

平安日增利货币市场基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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..	12
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.....	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 债券回购融资情况.....	41
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.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	42
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	43

7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	43
7.9 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	51
10.9 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 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	128,549,090,899.99 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	121,064,357,067.33 份	7,484,733,832.66 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	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 26 楼

邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2021年1月1日-2021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	1,343,513,361.84	127,621,895.72
本期利润	1,343,513,361.84	127,621,895.72
本期净值收益率	1.0817%	1.2020%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	期末基金资产净值	121,064,357,067.33
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(2021年6月30日)	
	累计净值收益率	27.6230%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益，由于本基金采用

摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安日增利货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1672%	0.0006%	0.1125%	0.0000%	0.0547%	0.0006%
过去三个月	0.5196%	0.0008%	0.3413%	0.0000%	0.1783%	0.0008%
过去六个月	1.0817%	0.0010%	0.6788%	0.0000%	0.4029%	0.0010%
过去一年	2.0966%	0.0014%	1.3688%	0.0000%	0.7278%	0.0014%
过去三年	7.4894%	0.0017%	4.1100%	0.0000%	3.3794%	0.0017%
自基金合同生效起至今	27.6230%	0.0036%	10.3763%	0.0000%	17.2467%	0.0036%

平安日增利货币 B

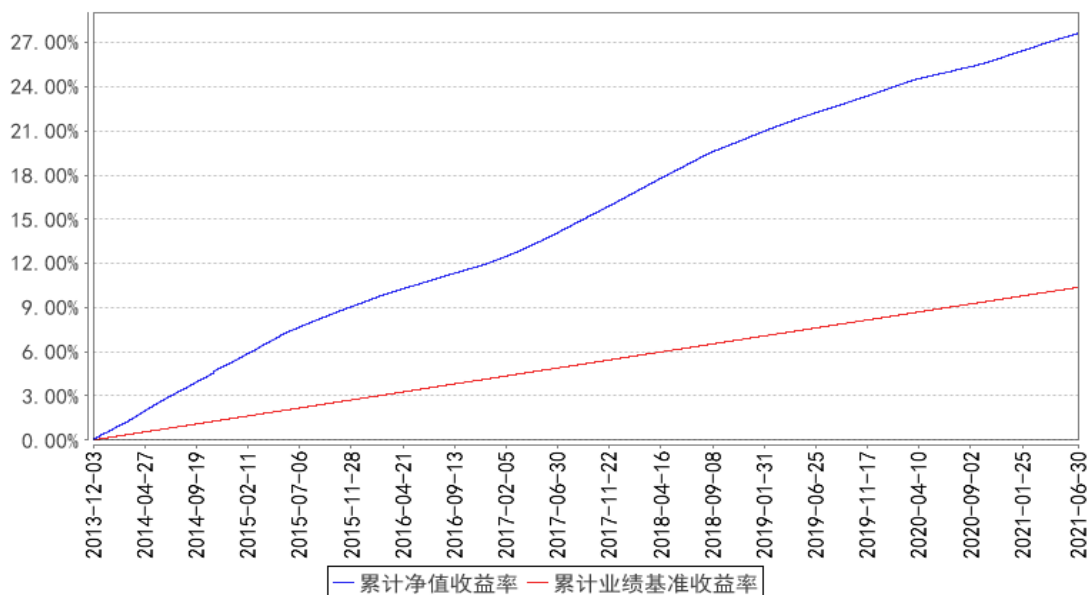
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1870%	0.0006%	0.1125%	0.0000%	0.0745%	0.0006%
过去三个月	0.5799%	0.0008%	0.3413%	0.0000%	0.2386%	0.0008%
过去六个月	1.2020%	0.0010%	0.6788%	0.0000%	0.5232%	0.0010%

自基金合同生效 起至今	1.9063%	0.0013%	1.0613%	0.0000%	0.8450 %	0.0013 %
----------------	---------	---------	---------	---------	-------------	-------------

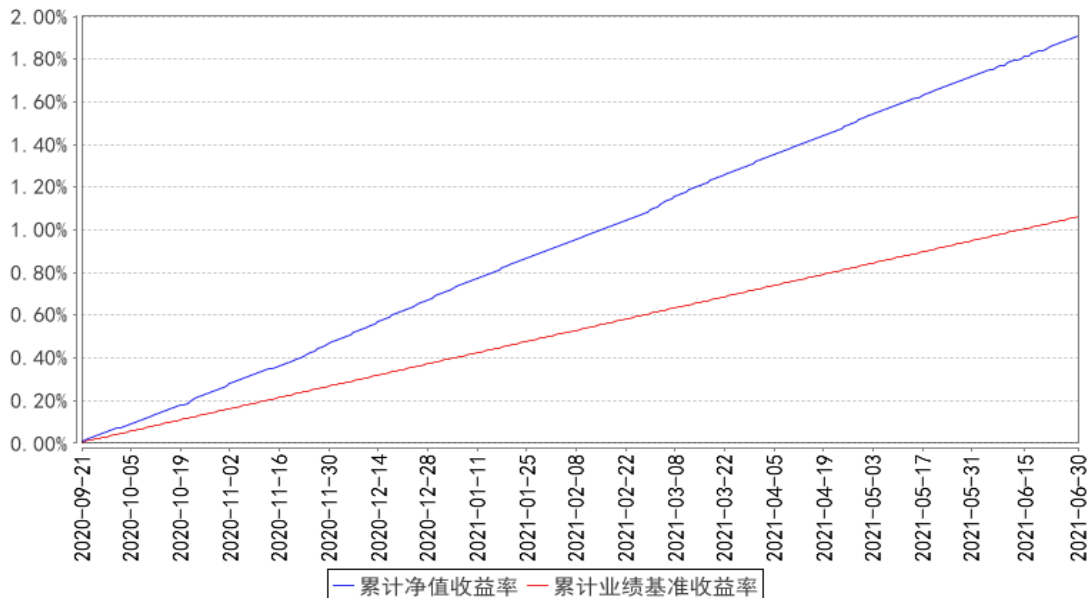
注：平安日增利 B 类份额“自基金合同生效日至今”指 2020 年 09 月 21 日至 2021 年 06 月 30 日

