

# 平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:平安证券股份有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期:2022 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划（以下简称：本计划）管理人的董事会及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。

本计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本计划合同规定，于2022年8月5日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本计划资产，但不保证本计划一定盈利。

本计划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计划的招募说明书。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》，本计划于2022年6月24日合同变更生效。本计划按照《基金法》及其他有关规定，参照公募基金管理运作。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年06月24日起至2022年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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	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>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	15
6.3 净资产(基金净值)变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
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.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 “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.....	39
7.7 期末按公允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.....	40
7.8 投资组合报告附注.....	40
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41

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.....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	43
10.9 其他重大事件.....	43
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>44</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 .....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	44
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>44</b>
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	44
12.3 查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划
基金简称	平安现金宝现金管理
基金主代码	970172
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 06 月 24 日
基金管理人	平安证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	14,941,274,818.75 份
基金合同存续期	-

### 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，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	通过研究宏观经济指标、财政政策、货币政策和市场资金供求等因素，结合历史与经验数据，对未来一段时间的货币市场利率进行研究预判，根据研究结果确定各类资产配置的比例和期限，并根据市场变化动态调整投资组合。 具体策略：资产配置策略、骑乘策略、杠杆投资策略、类属和品种配置策略等。
业绩比较基准	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	本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

### 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		平安证券股份有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	李薇	陈晨
	联系电话	0755-23997814	010-50938723
	电子邮箱	liweip@pasc.com.cn	chenc@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95511-8	4008-058-058
传真		0755-82408101	-
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层	北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址	深圳市福田区益田路平安金融中心南塔 23 层	北京市西城区锦什坊街 26 号
邮政编码	518033	100033
法定代表人	何之江	于文强

## 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="https://stock.pingan.com/">https://stock.pingan.com/</a>
基金中期报告备置地点	广东省深圳市福田区益田路平安金融中心南塔 23 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安证券股份有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	3,300,125.31
本期利润	3,300,125.31
本期净值收益率	0.0205%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2022 年 06 月 30 日）
期末基金资产净值	14,941,274,818.75
期末基金份额净值	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2022 年 06 月 30 日）
累计净值收益率	0.0205%

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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，所以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。

## 3.2 基金净值表现

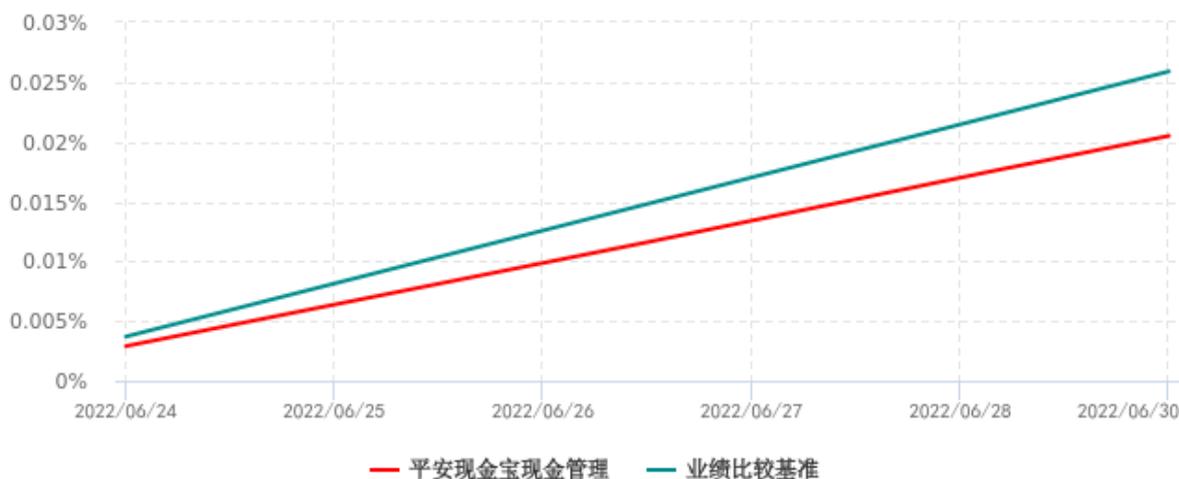
### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金合同 生效起至今	0.0205%	0.0001%	0.0259%	0.0000%	-0.0054 %	0.0001%

