

# 平安日增利货币市场基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</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.....	7
3.3 其他指标.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 债券回购融资情况.....	40
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	42
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	42

7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细.....	43
7.9 投资组合报告附注.....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	47
10.9 其他重大事件.....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## § 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	175,962,049,380.49 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	175,415,475,984.93 份	546,573,395.56 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	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	LISHUAI130@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

邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)		
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B	
本期已实现收益	1,624,196,127.11	37,228,324.96	
本期利润	1,624,196,127.11	37,228,324.96	
本期净值收益率	0.9169%	1.0369%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)		
	期末基金资产净值	175,415,475,984.93	546,573,395.56
	期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)		
	累计净值收益率	32.3609%	6.1975%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金按照实际利率计算账面价值，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期

利润的金额相等。

2. 本基金按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安日增利货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1481%	0.0007%	0.1125%	0.0000%	0.0356%	0.0007%
过去三个月	0.4622%	0.0007%	0.3413%	0.0000%	0.1209%	0.0007%
过去六个月	0.9169%	0.0008%	0.6788%	0.0000%	0.2381%	0.0008%
过去一年	1.6930%	0.0010%	1.3688%	0.0000%	0.3242%	0.0010%
过去三年	5.8868%	0.0013%	4.1063%	0.0000%	1.7805%	0.0013%
自基金合同生效起至今	32.3609%	0.0036%	13.1138%	0.0000%	19.2471%	0.0036%

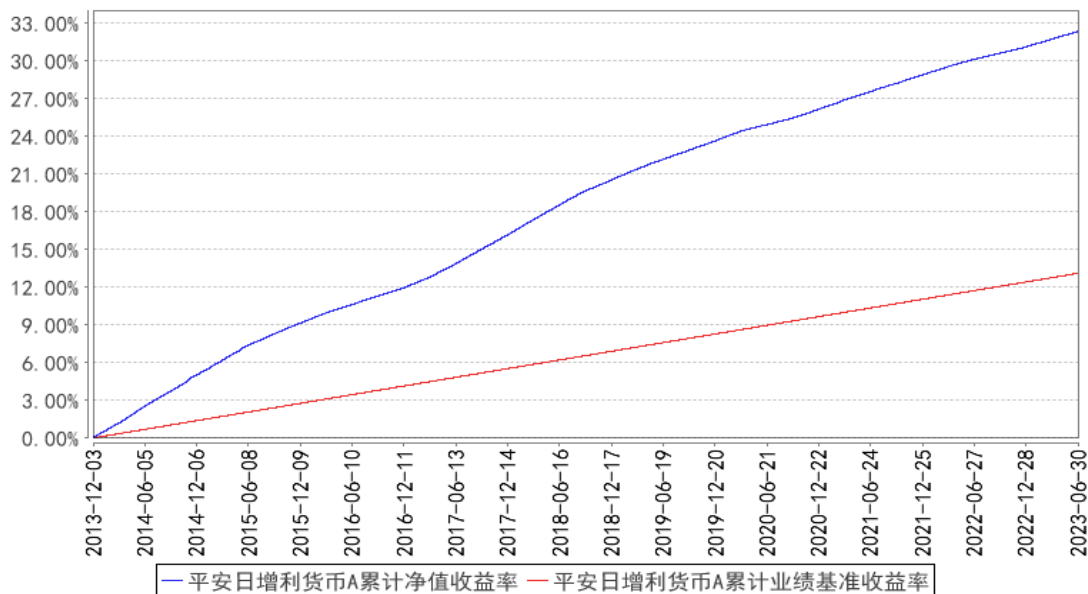
平安日增利货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1678%	0.0007%	0.1125%	0.0000%	0.0553%	0.0007%
过去三个月	0.5223%	0.0007%	0.3413%	0.0000%	0.1810%	0.0007%
过去六个月	1.0369%	0.0008%	0.6788%	0.0000%	0.3581%	0.0008%