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

平安日增利货币 A 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安日增利货币 B 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效；

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

比例符合基金合同约定；

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

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。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、专户六大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2021 年 6 月 30 日，平安基金共管理 138 只公募基金，公募资产管理总规模约为 3,831 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		
田元强	平安日增利货币市场基金基金经理	2019 年 3 月 21 日	-	8 年	田元强先生，西安交通大学工商管理硕士，曾先后担任鹏元资信评估有限公司信用评级部分析师、生命保险资产管理有限公司信用评级部分析师、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。现担任平安交易型货币市场基金、平安 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安合信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠铭纯债债券型证券投资基金、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基金经理。
罗薇	平安日增利货币市场基金基金经理助理	2021 年 2 月 23 日	-	8 年	罗薇女士，新南威尔士大学金融会计学专业硕士，曾任红塔红土基金管理有限公司固定收益交易员、基金经理助理、基金经理，2020 年 11 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安日增利货币市场基金、平安交易型货币市场基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金基金经理助理。

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

上半年“出口+地产”双轮驱动推动经济稳健复苏，基建与制造业投资表现平稳，消费受疫情影响有所波动但仍在持续修复，上半年国内经济表现出良好的复苏态势。货币政策聚焦防风险和为经济复苏维持良好环境，流动性环境整体偏宽松。年初以来海外疫情波动与国内“碳中和”催动大宗商品价波动推动 PPI 快速上行，但 PPI 向 CPI 传导受阻，猪肉价格起到通胀“压舱石”作用，维持 CPI 处于低位。尽管对流动性收紧和对通胀预期升温的担忧对市场产生扰动，但综合而言，上半年债市收益率整体下行，短端资产收益率下行明显。报告期内，本基金的投资操作以流动性管理为基础原则，结合市场变化动态调整组合剩余期限、杠杆水平，调整大类资产的配置比例，以维护产品收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期平安日增利货币 A 的基金份额净值收益率为 1.0817%，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 1.2020%，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，融资受限对地产投资形成负面影响，海外供给恢复对国内出口形成挤出效应，而国内消费和制造业投资的修复相对平缓，综合而言，下半年经济存在结构性和周期性压力并存的局面。货币政策关注重点仍在中小企业和困难行业融资问题，预计流动性环境仍将保持宽松。经济承压之下，“稳增长”政策有望发力，上半年财政政策趋于紧缩，主要与地方政府控杠杆、防风险有关，下半年财政支出和债券发行有望加速。债券市场方面，当前股份制银行存单发行收益率已接近疫情前水平，在政策利率没有出现大幅下调的情况下，收益率下行空间有限，但考虑到基本面边际走弱，流动性易松难紧，收益率上行空间亦不大；预计下半年市场以震荡为主，货币基金不仅需要把握市场波动捕捉资产配置机会，也需要做好流动性风险管理。我们将继续稳健操作，力争在保障安全性、流动性的情况下，为客户创造良好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》

等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 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 1,471,135,257.56 元，实际分配收益 1,471,135,257.56 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	25,332,211,384.27	39,335,154,946.74
结算备付金		294,407,969.13	324,508,544.55
存出保证金		396,671.20	150,225.19
交易性金融资产	6.4.7.2	87,958,765,052.84	66,093,844,659.36
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		87,286,269,128.26	65,183,675,794.72
资产支持证券投资		672,495,924.58	910,168,864.64
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	24,469,821,979.74	19,526,534,149.80
应收证券清算款		91,653,217.54	111,488,987.29
应收利息	6.4.7.5	675,377,898.92	603,885,205.37
应收股利		-	-
应收申购款		2,263,511,573.94	8,396,885.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		141,086,145,747.58	126,003,963,603.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		12,317,994,829.13	7,823,760,704.57
应付证券清算款		134,883,454.67	110,027,135.35
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		36,909,452.41	34,242,556.16
应付托管费		8,947,746.03	8,301,225.72
应付销售服务费		25,499,977.28	24,338,255.46
应付交易费用	6.4.7.7	769,243.50	685,350.68

