.0000%	0.1520%	0.0009%
过去六个月	0.9825%	0.0008%	0.6900%	0.0000%	0.2925%	0.0008%
过去一年	2.1550%	0.0012%	1.3688%	0.0000%	0.7862%	0.0012%
过去三年	7.2725%	0.0017%	4.1100%	0.0000%	3.1625%	0.0017%
过去五年	14.5951%	0.0025%	6.8475%	0.0000%	7.7476%	0.0025%
自基金合同生效起至今	20.1151%	0.0027%	8.5913%	0.0000%	11.5238%	0.0027%

平安日鑫 C

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	0.4578%	0.0009%	0.3450%	0.0000%	0.1128%	0.0009%
过去六个月	0.8822%	0.0008%	0.6900%	0.0000%	0.1922%	0.0008%
自基金合同生效起至今	1.6659%	0.0008%	1.2188%	0.0000%	0.4471%	0.0008%

场内货币

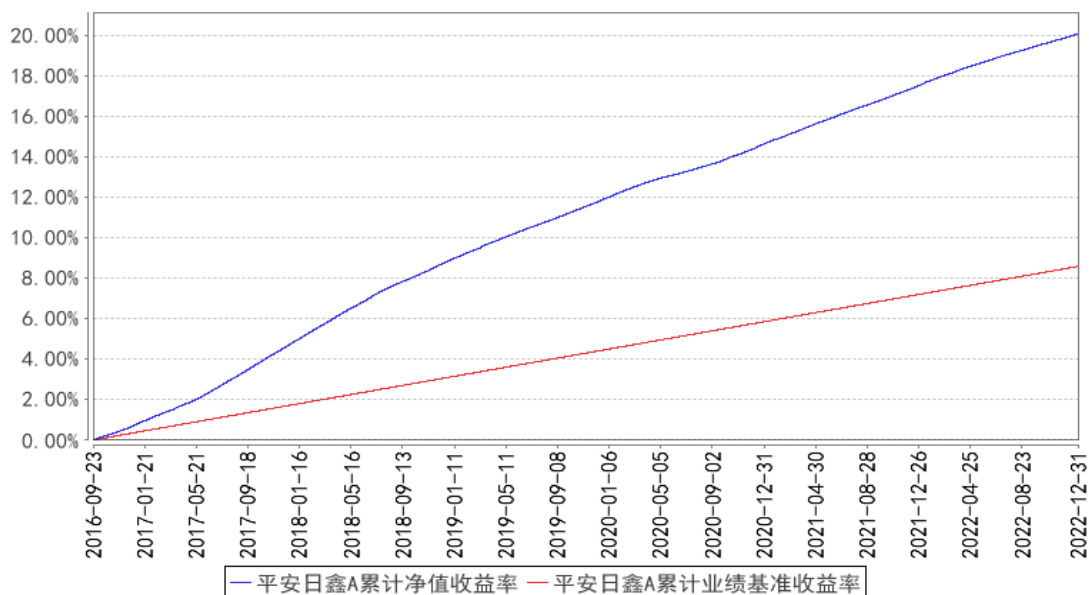


阶段	份额净值收益 率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.4969%	0.0009%	0.3450%	0.0000%	0.1519 %	0.0009 %
过去六个月	0.9824%	0.0008%	0.6900%	0.0000%	0.2924 %	0.0008 %
过去一年	2.1549%	0.0012%	1.3688%	0.0000%	0.7861 %	0.0012 %
过去三年	7.2722%	0.0017%	4.1100%	0.0000%	3.1622 %	0.0017 %
过去五年	14.5949 %	0.0025%	6.8475%	0.0000%	7.7474 %	0.0025 %
自基金合同生效 起至今	20.1147 %	0.0027%	8.5913%	0.0000%	11.523 4%	0.0027 %

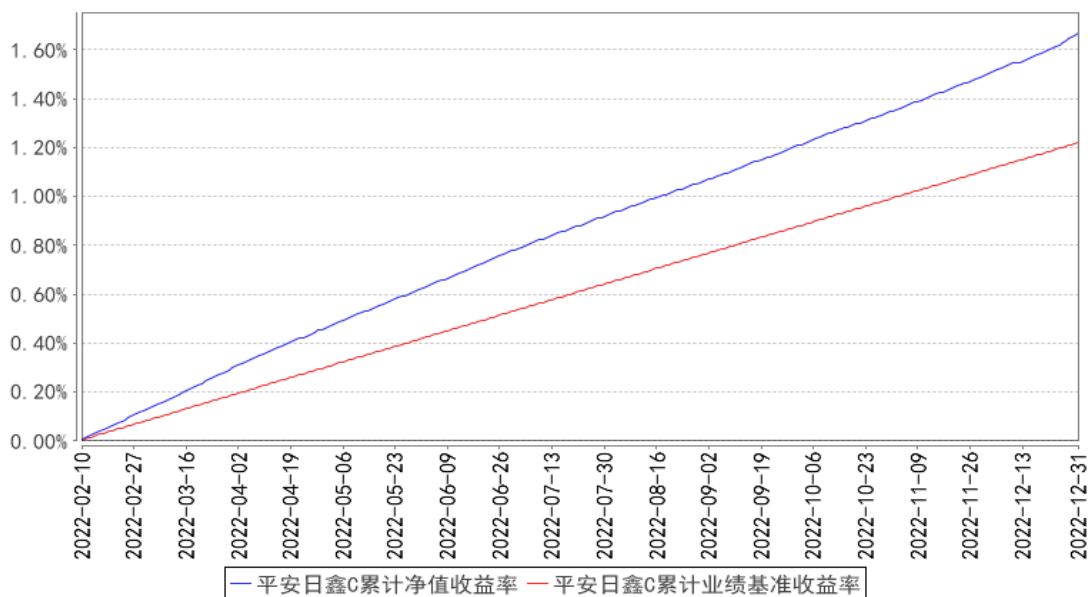
注：上述 C 类份额“自基金合同生效起至今”为 2022 年 02 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日。