### 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

平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收  
益率历史走势对比图

(2022年06月24日-2022年06月30日)



注：本集合计划净值表现从 2022 年 6 月 24 日合同生效日开始计算，相关数据时段为：2022 年 6 月 24 日至 2022 年 6 月 30 日。

## § 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

平安证券股份有限公司（以下简称“平安证券”），是中国平安保险（集团）股份有限公司旗下重要成员，前身为 1991 年 8 月创立的平安保险证券业务部。根据中国人民银行于 1995 年 10 月 23 日下发的《关于成立平安证券有限责任公司的批复》（银复[1995]368 号），平安证券于 1996 年 7 月取得中华人民共和国国家工商行政管理局核发的《企业法人营业执照》（第 1000001002345 号），平安证券正式成立。

平安证券以先进的金融科技为基础，依托行业领先的互联网平台和高效的线下业务网络，凭借资产获取和产品制造方面的强大实力，为客户提供包括互联网财富管理、企业及机构证券服务以及投资管理的全方位金融产品及服务，打造平安综合金融战略下智能化证券服务平台。

截至 2021 年 12 月 31 日，平安证券注册资本为 138 亿元，净资产为 425.77 亿元，总资产为 2,533.68 亿元。

截至 2022 年 6 月 30 日，平安证券资产管理总规模达到 3,383.11 亿元（含专项计划），根据中国证券投资基金业协会的统计数据，2022 年 1 季度平安证券资产管理月均规模为 1,705 亿元（不含专项计划）。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱燕琼	投资经理	2022-06-24	-	8 年	朱燕琼，现任平安证券资产管理事业部公募团队投资经理，北京大学经济学硕士。2013 年-2014 年就职于埃克森美孚（中国）投资有限公司，担任财务分析师。2014 年-2017 年就职于兴业信托，担任资产管理部投资经理。2017 年加入平安证券资产管理事业部，自 2017 年 8 月 31 日起至今担任平安证券现金宝集合资产管理计划、平安证券稳健资本一号集合资产管理计划（已更名为平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划）投资经理。
姜杰特	投资经理	2022-06-24	-	8 年	姜杰特，现任平安证券资产管理事业部公募团队投资经理，华东师范大学金融硕士。2014 年 7 月至 2015 年 10 月就职于江海证券有限公司，担任债券融资承做经理，2015 年 11 月加入平安证券股份有限公司，曾任固定收益投资经理助理。自 2017 年 9 月 28 日起至今担任平安证券稳健资本一号 7 期集合资产管理计划（已更名为平安证券安赢添利半年滚动持有债

					券型集合资产管理计划) 投资经理。自 2017 年 9 月 28 日起至 2019 年 7 月 10 日担任平安证券橙明 1 号集合资产管理计划投资经理、平安证券橙明 2 号集合资产管理计划、平安证券橙明 3 号集合资产管理计划投资经理。自 2017 年 9 月 28 日起至 2018 年 12 月 25 日担任平安证券橙明 4 号集合资产管理计划投资经理。自 2017 年 9 月 28 日起至 2018 年 11 月 7 日担任平安证券橙金 1 号集合资产管理计划投资经理。自 2018 年 3 月 12 日起至 2018 年 11 月 25 日担任平安证券安稳 1 号集合资产管理计划投资经理。自 2020 年 3 月 6 日起至今担任平安证券现金宝集合资产管理计划投资经理 (已更名为平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划)。
--	--	--	--	--	---

#### 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：本集合计划的投资经理不存在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

报告期内，管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等有关法律法规及本计划资产管理合同、招募说明书等有关法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本计划资产，在控制风险的前提下，为本计划持有人谋求最大利益。报告期内，本计划运作合法合规，不存在损害本计划持有人利益的行为。

#### 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

管理人通过建立完善规范、合规的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析等手段，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度等，建立集中交易管理机制，并重视交易执行环节的公平交易措施，以时间优

先、价格优先作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，确保公平对待各投资组合。报告期，管理人公平交易制度总体执行情况良好，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本集合计划不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的其他资管计划所有投资组合参与的交易所公开竞价中，同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 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