应交税费		2,123,009.07	2,031,335.71
应付利息		3,101,042.88	1,323,035.12
应付利润		6,668,325.10	8,656,679.43
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	157,767.52	279,000.00
负债合计		12,537,054,847.59	8,013,645,278.20
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	128,549,090,899.99	117,990,318,325.42
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		128,549,090,899.99	117,990,318,325.42
负债和所有者权益总计		141,086,145,747.58	126,003,963,603.62

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 128,549,090,899.99 份，其中平安日增利货币 A 基金份额总额 121,064,357,067.33 份，基金份额净值 1.0000 元。平安日增利货币 B 基金份额总额 7,484,733,832.66 份，基金份额净值 1.0000 元。

6.2 利润表

会计主体：平安日增利货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,939,960,201.14	1,617,094,818.24
1. 利息收入		1,891,524,273.08	1,550,888,223.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	516,559,127.36	225,318,020.68
债券利息收入		1,065,320,583.22	897,110,069.63
资产支持证券利息收入		13,398,249.86	59,616,506.73
买入返售金融资产收入		296,246,312.64	368,843,626.58
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		48,435,928.06	66,206,594.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	48,435,928.06	66,206,594.62
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-

股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以 “-”号填列)	6.4.7.18	-	-
减: 二、费用		468,824,943.58	430,497,451.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	221,671,691.67	193,317,044.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	53,738,591.90	46,864,738.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	155,183,497.66	146,452,306.72
4. 交易费用	6.4.7.19	-1,450.10	722.52
5. 利息支出		36,701,192.31	42,679,071.22
其中: 卖出回购金融资 产支出		36,701,192.31	42,679,071.22
6. 税金及附加		1,368,552.62	1,015,788.40
7. 其他费用	6.4.7.20	162,867.52	167,779.94
三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)		1,471,135,257.56	1,186,597,366.40
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以 “-”号填列)		1,471,135,257.56	1,186,597,366.40

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 平安日增利货币市场基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益(基金净 值)	117,990,318,325.42	-	117,990,318,325.42
二、本期经营活 动产生的基金 净值变动数(本 期利润)	-	1,471,135,257.56	1,471,135,257.56
三、本期基金份 额交易产生的 基金净值变动 数 (净值减少以 “-”号填列)	10,558,772,574.57	-	10,558,772,574.57

其中：1. 基金申购款	494,614,172,926.11	-	494,614,172,926.11
2. 基金赎回款	-484,055,400,351.54	-	-484,055,400,351.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,471,135,257.56	-1,471,135,257.56
五、期末所有者权益（基金净值）	128,549,090,899.99	-	128,549,090,899.99
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	108,306,221,675.33	-	108,306,221,675.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,186,597,366.40	1,186,597,366.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,422,308,954.50	-	-2,422,308,954.50
其中：1. 基金申购款	280,106,370,512.68	-	280,106,370,512.68
2. 基金赎回款	-282,528,679,467.18	-	-282,528,679,467.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,186,597,366.40	-1,186,597,366.40
五、期末所有者权益（基金净值）	105,883,912,720.83	-	105,883,912,720.83

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(以下简称“平安银行”)。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安日增利货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金,期限一年以(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:同期七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安日增利货币市场基金基金

合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,211,384.27
定期存款	25,330,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	3,700,000,000.00
存款期限 3 个月以上	21,630,000,000.00
其他存款	-
合计	25,332,211,384.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)	
债券	交易所市场	2,580,705,509.17	2,578,225,450.00	-2,480,059.17	-0.0019
	银行间市场	84,705,563,619.09	84,778,116,600.00	72,552,980.91	0.0564
	合计	87,286,269,128.26	87,356,342,050.00	70,072,921.74	0.0545
资产支持证券	672,495,924.58	674,995,100.00	2,499,175.42	0.0019	
合计	87,958,765,052.84	88,031,337,150.00	72,572,097.16	0.0565	

注：注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	11,470,000,000.00	-
银行间市场	12,999,821,979.74	-
合计	24,469,821,979.74	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	44,020.91
应收定期存款利息	212,334,731.27
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	119,235.24
应收债券利息	435,056,735.28
应收资产支持证券利息	14,315,088.87
应收买入返售证券利息	13,507,926.70
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	160.65
合计	675,377,898.92

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-

银行间市场应付交易费用	769,243.50
合计	769,243.50

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	157,767.52
合计	157,767.52

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安日增利货币 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	113,295,926,666.66	113,295,926,666.66
本期申购	446,901,759,871.16	446,901,759,871.16
本期赎回（以“-”号填列）	-439,133,329,470.49	-439,133,329,470.49
-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	121,064,357,067.33	121,064,357,067.33

平安日增利货币 B

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,694,391,658.76	4,694,391,658.76
本期申购	47,712,413,054.95	47,712,413,054.95
本期赎回（以“-”号填列）	-44,922,070,881.05	-44,922,070,881.05
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,484,733,832.66	7,484,733,832.66

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安日增利货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	1,343,513,361.84	-	1,343,513,361.84
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	-1,343,513,361.84	-	-1,343,513,361.84
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	127,621,895.72	-	127,621,895.72
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	-127,621,895.72	-	-127,621,895.72
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	1,272,480.32
定期存款利息收入	511,985,188.42
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,298,856.24
其他	2,602.38
合计	516,559,127.36

6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	48,435,928.06
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	48,435,928.06

