

# 平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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:2023 年 03 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、本集合计划）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。

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2023年3月28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。

本报告中财务资料经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计。

本报告期自2022年06月24日起至2022年12月31日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	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.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 债券回购融资情况.....	40
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	40
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	41
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	42

8.8 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 .....	42
8.9 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	44
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	44
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
11.4 基金投资策略的改变 .....	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	46
11.9 其他重大事件 .....	46
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	48
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
13.1 备查文件目录 .....	48
13.2 存放地点 .....	49
13.3 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	15,386,011,133.87 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	本集合计划投资策略包括：资产配置策略、杠杆投资策略、骑乘策略、类属和品种配置策略。
业绩比较基准	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	liwei@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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://stock.pingan.com/">https://stock.pingan.com/</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	97,543,957.75
本期利润	97,543,957.75
本期净值收益率	0.5867%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末
期末基金资产净值	15,386,011,133.87
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2022 年末
累计净值收益率	0.5867%

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

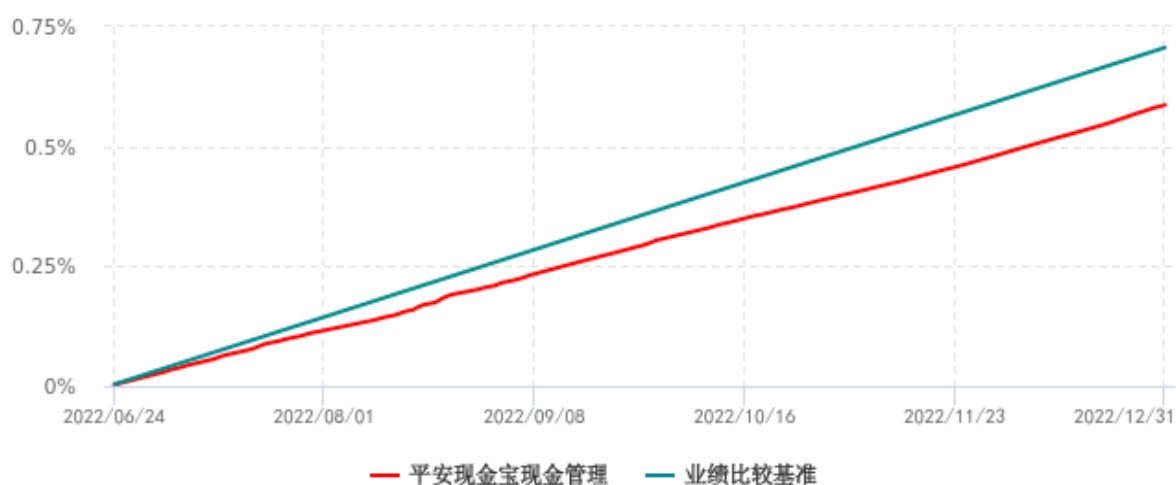
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		④		
过去三个月	0.2817%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	-0.0586%	0.0004%
过去六个月	0.5661%	0.0007%	0.6805%	0.0000%	-0.1144%	0.0007%
自基金合同生效起至今	0.5867%	0.0007%	0.7064%	0.0000%	-0.1197%	0.0007%