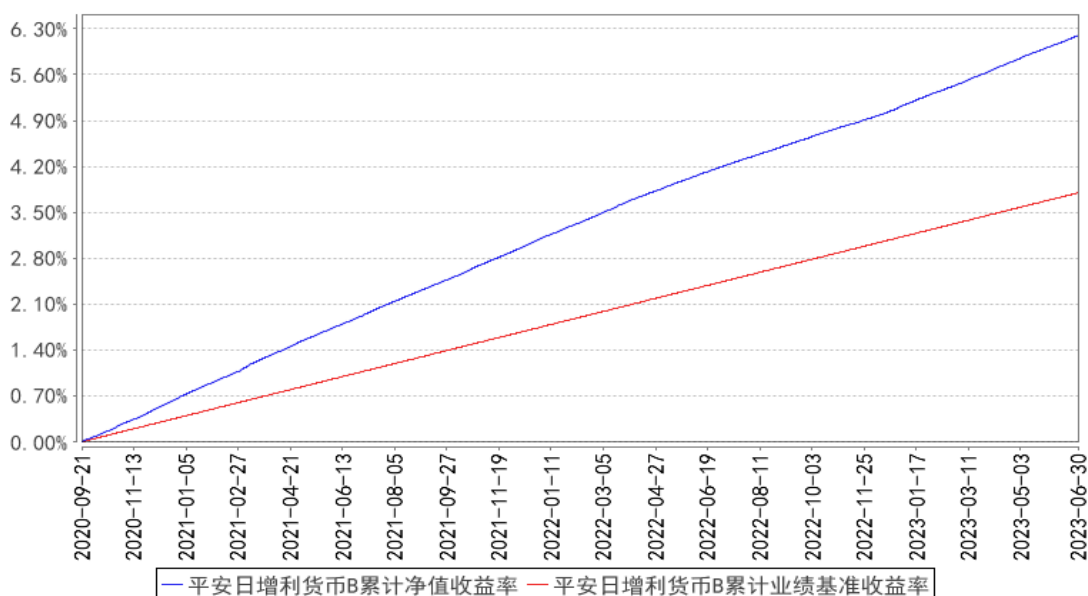
过去一年	1.9371%	0.0010%	1.3688%	0.0000%	0.5683%	0.0010%
自基金合同生效起至今	6.1975%	0.0013%	3.7988%	0.0000%	2.3987%	0.0013%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

平安日增利货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安日增利货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效；

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



比例符合基金合同约定；

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

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本金为 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、海外、专户七大业务板块（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 2023 年 6 月 30 日，平安基金共管理 186 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5,721.58 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经理	2022 年 6 月 13 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，平安日增利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。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资

组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年宏观经济在经历一轮疫后快速修复后再度走弱，年初防控政策调整后需求快速释放和基建发力带动生产景气回升，疫情快速过峰后消费强劲复苏，宏观经济呈现稳步修复；进入二季度随着生产生活恢复常态化，经济内生需求不足的问题愈加明显，工业生产受下游需求不足拖累走低，基建和进出口脉冲上行后再度回落，拖累经济复苏力度持续放缓，市场对宏观政策加码预期不断升温。一季度信贷投放旺盛，市场资金缺口扩大，央行通过降准和 MLF 加量续作等措施加大资金投放；二季度随着信贷投放节奏减缓，央行公开市场投放有所收窄，并通过调降 MLF 和 LPR 利率的方式降低实体经济融资成本，在税期、跨月等关键时点央行保持资金投放，延续对流动性呵护态度。上半年货币市场收益率整体呈现冲高回落，具体来看，年初经济修复斜率较高，带动货币市场收益率冲高；春节后信贷投放旺盛叠加存单集中到期后银行资金缺口扩大，货币市场收益率持续上行；至一季度末两会公布 GDP 目标增速不及预期，数据显示经济仍处于弱复苏进程中，货币市场收益率震荡回落；货币市场收益率在一季度整体呈现出快速上行后小幅回落。二季度初宏观经济各项经济数据喜忧参半，货币市场收益率呈现震荡，政治局会议着力点仍落在内需，市场对于财政政策加码预期落空，货币市场收益率快速回落；随后宏观数据显示经济复苏力度持续放缓，市场悲观情绪蔓延，货币市场收益率震荡下行；至二季度末降息落地利好出尽，市场对政策加码预期愈发强烈，货币市场收益率触底反弹；货币市场收益率在二季度整体呈现出震荡下行后的小幅反弹。