### 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

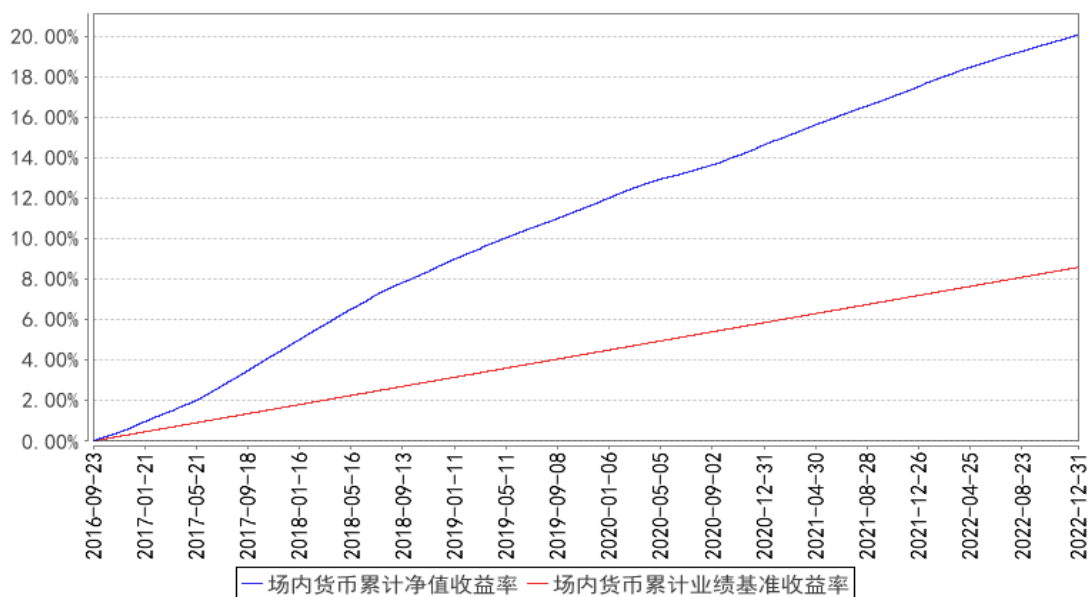
平安日鑫A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安日鑫C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



场内货币累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

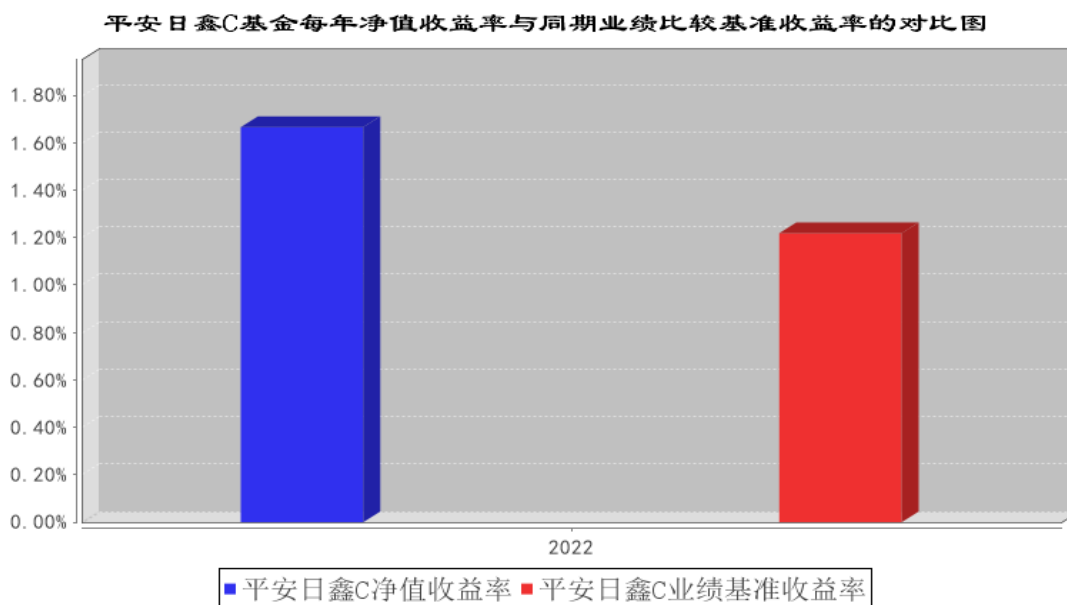
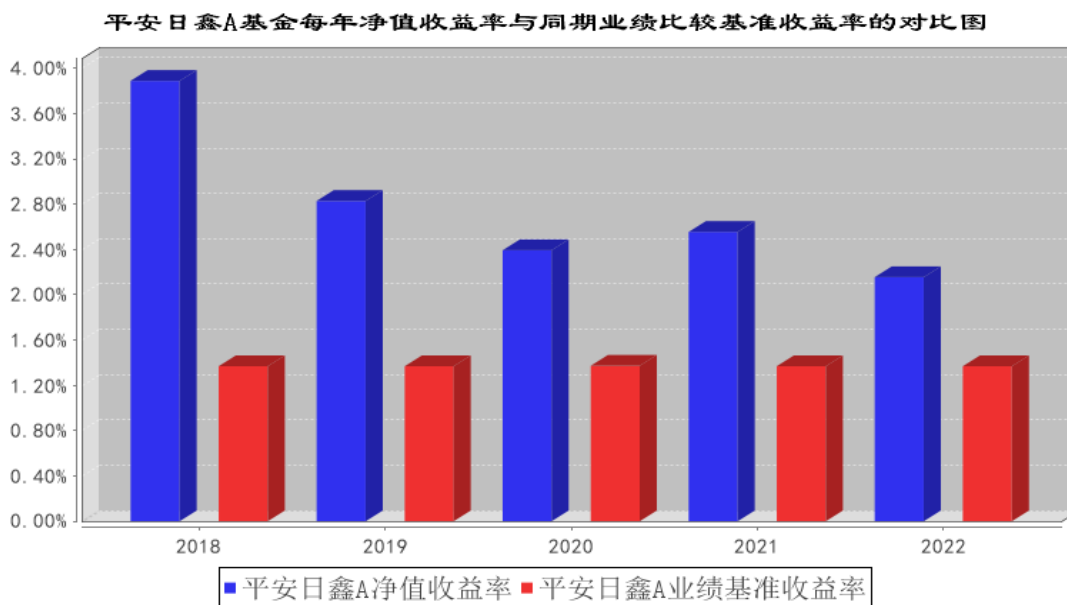