上半年债券市场呈现区间震荡的走势：1 月份受央行降息和鸽派表态的推动，收益率明显下行；但是 2 月份公布的 1 月份信贷社融数据明显超预期，市场从宽货币预期走向宽信用担忧，带动收益率回升至降息前水平；随后市场在 2 月份金融数据、1-2 月份经济数据、俄乌冲突、房地产政策放松、国内疫情增长等消息下反复摆动，3 月收益率呈现小幅震荡走势；4 月上海等地疫情封控措施升级，市场对货币政策加码和基本面预期悲观，资金利率显著下行，收益率有所下行，曲线走陡，4 月 15 日降息落空，且降准幅度小于市场预期，债市出现回调；5 月资金面维持宽松，资金价格大幅低于政策利率，收益率继续下行，月末疫情好转、复工复产加速导致市场调整；6 月，疫情管控松动、宽信用预期强化，市场再度修正了对经济复苏的前景判断，以及股市走高，风险偏好边际抬升，债市情绪转向谨慎，长端明显上行。整体看，1 年国债到期收益率下行 29bp 至 1.95%，1 年 AAA 中短期票据到期收益率下行 34bp 至 2.41%，1 年 AAA 存单到期收益率下行 32bp 至 2.28%。

本报告期内，本集合计划以同业存单、同业存款、AAA 评级信用短券、短期逆回购为主要的投资标的，基于对资金面及负债端变化预判，积极调整组合仓位、杠杆及剩余期限，在短端资产收益率过低时控制久期和仓位，待市场调整时，适时拉长组合剩余期限。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末平安现金宝现金管理基金份额净值为 1.000 元，本报告期内，基金份额净值收益率为 0.0205%，同期业绩比较基准收益率为 0.0259%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，6 月高频数据继续改善，疫情后经济底部修复，整体对债市偏负面。不过其可持续性存在分歧，中长期经济内生增长动力不足，反复的疫情对企业、居民资产负债表损伤较大，加上海外经济体开始进入衰退期，经济修复不会一蹴而就。货币政策总体基调仍然是“以我为主”，流动性总量预计维持充裕略高水平，资金面短期内大幅收紧的概率有限，仍未成为限制收益率上行的

有利支撑。后续关注高频经济动态、增量财政政策。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划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集合计划合同关于估值的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划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。

本集合计划管理人设有估值委员会，估值委员会负责对投资品种的估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制。估值委员会成员具有丰富的从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或产品估值运作等方面的专业胜任能力。本集合计划投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本集合计划管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司按约定提供固定收益品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

自资产管理合同生效日起，本集合计划根据每日计划收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在分红日根据实际净收益按月集中支付；本集合计划收益“每日分配、按月支付”，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额）。

#### 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

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满二百人或者资产净值低于五千万元的情形。

### § 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，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，对本集合计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划费用开支等方面进行监督和复核，未发现本集合计划管理人存在损害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、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

## § 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：平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	3,276,430,291.84
结算备付金		40,079,530.55
存出保证金		779,901.03
交易性金融资产	6.4.7.2	10,550,444,609.84
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		10,550,444,609.84
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	6.4.7.3	1,290,437,230.92

债权投资（若有）		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资（若有）		-
其他权益工具投资（若有）		-
应收清算款		129,558,711.93
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		15,287,730,276.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 06 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		208,500,000.00
应付清算款		130,019,051.74
应付赎回款		-
应付管理人报酬		2,812,585.52
应付托管费		656,791.72

应付销售服务费		781,273.74
应付投资顾问费		-
应交税费		275,809.55
应付利润		3,303,592.27
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.4	106,352.82
负债合计		346,455,457.36
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.5	14,941,274,818.75
其他综合收益（若有）		-
未分配利润	6.4.7.6	-
净资产合计		14,941,274,818.75
负债和净资产总计		15,287,730,276.11

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1 元，基金份额总额 14,941,274,818.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		7,316,031.04
1. 利息收入		2,455,314.87
其中：存款利息收入	6.4.7.7	1,789,828.27
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		675,656.26
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-10,169.66
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,860,716.17
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.8	4,890,946.92
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-
其他投资收益		-30,230.75
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-
<b>减：二、营业总支出</b>		4,015,905.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,812,585.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	156,254.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	781,273.74
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		250,205.51
其中：卖出回购金融资产支出		250,205.51