报告期内，本基金的投资操作以流动性管理为基础原则，选择具备良好信用资质的投资标的，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

本报告期平安日增利货币 A 的基金份额净值收益率为 0.9169%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%；本报告期平安日增利货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0369%，同期业绩比较基准收益

率为 0.6788%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，促消费政策逐步落地，制造业和基建投资有望维持温和，但地产行业投资动能仍显疲弱，海外经济动能放缓对出口仍有拖累；经济内生增长动能不足，外需承受较大压力，尽管政策加大稳增长力度，从各项稳增长政策落地到经济增速实际显现出好转迹象仍需时间积累；在去年低基数影响下，经济同比增速有望符合政策目标。经济修复需要温和的流动性环境，货币政策短期转向概率较小，预计仍将维持稳健宽松基调。综合来看，宏观经济处于筑底回升进程中，流动性环境对货币市场预计保持友好，但复苏预期与现实的不同步可能加大市场调整幅度，预计下半年货币市场以震荡为主，货币基金不仅需要把握市场波动捕捉资产配置机会，也需要做好流动性风险管理。我们将继续稳健操作，力争在保障安全性、流动性的情况下，为客户创造良好的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金基金合同的规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人，并按照自然日结转至基金份额持有人的基金账户。本报告期内应分配收益 1,661,424,452.07 元，实际分配收益 1,661,424,452.07 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：平安日增利货币市场基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	54,444,979,002.57	49,909,600,266.16
结算备付金		1,032,573,424.23	532,814,263.22
存出保证金		139,660.40	166,157.02
交易性金融资产	6.4.7.2	68,178,277,818.53	82,131,402,395.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		68,178,277,818.53	82,131,402,395.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	65,908,986,000.15	56,415,220,320.06
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		45,917.84	266,854,111.62
应收股利		-	-
应收申购款		2,320,218.12	5,214,275.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		189,567,322,041.84	189,261,271,788.75
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		13,501,528,493.19	15,352,898,670.66
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		48,456,392.27	49,449,853.56
应付托管费		7,341,877.60	7,492,402.06
应付销售服务费		36,221,697.31	36,857,974.55
应付投资顾问费		-	-
应交税费		79,736.86	867,732.67
应付利润		9,673,150.11	10,711,518.94
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,971,314.01	1,749,772.24
负债合计		13,605,272,661.35	15,460,027,924.68
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	175,962,049,380.49	173,801,243,864.07
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		175,962,049,380.49	173,801,243,864.07
负债和净资产总计		189,567,322,041.84	189,261,271,788.75

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 175,962,049,380.49 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额 175,415,475,984.93 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额 546,573,395.56 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安日增利货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,293,500,067.97	2,222,289,559.46
1. 利息收入		1,437,783,131.28	1,195,037,958.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	687,865,673.29	671,403,840.62
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		749,917,457.99	523,634,118.21
证券出借利息 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		855,716,936.69	1,027,251,600.63
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	855,716,936.69	1,026,195,411.86
资产支持证券 投资收益	6.4.7.16	-	1,056,188.77
贵金属投资收 益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计 量的金融资产终止确 认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		632,075,615.90	633,301,495.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	297,497,028.74	280,069,400.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,075,307.37	67,895,612.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	221,003,070.70	201,901,437.15
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		68,143,945.67	82,469,255.76
其中：卖出回购金融 资产支出		68,143,945.67	82,469,255.76

6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		227, 008. 68	816, 251. 04
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	129, 254. 74	149, 539. 60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1, 661, 424, 452. 07	1, 588, 988, 063. 70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1, 661, 424, 452. 07	1, 588, 988, 063. 70
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1, 661, 424, 452. 07	1, 588, 988, 063. 70

