

# 平安交易型货币市场基金 2026 年中期报告

2026 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：国泰海通证券股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 27 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。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 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 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 11        |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 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 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 净资产变动表                              | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>46</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 46        |
| 7.2 债券回购融资情况                            | 47        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                        | 47        |
| 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         | 48        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 48        |
| 7.6 期末按公允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      | 48        |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离      | 49        |

|                                              |           |
|----------------------------------------------|-----------|
| 7.8 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 ..... | 49        |
| 7.9 投资组合报告附注 .....                           | 49        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                    | <b>50</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                  | 50        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                 | 50        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....               | 50        |
| 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 .....       | 51        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                    | <b>51</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                      | <b>52</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                       | 52        |
| 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 .....       | 52        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 52        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                         | 52        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                  | 52        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....           | 52        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....       | 53        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....                  | 53        |
| 10.9 其他重大事件 .....                            | 53        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>              | <b>55</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 .....     | 55        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                    | 55        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                      | <b>56</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                            | 56        |
| 12.2 存放地点 .....                              | 56        |
| 12.3 查阅方式 .....                              | 56        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                    |                  |                 |
|-----------------|---------------------|--------------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 平安交易型货币市场基金         |                    |                  |                 |
| 基金简称            | 平安货币 ETF            |                    |                  |                 |
| 场内简称            | 货币 ETF 平安           |                    |                  |                 |
| 基金主代码           | 511700              |                    |                  |                 |
| 基金运作方式          | 契约型、交易型开放式          |                    |                  |                 |
| 基金合同生效日         | 2016 年 9 月 23 日     |                    |                  |                 |
| 基金管理人           | 平安基金管理有限公司          |                    |                  |                 |
| 基金托管人           | 国泰海通证券股份有限公司        |                    |                  |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 50,080,179,888.11 份 |                    |                  |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                    |                  |                 |
| 基金份额上市的证券交易所    | 上海证券交易所             |                    |                  |                 |
| 上市日期            | 2016 年 10 月 17 日    |                    |                  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 平安日鑫 A              | 平安日鑫 C             | 平安日鑫 D           | 场内货币            |
| 下属分级基金的交易代码     | 003034              | 015021             | 024897           | 511700          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 42,909,344,185.76 份 | 6,773,247,330.68 份 | 381,848,085.92 份 | 15,740,285.75 份 |

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

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                         |
|--------|---------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。                  |
| 投资策略   | 本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。 |
| 业绩比较基准 | 同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。                                |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。            |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                     | 基金托管人             |
|---------|------|---------------------------|-------------------|
| 名称      |      | 平安基金管理有限公司                | 国泰海通证券股份有限公司      |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李海波                       | 帅芳                |
|         | 联系电话 | 0755-88622632             | 021-38677947      |
|         | 电子邮箱 | fundservice@pingan.com.cn | tgrxp@tg.gtth.com |
| 客户服务电话  |      | 400-800-4800              | 021-38917599-5    |
| 传真      |      | 0755-23997878             | 021-50872603      |
| 注册地址    |      | 深圳市福田区福田街道益田路             | 中国（上海）自由贸易试验区     |

|       |                                 |                          |
|-------|---------------------------------|--------------------------|
|       | 5033 号平安金融中心 34 层               | 商城路 618 号                |
| 办公地址  | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 | 上海市静安区新闻路 669 号博华广场 19 楼 |
| 邮政编码  | 518048                          | 200041                   |
| 法定代表人 | 罗春风                             | 朱健                       |

2.4 信息披露方式

|                   |                 |
|-------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 证券时报            |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | fund.pingan.com |
| 基金中期报告置备地点        | 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 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号                |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|             |                                     |               |              |              |
|-------------|-------------------------------------|---------------|--------------|--------------|
| 3.1.1       | 报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |               |              |              |
| 期间数据<br>和指标 | 平安日鑫 A                              | 平安日鑫 C        | 平安日鑫 D       | 场内货币         |
| 本期已实现收益     | 344,224,827.84                      | 37,635,003.36 | 2,307,196.34 | 8,819,450.59 |
| 本期利润        | 344,224,827.84                      | 37,635,003.36 | 2,307,196.34 | 8,819,450.59 |
| 本期净值收益率     | 0.6833%                             | 0.5636%       | 0.6784%      | 0.6834%      |
| 3.1.2       | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)               |               |              |              |
| 期末数         |                                     |               |              |              |

| 据 和 指<br>标   |                       |                  |                |                  |
|--------------|-----------------------|------------------|----------------|------------------|
| 期末基金资产净值     | 42,909,344,185.76     | 6,773,247,330.68 | 381,848,085.92 | 1,574,028,574.55 |
| 期末基金份额净值     | 1.0000                | 1.0000           | 1.0000         | 100.0000         |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |                  |                |                  |
| 累计净值收益率      | 28.1693%              | 7.5776%          | 1.3549%        | 28.1690%         |

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

2. 本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安日鑫 A

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③      | ②－④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.3335%  | 0.0003%     | 0.3366%    | 0.0000%       | -0.0031% | 0.0003% |
| 过去六个月      | 0.6833%  | 0.0003%     | 0.6741%    | 0.0000%       | 0.0092%  | 0.0003% |
| 过去一年       | 1.4285%  | 0.0003%     | 1.3641%    | 0.0000%       | 0.0644%  | 0.0003% |
| 过去三年       | 5.4938%  | 0.0010%     | 4.1054%    | 0.0000%       | 1.3884%  | 0.0010% |
| 过去五年       | 10.3668% | 0.0013%     | 6.8429%    | 0.0000%       | 3.5239%  | 0.0013% |
| 过去七年       | 16.0206% | 0.0016%     | 9.5841%    | 0.0000%       | 6.4365%  | 0.0016% |
| 自基金合同生效起至今 | 28.1693% | 0.0026%     | 13.3754%   | 0.0000%       | 14.7939% | 0.0026% |