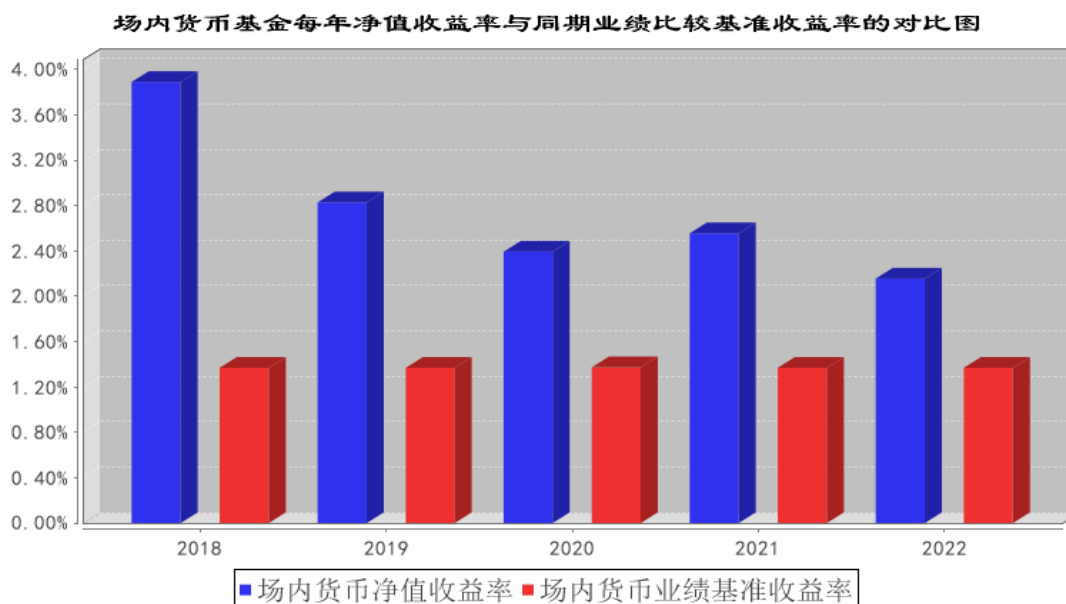
注：1、本基金基金合同于 2016 年 9 月 23 日正式生效；

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定；

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





注：本基金合同于 2016 年 9 月 23 日正式生效。

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

#### 平安日鑫 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
2022 年	1,462,070,384.59	-	4,053,879.27	1,466,124,263.86	-
2021 年	628,684,525.92	-	-272,249.87	628,412,276.05	-
2020 年	558,559,990.83	-	205,584.96	558,765,575.79	-
合计	2,649,314,901.34	-	3,987,214.36	2,653,302,115.70	-

#### 平安日鑫 C

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
2022 年	29,914,672.47	-	128,969.30	30,043,641.77	-
合计	29,914,672.47	-	128,969.30	30,043,641.77	-

#### 场内货币

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
2022 年	15,623,291.79	-	9,558.19	15,632,849.98	-

2021 年	5,747,234.77	-	-1,865.32	5,745,369.45	-
2020 年	7,964,093.15	-	-138,053.97	7,826,039.18	-
合计	29,334,619.71	-	-130,361.10	29,204,258.61	-

## § 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 12 月 31 日，平安基金共管理 181 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5080.52 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	平安交易型货币市场基金基金经理	2022 年 5 月 24 日	-	10 年	罗薇女士，新南威尔士大学金融会计学专业硕士，曾任红塔红土基金管理有限公司固定收益交易员、基金经理助理、基金经理。2020 年 11 月加入平安基金管理有限公司，现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、平安惠鸿纯债债券型证券投资基金、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠隆纯债债券型证券投资基金、平安惠兴纯

					债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、平安财富宝货币市场基金、平安惠信 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
李可颖	固定收益投资中心投资总监助理兼现金投资部负责人，平安交易型货币市场基金基金经理	2022 年 8 月 5 日	-	12 年	李可颖女士，南开大学法学专业硕士，曾任渤海证券股份有限公司高级交易经理、长盛基金管理有限公司高级债券交易员、博时基金管理有限公司高级交易员、鹏华基金管理有限公司基金经理、现金管理部副总监。2021 年 9 月加入平安基金管理有限公司，现任固定收益投资中心投资总监助理兼现金投资部负责人，同时担任平安日增利货币市场基金、平安交易型货币市场基金、平安中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。
田元强	平安交易型货币市场基金基金经理	2018 年 11 月 26 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析师、生命保险资产管理有限公司信用评估部分析师、中国中投证券有限责任公司研究总部分析员。2016 年 11 月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心固定收益高级研究员。现担任平安合信 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、平安元和 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金经理。
罗薇	平安交易型货币市场基金基金经理助理	2021 年 2 月 23 日	2022 年 5 月 24 日	10 年	罗薇女士，新南威尔士大学金融会计学专业硕士，曾任红塔红土基金管理有限公司固定收益交易员、基金经理助理、基金经理。2020 年 11 月加入平安基金管理有限公司，现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、平安惠鸿纯债债券型证券投资基金、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠隆纯债债券型证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、平安财富宝货币市场基金、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《证券投资基金管理人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 2022 年，宏观经济受到到内外双重因素拖累，国内疫情反复和地产行业下滑对需求形成抑制，海外通胀高企和俄乌冲突对能源供应带来冲击，全年经济呈现触底反弹形态。具体来看，上半年宏观经济承受来自地产和疫情的双重拖累，稳增长政策的持续发力对经济下滑形成对冲，央行以积极实施降准等措施为宽信用提供流动性支持，下半年汽车消费政策和设备更新需求助力工业生产维持较好景气度，至四季度重大项目加速落地形成实物工作量，防疫政策调整大幅降低疫情对消费影响，宏观经济稳步复苏。在此背景下，货币市场收益率全年呈现 V 型走势，上半年央行通过降准等措施维护宽松流动性环境，疫情冲击和稳增长发力交替成为货币市场主导因素，货币市场收益率整体呈震荡下行。下半年“保交楼”工作避免了断供问题进一步向金融系统的扩散，但地产行业的修复延缓，财政投放下银行间流动性充裕，三季度宽松的流动性环境推动货币市场经历了一波单边下行，随后财政投放行至尾声、缴税、缴准等因素均对资金面形成扰动，货币市场经历了 N 型震荡行情；至四季度，宏观经济展现平稳触底迹象，对宏观经济政策加码和对



央行货币政策转向的双重担忧引发货币市场收益率调整，理财赎回形成负反馈效应加剧调整力度，至年末，央行加大跨年投放力度，资金面充裕带动货币市场收益率有所企稳。

报告期内，本基金的投资操作以流动性管理为基础原则，严格管控信用风险，选择具备良好信用资质的投资标的；依据对于收益率曲线形态预判并结合市场变化动态灵活调整组合剩余期限、杠杆水平，调整大类资产的配置比例，以维护产品收益。我们将继续稳健操作，力争在保障安全性、流动性的情况下，为客户创造良好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期平安日鑫 A 的基金份额净值收益率为 2.1550%，同期业绩比较基准收益率为 1.3688%；本报告期平安日鑫 C 的基金份额净值收益率为 1.6659%，同期业绩比较基准收益率为 1.2188%；本报告期场内货币的基金份额净值收益率为 2.1549%，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 2023 年，随着疫情影响趋弱，国内生产消费有望得到修复；从稳增长结构来看，基建项目支出对经济形成托底，而政策性开发工具带动企业投资则夯实经济复苏基础，地产和消费修复则进一步形成助推；未来政策成效验证仍需假以时日，但经济触底企稳已成趋势，后续仍需观察经济修复斜率。流动性方面，宽信用仍然需要相应货币政策配合，央行仍有动力维护充裕的流动性环境，但考虑到资金脱虚向实过程可能降低银行间市场整体水位，资金面波动概率和幅度有望加大。基于以上基本面及政策面判断，我们预计 2023 年随着宏观指标改善，货币市场震荡幅度加大，我们将密切关注各项经济领先指标，积极根据市场变化灵活调整投资策略。我们将继续谨慎操作，严格管控信用风险，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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金合同的约定，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 1,511,800,755.61 元，实际分配收益 1,511,800,755.61 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

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安交易型货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