6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		4,848.04
8. 其他费用	6.4.7.9	10,738.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,300,125.31</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,300,125.31</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>3,300,125.31</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 （若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	16,371,905,598.99	-	-	16,371,905,598.99
加：会计政策变更（若有）	-	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-	-
其他（若有）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	16,371,905,598.99	-	-	16,371,905,598.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,430,630,780.24	-	-	-1,430,630,780.24
（一）、综合收益总额	-	-	3,300,125.31	3,300,125.31
（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）	-1,430,630,780.24	-	-	-1,430,630,780.24
其中：1. 基金申购款	8,432,394,795.66	-	-	8,432,394,795.66
2. 基金赎回款	-9,863,025,575.90	-	-	-9,863,025,575.90

（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）	-	-	-3,300,125.31	-3,300,125.31
（四）、其他综合收益结转留存收益（若有）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	14,941,274,818.75	-	-	14,941,274,818.75

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：

何之江	何瑜	刘国永
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

平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由原平安证券现金宝集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来，原集合计划为现金管理产品，于 2013 年 4 月 3 日经中国证券业协会中证协函【2013】286 号备案确认，自 2012 年 12 月 27 日起开始募集并于 2013 年 3 月 15 日结束募集，于 2013 年 3 月 18 日成立。

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》、《货币市场基金监督管理办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》、《现金管理产品运作管理指引》的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。2022 年 6 月 24 日，本集合计划经中国证券监督管理委员会《关于准予平安证券现金宝集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]649 号文）变更。《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划资产管理合同》自管理人公告的生效之日起生效，原《平安证券现金宝集合资产管理合同》同日起失效。

本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

本集合计划投资于以下金融工具：

- 1、现金；
- 2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；
- 3、期限在 1 个月以内的债券回购；
- 4、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；
- 5、中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本集合计划投资于前款第 4 项的，其中企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级均应当为最高级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。信用评级主要参照最近一个会计年度的信用评级，发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级。如因债项评级调整等管理人之外的因素，致使本集合计划投资范围不符合上述规定，管理人应在 10 个交易日内调整，中国证监会另有规定的除外。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了财政部《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本集合计划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

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 06 月 24 日起至 2022 年 06 月 30 日的经营成果和资产净值变动情况。

#### 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

本集合计划财务报表所载财务信息根据企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间自 2022 年 06 月 24 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本集合计划核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时划分为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本集合计划将持有的债券投资于初始确认时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；将其他金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划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。本集合计划初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于本集合计划的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益，直至分红期末按累计收益除以累计份额确定实际分配的收益率，分红期内遇银行存款提前解付的，按调整后利率预提收益，同时冲减前期已经预提的收益；买入返售金融资产以成本列示，按约定利率在实际持有期间内逐日预提收益；债券投资以买入成本列示，按票面利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法进行摊销，每日预提损益，为了避免采用“摊余成本法”计算的计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，集合计划管理人于每一估值日，采用估值技术，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。对于卖出回购金融资产款、应付款项和其他金融负债，采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本集合计划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；(3)该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划估值采用“摊余成本法”，并通过计算暂估收益率的方法每日确认各类金融工具的暂估收益：

(1) 银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益，直至分红期末按累计收益除以累计份额确定实际分配的收益率；分红期内遇银行存款提前解付的，按调整后利率预提收益，同时冲减前期已经预提的收益；

(2) 回购交易以成本列示，按约定利率在实际持有期间内逐日预提收益；

(3) 债券以买入成本列示，按票面利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法进行摊销，每日预提损益；

(4) 为了避免采用“摊余成本法”计算的计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，集合计划管理人于每一估值日，采用估值技术，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的集合计划资产净值与“摊余成本法”计算的集合计划资产净值负偏离度绝对值达到 0.25%时，管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内，当正偏离度绝对值达到 0.5%时，管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止资产管理合同进行财产清算等措施，并履行信息披露义务；

(5) 如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(6) 相关法律法规以及监管部门、自律规则另有规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如管理人或托管人发现集合计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，集合计划资产净值、每万份集合计划暂估净收益及七日年化暂估收益率计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对每万份集合计划暂估净收益及七日年化暂估收益率的计算结果对外予以公布。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资或资产支持证券投资的公允价值：