### 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

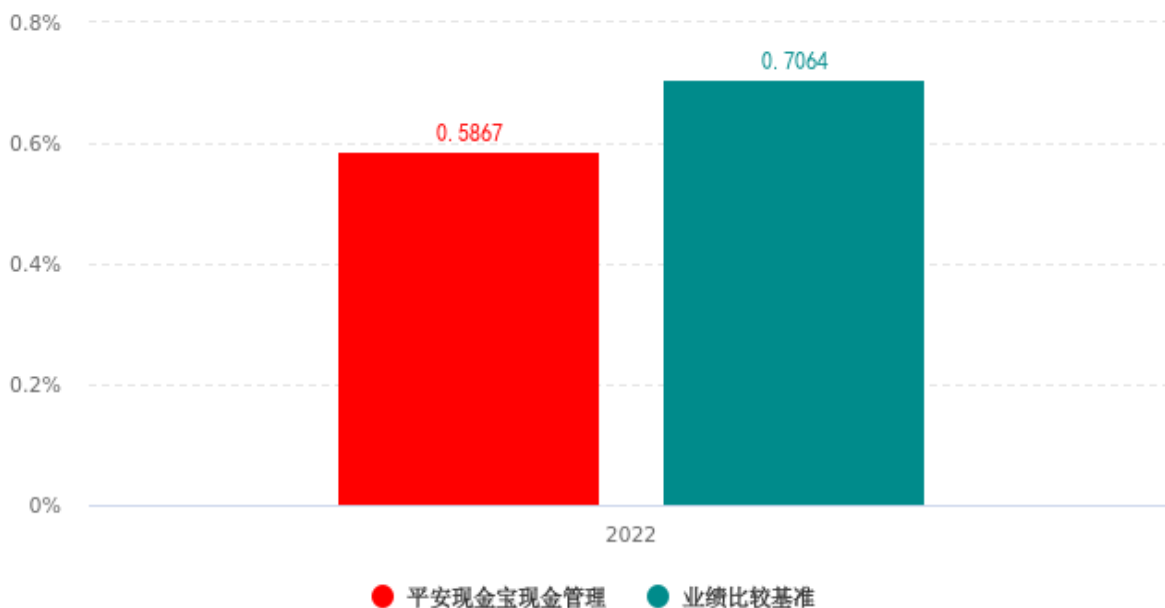
平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年06月24日-2022年12月31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 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2022	94,752,623.40	-	2,791,334.35	97,543,957.75	-
合计	94,752,623.40	-	2,791,334.35	97,543,957.75	-

## § 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 2022 年 12 月 31 日，平安证券注册资本为 138 亿元，净资产为 443.42 亿元，总资产为 2448.26 亿元。

截至 2022 年 9 月，平安证券资产管理总规模达到 3687 亿元（含专项计划），行业排名第 9。根



据中国证券投资基金业协会的统计数据，2022 年 3 季度平安证券资产管理月均规模为 1716 亿元（不含专项计划），行业排名第 12。

#### 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		
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)。
朱娟	投资经理	2022-09-14	-	7 年	朱娟，现任资产管理事业部投资经理，硕士学历。2016 年 7 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 2020 年 4 月 20 日起至 2021 年 5 月 6 日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。2022 年 7 月 25 日至 2022 年 9 月 1 日担任平安证券弘利信享 1 号集合资产管理计划投资经理。自 2022 年 9 月 14 日起至今担任平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划投资经理。
朱燕琼	投资经理	2022-06-24	2022-07-15	8 年	-

注：原共同管理本计划的投资经理朱燕琼已于 2022 年 7 月 15 日离任并公告。

#### 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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，结合本公司实际情况，制定了《公平交易管理制度》，主要内容包括投资决策、交易执行和交易行为等的内部控制和监控，规范范围包括但不限于境内外股票、基金、债券及衍生品的一级及二级市场投资交易等投资管控活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节。

公司严格遵守法律法规及公平交易制度的相关规定，公平对待所管理的不同投资组合，对投资交易行为进行监控、分析、评估、核查，监督投资交易的过程和结果，保证公平交易原则的实现，防范可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 4.3.2 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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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，未发现本计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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

回顾 2022 年，债市收益率窄幅震荡后 V 型反转，具体来看：

上半年，长端收益率在 20bp 内窄幅震荡。1 月受央行降息和鸽派表态的推动，收益率明显下行。但是 2 月公布的 1 月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 月金融数据、1-2 月经济数据、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。进入 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。但 4 月 15 日降息落空，且降准幅度低于预期，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 月初上海等地疫情管控松动、宽信用预期强化，市场再度修正了对经济复苏的前景判断，叠加股市走高，风险偏好边际抬升，债市情绪转向谨慎，长端明显上行。该阶段，10 年国债收益率上行 5bp 至 2.82%。

7-10 月，利率下行为主。7 月资金面极度宽松、疫情局部反复、断贷风波发酵、增量刺激政策有限，收益率转为下行。8 月中旬央行超预期降息 10bp，带动收益率快速下行，10 年国债创下 2.58% 年内低点。但随着流动性边际收敛，地产政策密集出台，叠加止盈需求，9 月利率转为大幅上行。不过，十一后疫情反复，经济复苏力度不足，利率整体开始下行。该阶段，10 年国债收益率下行 18bp 至 2.64%。