平安日鑫 C

| 阶段             | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③      | ②－④     |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月          | 0.2734%      | 0.0003%             | 0.3366%        | 0.0000%               | -0.0632% | 0.0003% |
| 过去六个月          | 0.5636%      | 0.0003%             | 0.6741%        | 0.0000%               | -0.1105% | 0.0003% |
| 过去一年           | 1.1853%      | 0.0003%             | 1.3641%        | 0.0000%               | -0.1788% | 0.0003% |
| 过去三年           | 4.7372%      | 0.0010%             | 4.1054%        | 0.0000%               | 0.6318%  | 0.0010% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 7.5776%      | 0.0011%             | 6.0029%        | 0.0000%               | 1.5747%  | 0.0011% |

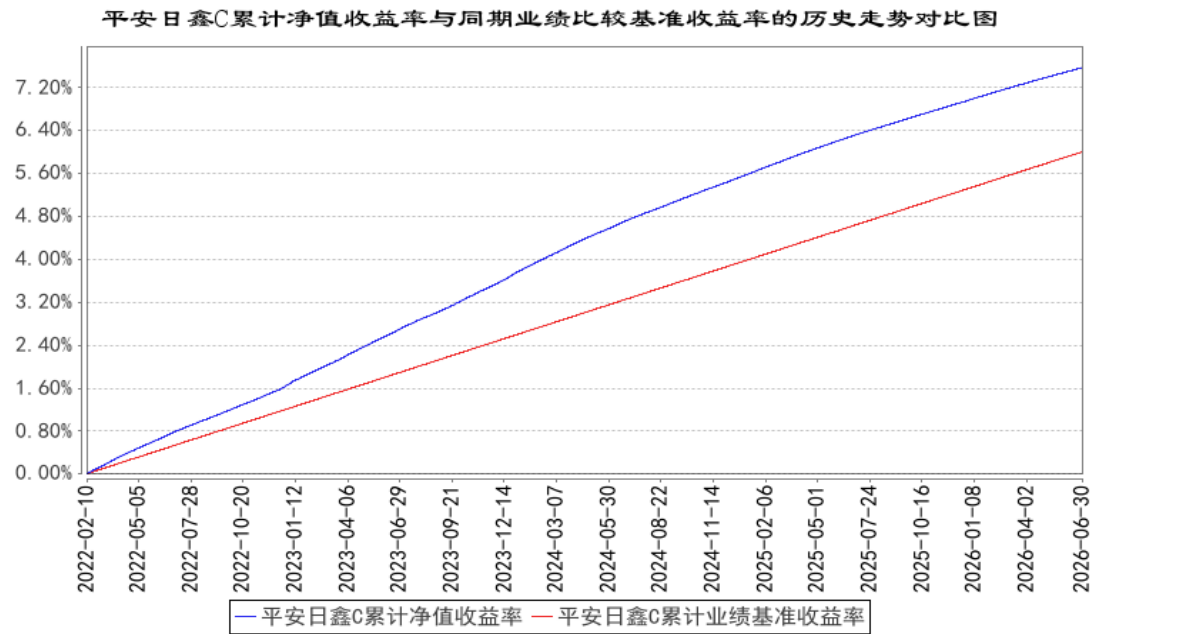
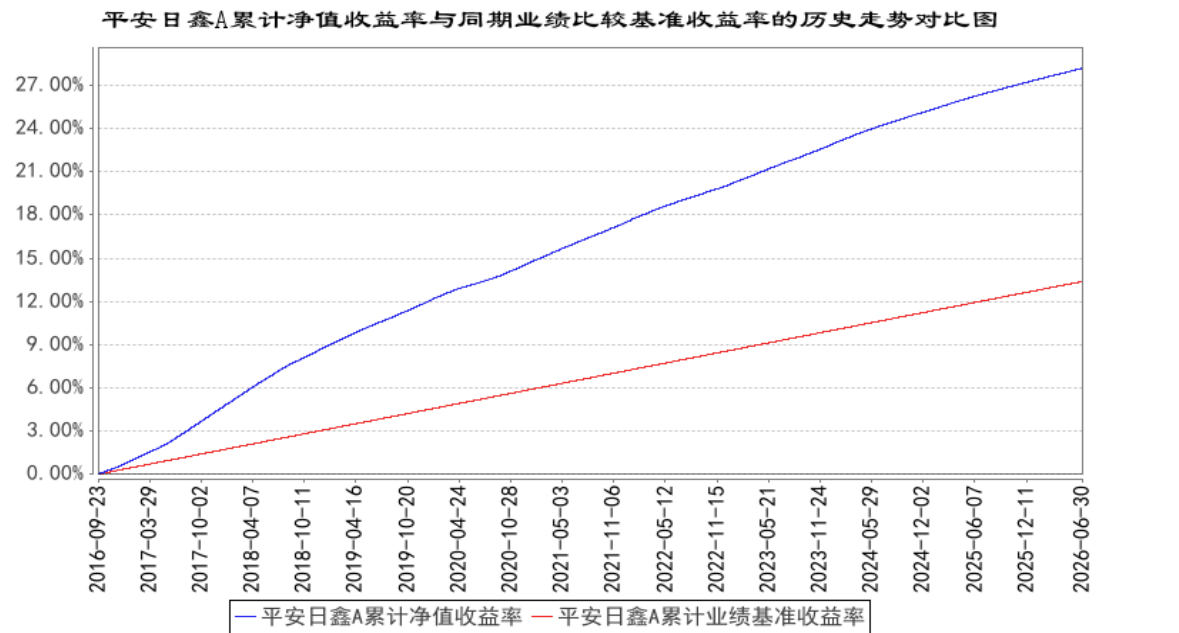
平安日鑫 D

| 阶段             | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③      | ②－④     |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月          | 0.3310%      | 0.0003%             | 0.3366%        | 0.0000%               | -0.0056% | 0.0003% |
| 过去六个月          | 0.6784%      | 0.0003%             | 0.6741%        | 0.0000%               | 0.0043%  | 0.0003% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 1.3549%      | 0.0003%             | 1.3079%        | 0.0000%               | 0.0470%  | 0.0003% |