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	102,275,327,424.85
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	101,315,767,962.52
减：应收利息总额	911,123,534.27
买卖债券差价收入	48,435,928.06

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	319,729,698.45
减：卖出资产支持证券成本总额	310,700,000.00
减：应收利息总额	9,029,698.45
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 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。

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	-1,450.10
合计	-1,450.10

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	89,260.15
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	600.00
合计	162,867.52

6.4.7.21 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司(“平安基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
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
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
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
大华银行(中国)有限公司(“大华银行”)	基金管理人股东的实际控制人控制的公司、基金销售机构
深圳平安汇通初创投资管理有限公司(“平安汇通初创”)	基金管理人的子公司的合营公司
上海陆金所基金销售有限公司(“陆金所”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
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
珠海亿融通资产管理有限公司(“珠海亿融通”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 的联营公司
珠海横琴平安钱进小额贷款有限公司(“平安钱进小贷”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳安创投资管理有限公司(“安创”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
深圳平安创科投资管理有限公司(“平安创科”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
大华银行有限公司(“大华银行有限公司”)	基金管理人股东的实际控制人

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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	221,671,691.67	193,317,044.86
其中：支付销售机构的客户维护费	42,610,517.09	16,089,047.28

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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	53,738,591.90	46,864,738.18

注：支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.08%/ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B	合计
大华银行	1.81	-	1.81
陆金所	2,517,613.26	-	2,517,613.26
平安基金	78,642,987.04	417,122.02	79,060,109.06
平安银行	18,557,526.62	64,227.27	18,621,753.89
平安证券	4,397.03	-	4,397.03
合计	99,722,525.76	481,349.29	100,203,875.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B	合计
大华银行	1.82	-	1.82
陆金所	196,754.23	-	196,754.23
平安基金	124,011,910.11	-	124,011,910.11
平安银行	594,154.93	-	594,154.93
平安证券	3,279.13	-	3,279.13

合计	124,806,100.22	-	124,806,100.22
----	----------------	---	----------------

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B
基金合同生效日（2013 年 12 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期间申购/买入总份额	170,228,290.07	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	170,228,290.07	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	-
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月	上年度可比期间 -

	30 日	
	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B
基金合同生效日（2013 年 12 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	19,453,704.86	-
报告期间申购/买入总份额	137,173,358.77	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	156,627,063.63	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

平安日增利货币 A

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
大华银行有限公司	206,125,219.15	0.1703	203,914,992.40	0.1800
平安不动产	41,710,483.26	0.0345	41,263,232.64	0.0364
平安好贷	20,460,348.14	0.0169	20,240,957.09	0.0179
平安汇通初创	-	-	793,040.30	0.0007
平安集团	-	-	495,458.49	0.0004
平安钱进小贷	66,478,002.51	0.0549	65,765,176.25	0.0580
平安人寿	589.51	0.0000	583.13	0.0000
珠海亿融通	2,909,810.28	0.0024	2,878,609.02	0.0025

份额单位：份

平安日增利货币 B

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）

安创	578,391.17	0.0077	571,508.86	0.0122
平安创科	1,251,429.69	0.0167	1,236,539.04	0.0263

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-	-	700,000,000.00	8,100,833.41
平安银行-活期	2,211,384.27	1,272,480.32	26,909,988.61	6,082,577.15

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2021 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人民币 10,470,971.87 元(2020 年上半年度：26,731,670.20 元)。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 16,400,000 张托管人平安银行的同业存单，账面价值为人民币 1,632,315,452.58 元，占基金资产净值的比例为 1.27%(2020 年 6 月 30 日：本基金持有 1,900,000 张托管人平安银行的同业存单，账面价值为人民币 189,522,292.73 元，占基金资产净值的比例为 0.18%)。

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
1,345,562,780.17	-	-2,049,418.33	1,343,513,361.84	-
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
127,560,831.72	-	61,064.00	127,621,895.72	-

注：本基金在本年度累计分配收益 1,471,135,257.56 元，其中以红利再投资方式结转入实收基

金 1,464,466,932.46 元，无包含于赎回款的已分配未支付收益，计入应付收益科目 6,668,325.10 元。

6.4.12 期末(2021 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 2021 年 6 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 11,396,067,829.13 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
112009320	20 浦发银行 CD320	2021 年 7 月 1 日	99.63	3,000,000	298,897,680.92
112009506	20 浦发银行 CD506	2021 年 7 月 1 日	99.59	115,000	11,452,431.03
112015469	20 民生银行 CD469	2021 年 7 月 1 日	99.85	1,250,000	124,810,058.91
112017165	20 光大银行 CD165	2021 年 7 月 1 日	99.74	3,000,000	299,233,511.99
112104032	21 中国银行 CD032	2021 年 7 月 1 日	97.44	3,000,000	292,333,108.41
112109212	21 浦发银行 CD212	2021 年 7 月 1 日	99.43	5,107,000	507,779,287.06
112110174	21 兴业银行 CD174	2021 年 7 月 1 日	98.47	5,000,000	492,346,592.17
112111116	21 平安银行 CD116	2021 年 7 月 1 日	99.86	3,192,000	318,750,761.50
112113117	21 浙商银行 CD117	2021 年 7 月 1 日	99.50	1,617,000	160,889,886.50
112115023	21 民生银	2021 年 7 月	98.40	1,957,000	192,565,346.87