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安日增利货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	173, 801, 243, 864. 07	-	-	173, 801, 243, 864. 07
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）	173, 801, 243, 864. 07	-	-	173, 801, 243, 864. 07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2, 160, 805, 516. 42	-	-	2, 160, 805, 516. 42
（一）、综合收益总额	-	-	1, 661, 424, 452. 07	1, 661, 424, 452. 07
（二）、本	2, 160, 805, 516. 42	-	-	2, 160, 805, 516. 42



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)				
其中：1. 基金申购款	1,023,911,410,086.53	-	-	1,023,911,410,086.53
2. 基金赎回款	- 1,021,750,604,570.11	-	-	- 1,021,750,604,570.11
(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)	-	-	- 1,661,424,452.07	-1,661,424,452.07
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	175,962,049,380.49	-	-	175,962,049,380.49
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	145,209,813,620.91	-	-	145,209,813,620.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期期 初净 资产 (基 金净 值)	145,209,813,620.91	-	-	145,209,813,620.91
三、本 期增 减变 动额 (减 少以 “-” 号填 列)	23,650,329,801.75	-	-	23,650,329,801.75
(一)、 综合 收益 总额	-	-	1,588,988,063.70	1,588,988,063.70
(二)、 本 期基 金份 额交 易产 生的 基金 净值 变动 数 (净 值减 少以 “-” 号填 列)	23,650,329,801.75	-	-	23,650,329,801.75
其中：1. 基金 申购 款	803,052,777,326.00	-	-	803,052,777,326.00
2. 基金 赎回 款	-779,402,447,524.25	-	-	-779,402,447,524.25
(三)、 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)	-	-	1,588,988,063.70	-1,588,988,063.70
(四)、 其 他综 合收 益结 转留 存收 益	-	-	-	-
四、本 期期 末净 资	168,860,143,422.66	-	-	168,860,143,422.66

产（基金 净值）				
-------------	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>张南南</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安日增利货币市场基金（原名为平安大华日增利货币市场基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1211 号文核准，由平安基金管理有限公司（原平安大华基金管理有限公司，已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华日增利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 525,508,703.96 元，业经安永华明会计师事务所安永华明（2013）验字第 60937497\_H01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华日增利货币市场基金基金合同》于 2013 年 12 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 525,531,640.49 份基金份额，其中认购资金利息折合 22,936.53 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》，平安大华日增利货币市场基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安日增利货币市场基金。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安日增利货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金，期限一年以内（含一年）的银行存款、同业存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本基金的业绩比较基准为：税后同期七天通知存款利率。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本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 3 号《半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。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### (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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	7,001,503.05
等于：本金	6,992,093.53
加：应计利息	9,409.52
减：坏账准备	-
定期存款	54,437,977,499.52
等于：本金	54,100,000,000.00
加：应计利息	337,977,499.52
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	2,701,797,916.70
存款期限 1-3 个月	1,506,875,000.22
存款期限 3 个月以上	50,229,304,582.60
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	54,444,979,002.57

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)	
债券	交易所市场	2,742,397,520.12	2,741,460,076.16	-937,443.96	-0.0005
	银行间市场	65,435,880,298.41	65,514,484,984.71	78,604,686.30	0.0447
	合计	68,178,277,818.53	68,255,945,060.87	77,667,242.34	0.0441
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	68,178,277,818.53	68,255,945,060.87	77,667,242.34	0.0441	

注：1. 偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；

2. 偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	34,551,471,976.99	-
银行间市场	31,357,514,023.16	-
合计	65,908,986,000.15	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,847,958.67
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,847,958.67
应付利息	-
预提费用	123,355.34
合计	1,971,314.01

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安日增利货币 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,835,163,992.50	172,835,163,992.50
本期申购	1,010,296,756,174.05	1,010,296,756,174.05
本期赎回（以“-”号填列）	-1,007,716,444,181.62	-1,007,716,444,181.62
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	175,415,475,984.93	175,415,475,984.93

平安日增利货币 B

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	966,079,871.57	966,079,871.57
本期申购	13,614,653,912.48	13,614,653,912.48