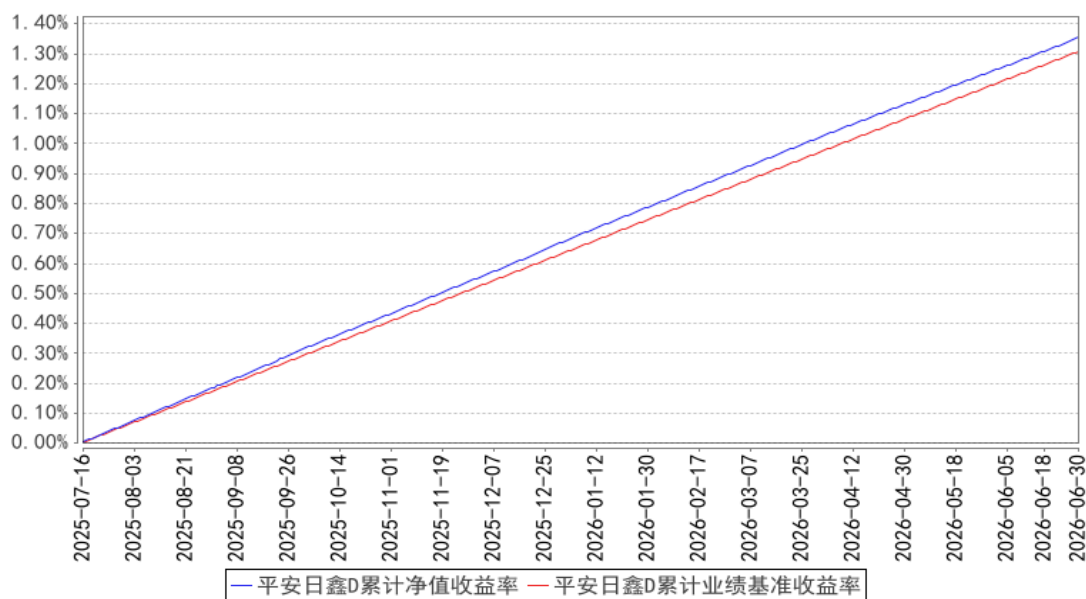
场内货币

| 阶段             | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③      | ②－④     |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月          | 0.3335%      | 0.0003%             | 0.3366%        | 0.0000%               | -0.0031% | 0.0003% |
| 过去六个月          | 0.6834%      | 0.0003%             | 0.6741%        | 0.0000%               | 0.0093%  | 0.0003% |
| 过去一年           | 1.4285%      | 0.0003%             | 1.3641%        | 0.0000%               | 0.0644%  | 0.0003% |
| 过去三年           | 5.4939%      | 0.0010%             | 4.1054%        | 0.0000%               | 1.3885%  | 0.0010% |
| 过去五年           | 10.3667%     | 0.0013%             | 6.8429%        | 0.0000%               | 3.5238%  | 0.0013% |
| 过去七年           | 16.0204%     | 0.0016%             | 9.5841%        | 0.0000%               | 6.4363%  | 0.0016% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 28.1690%     | 0.0026%             | 13.3754%       | 0.0000%               | 14.7936% | 0.0026% |

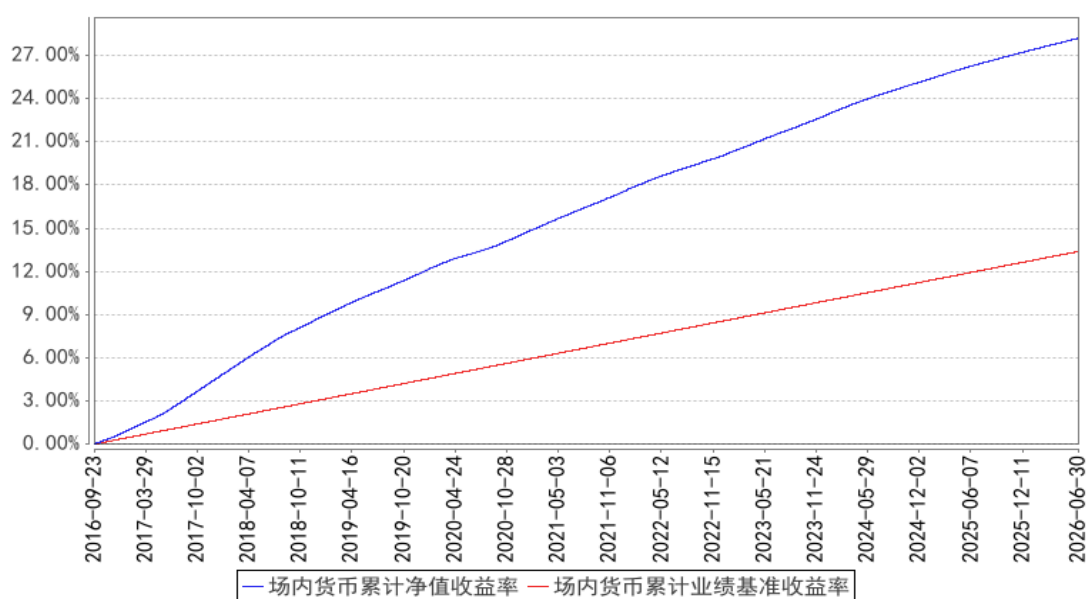
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



平安日鑫D累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



场内货币累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2016年9月23日正式生效；

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

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

4、本基金于2025年07月14日增设D类份额，D类份额从2025年07月16日开始有份额，所以上D类份额走势图从2025年07月16日开始。

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，总部位于深圳，是中国平安集团投资板块的重要成员。公司业务范围涵盖公募基金管理业务、资本市场专户管理业务，具有受托管理保险资金资产管理人资格、合格境内机构投资者（QDII）资格。截至 2026 年上半年末，公司综合管理规模超 9500 亿元，公募管理规模 7900 亿元，累计服务客户数超 1.7 亿人，产品线涵盖货币、债券、混合、股票、指数、FOF、MOM、REITs 等各类产品。公司以“为持有人创造价值”为使命，打造了一支人才梯队完善、长期业绩优异的近 170 人投研团队，构建起“业绩可归因、策略可复制、人才可持续”的专业投研平台，为投资者创造长期稳健的投资回报，致力成为受投资者信赖、行业领先的综合型资产管理公司。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务              | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                 |
|----|-----------------|-----------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                 | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                    |
| 罗薇 | 平安交易型货币市场基金基金经理 | 2022 年 5 月 24 日 | -    | 13 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，现任平安交易型货币市场基金、平安日增利货币市场基金、平安财富宝货币市场基金、平安惠文纯债债券型证券投资基金、平安金管家货币市场基金、平安惠鸿纯债债券型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安天添利货币市场基金基金经理。 |