	行 CD023	1 日			
112194713	21 苏州银行 CD075	2021 年 7 月 1 日	99.44	1,053,000	104,711,921.88
160312	16 进出 12	2021 年 7 月 1 日	100.26	500,000	50,131,335.27
180014	18 付息国债 14	2021 年 7 月 1 日	100.01	516,000	51,606,547.05
180412	18 农发 12	2021 年 7 月 1 日	100.42	439,000	44,083,397.02
190309	19 进出 09	2021 年 7 月 1 日	100.33	8,081,000	810,743,729.95
200010	20 付息国债 10	2021 年 7 月 1 日	100.01	4,041,000	404,127,734.59
200216	20 国开 16	2021 年 7 月 1 日	100.16	3,150,000	315,488,883.89
200314	20 进出 14	2021 年 7 月 1 日	100.21	1,354,000	135,683,510.53
200406	20 农发 06	2021 年 7 月 1 日	100.00	1,500,000	149,996,388.47
2103673	21 进出 673	2021 年 7 月 1 日	99.91	305,000	30,472,280.20
210401	21 农发 01	2021 年 7 月 1 日	100.16	500,000	50,082,130.00
210404	21 农发 04	2021 年 7 月 1 日	99.79	500,000	49,896,870.23
217707	21 贴现国开 07	2021 年 7 月 1 日	99.87	1,700,000	169,781,831.25
219917	21 贴现国债 17	2021 年 7 月 1 日	99.94	1,300,000	129,919,957.67
219921	21 贴现国债 21	2021 年 7 月 1 日	99.80	174,000	17,365,745.59
219922	21 贴现国债 22	2021 年 7 月 1 日	99.76	1,000,000	99,761,570.41
219924	21 贴现国债 24	2021 年 7 月 1 日	99.70	1,920,000	191,420,381.91
112087946	20 重庆银行 CD144	2021 年 7 月 2 日	99.32	5,000,000	496,594,285.01
112109020	21 浦发银行 CD020	2021 年 7 月 2 日	98.39	2,299,000	226,202,671.26
112115008	21 民生银行 CD008	2021 年 7 月 2 日	98.47	2,084,000	205,208,249.49
112196136	21 宁波银行 CD059	2021 年 7 月 2 日	99.36	796,000	79,088,059.26
180212	18 国开 12	2021 年 7 月	100.31	5,000,000	501,550,010.80

		2 日			
180412	18 农发 12	2021 年 7 月 2 日	100.42	1,061,000	106,543,244.27
190309	19 进出 09	2021 年 7 月 2 日	100.33	3,419,000	343,018,538.88
210206	21 国开 06	2021 年 7 月 2 日	99.98	2,669,000	266,835,438.43
112008331	20 中信银行 CD331	2021 年 7 月 5 日	100.00	6,000,000	600,000,000.00
112115025	21 民生银行 CD025	2021 年 7 月 5 日	98.39	1,909,000	187,828,082.62
140373	14 进出 73	2021 年 7 月 5 日	100.72	2,000,000	201,446,277.27
200015	20 付息国 债 15	2021 年 7 月 5 日	100.32	2,000,000	200,642,973.48
210201	21 国开 01	2021 年 7 月 5 日	100.01	1,951,000	195,120,883.14
210301	21 进出 01	2021 年 7 月 5 日	100.05	3,100,000	310,148,334.83
219920	21 贴现国 债 20	2021 年 7 月 5 日	99.28	1,062,000	105,431,225.14
160015	16 付息国 债 15	2021 年 7 月 6 日	100.03	1,500,000	150,037,893.95
160218	16 国开 18	2021 年 7 月 6 日	100.53	2,300,000	231,216,784.12
190202	19 国开 02	2021 年 7 月 6 日	100.33	2,028,000	203,463,399.80
190212	19 国开 12	2021 年 7 月 6 日	100.10	2,100,000	210,218,950.91
200010	20 付息国 债 10	2021 年 7 月 6 日	100.01	2,459,000	245,916,876.85
219910	21 贴现国 债 10	2021 年 7 月 6 日	99.65	2,300,000	229,183,846.14
219921	21 贴现国 债 21	2021 年 7 月 6 日	99.80	638,000	63,674,400.49
219925	21 贴现国 债 25	2021 年 7 月 6 日	99.07	1,900,000	188,241,498.35
112015573	20 民生银行 CD573	2021 年 7 月 7 日	98.58	3,000,000	295,727,382.77
112107004	21 招商银行 CD004	2021 年 7 月 7 日	98.54	497,000	48,975,857.64
112107072	21 招商银行 CD072	2021 年 7 月 7 日	97.56	1,400,000	136,588,799.13
112115041	21 民生银	2021 年 7 月	98.90	2,000,000	197,796,702.43

	行 CD041	7 日			
112181742	21 天津银行 CD231	2021 年 7 月 8 日	98.09	1,954,000	191,658,931.21
合计				119,697,000	11,922,692,478.94

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 921,927,000.00 元，截至 2021 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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%。