本期赎回（以“-”号填列）	-14,034,160,388.49	-14,034,160,388.49
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	546,573,395.56	546,573,395.56

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 平安日增利货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	1,624,196,127.11	-	1,624,196,127.11
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	-1,624,196,127.11	-	-1,624,196,127.11
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	37,228,324.96	-	37,228,324.96
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	-37,228,324.96	-	-37,228,324.96
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,524,384.76
定期存款利息收入	679,947,257.84
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,393,090.50
其他	940.19
合计	687,865,673.29

#### 6.4.7.14 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	795,842,914.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	59,874,022.47
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	855,716,936.69

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	117,325,977,253.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	116,887,304,301.76
减：应计利息总额	378,823,779.71
减：交易费用	-24,850.00
买卖债券差价收入	59,874,022.47

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

注：本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

注：本基金本报告期内无公允价值变动损益。

**6.4.7.21 其他收入**

注：本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	13,500.00
其他	1,699.40

合计	129,254.74
----	------------

#### 6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无须作披露的分部报告。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、基金销售机构
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
上海陆金所基金销售有限公司（“陆基金”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	297,497,028.74	280,069,400.06
其中：支付销售机构的客户维护费	112,445,154.63	90,423,730.76

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,075,307.37	67,895,612.15

注：支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

名称	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	5,474,092.98	-	5,474,092.98
平安基金	25,491,823.35	132,566.72	25,624,390.07
平安银行	31,963,003.70	7,094.78	31,970,098.48
平安证券	788.55	-	788.55
合计	62,929,708.58	139,661.50	63,069,370.08
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B	合计
陆基金	6,854,317.06	564.22	6,854,881.28
平安基金	33,489,318.20	238,771.98	33,728,090.18
平安银行	41,864,551.33	57,058.16	41,921,609.49
平安证券	1,138.66	-	1,138.66
合计	82,209,325.25	296,394.36	82,505,719.61

注：支付基金销售机构的销售服务费按 A 类基金前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

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

支付基金销售机构的销售服务费按 B 类基金前一日基金资产净值 0.01% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：无。

##### 6.4.10.5.2 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

平安日增利货币 A

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
平安好贷	21,219,842.80	0.0121	21,025,537.50	0.0122
平安人寿	611.81	0.0000	606.09	0.0000

#### 6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-定期	-	-	-	1,214,166.67
平安银行-活期	7,001,503.05	2,524,384.76	302,695,100.18	1,040,435.30

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

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2023 年上半年度，本基金因投资托管人平安银行的同业存单而取得的利息收入为 103,406.60 人民币元(2022 年上半年度：15,501,498.25 元)。于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有托管人平安银行的同业存单(2022 年 6 月 30 日：本基金持有 2,500,000 张托管人平安银行的同业存单，账面价值为人民币 247,616,238.64 元，占基金资产净值的比例为 0.15%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

平安日增利货币 A

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
1,625,202,270.17	-	- 1,006,143.06	1,624,196,127.11	-
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
37,260,550.73	-	-32,225.77	37,228,324.96	-

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 13,501,528,493.19 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
092118003	21 农发清发 03	2023 年 7 月 3 日	102.42	790,000	80,911,091.65
092202001	22 国开清发 01	2023 年 7 月 3 日	101.37	2,300,000	233,159,913.93
092218001	22 农发清发 01	2023 年 7 月 3 日	100.93	1,000,000	100,927,163.05
112205182	22 建设银行 CD182	2023 年 7 月 3 日	99.01	2,000,000	198,017,284.92
112208201	22 中信银行 CD201	2023 年 7 月 3 日	98.75	1,248,000	123,243,117.45
112217136	22 光大银行 CD136	2023 年 7 月 3 日	99.92	1,000,000	99,916,200.95
112217145	22 光大银行 CD145	2023 年 7 月 3 日	99.82	1,000,000	99,818,614.20
112220159	22 广发银行 CD159	2023 年 7 月 3 日	99.83	1,000,000	99,831,895.47
112304002	23 中国银行 CD002	2023 年 7 月 3 日	99.08	4,910,000	486,494,286.55
112304013	23 中国银行 CD013	2023 年 7 月 3 日	98.83	6,000,000	592,979,254.14
112304016	23 中国银行	2023 年 7 月 3 日	98.13	4,000,000	392,524,119.58