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

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 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《基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，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的规定及基金合同的约定。

## 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

本报告期内，本管理人管理的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超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 5 次，为公司旗下的指数量化投资组合与其他组合因投资策略需要而发生的同日反向交易，或为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 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

2026 年上半年宏观经济呈现冷热分化，全球制造业周期上行叠加 AI 科技浪潮推动下外需强劲，带动工业生产活动景气回暖；而内需在国内补效应退坡、电商促销力度下降、地产行业底部震荡、基建投资力度放缓等因素影响下，表现持续低迷。“新”“旧”动能相关行业分化明显，全球 AI 算力需求扩张与国内设备更新政策共同提振科技产业投资，传统的地产、基建相关产业链则延续疲态，财政投资在一季度有靠前发力迹象，进入二季度后力度放缓。通胀数据上半年整体呈现回升趋势，PPI 在生产景气度提升和上游原油有色金属等输入性因素影响下修复回正，工业品价格快速修复，算力景气拉动电子半导体相关行业价格上涨，国际油价高位震荡带动上游能源开采及加工行业价格改善，共同助力 PPI 修复趋势；CPI 则呈现总体平稳、温和修复态势，上半年节假日较多，居民旺盛出行意愿助力服务价格上涨，引领核心 CPI 回升，果蔬猪肉供给充裕，食品项

CPI 波动幅度较窄，消费品价格均呈现内部分化，居民商品服务消费意愿疲弱拖累非食品项表现，金价走高则对通胀形成一定支撑。上半年央行延续“以我为主”的政策态度，在海外不确定性上升的背景下，央行保持政策定力，着力稳定市场预期，货币政策在适度宽松的基调下，同时强调政策前瞻性和灵活性：春节前加力投放长期资金，积极表态支持政府债发行，春节后市场对输入型通胀关注度上升，央行公开市场操作更加谨慎，在信贷需求疲弱的背景下，逐步回笼买断式回购投放，避免资金在银行间市场形成淤积；同时，在税期、季末等关键时点加大公开市场投放，以补充短期流动性，避免资金面大幅波动。从货币政策例会表态来看，央行对降准降息政策工具的使用仍并未表现出较强意愿；央行增加隔夜 OMO 操作，明确在货币市场隔夜利率持续低于或高于相应工具操作利率时启动临时隔夜正、逆回购操作，进一步传递出在维护资金面稳定的同时增强政策灵活性的态度。上半年货币市场收益率在一季度震荡下行后，二季度呈现区间震荡走势，具体来看，年初市场对经济开门红带动信贷加力投放的预期较强，货币市场收益率短暂持平 2025 年末，随后央行加大长期资金投放以及实际信贷投放低于预期，银行资金缺口收敛，货币市场收益率震荡下行；春节前后货币市场收益率受到银行间活期利率托底窄幅震荡，一季度末市场预期同业自律的进一步趋严将带动资金价格走低，叠加银行流动性充裕存款存单募集积极性不高，供需不平衡下，货币市场收益率整体回落；4 月银行信贷需求疲弱，财政投放落地后市场流动性充裕，活期存款利率全面下调，资金价格回落带动货币市场收益率全面下行；5 月市场流动性延续充裕局面，货币市场收益率低位震荡；6 月随着央行持续回笼买断式投放，随着资金面收敛，银行募集意愿提升，大行一级发行持续提价带动货币市场收益率震荡上行。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期平安日鑫 A 的基金份额净值收益率为 0.6833%，同期业绩比较基准收益率为 0.6741%；本报告期平安日鑫 C 的基金份额净值收益率为 0.5636%，同期业绩比较基准收益率为 0.6741%；本报告期平安日鑫 D 的基金份额净值收益率为 0.6784%，同期业绩比较基准收益率为 0.6741%；本报告期场内货币的基金份额净值收益率为 0.6834%，同期业绩比较基准收益率为 0.6741%。

#### 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，全球制造业景气度周期上行为外需提供支撑，K 型经济结构下，新动能对经济增长贡献逐步上升，旧动能相关产业仍处于寻底过程中，经济外热内冷的局面有望延续。海外局部战争对国际油价影响仍有不确定性，对美关税谈判和对欧贸易反制仍有可能对出口形成冲击，后

续仍需关注外部影响以及相应的内部宏观政策落地进度。经济修复需要宽松的流动性环境，央行货币政策箱中充裕的数量型和价格型工具有利于维护合理充裕的流动性环境。从大行存款存单保持积极募集的迹象来看，货币市场供需格局已经呈现显著改善，在固收市场整体利差极限压缩的市场环境下，预计货币市场波动区间亦跟随收窄。综合来看，当前流动性环境对货币基金较为友好，预计下半年货币市场以震荡为主，货币基金不仅需要把握市场波动捕捉资产配置机会，也需要做好流动性风险管理。我们将继续稳健操作，力争在保障安全性、流动性的情况下，为客户创造良好的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金基金合同的规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人，并按照自然日结转至基金份额持有人的基金账户。本报告期内应分配收益 392,986,478.13 元，实际分配收益 392,986,478.13 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