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 63.29%（上年末：50.49%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种（企业债或短期融资券），并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于本期末，本基金前 10 名份额持有人的合计占比为 5.32%，本基金投资组合的平均剩余期限为 88 天，平均剩余存续期为 88 天。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	24,382,211,384.27	950,000,000.00	-	-	-	25,332,211,384.27
结算备付金	294,407,969.13	-	-	-	-	294,407,969.13
存出保证金	396,671.20	-	-	-	-	396,671.20
交易性金融资产	70,213,621,039.93	17,745,144,012.91	-	-	-	87,958,765,052.84
买入返售金融资产	24,469,821,979.74	-	-	-	-	24,469,821,979.74
应收利息	-	-	-	-	675,377,898.92	675,377,898.92
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	2,263,511,573.94	2,263,511,573.94
应收证券清算款	-	-	-	-	91,653,217.54	91,653,217.54
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	119,360,459,044.27	18,695,144,012.91	-	-	3,030,542,690.40	141,086,145,747.58
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	36,909,452.41	36,909,452.41
应付托管费	-	-	-	-	8,947,746.03	8,947,746.03
应付证券清算款	-	-	-	-	134,883,454.67	134,883,454.67
卖出回购金融资产款	12,317,994,829.13	-	-	-	-	12,317,994,829.13
应付销售服务费	-	-	-	-	25,499,977.28	25,499,977.28
应付交易费用	-	-	-	-	769,243.50	769,243.50
应付利息	-	-	-	-	3,101,042.88	3,101,042.88
应付利润	-	-	-	-	6,668,325.10	6,668,325.10
应交税费	-	-	-	-	2,123,009.07	2,123,009.07
其他负债	-	-	-	-	157,767.52	157,767.52
负债总计	12,317,994,829.13	-	-	-	219,060,018.46	12,537,054,847.59
利率敏感度缺口	107,042,464,215.14	18,695,144,012.91	-	-	2,811,482,671.94	128,549,090,899.99
上年度末 2020 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	39,335,154,946.74	-	-	-	-	39,335,154,946.74

	46.74					
结算备付金	324,508,544.55	-	-	-	-	324,508,544.55
存出保证金	150,225.19	-	-	-	-	150,225.19
交易性金融资产	55,553,250,413.14	10,540,594,246.22	-	-	-	66,093,844,659.36
买入返售金融资产	19,526,534,149.80	-	-	-	-	19,526,534,149.80
应收利息	-	-	-	-	603,885,205.37	603,885,205.37
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	8,396,885.32	8,396,885.32
应收证券清算款	-	-	-	-	111,488,987.29	111,488,987.29
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	114,739,598,279.42	10,540,594,246.22	-	-	723,771,077.98	126,003,963,603.62
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	34,242,556.16	34,242,556.16
应付托管费	-	-	-	-	8,301,225.72	8,301,225.72
应付证券清算款	-	-	-	-	110,027,135.35	110,027,135.35
卖出回购金融资产款	7,823,760,704.57	-	-	-	-	7,823,760,704.57
应付销售服务费	-	-	-	-	24,338,255.46	24,338,255.46
应付交易费用	-	-	-	-	685,350.68	685,350.68
应付利息	-	-	-	-	1,323,035.12	1,323,035.12
应付利润	-	-	-	-	8,656,679.43	8,656,679.43
应交税费	-	-	-	-	2,031,335.71	2,031,335.71
其他负债	-	-	-	-	279,000.00	279,000.00
负债总计	7,823,760,704.57	-	-	-	189,884,573.63	8,013,645,278.20
利率敏感度缺口	106,915,837,574.85	10,540,594,246.22	-	-	533,886,504.35	117,990,318,325.42

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	45,041,645.74	29,980,990.98
	市场利率上升 25 个基点	-44,956,423.84	-29,913,059.84

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，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

6.4.14 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	87,958,765,052.84	62.34
	其中：债券	87,286,269,128.26	61.87
	资产支持证 券	672,495,924.58	0.48
2	买入返售金融资产	24,469,821,979.74	17.34
	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	25,626,619,353.40	18.16
4	其他各项资产	3,030,939,361.60	2.15
5	合计	141,086,145,747.58	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	1.84	
	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	12,317,994,829.13	9.58
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	88
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	74

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本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	33.54	9.69
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	17.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	22.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	28.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	107.47	9.69

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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,138,245,516.07	1.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,596,196,526.09	3.58
	其中：政策性金融债	4,465,281,087.21	3.47
4	企业债券	2,608,869,011.74	2.03
5	企业短期融资券	28,247,694,138.10	21.97
6	中期票据	3,072,882,271.87	2.39
7	同业存单	46,622,381,664.39	36.27
8	其他	-	-
9	合计	87,286,269,128.26	67.90
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	112113117	21 浙商银行 CD117	18,000,000	1,790,982,038.98	1.39
2	190309	19 进出 09	11,500,000	1,153,762,268.83	0.90
3	200010	20 附息国债 10	6,500,000	650,044,611.44	0.51
4	112008331	20 中信银行 CD331	6,000,000	600,000,000.00	0.47
5	112109212	21 浦发银行 CD212	5,500,000	546,854,528.85	0.43
6	180212	18 国开 12	5,000,000	501,550,010.80	0.39
7	112111123	21 平安银行 CD123	5,000,000	500,000,000.00	0.39
8	112111116	21 平安银行 CD116	5,000,000	499,296,305.60	0.39
9	112003126	20 农业银行 CD126	5,000,000	499,105,145.96	0.39
10	112113088	21 浙商银行 CD088	5,000,000	499,072,029.64	0.39