	CD016	日			
112305068	23 建设银行 CD068	2023 年 7 月 3 日	98.17	1,908,000	187,303,822.16
112305076	23 建设银行 CD076	2023 年 7 月 3 日	98.14	690,000	67,718,644.24
112305134	23 建设银行 CD134	2023 年 7 月 3 日	98.38	5,000,000	491,909,436.29
112306049	23 交通银行 CD049	2023 年 7 月 3 日	99.09	81,000	8,026,557.27
112306110	23 交通银行 CD110	2023 年 7 月 3 日	98.82	17,000,000	1,679,888,224.99
112308131	23 中信银行 CD131	2023 年 7 月 3 日	97.89	4,500,000	440,483,021.51
112317107	23 光大银行 CD107	2023 年 7 月 3 日	97.95	98,000	9,599,237.55
112317131	23 光大银行 CD131	2023 年 7 月 3 日	97.91	1,000,000	97,912,377.35
112317132	23 光大银行 CD132	2023 年 7 月 3 日	97.91	1,000,000	97,906,176.91
112317146	23 光大银行 CD146	2023 年 7 月 3 日	97.79	1,000,000	97,788,255.41
112320040	23 广发银行 CD040	2023 年 7 月 3 日	99.05	1,000,000	99,047,720.14
170404	17 农发 04	2023 年 7 月 3 日	102.68	1,100,000	112,943,078.29
180211	18 国开 11	2023 年 7 月 3 日	103.50	6,060,000	627,209,994.26
180413	18 农发 13	2023 年 7 月 3 日	102.69	3,600,000	369,691,569.54
190203	19 国开 03	2023 年 7 月 3 日	102.03	2,129,000	217,223,384.28
200207	20 国开 07	2023 年 7 月 3 日	102.80	10,600,000	1,089,672,713.79
200313	20 进出 13	2023 年 7 月 3 日	102.93	500,000	51,467,333.46
210202	21 国开 02	2023 年 7 月 3 日	101.78	13,700,000	1,394,318,457.81
220211	22 国开 11	2023 年 7 月 3 日	101.59	3,246,000	329,770,593.72
220216	22 国开 16	2023 年 7 月 3 日	100.95	4,000,000	403,801,767.58
220306	22 进出 06	2023 年 7 月 3 日	101.52	5,320,000	540,078,213.12
220308	22 进出 08	2023 年 7 月 3	101.10	6,084,000	615,086,037.97

		日			
220408	22 农发 08	2023 年 7 月 3 日	101.22	12,289,000	1,243,944,613.63
220411	22 农发 11	2023 年 7 月 3 日	101.22	13,400,000	1,356,333,705.43
2304105	23 农发贴现 05	2023 年 7 月 3 日	99.70	2,000,000	199,400,195.88
合计				142,553,000	14,336,348,074.47

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

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 33.52%（上年末：42.05%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6 月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产						
银行存款	53,444,716,780.33	1,000,262,222.24	-	-	-	54,444,979,002.57
结算备付金	1,032,573,424.23	-	-	-	-	1,032,573,424.23
存出保证金	139,660.40	-	-	-	-	139,660.40
交易性金融资产	43,348,231,344.49	24,830,046,474.04	-	-	-	68,178,277,818.53
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	65,908,986,000.15	-	-	-	-	65,908,986,000.15
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	2,320,218.12	2,320,218.12
应收清算款	-	-	-	-	45,917.84	45,917.84
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	163,734,647,209.60	25,830,308,696.28	0.00	-	2,366,135.96	189,567,322,041.84
负债						