11-12 月，债市大幅调整。进入 11 月份后，资金面明显收敛；防疫优化叠加地产支持政策频出，市场对基本面预期转向乐观，债市大幅调整并引发银行理财集中赎回负反馈。10 年期国债收

收益率大幅上行 28bp 至 2.92%，创年内新高。12 月中，疫情管控放开初期新冠病毒传播进入高峰期，经济弱现实压制下风险偏好回落；加上央行连续大额投放维稳年末流动性，买方情绪提振，收益率出现回落。该阶段，10 年国债收益率上行 19bp 至 2.84%。

全年来看，国债长、短端表现分化，短端下行，而长端上行；利差层面，信用利差先降后升，10 年国开、国债利差压缩显著。1 年期国债、国开债、AAA 中票收益率分别下行 15bp、8bp、4bp；长端表现分化，10 年国债收益率上行 6bp，10 年国开债收益率下行 9bp。

投资操作层面，报告期内，本基金在短端资产收益率过低时控制久期和仓位，防御利率上行；待利率回调后，年末等时点适度加大了对存单、高等级信用债、长期限逆回购资产的配置，拉长组合久期。货币宽松基调下，保持杠杆策略，严控融资成本，以提高组合的综合收益。此外，在做好流动性管理的前提下，丰富盈利来源，适度进行存单、高等级信用债波段交易，增厚组合收益。

#### 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 0.5867%，同期业绩比较基准收益率为 0.7064%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，防疫政策的转向和宽信用政策的不断推动将继续推动国内经济基本面的复苏，债市对此已有部分定价，市场的不确定性在于复苏的强度以及货币政策的应对。一致预期转向的阶段大概率已经过去，未来债市波动的斜率将有所放缓，而复苏的强度和对应的货币政策又可能受制于居民收入预期、地产投资、出口等因素的制约。短期内在数据真空阶段，关注资金面和风险偏好变化。投资策略方面，不做信用下沉，将继续结合负债端情况，在短端利率冲高时，加大对同业存单、高等级信用债、存款的配置力度，保持组合高流动性的同时锁定收益；并通过波段、骑乘交易，增厚组合收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护计划份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对资产管理计划运作的内部监察稽核。公司稽核监察部按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，对公司大集合资管业务内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，定期制作监察稽核报告。公司稽核监察部通过检查本集合计划相关主要人员的变动情况、公司股东情况、投资及决策架构、制度体系建设、人员及行为规范、投资运作、销售管理、后台运营、风险准备金使用等，对本集合计划的整体运作情况进行监督检查，防范公司在本集合计划内部管理及投资账户运作中存在的风险，及时提出改进意见。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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）。

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

报告期内，本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了监督和复核，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第 60799556_H02 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 6 月 24 日（集合计划合同变更生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2022 年 6 月 24 日（集合计划合同变更生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项

	(如适用), 并运用持续经营假设, 除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险, 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	乌爱莉	乔贝贝
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2023-03-28	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	3,469,064,687.26
结算备付金		130,176,005.69
存出保证金		823,660.71
交易性金融资产	7.4.7.2	13,057,969,553.87
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		13,057,969,553.87
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	7.4.7.3	1,150,225,955.33
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		100,059,616.45
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.4	120,960.00
资产总计		17,908,440,439.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>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		2,406,362,857.01
应付清算款		96,148,123.89
应付赎回款		-
应付管理人报酬		14,187,279.30
应付托管费		788,182.16
应付销售服务费		980,526.49
应付投资顾问费		-
应交税费		928,005.47



应付利润		2,793,242.88
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.5	241,088.24
负债合计		2,522,429,305.44
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.6	15,386,011,133.87
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.7	-
净资产合计		15,386,011,133.87
负债和净资产总计		17,908,440,439.31