本报告期内，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安交易型货币市场基金

（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、利润分配等情况进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期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、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安交易型货币市场基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 23,138,537,931.93      | 16,866,983,514.67        |
| 结算备付金    |         | 22,067,957.00          | 17,452,456.56            |
| 存出保证金    |         | 105,129.66             | 128,957.27               |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 22,919,553,939.34      | 26,810,259,573.44        |
| 其中：股票投资  |         | -                      | -                        |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | 22,919,553,939.34      | 26,810,259,573.44        |
| 资产支持证券投资 |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资    |         | -                      | -                        |
| 其他投资     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产   | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 8,471,675,300.69       | 21,704,297,589.14        |
| 应收清算款    |         | 239,985,123.09         | -                        |
| 应收股利     |         | -                      | -                        |
| 应收申购款    |         | 66,677.61              | 168,430,998.95           |
| 递延所得税资产  |         | -                      | -                        |
| 其他资产     | 6.4.7.8 | -                      | -                        |

|           |          |                        |                          |
|-----------|----------|------------------------|--------------------------|
| 资产总计      |          | 54,791,992,059.32      | 65,567,553,090.03        |
| 负债和净资产    | 附注号      | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 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 |          | 3,140,108,164.38       | 5,900,829,072.45         |
| 应付清算款     |          | -                      | -                        |
| 应付赎回款     |          | -                      | -                        |
| 应付管理人报酬   |          | 7,032,272.74           | 7,963,238.68             |
| 应付托管费     |          | 2,344,090.89           | 2,654,412.90             |
| 应付销售服务费   |          | 1,790,078.13           | 1,828,270.41             |
| 应付投资顾问费   |          | -                      | -                        |
| 应交税费      |          | 160,946.41             | 168,909.40               |
| 应付利润      |          | 1,798,564.31           | 2,386,868.69             |
| 递延所得税负债   |          | -                      | -                        |
| 其他负债      | 6.4.7.9  | 289,765.55             | 689,891.01               |
| 负债合计      |          | 3,153,523,882.41       | 5,916,520,663.54         |
| 净资产:      |          |                        |                          |
| 实收基金      | 6.4.7.10 | 51,638,468,176.91      | 59,651,032,426.49        |
| 未分配利润     | 6.4.7.12 | -                      | -                        |
| 净资产合计     |          | 51,638,468,176.91      | 59,651,032,426.49        |
| 负债和净资产总计  |          | 54,791,992,059.32      | 65,567,553,090.03        |

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 50,080,179,888.11 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 42,909,344,185.76 份；下属 C 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,773,247,330.68 份；下属 D 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 381,848,085.92 份；下属 E 类基金份额净值 100.0000 元，基金份额总额 15,740,285.75 份。

6.2 利润表

会计主体：平安交易型货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目       | 附注号      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|-----------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入   |          | 482,192,540.82                           | 527,248,826.11                                |
| 1. 利息收入   |          | 279,559,250.48                           | 257,362,267.90                                |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 200,470,512.85                           | 121,967,879.43                                |
| 债券利息收入    |          | -                                        | -                                             |

|                                 |            |                |                |
|---------------------------------|------------|----------------|----------------|
| 资产支持证券<br>利息收入                  |            | -              | -              |
| 买入返售金融<br>资产收入                  |            | 79,088,737.63  | 135,394,388.47 |
| 其他利息收入                          |            | -              | -              |
| 2. 投资收益（损失以<br>“-”填列）           |            | 202,633,290.34 | 269,886,558.21 |
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.14   | -              | -              |
| 基金投资收益                          |            | -              | -              |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.15   | 202,633,290.34 | 269,886,558.21 |
| 资产支持证券<br>投资收益                  | 6.4.7.16   | -              | -              |
| 贵金属投资收<br>益                     | 6.4.7.17   | -              | -              |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.18   | -              | -              |
| 股利收益                            | 6.4.7.19   | -              | -              |
| 以摊余成本计<br>量的金融资产终止确<br>认产生的收益   |            | -              | -              |
| 其他投资收益                          |            | -              | -              |
| 3. 公允价值变动收益<br>（损失以“-”号填<br>列）  | 6.4.7.20   | -              | -              |
| 4. 汇兑收益（损失以<br>“-”号填列）          |            | -              | -              |
| 5. 其他收入（损失以<br>“-”号填列）          | 6.4.7.21   | -              | -              |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 89,206,062.69  | 77,797,294.87  |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 43,830,941.35  | 40,527,799.92  |
| 其中：暂估管理人报<br>酬                  |            | -              | -              |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 14,610,313.83  | 13,509,266.64  |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.3 | 10,905,673.97  | 10,395,178.44  |
| 4. 投资顾问费                        |            | -              | -              |
| 5. 利息支出                         |            | 19,653,980.37  | 13,185,005.16  |
| 其中：卖出回购金融<br>资产支出               |            | 19,653,980.37  | 13,185,005.16  |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.22   | -              | -              |
| 7. 税金及附加                        |            | 84,534.22      | 62,240.76      |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.23   | 120,618.95     | 117,803.95     |
| <b>三、利润总额（亏损<br/>总额以“-”号填列）</b> |            | 392,986,478.13 | 449,451,531.24 |
| <b>减：所得税费用</b>                  |            | -              | -              |

|                   |  |                |                |
|-------------------|--|----------------|----------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 392,986,478.13 | 449,451,531.24 |
| 五、其他综合收益的税后净额     |  | -              | -              |
| 六、综合收益总额          |  | 392,986,478.13 | 449,451,531.24 |