(1) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信

息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

同时满足下列条件的，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。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。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于本计划申购确认日及本计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括本计划转换所引起的转入本计划的实收基金增加和转出本计划的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

收入是本集合计划在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本集合计划、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的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；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益/（损失）卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(5) 公允价值变动收益/（损失）系本集合计划持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(6) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.9 费用的确认和计量

对于本集合计划合同约定费率和计算方法的费用，在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

对于本集合计划的其他金融负债在持有期间确认的利息支出，以实际利率法逐日确认，实际利率法与直线法差异较小的以直线法近似计算。

#### 6.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划每份集合计划份额享有同等分配权；

(2) 本集合计划收益“每日分配、按月支付”，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额）；

(3) 本计划采用 1.00 元固定份额净值交易方式（法律法规另有规定的情形除外），自资产管理合同生效日起，本集合计划根据每日计划收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在分红日根据实际净收益按月集中支付；当分红日实际每万份集合计划净收益和七日年化收益率与暂估值有差异时，管理人向投资者说明造成差异的具体原因；

(4) 本集合计划根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 收益月度支付时，如投资者的累计实际未结转收益为正，则为集合计划份额持有人增加相应的集合计划份额；如投资者的累计实际未结转收益等于零时，集合计划份额持有人的集合计划份额保持不变；如投资者的累计实际未结转收益为负，则为份额持有人缩减相应的份额；遇投资者剩余份额不足以扣减的情形，管理人将根据内部应急机制保障集合计划平稳运行；

(6) 投资者赎回集合计划份额时，于当期月度分红日支付对应的收益；

(7) 投资者解约情形下，管理人将按照同期中国人民银行公布的活期存款基准利率对该投资人进行收益分配；

(8) 当日申购的集合计划份额自下一个工作日起，享有本集合计划的收益分配权益；当日赎回的集合计划份额自下一个工作日起，不享有本集合计划的收益分配权益；

(9) 在不违反法律法规、资产管理合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，管理人可调整集合计划收益的分配原则和支付方式，不需召开集合计划份额持有人大会；

(10) 如需召开集合计划份额持有人大会，为确保集合计划份额持有人的表决权体现其持有的权益，管理人将于以登记机构在权益登记日登记的份额体现投资人持有的权益；

(11) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 6.4.4.11 外币交易

本报告期间本集合计划不涉及外币交易。

#### 6.4.4.12 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本集合计划目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期间本集合计划无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 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

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

本集合计划按相关税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

#### 6.4.6.1 增值税

根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，通知自 2018 年 1 月 1 日起施行。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。

本集合计划分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.6.2 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

#### 6.4.6.3 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 2022 年 06 月 30 日
活期存款	6,816,611.70
等于：本金	6,798,376.84
加：应计利息	18,234.86
减：坏账准备（若有）	-
定期存款	552,753,541.75
等于：本金	550,000,000.00
加：应计利息	2,753,541.75
减：坏账准备（若有）	-
其中：存款期限 1 个月以内	300,038,333.34
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	252,715,208.41
其他存款	2,716,860,138.39
等于：本金	2,714,584,459.77
加：应计利息	2,275,678.62
减：坏账准备（若有）	-
合计	3,276,430,291.84

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 06 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	2,651,705,655.50	2,653,542,096.34	1,836,440.84	0.0123
	银行间市场	7,898,738,954.34	7,904,853,597.28	6,114,642.94	0.0409
	合计	10,550,444,609.84	10,558,395,693.62	7,951,083.78	0.0532
资产支持证券		-	-	-	-
合计		10,550,444,609.84	10,558,395,693.62	7,951,083.78	0.0532

## 6.4.7.3 买入返售金融资产

## 6.4.7.3.1 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 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	360,078,205.68	-
银行间市场	930,359,025.24	-
合计	1,290,437,230.92	-

## 6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 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	89,117.78
其中：交易所市场	-
银行间市场	89,117.78
应付利息	-
预提费用-审计费	7,935.04
预提费用-账户维护费	9,300.00
合计	106,352.82

## 6.4.7.5 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	16,371,905,598.99	16,371,905,598.99
本期申购	8,432,394,795.66	8,432,394,795.66
本期赎回（以“-”号填列）	-9,863,025,575.90	-9,863,025,575.90
本期末	14,941,274,818.75	14,941,274,818.75