## §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	安永华明(2023)审字第 60937497_H13 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	平安交易型货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了平安交易型货币市场基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的平安交易型货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了平安交易型货币市场基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安交易型货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	平安交易型货币市场基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估平安交易型货币市场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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督平安交易型货币市场基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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>（1）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。</p> <p>（2）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>（3）评价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>（4）对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，就可能导致对平安交易型货币市场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交易型货币市场基金不能持续经营。</p> <p>（5）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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>高 鹤   黄伟煌</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12</p>

	室
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安交易型货币市场基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	16,798,294,550.18	7,500,197,014.59
结算备付金		229,453,218.19	64,545,688.71
存出保证金		10,053.03	83,389.17
交易性金融资产	7.4.7.2	35,311,897,604.31	22,214,906,027.17
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		35,311,897,604.31	22,178,906,027.17
资产支持证券投资		-	36,000,000.00
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	28,989,708,479.85	3,186,009,436.06
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		135,502,416.60	563,222,180.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	145,977,121.26
资产总计		81,464,866,322.16	33,674,940,857.48
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 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		7,201,711,335.24	5,240,095,609.84

应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,902,812.59	3,499,975.68
应付托管费		3,300,937.53	1,166,658.54
应付销售服务费		964,649.91	233,331.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		410,722.94	964,240.06
应付利润		5,774,631.18	1,582,224.42
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,151,610.57	2,221,050.85
负债合计		7,223,216,699.96	5,249,763,091.10
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	74,241,649,622.20	28,425,177,766.38
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		74,241,649,622.20	28,425,177,766.38
负债和净资产总计		81,464,866,322.16	33,674,940,857.48

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 73,970,783,769.02 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 72,160,913,162.42 份；C 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,807,134,587.88 份；E 类基金份额净值 100.0000 元，基金份额总额 2,736,018.72 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安交易型货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		1,776,251,449.28	729,605,832.30
1. 利息收入		996,407,575.18	719,243,352.83
其中：存款利息收入	7.4.7.13	506,876,677.43	83,468,515.82
债券利息收入		-	503,844,346.23
资产支持证券 利息收入		-	12,283,474.41
买入返售金融 资产收入		489,530,897.75	119,647,016.37
证券出借利息 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		779,843,874.10	10,362,479.47
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	779,558,241.94	10,362,479.47
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	285,632.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	-	-
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）	7.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		264,450,693.67	95,448,186.80
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	109,832,829.92	37,938,144.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	36,610,943.27	12,646,048.05
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	8,723,283.99	2,529,209.59
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		108,552,928.02	41,298,222.56
其中：卖出回购金融资产支出		108,552,928.02	41,298,222.56
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		465,373.47	761,892.42
8. 其他费用	7.4.7.23	265,335.00	274,670.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,511,800,755.61	634,157,645.50
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,511,800,755.61	634,157,645.50
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,511,800,755.61	634,157,645.50

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安交易型货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	28,425,177,766.38	-	-	28,425,177,766.38
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）	28,425,177,766.38	-	-	28,425,177,766.38
三、本期 增减变动 额（减少 以“-”号 填列）	45,816,471,855.82	-	-	45,816,471,855.82
（一）、综 合收益总 额	-	-	1,511,800,755.61	1,511,800,755.61
（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）	45,816,471,855.82	-	-	45,816,471,855.82
其中：1. 基金申购 款	162,201,980,580.02	-	-	162,201,980,580.02
2. 基金赎回 款	-	-	-	-
	116,385,508,724.20			116,385,508,724.20



(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)	-	-	1,511,800,755.61	-1,511,800,755.61
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	74,241,649,622.20	-	-	74,241,649,622.20
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年12月31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)	23,990,729,974.08	-	-	23,990,729,974.08
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)	23,990,729,974.08	-	-	23,990,729,974.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,434,447,792.30	-	-	4,434,447,792.30
(一)、综合收益总额	-	-	634,157,645.50	634,157,645.50
(二)、本期基金份额	4,434,447,792.30	-	-	4,434,447,792.30

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	89,935,997,166.25	-	-	89,935,997,166.25
2. 基金赎回款	-85,501,549,373.95	-	-	-85,501,549,373.95
(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)	-	-	-634,157,645.50	-634,157,645.50
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	28,425,177,766.38	-	-	28,425,177,766.38

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

平安交易型货币市场基金(原名为平安大华交易型货币市场基金,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[2016]1380号《关于准予平安大华交

易型货币市场基金注册的批复》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《平安大华交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 1,590,518,565.34 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第 1210 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华交易型货币市场基金基金合同》于 2016 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,590,527,400.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 8,834.75 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，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

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》，平安大华交易型货币市场基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安交易型货币市场基金。

根据《平安交易型货币市场基金基金合同》和《平安交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人平安基金管理有限公司在基金合同生效日当日，即 2016 年 9 月 23 日为本基金 E 类基金份额办理份额折算。本基金 E 类基金份额募集认购金额为 1,384,657,000.00 元，折算前基金份额总额为 1,384,657,000.00 份，折算前基金份额净值为 1.00 元；根据本基金的基金份额折算方法，折算后 E 类基金份额总额为 13,846,570.00 份，折算后基金份额净值为 100.00 元。本基金 E 类基金份额的注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2016 年 9 月 26 日进行了变更登记。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证自律监管决定书[2016]246 号文审核同意，本基金 E 类基金份额于 2016 年 10 月 17 日在上交所上市交易。

根据《平安基金管理有限公司关于平安交易型货币市场基金增设 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，自 2022 年 02 月 08 日起本基金在现有 A 类基金份额和 E 类基金份额的基础上增设 C 类份额。A 类和 C 类为场外基金份额，E 类为场内基金份额。三类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布每万份基金净收益或每百份基金已实现收益和七日年化收益率。A 类和 C 类基金份额通过基金管理人指定的场外销售机构办理申购和赎回等业务。E 类基金份额通过上海证券交易所场内交易平台办理申购和赎回等业务，并在上海证券交易所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安交易型货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；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；以及中国证监会、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：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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、以摊余成本计量的金融资产；

###### （2）金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最底层输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当按实际利率法计算确定的基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值产生重大偏离，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资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第120号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2) 债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的投资收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账。

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提。

(4) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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

(1) 本基金同一类别内的每份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) 每日分配收益：本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，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；

(4) 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额采用“每日分配、按日支付”原则。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日结转。投资人当日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；

(5) 本基金 E 类基金份额采用“每日分配、利随本清”的原则。根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，记入投资人收益账户。投资人赎回 E 类基金份额时，其对应比例的累计收益将立即结清，以现金支付给投资人；若累计收益为负值，则从投资人赎回基金款中按比例扣除。投资人当日收益分配的计算保留小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理；

(6) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，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；

(7) 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个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(8) 投资人卖出部分 E 类基金份额时，不支付对应的收益；但投资人全部卖出 E 类基金份额时，以现金方式将全部累计收益与投资人结清；

(9) 当日买入的基金份额自买入当日起享有基金的收益分配权益；当日卖出的基金份额自卖出当日起，不享有基金的收益分配权益；

(10) 在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；

(11) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 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