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 15,386,011,133.87 份。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		207,986,548.97
1. 利息收入		83,341,548.39
其中：存款利息收入	7.4.7.8	59,932,555.99
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		23,408,992.4
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		124,645,000.58
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.9	124,645,000.58
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		-
其他投资收益		-
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>		110,442,591.22
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	78,232,895.18
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,346,271.96
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	11,019,881.61
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		16,544,294.46
其中：卖出回购金融资产支出		16,544,294.46
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		195,939.70
8. 其他费用	7.4.7.10	103,308.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		97,543,957.75
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		97,543,957.75
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		97,543,957.75

### 7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	16,371,905,598.99	-	-	16,371,905,598.99
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）	16,371,905,598.99	-	-	16,371,905,598.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-985,894,465.12	-	-	-985,894,465.12
（一）、综合收益总额	-	-	97,543,957.75	97,543,957.75
（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）	-985,894,465.12	-	-	-985,894,465.12
其中：1. 基金申购款	207,932,642,221.93	-	-	207,932,642,221.93
2. 基金赎回款	-	-	-	-

	208,918,536,687.05			208,918,536,687.05
(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)	-	-	-97,543,957.75	-97,543,957.75
(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)	15,386,011,133.87	-	-	15,386,011,133.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

何之江	何瑜	文波
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

平安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。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）准予变更。《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 2022 年 6 月 24 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。

本集合计划为契约型开放式，本集合计划自合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为平安证券股份有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司或接受平安证券股份有限公司委托代为办理登记业务的机构。托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

本集合计划为货币型集合资产管理计划，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。

本集合计划主要投资于：现金；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；期限在 1 个月以内的债券回购；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、超短期融资券以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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。

本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 12 月 31 日的财务状况以及自 2022 年 6 月 24 日（集合计划合同变更生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和资产净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本集合计划合同于 2022 年 6 月 24 日变更生效，故本报告期为自 2022 年 6 月 24 日起至 2022 年 12 月 31 日止期间，本报告期的财务报表及报表附注均无上年同期对比数据。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

###### (2) 金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以

外，本集合计划的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

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

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

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

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

当本集合计划不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本集合计划直接减记该金融资产的账面余额。

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

本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本集合计划既没

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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

本集合计划采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率法计算的集合计划资产净值与按其他可参考公允价值指标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，采用其他可参考公允价值指标，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当按实际利率法计算确定的集合计划资产净值与影子定价确定的集合计划资产净值产生重大偏离，集合计划管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使集合计划资产净值更能公允地反映集合计划资产价值。

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

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的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变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本集合计划接受相关服务的期间计入当期损益。

#### 7.4.4.10 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) 本集合计划采用 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。

#### 7.4.4.11 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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。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。

#### 7.4.6.4 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。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

本集合计划按照相关法律法规要求应缴纳的个人所得税税额已由本集合计划管理人平安证券依照相关法律法规要求代扣代缴。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	3,368,959,687.26
等于：本金	3,366,125,321.14

加：应计利息	2,834,366.12
减：坏账准备	-
定期存款	100,105,000.00
等于：本金	100,000,000.00
加：应计利息	105,000.00
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	100,105,000.00
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,469,064,687.26

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	1,660,236,110.91	1,656,888,180.85	-3,347,930.06	-0.0218
	银行间市场	11,397,733,442.96	11,389,404,402.75	-8,329,040.21	-0.0541
	合计	13,057,969,553.87	13,046,292,583.60	-	-0.0759
				11,676,970.27	
资产支持证券		-	-	-	-
合计		13,057,969,553.87	13,046,292,583.60	-	-0.0759
				11,676,970.27	

## 7.4.7.3 买入返售金融资产

## 7.4.7.3.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,150,225,955.33	-
银行间市场	-	-
合计	1,150,225,955.33	-

## 7.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 7.4.7.4 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	120,960.00
合计	120,960.00

## 7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	211,788.24
其中：交易所市场	-
银行间市场	211,788.24
应付利息	-
预提费用	29,300.00
合计	241,088.24

## 7.4.7.6 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 12 月 31 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	207,932,642,221.93	207,932,642,221.93
本期赎回（以“-”号填列）	-208,918,536,687.05	-208,918,536,687.05
本期末	15,386,011,133.87	15,386,011,133.87