## 6.4.7.6 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,300,125.31	-	3,300,125.31

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	-3,300,125.31	-	-3,300,125.31
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	13,952.15
定期存款利息收入	167,735.03
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,619.39
其他	1,595,521.70
合计	1,789,828.27

#### 6.4.7.8 债券投资收益

##### 6.4.7.8.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	4,817,421.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	73,525.81
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	4,890,946.92

##### 6.4.7.8.2 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 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,931,667,608.54
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,908,191,507.38
减：应计利息总额	23,402,575.35
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	73,525.81

#### 6.4.7.9 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	306.88
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他费用	10,431.28
合计	10,738.16

#### 6.4.7.10 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本集合计划目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 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，本计划无需要披露的或有事项。

##### 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，本计划无需要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

本集合计划本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

##### 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
平安证券股份有限公司	管理人、销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	托管人

#### 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：报告期内，本集合计划无股票关联交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

注：报告期内，本集合计划无权证关联交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
平安证券	230,577,800.00	100.00%

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
平安证券	1,656,430,000.00	100.00%

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,812,585.52
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.9% 计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{管理费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

如果以 0.90% 的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率，管理人将调整管理费为 0.25%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，管理人方可恢复计提 0.90% 的管理费。管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托

管人于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	156,254.76

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的【0.05】%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 【0.05】\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：对于本集合计划每日应收取的销售服务费以【0.25】%的年费率按其持有的前一日集合计划资产净值进行计算。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 【0.25】\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送销售服务费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给注册登记机构或管理人，经注册登记机构或管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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：报告期内本集合计划未发生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

##### 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

关联方名称	本期末 2022 年 06 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
姜学红	150,353.41	0.0010%
王承亮	77,496.99	0.0005%
于春洪	1,388.92	0.0000%

## 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	6,816,611.70	13,952.15

## 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：报告期内本集合计划未发生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

本报告期内，本集合计划未涉及其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

单位：人民币元

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
-	91,293,985.82	-87,993,860.51	3,300,125.31	-

注：自资产管理合同生效日起，本集合计划根据每日计划收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在分红日根据实际净收益按月集中支付；本集合计划收益“每日分配、按月支付”，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额）。

## 6.4.12 期末（2022 年 06 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：本集合计划期末未持有流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划期末未持有流通受限证券。

#### 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

注：本集合计划当期未参与银行间市场债券正回购。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本计划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 208,500,000.00 元，于 2022 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本计划在回购期内持有的证券交易所的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，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

本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定范围之内。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

管理人将风险管理视为经营管理活动和业务活动的核心内容之一，以建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系，确保整体风险可测、可控、可承受，保障持续、稳定经营为风险管理目标，优化风险管理架构，完善风险政策制度体系，规范风险管理全流程，健全风险管理系统和工具，丰富风险管理手段。管理人通过采取定性和定量相结合的风险管理方法，对业务活动中的各类风险进行识别、评估与计量、应对与处置、监测与报告。在风险可控前提下实现风险与收益的平衡，促进公司各类业务稳健发展。

管理人持续推进与自身战略相一致的、全面的风险管理架构体系，形成了由董事会及下设的风险控制委员会、经理层及风险管理委员会、风险管理职能部门及各业务部门的风险管理组织架构体系。董事会承担全面风险管理最终责任，经理层承担全面风险管理主要责任，各业务部门及分支机构、风险管理职能部门、稽核监察部构成风险管理三道防线，建立多层次、相互衔接、有效制衡的运行机制，持续监控管理各类风险。此外，管理人采取派驻式风险管理组织架构，在各事业部内嵌设置风险管理团队，资管派驻风险管理团队前置负责资管业务投前评估和审批、投中监控和沟通、投后检视和汇报，敏捷支持资管各类业务风险管理。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。管理人搭建了完善的信用风险管理体系，建立了覆盖投前投中投后全流程的管理要求及标准，投前有效识别和评估、重点防范问题债券入池，投中实时测算债券投资相关限制要求，投后加强对于债券监控预警。投前严格准入，坚守质量底线，目前管理人建立了科学的内部信用评级管理机制，评级结果在信用债投资全流程中有效运用。债券投前按照先入池后投资的原则，在获取有效债券内部评级，严格履行内部准入审批程序入池，同时，债券投资需满足管理人内部限额管理、公平交易及价格偏离相关规范要求，在发行人授信额度限额、各类集中度限额及价格合理偏离范围内开展。投中依托系统对各项准入标准、集中度指标、审批授权、价格偏离等管理要求实时监控预警，确保债券交易中符合投前准入标准、符合各项额度要求且交易价格公允，交易结束后通过各投资组合价差监控分析确保各投资组合债券投资活动公平对待。投后持续加强风险应对和处置能力，通过持续的限额监控、舆情监控、债券池定期检视、债券内部评级跟踪、债券风险分类分级管理等，及时发现风险债券，并匹配相应的应对处置措施。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 06 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	1,794,789,677.77
合计	1,794,789,677.77