6.3 净资产变动表

会计主体：平安交易型货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期                              |                 |                     |
|------------------------------------------|---------------------------------|-----------------|---------------------|
|                                          | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 |                     |
|                                          | 实收基金                            | 未分配利润           | 净资产合计               |
| 一、上期期末净资产                                | 59,651,032,426.49               | -               | 59,651,032,426.49   |
| 二、本期期初净资产                                | 59,651,032,426.49               | -               | 59,651,032,426.49   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -8,012,564,249.58               | -               | -8,012,564,249.58   |
| （一）、综合收益总额                               | -                               | 392,986,478.13  | 392,986,478.13      |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -8,012,564,249.58               | -               | -8,012,564,249.58   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 211,578,112,436.08              | -               | 211,578,112,436.08  |
| 2. 基金赎回款                                 | -219,590,676,685.66             | -               | -219,590,676,685.66 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                               | -392,986,478.13 | -392,986,478.13     |
| 四、本期期末净资产                                | 51,638,468,176.91               | -               | 51,638,468,176.91   |
| 项目                                       | 上年度可比期间                         |                 |                     |
|                                          | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                 |                     |
|                                          | 实收基金                            | 未分配利润           | 净资产合计               |

|                                          |                        |                 |                    |
|------------------------------------------|------------------------|-----------------|--------------------|
| 一、上期期末净资产                                | 48,184,621,911.76      | -               | 48,184,621,911.76  |
| 二、本期期初净资产                                | 48,184,621,911.76      | -               | 48,184,621,911.76  |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                 | 9,402,391,192.11       | -               | 9,402,391,192.11   |
| (一)、综合收益总额                               | -                      | 449,451,531.24  | 449,451,531.24     |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 9,402,391,192.11       | -               | 9,402,391,192.11   |
| 其中:1.基金申购款                               | 95,504,495,635.09      | -               | 95,504,495,635.09  |
| 2.基金赎回款                                  | -<br>86,102,104,442.98 | -               | -86,102,104,442.98 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                      | -449,451,531.24 | -449,451,531.24    |
| 四、本期期末净资产                                | 57,587,013,103.87      | -               | 57,587,013,103.87  |

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>肖宇鹏</u> | <u>马杰</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

平安交易型货币市场基金(原名为平安大华交易型货币市场基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1380号《关于准予平安大华交易型货币市场基金注册的批复》准予注册,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于2018年10月25日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,590,518,565.34元,业经

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第 1210 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华交易型货币市场基金基金合同》于 2016 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,590,527,400.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 8,834.75 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

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

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

根据《平安基金管理有限公司关于平安交易型货币市场基金增设 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人平安基金管理有限公司决定自 2022 年 2 月 8 日起对本基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原 A 类基金份额和 E 类基金份额保持不变。根据《关于平安交易型货币市场基金增设 D 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人平安基金管理有限公司决定自 2025 年 7 月 14 日起对本基金在现有份额的基础上增设 D 类基金份额，原 A 类、C 类和 E 类基金份额保持不变。A 类、C 类和 D 类为场外基金份额，E 类为场内基金份额。四类基金份额分设不同的基金代码，收取不同的销售服务费，并分别公布每万份基金净收益或每百份基金已实现收益和七日年化收益率。A 类、C 类和 D 类基金份额通过基金管理人指定的场外销售机构办理申购和赎回等业务。E 类基金份额通过上海证券交易所场内交易平台办理申购和赎回等业务，并在上海证券交易所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安交易型货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

#### 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、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

本基金的主要税项列示如下：

##### （1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利

息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## （2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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。

## （3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《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《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。

## （4）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‰，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；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             |  | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|------------------------|
| 活期存款           |  | 5,873,826,302.48       |
| 等于：本金          |  | 5,871,880,741.57       |
| 加：应计利息         |  | 1,945,560.91           |
| 定期存款           |  | 17,264,711,629.45      |
| 等于：本金          |  | 17,200,000,000.00      |
| 加：应计利息         |  | 64,711,629.45          |
| 其中：存款期限 1 个月以内 |  | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    |  | 1,002,428,333.54       |
| 存款期限 3 个月以上    |  | 16,262,283,295.91      |
| 其他存款           |  | -                      |
| 等于：本金          |  | -                      |
| 加：应计利息         |  | -                      |
| 合计             |  | 23,138,537,931.93      |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 |           | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                   |               |             |
|----|-----------|------------------------|-------------------|---------------|-------------|
|    |           | 按实际利率计算的账<br>面价值       | 影子定价              | 偏离金额          | 偏离度<br>(%)  |
| 债券 | 交易所市<br>场 | 820,169,550.26         | 819,971,854.24    | -197,696.02   | -<br>0.0004 |
|    | 银行间市<br>场 | 22,099,384,389.08      | 22,110,638,677.09 | 11,254,288.01 | 0.0218      |
|    | 合计        | 22,919,553,939.34      | 22,930,610,531.33 | 11,056,591.99 | 0.0214      |

|        |                   |                   |               |        |
|--------|-------------------|-------------------|---------------|--------|
| 资产支持证券 | -                 | -                 | -             | -      |
| 合计     | 22,919,553,939.34 | 22,930,610,531.33 | 11,056,591.99 | 0.0214 |

注：1. 偏离金额=影子定价—按实际利率计算的账面价值；  
 2. 偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                      | -         |
| 银行间市场 | 8,471,675,300.69       | -         |
| 合计    | 8,471,675,300.69       | -         |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 181,286.60             |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 181,286.60             |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 108,478.95             |
| 合计          | 289,765.55             |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安日鑫 A

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                     |
|---------------|---------------------------------------|---------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额                |
| 上年度末          | 51,761,726,919.09                     | 51,761,726,919.09   |
| 本期申购          | 181,772,477,340.15                    | 181,772,477,340.15  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -190,624,860,073.48                   | -190,624,860,073.48 |
| 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           | 42,909,344,185.76                     | 42,909,344,185.76   |

平安日鑫 C

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|               | 基金份额（份）            | 账面金额               |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 上年度末          | 6,565,336,542.32   | 6,565,336,542.32   |
| 本期申购          | 27,986,855,021.95  | 27,986,855,021.95  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -27,778,944,233.59 | -27,778,944,233.59 |
| 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           | 6,773,247,330.68   | 6,773,247,330.68   |

平安日鑫 D

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额              |
| 上年度末          | 119,158,284.60                        | 119,158,284.60    |
| 本期申购          | 1,352,410,736.77                      | 1,352,410,736.77  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,089,720,935.45                     | -1,089,720,935.45 |
| 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           | 381,848,085.92                        | 381,848,085.92    |

场内货币

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 12,048,106.80                         | 1,204,810,680.48 |
| 本期申购          | 4,663,693.37                          | 466,369,337.21   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -971,514.43                           | -97,151,443.14   |
| 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           | 15,740,285.75                         | 1,574,028,574.55 |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