## 7.4.7.7 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	97,543,957.75	-	97,543,957.75

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	-97,543,957.75	-	-97,543,957.75
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.8 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 12 月 31 日
活期存款利息收入	57,411,926.65
定期存款利息收入	2,158,984.94
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	353,572.18
其他	8,072.22
合计	59,932,555.99

#### 7.4.7.9 债券投资收益

##### 7.4.7.9.1 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 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	117,132,231.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,512,769.40
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	124,645,000.58

##### 7.4.7.9.2 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 12 月 31 日
----	--

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,169,027,179.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,003,765,157.43
减：应计利息总额	157,749,252.45
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	7,512,769.40

#### 7.4.7.10 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 12 月 31 日
审计费用	12,371.84
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	64,258.97
账户维护费	26,677.50
合计	103,308.31

#### 7.4.7.11 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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本计划无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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、登记机构

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

注：报告期内，本集合计划无股票关联交易。

## 7.4.10.1.2 权证交易

注：报告期内，本集合计划无权证关联交易。

## 7.4.10.1.3 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 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
平安证券	2,300,026,280	100.00%

## 7.4.10.1.4 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 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
平安证券	76,521,140,000.00	100.00%

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：平安证券股份有限公司已免除本集合计划的交易佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	78,232,895.18
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。

#### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,346,271.96

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
平安证券股份有限公司	11,019,881.61
合计	11,019,881.61

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。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：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。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：报告期内，本集合计划未涉及与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：报告期内，本集合计划未涉及与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注：报告期内管理人未运用自有资金投资本集合计划，于本期末未持有本集合计划份额。

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：本集合计划于本期末无除集合计划管理人之外的其他关联方投资本集合计划份额的情况。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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	18,951,490.54	12,658,342.18

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：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。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本集合计划报告期由关联方中国证券登记结算有限责任公司保管的结算备付金与存出保证金的期末余额及当期产生的利息收入情况如下：

2022 年 6 月 24 日(集合计划合同变更生效日)至 2022 年 12 月 31 日, 结算备付金当期利息收入 353,572.18 元, 期末余额 130,176,005.69 元。

2022 年 6 月 24 日(集合计划合同变更生效日)至 2022 年 12 月 31 日, 存出保证金当期利息收入 8,072.22 元, 期末余额 823,660.71 元。



## 7.4.11 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
94,752,623.40	0	2,791,334.35	97,543,957.75	-

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）。

## 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本集合计划期末未持有流通受限证券。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划期末未持有流通受限证券。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,002,450,150.16 元，是以如下债券作为质押：

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
112208022	22 中信银行 CD022	2023-01-03	99.66	290,000	28,900,722.14
112209120	22 浦发银行 CD120	2023-01-03	99.00	220,000	21,781,026.91
112209158	22 浦发银行 CD158	2023-01-03	98.90	1,090,000	107,798,178.98
112212112	22 北京银行 CD112	2023-01-03	98.80	1,000,000	98,799,570.77
112271628	22 徽商银行 CD157	2023-01-03	99.03	1,500,000	148,550,407.68
112280963	22 上海农商 银行 CD039	2023-01-03	99.55	1,000,000	99,549,772.39
112282047	22 青岛银行 CD047	2023-01-03	98.87	440,000	43,503,139.12

112283927	22 徽商银行 CD074	2023-01-03	99.24	1,000,000	99,238,108.59
112284109	22 广州银行 CD051	2023-01-03	98.85	1,000,000	98,850,747.71
112284370	22 杭州银行 CD224	2023-01-03	98.64	2,000,000	197,278,058.21
112285604	22 徽商银行 CD088	2023-01-03	99.08	300,000	29,722,852.59
112286310	22 徽商银行 CD101	2023-01-03	99.18	1,000,000	99,179,435.81
112286314	22 宁波银行 CD248	2023-01-04	98.35	720,000	70,809,041.97
112289613	22 珠海华润 银行 CD113	2023-01-03	99.34	2,000,000	198,687,880.13
112289844	22 重庆农村 商行 CD214	2023-01-03	99.35	1,000,000	99,348,376.49
112292326	22 青岛银行 CD010	2023-01-03	99.72	90,000	8,975,072.41
112299321	22 成都银行 CD123	2023-01-03	99.66	2,000,000	199,320,556.23
CND100052HN6	22 南京银行 CD092	2023-01-03	99.12	1,000,000	99,118,902.22
CND10005DGB7	22 江苏银行 CD097	2023-01-03	98.95	2,000,000	197,907,745.53
CND10005HNX8	22 长沙银行 CD190	2023-01-03	98.84	1,000,000	98,842,591.69
CND10005Y1D5	22 民生银行 CD506	2023-01-03	99.62	1,200,000	119,540,409.26
合计				21,850,000	2,165,702,596.83