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币

7,500,197,014.59 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 17,464,282.13 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,517,661,296.72 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 64,545,688.71 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 35,849.21 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 64,581,537.92 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 83,389.17 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 37.60 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 83,426.77 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,186,009,436.06 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,374,727.59 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,187,384,163.65 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 145,977,121.26 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 17,464,282.13 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 35,849.21 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 37.60 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 127,102,224.73 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 1,374,727.59 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 22,214,906,027.17 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 127,102,224.73 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 22,342,008,251.90 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,240,095,609.84 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 1,726,686.04 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,241,822,295.88 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,726,686.04 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 1,726,686.04 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### (2) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### (3) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### (4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	64,766,214.57	1,200,197,014.59
等于：本金	62,357,995.24	1,200,197,014.59
加：应计利息	2,408,219.33	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	16,733,528,335.61	6,300,000,000.00
等于：本金	16,670,000,000.00	6,300,000,000.00
加：应计利息	63,528,335.61	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-

存款期限 1-3 个月	6,000,995,833.35	1,000,000,000.00
存款期限 3 个月以上	10,732,532,502.26	5,300,000,000.00
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	16,798,294,550.18	7,500,197,014.59

注：1. 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2. 本基金报告期内提前支取部分定期存款，根据约定，原定期存款利率不变，提前支取未造成利息损失。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 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	-	-	-	-
	银行间市场	35,311,897,604.31	35,311,500,895.87	-396,708.44	-0.0005
	合计	35,311,897,604.31	35,311,500,895.87	-396,708.44	-0.0005
资产支持证券		-	-	-	-
合计		35,311,897,604.31	35,311,500,895.87	-396,708.44	-0.0005
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 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	265,864,085.81	265,339,500.00	-524,585.81	-0.0018
	银行间市场	21,913,041,941.36	21,939,934,400.00	26,892,458.64	0.0946
	合计	22,178,906,027.17	22,205,273,900.00	26,367,872.83	0.0928
资产支持证券		36,000,000.00	36,252,000.00	252,000.00	0.0009
合计		22,214,906,027.17	22,241,525,900.00	26,619,872.83	0.0936

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

**7.4.7.3.2 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。

**7.4.7.3.3 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。

**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 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	534,554,357.37	-
银行间市场	28,455,154,122.48	-
合计	28,989,708,479.85	-
项目	上年度末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,935,300,000.00	-
银行间市场	1,250,709,436.06	-
合计	3,186,009,436.06	-

**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。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

**7.4.7.5.2 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。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期无其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	145,977,121.26
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	145,977,121.26

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021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	-	-
应付交易费用	912,610.57	245,364.81
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	912,610.57	245,364.81
应付利息	-	1,726,686.04
预提费用	239,000.00	249,000.00
合计	1,151,610.57	2,221,050.85

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安日鑫 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,213,758,762.98	28,213,758,762.98
本期申购	141,554,779,227.57	141,554,779,227.57
本期赎回（以“-”号填列）	-97,607,624,828.13	-97,607,624,828.13
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	72,160,913,162.42	72,160,913,162.42

## 平安日鑫 C

项目	本期 2022 年 2 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	17,626,373,060.66	17,626,373,060.66
本期赎回（以“-”号填列）	-15,819,238,472.78	-15,819,238,472.78
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	1,807,134,587.88	1,807,134,587.88

## 场内货币

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,114,190.03	211,419,003.40
本期申购	30,208,282.92	3,020,828,291.79
本期赎回（以“-”号填列）	-29,586,454.23	-2,958,645,423.29
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	2,736,018.72	273,601,871.90

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金于 2022 年 2 月 8 日增设 C 类基金份额。

（3）根据《平安交易型货币市场基金基金合同》，本基金折算后 E 类每份基金份额对应的面值为人民币 100.00 元。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 平安日鑫 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	1,466,124,263.86	-	1,466,124,263.86
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	-1,466,124,263.86	-	-1,466,124,263.86
本期末	-	-	-

## 平安日鑫 C

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	30,043,641.77	-	30,043,641.77
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	-30,043,641.77	-	-30,043,641.77
本期末	-	-	-

## 场内货币

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	15,632,849.98	-	15,632,849.98
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	-15,632,849.98	-	-15,632,849.98
本期末	-	-	-

## 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	55,119,993.07	870,597.63
定期存款利息收入	448,923,142.28	81,121,193.14
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,832,888.02	1,473,995.42
其他	654.06	2,729.63
合计	506,876,677.43	83,468,515.82

## 7.4.7.14 股票投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日

债券投资收益——利息收入	756,426,340.34	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	23,131,901.60	10,362,479.47
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	779,558,241.94	10,362,479.47

#### 7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	98,498,335,100.05	54,755,751,242.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	98,012,994,564.51	54,262,564,230.77
减：应计利息总额	462,209,133.90	482,824,532.05
减：交易费用	-499.96	-
买卖债券差价收入	23,131,901.60	10,362,479.47

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	285,632.16	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	-
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	285,632.16	-

#### 7.4.7.16.2 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12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出资产支持证券成交总额	37,039,703.67	394,339,853.16
减：卖出资产支持证券成本总额	36,000,000.00	383,000,000.00
减：应计利息总额	1,039,703.67	11,339,853.16
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

#### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益—赎回差价收入。

#### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益—申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 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。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.19 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。

#### 7.4.7.20 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收益。

#### 7.4.7.21 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。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	110,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	32,400.00	33,330.00
其他	2,935.00	1,200.00
交易费用	-	140.01
合计	265,335.00	274,670.01

#### 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
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安证券”）	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
深圳鑫橙投资管理有限公司（“深圳鑫橙”）	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
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	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
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
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	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
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
中国平安财产保险股份有限公司(“平安财险”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安付科技服务有限公司(“平安付”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安国际融资租赁有限公司(“平安国际租赁”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安国际融资租赁(深圳)有限公司(“国际租赁深圳”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安国际融资租赁(天津)有限公司(“国际租赁天津”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安综合金融服务有限公司(“平安综合金融”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳万里通网络信息技术有限公司(“万里通”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安壹钱包电子商务有限公司(“壹钱包”)	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	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 成交总额的比例 (%)
国泰君安证券	120,791,400.00	100.00	1,598,316,960.00	100.00

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
国泰君安证券	408,858,461,000.00	100.00	207,170,854,000.00	100.00

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间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 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	109,832,829.92	37,938,144.17
其中：支付销售机构的客户维护 费	6,505,783.09	1,931,779.32

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 0.15%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管 费	36,610,943.27	12,646,048.05