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0934%
报告期内偏离度的最低值	-0.0138%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0566%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	169585	20 花 04A1	1,870,000	187,000,000.00	0.15
2	169515	弘花 05A	670,000	67,000,000.00	0.05
3	138918	招慧 09A	600,000	59,999,447.39	0.05
4	137116	20 睿成 01	560,000	56,000,000.00	0.04
5	179252	20 天圆 04	530,000	53,000,000.00	0.04
6	137115	20 合信 05	520,000	52,000,000.00	0.04
7	137137	链融 30A1	500,000	50,000,000.00	0.04
8	137597	天著优 11	380,000	38,000,000.00	0.03
9	137222	中借 05A	350,000	35,000,000.00	0.03
10	137647	21 弘基 1A	350,000	35,000,000.00	0.03

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

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

上海银保监局于 2020 年 8 月 10 日做出沪银保监银罚决字（2020）12 号处罚决定，由于上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）：1. 未按专营部门制规定开展同业业务；2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3. 延迟支付同业投资资金吸收存款；4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制；6. 个人消费贷款贷后管理未尽职；7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模；8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；9. 办理无真实贸易背景的贴现业务；10. 委托贷款资金来源审查未尽职；11. 未按权限和程序办理委托贷款业务；12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务。根据相关规定对公司罚款 2100 万元。

上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 5 月至 2019 年 1 月期间，未按规定开展代销业务，中国银行保险监督管理委员会上海监管局根据相关规定作出沪银保监罚决字（2021）29 号处罚决定，要求公司责令改正，并处罚款共计 760 万元。

国家外汇管理局北京外汇管理部于 2020 年 8 月 25 日做出京汇罚（2020）17 号处罚决定，由于中信银行股份有限公司（以下简称“公司”）存在以下违法违规行为：违规办理内保外贷业务；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；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理售汇业务；违反外汇账户管理规定。根据相关规定对公司给予警告，没收违法所得 14857527.66 元人民币，并处 1177.04 万元人民币罚款。

中国人民银行于 2021 年 2 月 5 日作出银罚字〔2021〕1 号处罚决定，由于中信银行股份有限公司（以下简称“公司”）：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；3. 未按规定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。根据相关规定对公司罚款 2890 万元。

中信银行股份有限公司（以下简称“公司”）因违反《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、《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 3 月 17 日作出银保监罚决字〔2021〕5 号处罚决定，对公司罚款 450 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 7 月 13 日作出银保监罚决字〔2020〕36 号处罚决定，由于中国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）向关系人发放信用贷款（二）批量处置不良资产未公告（三）批量处置不良资产未向监管部门报告（四）违规转让正常类贷款（五）个人住房贷款首付比例违规（六）流动资金贷款被用于固定资产投资（七）超过实际需求发放流动资金贷款（八）贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发（九）贷款用于偿还银行承兑汇票垫款（十）承兑业务贸易背景审查不严（十一）保理业务授权管理不到位（十二）贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人（十三）贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金（十四）信贷资金用于兑付到期理财资产（十五）信贷资金用于承接承销债券（十六）销售非保本理财产品违规出具承诺函（十七）提供与事实不符的报告（十八）理财产品相互交易、相互调节收益（十九）面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资（二十）将系统内资金纳入一般存款核算，虚增存款（二十一）开立同业银行结算账户不合规（二十二）个别人员未经核准即履行高管人员职责（二十三）对小微企业不当收费（二十四）未按规定报送案件。根据相关规定没收公司违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 7 日作出银保监罚决字〔2020〕66 号处罚决定，由于中国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”）：收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）。根据相关规定没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 1 月 19 日作出银保监罚决字〔2021〕1 号处罚决定，由于中国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）发生重要信息系统突发事件未报告；（二）制卡数据违规明文留存；（三）生产网络、分行无线互联网络保护不当；（四）数据安全管理工作较粗放，存在数据泄露风险；（五）网络信息系统存在较多漏洞；（六）互联网门户网站泄露敏