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 06 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	6,017,631,207.77
合计	6,017,631,207.77

##### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 06 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	2,738,023,724.30
合计	2,738,023,724.30

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指未能以合理价格及时变现产品资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人要求赎回其持有的集合计划份额，另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。

管理人已建立贯穿产品生命周期的流动性风险管理机制，根据产品投资策略、估值方法、历史申购与赎回数据、销售渠道、投资者类型、投资者结构、投资者风险偏好与潜在的流动性要求、基础市场环境等多种因素，审慎评估各类资产的流动性。产品设计过程中，根据产品风险评级、开放周期和频率，对产品运作进行审慎管理，及时调整；投资过程中，根据投资品种的流动性特点、产品流动性要求在投资过程中合理配置资产，充分考虑投资变现时的难易程度；交易过程中，做好产品资金头寸管理，每日检查产品头寸安排，监控流动性缺口情况；监控产品申购赎回情况，加强与客户沟通，防范产品流动性风险。

管理人定期或在遇到市场出现重大变化、公司进行重大创新、内部出现重大风险情况或风险事件时，开展流动性风险压力测试，建立流动性风险应急管理措施，及时应对与化解流动性风险。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划管理人在集合计划运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易。本集合计划管理人建立了科学的资产负债管理和头寸管理机制，并通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

本集合计划主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致集合计划收益水平发生变化，产生风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，本集合计划投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,023,715 ,083.43	102,306,9 44.78	150,408,2 63.63	-	-	-	3,276,4 30,291. 84

结算备付金	40,079,530.55	-	-	-	-	-	40,079,530.55
存出保证金	779,901.03	-	-	-	-	-	779,901.03
债权投资	681,290,490.98	4,812,637,635.01	5,056,516,483.85	-	-	-	10,550,444,609.84
买入返售金融资产	1,290,437,230.92	-	-	-	-	-	1,290,437,230.92
应收清算款	-	-	-	-	-	129,558,711.93	129,558,711.93
资产总计	5,036,302,236.91	4,914,944,579.79	5,206,924,747.48	-	-	129,558,711.93	15,287,730,276.11
负债							
卖出回购金融资产款	208,500,000.00	-	-	-	-	-	208,500,000.00
应付清算款	-	-	-	-	-	130,019,051.74	130,019,051.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,812,585.52	2,812,585.52
应付托管费	-	-	-	-	-	656,791.72	656,791.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	781,273.74	781,273.74
应付交易费用	-	-	-	-	-	89,117.78	89,117.78
应交税费	-	-	-	-	-	275,809.55	275,809.55
应付利润	-	-	-	-	-	3,303,592.27	3,303,592.27
其他负债	-	-	-	-	-	17,235.04	17,235.04
负债总计	208,500,000.00	-	-	-	-	137,955,457.36	346,455,457.36
利率敏感度缺口	4,827,802,236.91	4,914,944,579.79	5,206,924,747.48	-	-	-8,396,745.43	14,941,274,818.75

## 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。本集合计划不涉及境外投资，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

其他价格风险是指以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项影响，也可能来源于证券市场整体波动影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 06 月 30 日
第一层次	-
第二层次	10,550,444,609.84
第三层次	-
合计	10,550,444,609.84

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本集合计划分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 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，其账面价值接近于公允价值。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (1.1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (1.2) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 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。

##### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2022 年 06 月 30 日，本集合计划持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为人民币 10,550,444,609.84 元，无属于于第一或第三层级的余额。

##### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本集合计划分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## § 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	10,550,444,609.84	69.01
	其中：债券	10,550,444,609.84	69.01
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	1,290,437,230.92	8.44
	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	3,316,509,822.39	21.69
4	其他各项资产	130,338,612.96	0.85
5	合计	15,287,730,276.11	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.66	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	208,500,000.00	1.40
	其中：买断式回购融资	-	-

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：报告期内，本集合计划未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情形。

## 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	94
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	78

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：报告期内，本集合计划未出现投资组合平均剩余期限超过 120 天情况。

### 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(天数)	各期限资产占基金资产净值	各期限负债占基金资产净值
----	------------	--------------	--------------

		的比例(%)	的比例(%)
1	30 天以内	34.30	2.27
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	16.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	15.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	32.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	102.32	2.27

#### 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：报告期内，本集合集合未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况。

#### 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,239,468,969.12	14.99
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	695,913,585.58	4.66
5	企业短期融资券	921,979,375.28	6.17
6	中期票据	675,451,472.09	4.52
7	同业存单	6,017,631,207.77	40.28
8	其他	-	-
9	合计	10,550,444,609.84	70.61
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 “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	0.0539%
报告期内偏离度的最低值	0.0442%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0485%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内，本集合计划未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内，本集合计划未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 7.7 期末按公允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：期末本集合计划未投资资产支持证券。（请投资确认）

### 7.8 投资组合报告附注

#### 7.8.1 基金计价方法说明

本集合计划估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。

#### 7.8.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本集合计划投资前十名证券的发行主体在本报告期内未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。

#### 7.8.3 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	779,901.03
2	应收清算款	129,558,711.93
3	应收利息	-
4	应收申购款	-

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	130,338,612.96

## § 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

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
176,003	84,892.16	25,553,981 .87	0.17%	14,915,711 ,925.77	99.83%

### 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）	占上市总份额比例
1	个人	108,963,489.74	0.73%
2	个人	40,894,687.73	0.27%
3	个人	35,340,649.40	0.24%
4	个人	34,146,324.48	0.23%
5	个人	29,659,197.93	0.20%
6	个人	28,285,357.17	0.19%
7	个人	20,532,910.28	0.14%
8	个人	20,318,578.52	0.14%
9	个人	20,249,324.88	0.14%
10	个人	18,837,285.13	0.13%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	7,971,102.45	0.0533%

### 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	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	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 06 月 24 日）基金份额总额	16,371,905,598.99
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8,432,394,795.66
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	9,863,025,575.90
本报告期末基金份额总额	14,941,274,818.75

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无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

报告期内，本集合计划管理人、托管人的专门托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及管理人、集合计划财产、托管人基金托管业务的重大诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划未发生投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本集合计划未发生改聘会计师事务所的情形。

### 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

本报告期内本集合计划管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

## 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	
平安证券	3	-	-	-	-	-

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
平安证券	230,577,800.00	100.00%	1,656,430,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：报告期内，本集合计划未出现偏离度绝对值超过 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	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划资产管理合同及招募说明书提示性公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-06-21
2	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划资产管理合同	基金电子披露网站及管理人网站	2022-06-21
3	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划招募说明书	基金电子披露网站及管理人网站	2022-06-21
4	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划托管协议	基金电子披露网站及管理人网站	2022-06-21
5	平安证券现金宝集合资产管理计划变更生效暨平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划资产管理合同生效公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-06-24

6	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划_2022 年基金产品资料概要（更新）	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-06-24
7	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划_2022 年开放日常申购、赎回业务公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-06-24
8	平安证券股份有限公司关于旗下现金宝现金管理型集合资产管理计划销售机构的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-06-24
9	关于平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划调整“快速取现业务”额度的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-06-24

## § 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：报告期间本集合计划未出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内本集合计划无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1)《关于准予平安证券现金宝集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函 [2022]649 号)；
- (2)《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划资产管理合同》
- (3)《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划招募说明书》
- (4)《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划托管协议》
- (5)《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划资产管理合同生效公告》
- (6) 管理人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路平安金融中心南塔 23 层。

### 12.3 查阅方式

- (1) 书面查阅：可在营业时间于管理人文件存放地点免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- (2) 网络查阅：管理人网站 <https://stock.pingan.com/>。

平安证券股份有限公司  
二〇二二年八月三十日