注：支付基金托管行国泰君安证券的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	本期

获得销售服务费的各关联方名称	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	平安日鑫 A	平安日鑫 C	场内货币	合计
陆基金	13,009.39	56.88	-	13,066.27
平安基金	5,527,324.05	239,967.46	15,830.17	5,783,121.68
平安人寿	374.59	194,398.71	-	194,773.30
平安银行	188,421.13	1,027,559.12	-	1,215,980.25
平安证券	1,660.11	-	856.51	2,516.62
合计	5,730,789.27	1,461,982.17	16,686.68	7,209,458.12
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 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
平安日鑫 A	平安日鑫 C	场内货币	合计	
国泰君安证券	167.96	-	587.62	755.58
陆基金	16,437.21	-	-	16,437.21
平安基金	2,034,004.11	-	10,827.74	2,044,831.85
平安人寿	14,997.15	-	-	14,997.15
平安银行	113,742.17	-	-	113,742.17
平安证券	1,107.89	-	283.75	1,391.64
合计	2,180,456.49	-	11,699.11	2,192,155.60

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 0.01%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：

A 类基金日销售服务费=A 类基金前一日基金资产净值×0.01%/当年天数。

支付基金销售机构的销售服务费按 C 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：

C 类基金日销售服务费=C 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 E 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：

E 类基金日销售服务费=E 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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
国泰君安证券	1,889,365,480.27	2,240,045,487.83	3,711,480,000.00	1,843,296.91	770,000.00	210,560.49
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
国泰君安证券	75,022,383.56	-	1,195,000,000.00	529,998.46	700,008.00	360,509.32

## 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

## 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 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 12月31日	本期 2022年2月8日 (基金合同生效 日)至2022年12 月31日	本期 2022年1月1日至 2022年12月31日
		平安日鑫 A	平安日鑫 C
基金合同生效日 (2016年9月23 日)持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基 金份额	50,365,702.60	-	-
报告期间申购/买入 总份额	1,154,380,665.22	-	-
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	790,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额	414,746,367.82	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.5748%	-	-
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 -	上年度可比期间 2021年1月1日至 2021年12月31日
	平安日鑫 A	平安日鑫 C	场内货币
基金合同生效日 (2016年9月23日)持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	80,339,938.61	-	-
报告期间申购/买入总份额	321,722,239.82	-	-
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	351,696,475.83	-	-
报告期末持有的基金份额	50,365,702.60	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1785%	-	-

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。

#### 7.4.10.5.2 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

##### 平安日鑫 A

关联方名称	本期末 2022年12月31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(%)
国泰君安证券	406,461,955.46	0.5633	0.00	0.0000

平安不动产	2,024.05	0.0000	1,981.46	0.0000
平安财险	19.53	0.0000	19.41	0.0000
平安付	-	-	106,787,858.46	0.3785
平安汇通	28,602,716.49	0.0396	213,311,208.57	0.7561
平安集团	500,261,893.72	0.6933	0.00	0.0000
平安人寿	4,004,176,237.59	5.5490	308,879,973.39	1.0948
平安银行	5,527,413,970.17	7.6598	1,500,146,090.33	5.3171
平安证券	113,311,269.30	0.1570	110,966,340.60	0.3933
平安综合金融	-	-	53,024,639.87	0.1879
深圳鑫橙	28,983,908.39	0.0402	29,904,164.67	0.1060
万里通	-	-	30,000,000.00	0.1063
壹钱包	-	-	505,586.81	0.0018

份额单位：份

## 场内货币

关联方名称	本期末 2022年12月31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 (%)
国际租赁 深圳	-	-	281.22	0.0133
国际租赁 天津	-	-	617.18	0.0292
平安国际 租赁	-	-	725.91	0.0343
平安人寿	1.00	0.0000	1.25	0.0001

## 7.4.10.6 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12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
国泰君安证券-活期	64,766,214.57	55,119,993.07	1,200,197,014.59	870,597.63
平安银行-定期	-	17,175,666.67	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰君安证券保管，按银行同业存款利率计息；定期存款由平安银行保管，按协议利率计息。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2022 年度，本基金因投资平安银行的同业存单而取得的利息收入为人民币 2,261,143.70 元(上年度可比期间：14,042,982.24 元)。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有 0 张平安银行的同业存单(2021 年 12 月 31 日，数量：3,000,000.00 张；成本：298,671,186.30 元；市值：299,000,000.00，比例：1.05%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

平安日鑫 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
1,462,070,384.59	-	4,053,879.27	1,466,124,263.86	-
平安日鑫 C				
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
29,914,672.47	-	128,969.30	30,043,641.77	-
场内货币				
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
15,623,291.79	-	9,558.19	15,632,849.98	-

#### 7.4.12 期末（2022 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 2022 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 7,201,711,335.24 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
112208064	22 中信银行 CD064	2023 年 1 月 3 日	98.89	2,299,000	227,341,888.46
112209118	22 浦发银行	2023 年 1 月 3	98.95	3,335,000	329,996,868.08

	CD118	日			
112218036	22 华夏银行 CD036	2023 年 1 月 3 日	99.60	2,170,000	216,127,649.80
112218267	22 华夏银行 CD267	2023 年 1 月 3 日	98.79	5,382,000	531,678,184.17
112219209	22 恒丰银行 CD209	2023 年 1 月 3 日	99.50	5,377,000	535,019,194.68
112272186	22 重庆农村 商行 CD236	2023 年 1 月 3 日	98.95	2,273,000	224,918,082.87
112273644	22 北京农商 银行 CD287	2023 年 1 月 3 日	98.75	13,332,000	1,316,508,392.75
180204	18 国开 04	2023 年 1 月 3 日	104.30	1,400,000	146,015,418.82
180211	18 国开 11	2023 年 1 月 3 日	102.58	2,300,000	235,936,918.74
200202	20 国开 02	2023 年 1 月 3 日	101.35	4,500,000	456,067,756.47
200207	20 国开 07	2023 年 1 月 3 日	101.84	4,500,000	458,300,758.73
210302	21 进出 02	2023 年 1 月 3 日	102.70	177,000	18,177,745.74
210312	21 进出 12	2023 年 1 月 3 日	102.70	2,500,000	256,758,394.70
220201	22 国开 01	2023 年 1 月 3 日	102.03	10,100,000	1,030,512,161.23
220206	22 国开 06	2023 年 1 月 3 日	101.12	2,900,000	293,261,554.13
220211	22 国开 11	2023 年 1 月 3 日	100.71	200,000	20,141,159.52
220301	22 进出 01	2023 年 1 月 3 日	101.56	700,000	71,090,397.95
220304	22 进出 04	2023 年 1 月 3 日	101.34	1,000,000	101,344,694.68
220306	22 进出 06	2023 年 1 月 3 日	100.66	900,000	90,590,757.82
220401	22 农发 01	2023 年 1 月 3 日	101.52	800,000	81,217,913.12
220404	22 农发 04	2023 年 1 月 3 日	100.99	2,500,000	252,472,187.18
229950	22 贴现国债 50	2023 年 1 月 3 日	99.67	4,000,000	398,668,611.92
229957	22 贴现国债 57	2023 年 1 月 3 日	99.51	500,000	49,754,871.35
229962	22 贴现国债	2023 年 1 月 3	99.83	3,300,000	329,443,844.02