应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	48,456,392.27	48,456,392.27
应付托管费	-	-	-	-	7,341,877.60	7,341,877.60
应付清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	13,501,528,493.19	-	-	-	-	13,501,528,493.19
应付销售服务费	-	-	-	-	36,221,697.31	36,221,697.31
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	9,673,150.11	9,673,150.11
应交税费	-	-	-	-	79,736.86	79,736.86
其他负债	-	-	-	-	1,971,314.01	1,971,314.01
负债总计	13,501,528,493.19	-	-	-	103,744,168.16	13,605,272,661.35
利率敏感度缺口	150,233,118,716.41	25,830,308,696.28	0.00	-	101,378,032.20	175,962,049,380.49
上年度末 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	46,702,195,821.64	3,207,404,444.52	-	-	-	49,909,600,266.16
结算备付金	532,814,263.22	-	-	-	-	532,814,263.22
存出保证金	166,157.02	-	-	-	-	166,157.02
交易性金融资产	74,971,462,139.67	7,159,940,255.53	-	-	-	82,131,402,395.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	56,415,220,320.06	-	-	-	-	56,415,220,320.06
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	5,214,275.47	5,214,275.47
应收清算款	-	-	-	-	-266,854,111.62	266,854,111.62
其他资产	-	-	-	-	-	-

资产总计	178,621,858,701.61	10,367,344,700.05	-	-	272,068,387.09	189,261,271,788.75
负债						
应付赎回款						
应付管理人报酬					49,449,853.56	49,449,853.56
应付托管费					7,492,402.06	7,492,402.06
应付清算款						
卖出回购金融资产款	15,352,898,670.66					15,352,898,670.66
应付销售服务费					36,857,974.55	36,857,974.55
应付投资顾问费						
应付利润					10,711,518.94	10,711,518.94
应交税费					867,732.67	867,732.67
其他负债					1,749,772.24	1,749,772.24
负债总计	15,352,898,670.66				107,129,254.02	15,460,027,924.68
利率敏感度缺口	163,268,960,030.95	10,367,344,700.05			-164,939,133.07	173,801,243,864.07

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-82,611,345.15	-73,194,688.39
市场利率下降 25 个基点	82,873,942.11	73,345,960.46	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同）

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	68,178,277,818.53	82,131,402,395.20
第三层次	-	-
合计	68,178,277,818.53	82,131,402,395.20

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用

的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 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。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	68,178,277,818.53	35.97
	其中：债券	68,178,277,818.53	35.97
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	65,908,986,000.15	34.77
	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	55,477,552,426.80	29.27
4	其他各项资产	2,505,796.36	0.00
5	合计	189,567,322,041.84	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		3.84
	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	13,501,528,493.19	7.67
	其中：买断式回购融资	-	-

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



### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	57

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	52.91	7.67
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	3.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	6.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	12.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	32.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	107.39	7.67

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,320,457,700.76	7.00
	其中：政策	9,187,921,362.51	5.22

	性金融债		
4	企业债券	2,742,397,520.12	1.56
5	企业短期融资券	4,361,220,849.05	2.48
6	中期票据	257,379,699.19	0.15
7	同业存单	48,496,822,049.41	27.56
8	其他	-	-
9	合计	68,178,277,818.53	38.75
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	按实际利率计算的 账面价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	112396837	23 宁波银行 CD063	33,000,000	3,231,334,513.35	1.84
2	112303034	23 农业银行 CD034	32,000,000	3,162,062,558.21	1.80
3	112381997	23 宁波银行 CD129	25,000,000	2,472,129,197.20	1.40
4	112395810	23 杭州银行 CD072	25,000,000	2,468,007,854.97	1.40
5	112303135	23 农业银行 CD135	25,000,000	2,442,117,739.01	1.39
6	112306110	23 交通银行 CD110	17,000,000	1,679,888,224.99	0.95
7	112216124	22 上海银行 CD124	16,000,000	1,598,245,289.67	0.91
8	210202	21 国开 02	13,700,000	1,394,318,457.81	0.79
9	220411	22 农发 11	13,400,000	1,356,333,705.43	0.77
10	220408	22 农发 08	13,300,000	1,346,282,314.37	0.77

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25 (含) -0.5% 间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0667%
报告期内偏离度的最低值	-0.0081%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0189%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