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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 403,912,706.85 元，于 2023 年 1 月 3 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本集合计划当期未参与转融通证券出借业务。

#### 7.4.13 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。

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-

未评级	917,729,797.01
合计	917,729,797.01

#### 7.4.13.2.2 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 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	9,254,737,113.30
合计	9,254,737,113.30

#### 7.4.13.2.3 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 12 月 31 日
AAA	2,814,548,259.00
AAA 以下	-
未评级	70,954,384.56
合计	2,885,502,643.56

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	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	3,469,064,687.26	-	-	-	-	-	3,469,064,687.26
结算备付金	130,176,005.69	-	-	-	-	-	130,176,005.69
存出保证金	823,660.71	-	-	-	-	-	823,660.71
交易性金融资产	101,189,133.69	3,779,369,006.86	9,177,411,413.32	-	-	-	13,057,969,553.87
买入返售金融资产	1,150,225,955.33	-	-	-	-	-	1,150,225,955.33
应收清算款	-	-	-	-	-	100,059,616.45	100,059,616.45
其他资产	-	-	-	-	-	120,960.00	120,960.00
资产总计	4,851,479,442.68	3,779,369,006.86	9,177,411,413.32	-	-	100,180,576.45	17,908,440,439.31
负债							

卖出回购金融资产款	2,406,362,857.01	-	-	-	-	-	2,406,362,857.01
应付清算款	-	-	-	-	-	96,148,123.89	96,148,123.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,187,279.30	14,187,279.30
应付托管费	-	-	-	-	-	788,182.16	788,182.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	980,526.49	980,526.49
应交税费	-	-	-	-	-	928,005.47	928,005.47
应付利润	-	-	-	-	-	2,793,242.88	2,793,242.88
其他负债	-	-	-	-	-	241,088.24	241,088.24
负债总计	2,406,362,857.01	-	-	-	-	116,066,448.43	2,522,429,305.44
利率敏感度缺口	2,445,116,585.67	3,779,369,006.86	9,177,411,413.32	-	-	-15,885,871.98	15,386,011,133.32

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-12,743,445.70
	市场利率下降 25 个基点	12,743,445.70

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合

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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

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，本集合计划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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-
第二层次	13,057,969,553.87
第三层次	-
合计	13,057,969,553.87

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期未发生公允价值所属层次间的重大变动。

###### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划持有的不以公允价值计量的金融工具包括以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因剩余期限较短，其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	13,057,969,553.87	72.92
	其中：债券	13,057,969,553.87	72.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,150,225,955.33	6.42
	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	3,599,240,692.95	20.10
4	其他各项资产	101,004,237.16	0.56
5	合计	17,908,440,439.31	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	11.27	
	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	2,406,362,857.01	15.64
	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。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

#### 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。

#### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例



序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30 天以内	27.63	16.27
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	13.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	15.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	12.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	46.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	116.39	16.27

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	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	1,022,457,782.53	6.65
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	963,929,602.85	6.26
5	企业短期融资券	857,538,954.26	5.57
6	中期票据	959,306,100.93	6.23
7	同业存单	9,254,737,113.30	60.15
8	其他	-	-
9	合计	13,057,969,553.87	84.87
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112286484	22 东莞银行 CD217	2,500,000	246,606,764.39	1.60
2	112209158	22 浦发银行 CD158	2,100,000	207,684,565.01	1.35
3	163351	20 信达 01	2,000,000	205,021,493.87	1.33
4	112299321	22 成都银行 CD123	2,000,000	199,320,556.23	1.30
5	112215506	22 民生银行 CD506	2,000,000	199,234,015.44	1.29
6	112210382	22 兴业银行 CD382	2,000,000	198,896,801.38	1.29
7	112289613	22 珠海华润银行 CD113	2,000,000	198,687,880.13	1.29
8	112214097	22 江苏银行 CD097	2,000,000	197,907,745.53	1.29
9	112284370	22 杭州银行 CD224	2,000,000	197,278,058.21	1.28
10	112213100	22 浙商银行 CD100	2,000,000	197,202,014.25	1.28