	62	日			
合计				76,445,000	7,671,345,406.93

#### 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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 41.66%（上年末：73.19%）。

#### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的货币市场工具，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	14,519,209,824.65	2,279,084,725.53	-	-	-	16,798,294,550.18
结算备付金	229,453,218.19	-	-	-	-	229,453,218.19
存出保证金	10,053.03	-	-	-	-	10,053.03
交易性金融资产	30,111,017,825.97	5,200,879,778.34	-	-	-	35,311,897,604.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	28,989,708,479.85	-	-	-	-	28,989,708,479.85
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	135,502,416.60	135,502,416.60
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	73,849,399,401.69	7,479,964,503.87	-	-	135,502,416.60	81,464,866,322.16
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	9,902,812.59	9,902,812.59
应付托管费	-	-	-	-	3,300,937.53	3,300,937.53
应付清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	7,201,711,335.24	-	-	-	-	7,201,711,335.24
应付销售服	-	-	-	-	964,649.91	964,649.91

务费						
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	5,774,631.18	5,774,631.18
应交税费	-	-	-	-	410,722.94	410,722.94
其他负债	-	-	-	-	1,151,610.57	1,151,610.57
负债总计	7,201,711,335.24	-	-	-	21,505,364.72	7,223,216,699.96
利率敏感度缺口	66,647,688,066.45	7,479,964,503.87	-	-	-113,997,051.88	74,241,649,622.20
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	7,300,197,014.59	200,000,000.00	-	-	-	7,500,197,014.59
结算备付金	64,545,688.71	-	-	-	-	64,545,688.71
存出保证金	83,389.17	-	-	-	-	83,389.17
交易性金融资产	20,487,944,517.96	1,726,961,509.21	-	-	-	-22,214,906,027.17
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,186,009,436.06	-	-	-	-	3,186,009,436.06
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-563,222,180.52	563,222,180.52
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-145,977,121.26	145,977,121.26
资产总计	31,038,780,046.49	1,926,961,509.21	-	-	-709,199,301.78	33,674,940,857.48
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,499,975.68	3,499,975.68
应付托管费	-	-	-	-	1,166,658.54	1,166,658.54
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	5,240,095,609.84	-	-	-	-	5,240,095,609.84
应付销售服务费	-	-	-	-	233,331.71	233,331.71
应付利润	-	-	-	-	1,582,224.42	1,582,224.42
应交税费	-	-	-	-	964,240.06	964,240.06
其他负债	-	-	-	-	2,221,050.85	2,221,050.85
负债总计	5,240,095,609.84	-	-	-	9,667,481.26	5,249,763,091.10
利率敏感度	25,798,684,436.65	1,926,961,509.21	-	-	-699,531,820.52	28,425,177,766.38



缺口					
----	--	--	--	--	--

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。

#### 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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-31,463,958.99	-12,334,207.11
	市场利率下降 25 个基点	31,531,039.59	12,358,311.61

#### 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）。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 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。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	35,311,897,604.31	22,214,906,027.17
第三层次	-	-
合计	35,311,897,604.31	22,214,906,027.17

#### 7.4.14.2.2 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持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	资产支持证券投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-

其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	资产支持证券投资	
期初余额	-	363,000,000.00	363,000,000.00
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	363,000,000.00	363,000,000.00
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期及上年度报告期末未使用不可观察输入值。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	35,311,897,604.31	43.35
	其中：债券	35,311,897,604.31	43.35
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	28,989,708,479.85	35.59
	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	17,027,747,768.37	20.90
4	其他各项资产	135,512,469.63	0.17
5	合计	81,464,866,322.16	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	8.18	
	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	7,201,711,335.24	9.70
	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	87
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	58

#### 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净值比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	41.56	9.70
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	3.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	18.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	6.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	38.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.32	9.70

## 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	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	777,867,327.29	1.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,708,377,729.05	5.00
	其中：政策性金融债	3,606,345,163.02	4.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,548,696,025.64	3.43
6	中期票据	357,532,946.44	0.48
7	同业存单	27,919,423,575.89	37.61
8	其他	-	-
9	合计	35,311,897,604.31	47.56
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 8.6 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	112273644	22 北京农商 银行 CD287	22,000,000	2,172,456,093.65	2.93
2	112213154	22 浙商银行 CD154	15,000,000	1,481,432,367.34	2.00
3	220201	22 国开 01	10,100,000	1,030,512,161.23	1.39
4	112213161	22 浙商银行 CD161	10,000,000	994,033,194.64	1.34
5	112213065	22 浙商银行 CD065	10,000,000	991,650,711.81	1.34
6	112272186	22 重庆农村 商行 CD236	10,000,000	989,520,822.13	1.33
7	112218267	22 华夏银行 CD267	10,000,000	987,882,170.52	1.33
8	112273764	22 北京农商 银行 CD288	10,000,000	987,695,141.32	1.33
9	112212195	22 北京银行 CD195	10,000,000	987,623,964.12	1.33
10	112283490	22 苏州银行 CD225	8,000,000	790,559,604.24	1.06

### 8.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1123%
报告期内偏离度的最低值	-0.0570%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0498%

#### 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

### 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

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）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。

中国人民银行重庆营业管理部于 2022 年 6 月 8 日作出渝银罚（2022）2 号处罚决定，由于重庆农村商业银行股份有限公司（以下简称“公司”）1. 未按照规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；3. 未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；4. 与身份不明的客户进行交易，根据相关规定，对其处以罚款 255 万元。

北京市顺义区水务局于 2022 年 9 月 26 日作出顺水罚字（2022）第 44 号处罚决定，由于北京农村商业银行股份有限公司（以下简称“公司”）未经批准擅自利用自备井取水，根据相关规定，对公司处以 7.2 万元的行政罚款。

中国银行保险监督管理委员会重庆监管局于 2022 年 11 月 11 日作出渝银保监罚决字（2022）44 号处罚决定，由于重庆农村商业银行股份有限公司存在以下违法违规情况：1. 审查审批不尽职，超需求发放流动资金贷款形成风险；2. 掩盖不良贷款；3. 拨备覆盖率指标虚假，贷款减值准备不足；4. 未按规定对质押资产进行审查即向政府融资平台公司发放贷款；5. 同业授信调查及审查审批不尽职，部分业务出现风险；6. 贷款“三查”不尽职，导致形成重大信用风险；7. 同业投资业务不合规；8. 贷后管理不到位，信贷资金被挪用；9. 未执行统一授信管理，依据相关规定，对其罚款 1285 万元。

中国银行保险监督管理委员会北京监管局于 2022 年 11 月 21 日作出京银保监罚决字（2022）57 号处罚决定，由于北京农村商业银行股份有限公司存在 EAST 数据漏报及报送不一致、数据错报、其他与数据报送相关的违规问题，依据相关规定，责令其改正，并给予罚款合计 630 万元的行政处罚。