注：本报告期内本基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

### 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金按实际利率计算账面价值，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

#### 7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海银行股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

#### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	139,660.40
2	应收清算款	45,917.84
3	应收利息	-
4	应收申购款	2,320,218.12
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,505,796.36

#### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
平安日增利货币 A	47,167,138	3,719.02	568,311,059.73	0.32	174,847,164,925.20	99.68
平安日增利货币 B	89	6,141,274.11	546,573,395.56	100.00	-	-
合计	47,167,223	3,730.60	1,114,884,455.29	0.63	174,847,164,925.20	99.37

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	银行类机构	213,776,648.49	0.12
2	券商类机构	100,935,963.40	0.06
3	信托类机构	41,353,161.91	0.02
4	银行类机构	40,295,444.79	0.02
5	券商类机构	40,008,323.16	0.02
6	基金类机构	37,402,098.51	0.02
7	其他机构	35,071,861.26	0.02
8	信托类机构	27,508,850.33	0.02
9	券商类机构	26,403,199.73	0.02

10	其他机构	25,601,056.32	0.01
----	------	---------------	------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安日增利货币 A	1,721,787.34	0.0010
	平安日增利货币 B	-	-
	合计	1,721,787.34	0.0010

注：上述从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安日增利货币 A	50~100
	平安日增利货币 B	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	平安日增利货币 A	0
	平安日增利货币 B	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B
基金合同生效日 （2013 年 12 月 3 日）基金份额总额	525,531,640.49	-
本报告期期初基金 份额总额	172,835,163,992.50	966,079,871.57
本报告期基金总申 购份额	1,010,296,756,174.05	13,614,653,912.48
减：本报告期基金 总赎回份额	1,007,716,444,181.62	14,034,160,388.49
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	175,415,475,984.93	546,573,395.56

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人公司董事杨玉萍女士因工作安排不再出任公司第四届董事会董事，公司股东平安信托有限责任公司根据《公司章程》推荐郭晓涛先生接替杨玉萍女士出任公司董事。经公司 2023 年第二次股东会审议，同意郭晓涛先生出任公司董事，杨玉萍女士不再担任公司董事。上述变更自 2023 年 3 月 17 日公司 2023 年第二次股东会做出决议之日起生效。

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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	2	-	-	-	-	-

注：1 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

2 本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国信证券	2,665,279,750.00	100.00	847,281,431,000.00	100.00	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期内本基金偏离度绝对值未出现超过 0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于平安日增利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	2023 年 01 月 04 日
2	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	2023 年 01 月 05 日
3	平安基金管理有限公司关于新增中国银河证券股份有限公司为平安日增利货币市场基金 B 类份额销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 05 日
4	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 14 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	2023 年 01 月 17 日
6	平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 19 日

	优惠的公告		
7	平安日增利货币市场基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 20 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁（杭州）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	2023 年 02 月 08 日
9	平安基金管理有限公司关于暂停上海爱建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	2023 年 02 月 09 日
10	关于暂停浦领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	2023 年 02 月 13 日
11	平安基金管理有限公司关于新增平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 15 日
12	平安基金管理有限公司关于新增平安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	2023 年 03 月 20 日
13	平安日增利货币市场基金 2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 31 日
14	平安基金管理有限公司关于新增华泰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	2023 年 03 月 31 日
15	平安日增利货币市场基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 22 日
16	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	2023 年 04 月 25 日
17	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享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	2023 年 05 月 12 日
18	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州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	2023 年 05 月 26 日
19	平安基金管理有限公司关于新增国信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 06 月 02 日
20	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通期货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	2023 年 06 月 08 日
21	平安日增利货币市场基金端午节假期前暂停申购、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	2023 年 06 月 20 日
22	平安基金管理有限公司关于新增中证金牛（北京）基金销售有限公司	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 06 月 27 日



	为旗下基金销售机构的公告		
--	--------------	--	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准平安日增利货币市场基金募集的文件
- (2) 平安日增利货币市场基金基金合同
- (3) 平安日增利货币市场基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务热线：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日