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

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1072%
报告期内偏离度的最低值	-0.1676%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0667%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：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

注：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。

### 8.8 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。

### 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

### 8.9.2 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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，东莞银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会广东监管局的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会及其地方机构、中国保险监督管理委员会及其地方机构、中国人民银行、上海证监局的处罚。成都银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会及其地方机构、中国银行保险监督管理委员会及其地方机构、中国保险监督管理委员会及其地方机构、中国银行业监督管理委员会及其地方机构、中国人民银行的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会及其地方机构、中国保险监督管理委员会及其地方机构、中国人民银行的处罚。江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行营业管理部、中国保险监督管理委员会及其地方机构的处罚。杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国保险监督管理委员会及其地方机构的处罚。浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会及其地方机构、中国银行业监督管理委员会及其地方机构、中国人民银行的处罚。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	823,660.71
2	应收清算款	100,059,616.45
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	120,960.00
7	其他	-
8	合计	101,004,237.16

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
250,705	61,370.98	310,251,560.63	2.02%	15,075,759,573.24	97.98%

## 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	个人	89,930,694.76	0.5845%
2	个人	64,547,603.92	0.4195%
3	个人	49,003,279.94	0.3185%
4	个人	40,368,699.75	0.2624%
5	个人	36,383,708.64	0.2365%
6	个人	36,382,279.13	0.2365%
7	个人	25,457,677.77	0.1655%
8	个人	21,250,546.26	0.1381%
9	个人	20,204,457.04	0.1313%
10	个人	19,017,703.17	0.1236%

## 9.3 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	5,908,213.50	0.0384%

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

## § 10 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	207,932,642,221.93
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	208,918,536,687.05
本报告期期末基金份额总额	15,386,011,133.87

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及管理人、集合计划财产、托管人基金托管业务的重大诉讼。

### 11.4 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。

### 11.5 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。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内本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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	3	-	-	-	-	-

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回购成	成交	占当期权	成交	占当

		额的比例		交总额的 比例	金 额	证成 交总 额的 比例	金 额	期 基 金 成 交 总 额 的 比 例
平安 证 券	2,300,026,280.00	100.00%	76,521,140,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 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。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安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
10	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更新及产品资料概要更新的提示性公告	指定报刊	2022-07-15
11	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2022-07-15
12	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划基金经理变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-07-15
13	平安证券股份有限公司旗下大集合产品季度报告提示性公告	指定报刊	2022-07-20
14	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划 2022 年第 2 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2022-07-20
15	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划收益支付公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-07-26
16	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划收益支付公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-08-25
17	平安证券股份有限公司旗下大集合产品中中期报告提示性公告	指定报刊	2022-08-30
18	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	基金电子披露网站及管理人网站	2022-08-30
19	关于平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-09-05
20	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更新及产品资料概要更新的提示性公告	指定报刊	2022-09-14
21	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2022-09-14
22	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划基金经理变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-09-14
23	关于平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-09-26
24	平安证券现金宝现金管理型集	指定报刊、基金电子披露网站	2022-09-27

	合资产管理计划收益支付公告	及管理人网站	
25	关于平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划销售服务费优惠活动的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-10-21
26	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划收益支付公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-10-25
27	平安证券股份有限公司旗下大集合产品季度报告提示性公告	指定报刊	2022-10-26
28	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划 2022 年第 3 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2022-10-26
29	关于平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划销售服务费优惠活动的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-11-15
30	关于平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划销售服务费优惠活动的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-11-24
31	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划收益支付公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-11-25
32	平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划收益支付公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2022-12-27

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：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。

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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》及《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划更新的招募说明书》



- (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。

### 13.2 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。

### 13.3 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  
二〇二三年三月三十日