国家外汇管理局北京外汇管理部于 2022 年 11 月 28 日作出京汇罚（2022）20 号处罚决定，



由于北京银行股份有限公司（以下简称“公司”）办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查，违反规定办理结汇、售汇业务，违反外汇登记管理规定，依据相关规定，没收公司违法所得 349,067.43 元人民币，对公司处以罚款 156.5 万元人民币。

人民银行南京分行于 2022 年 12 月 21 日作出南银罚决字（2022）4 号处罚决定，由于苏州银行股份有限公司（以下简称“公司”）提供与实际不符的统计报表，违反账户管理规定，违反人民币反假有关规定，占压财政存款或者资金，违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，未按规定履行客户身份识别义务，违反个人金融信息保护规定，依据相关规定，对公司提出警告，并处罚款 122.2 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，对公司的经营情况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。

### 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	10,053.03
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	135,502,416.60
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	135,512,469.63

### 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
平安日 鑫 A	139,458	517,438.32	71,766,087,921.76	99.45	394,825,240.66	0.55
平安日 鑫 C	99,671	18,131.00	19,905,658.20	1.10	1,787,228,929.68	98.90
场内货 币	1,250	2,188.81	1,032,125.27	37.72	1,703,893.45	62.28
合计	240,173	307,989.59	71,787,025,705.23	97.05	2,183,758,063.79	2.95

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 期末上市基金前十名持有人

### 场内货币

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	邹永芬	76,866.98	2.81
2	北京和聚投资管理有 限公司-和聚荆玉私 募证券投资基金	47,987.21	1.75
3	朱栋	47,658.59	1.74
4	秦汝权	47,230.66	1.73
5	中国人保资管-中国 银行-中国人保资产 中短期配置 6 号资产 管理产品	45,128.85	1.65
6	中国银河证券股份有 限公司	44,908.09	1.64
7	姚书新	43,696.78	1.60
8	华泰证券股份有限公 司	40,403.27	1.48
9	冯绮婷	32,402.98	1.18
10	中国人保资管-光大 银行-人保资产安心 优选高分红 1 号资产 管理产品	30,853.47	1.13

## 9.3 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	6,621,476,129.70	8.95
2	银行类机构	4,450,505,035.79	6.02
3	银行类机构	4,065,599,040.35	5.50

4	银行类机构	3,252,640,451.07	4.40
5	银行类机构	2,829,653,145.84	3.83
6	银行类机构	2,551,257,845.31	3.45
7	银行类机构	2,512,282,759.51	3.40
8	保险类机构	2,002,114,875.51	2.71
9	保险类机构	2,001,996,586.66	2.71
10	银行类机构	1,843,775,414.29	2.49

#### 9.4 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	平安日鑫 A	1,174.66	0.0000
	平安日鑫 C	116,376.69	0.0064
	场内货币	-	-
	合计	117,551.35	0.0002

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）。

#### 9.5 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	平安日鑫 A	0
	平安日鑫 C	0
	场内货币	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安日鑫 A	0
	平安日鑫 C	0
	场内货币	0
	合计	0

#### 9.6 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情况

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	平安日鑫 A	平安日鑫 C	场内货币
基金合同生效日（2016年9月23日）基金份额总额	205,870,400.09	-	13,846,570.00

本报告期期初基金份额总额	28,213,758,762.98	-	2,114,190.03
本报告期基金总申购份额	141,554,779,227.57	17,626,373,060.66	30,208,282.92
减：本报告期基金总赎回份额	97,607,624,828.13	15,819,238,472.78	29,586,454.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-	0.00
本报告期期末基金份额总额	72,160,913,162.42	1,807,134,587.88	2,736,018.72

注：本基金 A 类（平安日鑫 A）、C 类（平安日鑫 C）份额净值为 1.00 元，E 类（场内货币）份额净值为 100.00 元

## § 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

本报告期内，本基金管理人—平安基金管理有限公司（以下简称“公司”）董事陈宁先生因工作变动，经公司 2022 年 1 月 19 日召开的 2022 年第一次股东会审议，不再出任公司第四届董事会董事，并由李佩锋先生接替陈宁先生任职公司的董事。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 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，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 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

经基金管理人董事会审议通过，并履行适当程序，聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计机构，本报告期应支付给该事务所的报酬为 110,000.00 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其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 (%)	
国泰君安证券	3	-	-	-	-	-

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 (%)
国泰君安证券	120,791,400.00	100.00	408,858,461,000.00	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	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提醒投	中国证监会规定报刊及	2022 年 01 月 12 日

	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	网站	
3	平安交易型货币市场基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 21 日
4	平安交易型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
5	平安基金管理有限公司关于平安交易型货币市场基金增设 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 02 月 08 日
6	平安交易型货币市场基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 02 月 08 日
7	平安交易型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 02 月 08 日
8	平安交易型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 02 月 08 日
9	平安交易型货币市场基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 02 月 08 日
10	平安基金管理有限公司关于平安交易型货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 02 月 16 日
11	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增华安证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 03 月 22 日
12	平安交易型货币市场基金清明节假期前暂停申购、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 03 月 25 日
13	平安交易型货币市场基金 2021 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 03 月 31 日
14	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
15	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增东吴证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 07 日
16	平安交易型货币市场基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 21 日
17	平安交易型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
18	平安交易型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 25 日

19	平安交易型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 25 日
20	平安交易型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 05 月 25 日
21	平安交易型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 30 日
22	平安交易型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 30 日
23	平安交易型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
24	平安交易型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
25	平安交易型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
26	平安交易型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 22 日
27	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
28	平安基金管理有限公司关于暂停乾道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	2022 年 07 月 18 日
29	平安交易型货币市场基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 07 月 20 日
30	平安交易型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 08 月 06 日
31	平安交易型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 08 月 06 日
32	平安交易型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 08 月 06 日
33	平安基金管理有限公司关于终止与北京懒猫基金销售有限公司销售业务合作的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 08 月 19 日
34	平安基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 08 月 24 日
35	平安交易型货币市场基金 2022 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 08 月 30 日
36	平安交易型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	2022 年 09 月 27 日
37	平安交易型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 09 月 30 日
38	平安交易型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 09 月 30 日

39	平安基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子冒用“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 10 月 25 日
40	平安交易型货币市场基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 10 月 25 日
41	平安基金管理有限公司关于终止与国开证券股份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 11 月 11 日
42	平安基金管理有限公司关于终止与深圳信诚基金销售有限公司销售业务合作的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 11 月 14 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

为更好地满足投资者的投资理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等法律法规的规定及平安交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）的基金合同的约定，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）在与本基金基金托管人国泰君安证券股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案后，决定自本公告公告之日起在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额。详细内容可阅读本公司于 2022 年 2 月 8 日发布的《平安基金管理有限公司关于平安交易型货币市场基金增设 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安交易型货币市场基金募集注册的文件
- (2) 平安交易型货币市场基金基金合同
- (3) 平安交易型货币市场基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 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

2023 年 3 月 29 日