感信息。根据相关规定罚款 420 万元。

银保监会于 2020 年 7 月 13 日作出银保监罚决字（2020）16 号处罚决定，由于浙商银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）关联交易未经关联交易委员会审批；（二）未严格执行关键岗位轮岗制度；（三）对上海分行理财业务授权混乱；（四）以保险类资产管理公司为通道，违规将存放同业款项倒存为一般性存款；（五）通过保险资管计划协助他行将存放同业款项转为一般性存款；（六）通过投资他行一般企业存单收益权的方式为他行虚增一般性存款；（七）以投资虚假底层债权并要求客户以存单质押的方式虚增存款；（八）黄金租赁业务未按监管要求计提风险加权资产；（九）不良资产虚假出表；（十）信贷资产虚假转让，违规削减信贷规模；（十一）向资金掮客销售私募信贷资产证券化产品次级份额，并以该次级份额受益权为质押溢价开立信用证；（十二）向资金掮客虚假代销信托产品，并以代销的信托产品收益权质押开立无真实贸易背景的信用证；（十三）债券主承销业务未按规定纳入统一授信管理；（十四）为个人提供以股票质押的融资不审慎；（十五）违规向客户提供融资用于参与定向增发；（十六）通过同业票据不当交易规避信贷规模管控；（十七）违规以投资代替贴现，少计风险加权资产；（十八）以类资产证券化方式开展信贷资产转让，少计风险加权资产；（十九）以存放同业质押并指令交易对手以委托投资的方式收购本行资产，实现资产虚假出表；（二十）向他行卖出债券并承诺回购，少计风险加权资产；（二十一）通过特殊目的载体向他行存款并提供质押担保，由他行向本行授信客户提供融资；（二十二）同业投资接受金融机构回购承诺；（二十三）购买银行违规发行的同业委托投资计划用于承接该银行资产，并接受信用担保；（二十四）同业投资承接他行资产并接受他行存单质押担保；（二十五）通过违规发售理财产品实现本行资产虚假出表；（二十六）通过违规发售理财产品帮助交易对手实现资产虚假出表；（二十七）转让理财资产违规提供回购承诺；（二十八）理财资金违规用于保险公司增资；（二十九）违规向土地储备机构融资；（三十）向房地产开发企业提供融资，用于偿还股东垫付的土地出让金；（三十一）通过理财非标投资向房地产开发企业提供融资，用于缴纳土地出让金。根据相关规定对公司罚款 10120 万元。

国家开发银行违反《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，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 25 日做出银保监罚决字（2020）67 号处罚决定，罚款 4880 万元。

国家开发银行海南省分行因擅自提供对外担保，违反《中华人民共和国外汇管理条例》（中华人民共和国国务院令 532 号）第四十三条相关规定，国家外汇管理局海南省分局于 2021 年 3 月 3 日作出琼汇检罚（2021）2 号处罚决定，对该分行给予警告，处人民币 4266.16 万元的罚款。

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，

对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	396,671.20
2	应收证券清算款	91,653,217.54
3	应收利息	675,377,898.92
4	应收申购款	2,263,511,573.94
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,030,939,361.60

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	48,925,258	2,474.48	4,314,851,548.96	3.56	116,749,505,518.37	96.44
平安	65	115,149,751.27	7,484,733,832.66	100.00	-	-

日增利货币 B						
合计	48,925,318	2,627.46	11,799,585,381.62	9.18	116,749,505,518.37	90.82

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	2,000,000,000.00	1.56
2	银行类机构	1,156,129,629.92	0.90
3	信托类机构	841,250,089.08	0.65
4	银行类机构	603,358,286.87	0.47
5	银行类机构	502,428,114.80	0.39
6	银行类机构	458,952,332.20	0.36
7	银行类机构	353,698,909.92	0.28
8	银行类机构	304,604,844.13	0.24
9	银行类机构	302,348,795.77	0.24
10	券商类机构	301,883,982.35	0.23
10	券商类机构	301,883,982.35	0.23

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	1,154,148.35	0.0010
	平安日增利货币 B	-	-
	合计	1,154,148.35	0.0009

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、基金投资和研究人员、部门负责人持有本开	平安日增利货币 A	10~50
	平安日增利货币 B	0

开放式基金		
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	平安日增利货币 A	0~10
	平安日增利货币 B	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安日增利货币 A	平安日增利货币 B
基金合同生效日 (2013 年 12 月 3 日) 基金份额总额	525,531,640.49	-
本报告期期初基金 份额总额	113,295,926,666.66	4,694,391,658.76
本报告期基金总申 购份额	446,901,759,871.16	47,712,413,054.95
减: 本报告期基金 总赎回份额	439,133,329,470.49	44,922,070,881.05
本报告期基金拆分 变动份额 (份额减 少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金 份额总额	121,064,357,067.33	7,484,733,832.66

§ 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

2021 年 3 月 2 日, 王金涛担任平安基金管理有限公司总经理助理。

2021 年 1 月 26 日, 根据工作安排, 陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日, 平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁 (主持工作)。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内, 本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

注：1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	3,029,894,720.00	100.00%	457,685,809,000.00	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 2020 年 12 月 31 日基金净值公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 01 日
2	平安日增利货币市场基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
3	平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
4	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 27 日
5	平安日增利货币市场基金春节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 02 月 05 日
6	平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 05 日
7	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 12 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 16 日
9	平安日增利货币市场基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 31 日
10	平安基金管理有限公司关于新增中国中金财富证券有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 06 日
11	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 09 日
12	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 12 日
13	平安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、定期定额投资起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 15 日
14	平安日增利货币市场基金 2021 年第	中国证监会规定报刊及	2021 年 04 月 22 日

	1 季度报告	网站	
15	平安日增利货币市场基金劳动节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 23 日
16	平安基金管理有限公司关于终止与深圳市小牛基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 27 日
17	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 18 日
18	平安日增利货币市场基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
19	平安日增利货币市场基金招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
20	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 02 日
21	关于终止苏州财路基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 03 日
22	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 07 日
23	平安基金管理有限公司关于暂停北京加和基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 21 日
24	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日
25	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

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

平安基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日