平安日鑫 A

| 项目   | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------|-------|-------|---------|
| 上年度末 | -     | -     | -       |

|                |                 |   |                 |
|----------------|-----------------|---|-----------------|
| 本期期初           | -               | - | -               |
| 本期利润           | 344,224,827.84  | - | 344,224,827.84  |
| 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        | -344,224,827.84 | - | -344,224,827.84 |
| 本期末            | -               | - | -               |

平安日鑫 C

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 上年度末           | -              | -     | -              |
| 本期期初           | -              | -     | -              |
| 本期利润           | 37,635,003.36  | -     | 37,635,003.36  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -              | -     | -              |
| 其中：基金申购款       | -              | -     | -              |
| 基金赎回款          | -              | -     | -              |
| 本期已分配利润        | -37,635,003.36 | -     | -37,635,003.36 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

平安日鑫 D

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 2,307,196.34  | -     | 2,307,196.34  |
| 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        | -2,307,196.34 | -     | -2,307,196.34 |
| 本期末            | -             | -     | -             |

场内货币

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 8,819,450.59  | -     | 8,819,450.59  |
| 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        | -8,819,450.59 | -     | -8,819,450.59 |
| 本期末            | -             | -     | -             |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 68,901,631.65                         |
| 定期存款利息收入  | 131,175,179.08                        |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 46,805.82                             |
| 其他        | 346,896.30                            |
| 合计        | 200,470,512.85                        |

#### 6.4.7.14 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票买卖差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 200,010,599.71             |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,622,690.63               |
| 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                           | 202,633,290.34             |

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 22,303,986,518.05          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 22,246,411,942.48          |
| 减：应计利息总额               | 54,952,284.94              |
| 减：交易费用                 | -400.00                    |
| 买卖债券差价收入               | 2,622,690.63               |

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

注：本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

注：本基金本报告期内无公允价值变动损益。

**6.4.7.21 其他收入**

注：本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|         | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------|
| 审计费用    | 39,671.58                       |
| 信息披露费   | 59,507.37                       |
| 证券出借违约金 | —                               |
| 银行费用    | 2,840.00                        |
| 账户维护费   | 18,000.00                       |
| 其他      | 600.00                          |
| 合计      | 120,618.95                      |

#### 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、关联关系

##### 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         |
| 国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）   | 基金托管人、基金销售机构                |
| 大华资产管理有限公司               | 基金管理人的股东                    |
| 三亚盈湾旅业有限公司               | 基金管理人的股东                    |
| 平安信托有限责任公司               | 基金管理人的股东                    |
| 深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）   | 基金管理人的子公司                   |
| 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         |
| 方正证券股份有限公司（“方正证券”）       | 基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”）       | 基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 上海陆金所基金销售有限公司（“陆基金”）     | 基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”）   | 基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”） | 基金管理人的最终控股母公司               |
| 中国平安财产保险股份有限公司（“平安财险”）   | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司        |
| 平安基础产业投资基金管理有限公司         | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司        |

|                            |                      |
|----------------------------|----------------------|
| (“平安基础产业”)                 |                      |
| 平安磐海资本有限责任公司(“平安磐海资本”)     | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 深圳平安融易投资咨询有限公司(“深圳平安融易投资”) | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 平安普惠企业管理有限公司(“平安普惠”)       | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |

注：国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                  |
|--------|---------------------------------------|------------------|--------------------------------------------|------------------|
|        | 成交金额                                  | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额                                       | 占当期债券成交总额的比例 (%) |
| 国泰海通证券 | 501,666,680.00                        | 100.00           | 903,505,030.00                             | 100.00           |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                    | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                    |
|--------|---------------------------------------|--------------------|--------------------------------------------|--------------------|
|        | 成交金额                                  | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额                                       | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) |
| 国泰海通证券 | 28,769,489,000.00                     | 100.00             | 19,444,725,000.00                          | 100.00             |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 43,830,941.35                         | 40,527,799.92                              |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 8,882,158.70                          | 5,446,631.99                               |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 34,948,782.65                         | 35,081,167.93                              |

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 14,610,313.83                         | 13,509,266.64                              |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |              |        |          |              |
|----------------|---------------------------------------|--------------|--------|----------|--------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                      |              |        |          |              |
|                | 平安日鑫 A                                | 平安日鑫 C       | 平安日鑫 D | 场内货币     | 合计           |
| 方正证券           | 4,314.16                              | 0.08         | —      | 563.88   | 4,878.12     |
| 国泰海通证券         | 10,687.63                             | 1,786,710.13 | —      | 5,588.48 | 1,802,986.24 |
| 陆基金            | 1,543.56                              | 202,360.13   | —      | —        | 203,903.69   |

|                        |                                            |                  |        |           |                  |
|------------------------|--------------------------------------------|------------------|--------|-----------|------------------|
| 平安基金                   | 1,069,220.4<br>7                           | 2,814,536.1<br>7 | 0.21   | 15,585.69 | 3,899,342.5<br>4 |
| 平安人寿                   | 233.78                                     | 687,276.72       | -      | -         | 687,510.50       |
| 平安银行                   | 300,963.76                                 | 7,526.70         | -      | -         | 308,490.46       |
| 平安证券                   | 105,471.20                                 | -                | -      | 1,533.61  | 107,004.81       |
| 合计                     | 1,492,434.5<br>6                           | 5,498,409.9<br>3 | 0.21   | 23,271.66 | 7,014,116.3<br>6 |
| 获得销售服务<br>费的各关联方<br>名称 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                  |        |           |                  |
|                        | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                  |        |           |                  |
|                        | 平安日鑫 A                                     | 平安日鑫 C           | 平安日鑫 D | 场内货币      | 合计               |
| 方正证券                   | 1,248.05                                   | -                | -      | 236.63    | 1,484.68         |
| 国泰海通证券                 | 124.40                                     | -                | -      | 931.11    | 1,055.51         |
| 陆基金                    | 1,501.75                                   | 2,211.72         | -      | -         | 3,713.47         |
| 平安基金                   | 1,298,274.2<br>7                           | 5,006,276.2<br>1 | -      | 9,004.49  | 6,313,554.9<br>7 |
| 平安人寿                   | 285.19                                     | 1,118.32         | -      | -         | 1,403.51         |
| 平安银行                   | 287,282.86                                 | 562,481.72       | -      | -         | 849,764.58       |
| 平安证券                   | 11,844.63                                  | -                | -      | 739.71    | 12,584.34        |
| 合计                     | 1,600,561.1<br>5                           | 5,572,087.9<br>7 | -      | 10,911.94 | 7,183,561.0<br>6 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按 A 类基金份额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：日 A 类基金份额销售服务费=前一日 A 类基金份额基金资产净值×0.01%/当年天数；

支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额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：日 C 类基金份额销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值×0.25%/当年天数；

支付基金销售机构的销售服务费按 D 类基金份额前一日基金资产净值 0.02%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：日 D 类基金份额销售服务费＝前一日 D 类基金份额基金资产净值×0.02%/当年天数；

支付基金销售机构的销售服务费按 E 类基金份额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：日 E 类基金份额销售服务费＝前一日 E 类基金份额基金资产净值×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

单位：人民币元

| 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日      |        |      |                |            |       |      |
|--------------------------------------------|--------|------|----------------|------------|-------|------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额 |      | 基金逆回购          |            | 基金正回购 |      |
|                                            | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额           | 利息收入       | 交易金额  | 利息支出 |
| -                                          | -      | -    | -              | -          | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |      |                |            |       |      |
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额 |      | 基金逆回购          |            | 基金正回购 |      |
|                                            | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额           | 利息收入       | 交易金额  | 利息支出 |
| 国泰海通证券                                     | -      | -    | 500,000,000.00 | 155,351.37 | -     | -    |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |        |        |      |
|---------------------------------|---------------------------------------|--------|--------|------|
|                                 | 平安日鑫 A                                | 平安日鑫 C | 平安日鑫 D | 场内货币 |
| 基金合同生效日（2016 年 9 月 23 日）持有的基金份额 | -                                     | -      | -      | -    |
| 报告期初持有的基金份额                     | 1,070,013,728.58                      | -      | -      | -    |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 1,257,744,512.08                      | -      | -      | -    |

|                                 |                                            |        |              |                                            |
|---------------------------------|--------------------------------------------|--------|--------------|--------------------------------------------|
| 报告期间因拆分变动份额                     | -                                          | -      | -            | -                                          |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | 1,603,901,100.00                           | -      | -            | -                                          |
| 报告期末持有的基金份额                     | 723,857,140.66                             | -      | -            | -                                          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 1.6869%                                    | -      | -            | -                                          |
| 项目                              | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        | 上年度可比期间<br>- | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|                                 | 平安日鑫 A                                     | 平安日鑫 C | 平安日鑫 D       | 场内货币                                       |
| 基金合同生效日（2016 年 9 月 23 日）持有的基金份额 | -                                          | -      | -            | -                                          |
| 报告期初持有的基金份额                     | 769,253,557.87                             | -      | -            | -                                          |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 1,332,892,609.98                           | -      | -            | -                                          |
| 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                  | 1,557,502,000.00                           | -      | -            | -                                          |
| 报告期末持有的基金份额                     | 544,644,167.85                             | -      | -            | -                                          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总                 | 1.1036%                                    | -      | -            | -                                          |

|      |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|
| 份额比例 |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|

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

平安日鑫 A

| 关联方名称      | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                             | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                             |
|------------|------------------------|-----------------------------|--------------------------|-----------------------------|
|            | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例（%） | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例（%） |
| 方正证券       | 200,000,000.00         | 0.4661                      | -                        | -                           |
| 国泰海通<br>证券 | 625,421,801.09         | 1.4575                      | 621,173,931.94           | 1.2001                      |
| 平安财险       | 19.98                  | 0.0000                      | 19.97                    | 0.0000                      |
| 平安汇通       | 107,846,829.19         | 0.2513                      | 54,612.85                | 0.0001                      |
| 平安基础<br>产业 | -                      | -                           | 59,248,355.14            | 0.1145                      |
| 平安磐海<br>资本 | 91,143,544.06          | 0.2124                      | 228,883,322.78           | 0.4422                      |
| 平安普惠       | 50,375.30              | 0.0001                      | 50,033.20                | 0.0001                      |
| 平安人寿       | 677,525,567.58         | 1.5790                      | 672,923,809.22           | 1.3000                      |
| 平安银行       | 742,161,016.80         | 1.7296                      | 500,169,407.87           | 0.9663                      |
| 平安证券       | 741,867,548.07         | 1.7289                      | 736,828,778.66           | 1.4235                      |

份额单位：份

场内货币

| 关联方名称        | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                             | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                             |
|--------------|------------------------|-----------------------------|--------------------------|-----------------------------|
|              | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例（%） | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例（%） |
| 平安人寿         | 1.39                   | 0.0000                      | 1.00                     | 0.0000                      |
| 深圳平安<br>融易投资 | 90.44                  | 0.0006                      | 89.00                    | 0.0007                      |

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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       |
|-----------|--------------|---------------|----------------|--------------|
| 国泰海通证券-活期 | 9,755,629.13 | 47,823,063.60 | 252,143,377.41 | 1,116,111.14 |

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰海通证券保管，按银行同业存款利率计息。

#### 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未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 平安日鑫 A           |                   |              |                |    |
|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 344,800,872.99   | -                 | -576,045.15  | 344,224,827.84 |    |
| 平安日鑫 C           |                   |              |                |    |
| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 37,663,086.42    | -                 | -28,083.06   | 37,635,003.36  |    |
| 平安日鑫 D           |                   |              |                |    |
| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 2,298,485.89     | -                 | 8,710.45     | 2,307,196.34   |    |
| 场内货币             |                   |              |                |    |
| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 8,812,337.21     | -                 | 7,113.38     | 8,819,450.59   |    |

#### 6.4.12 期末（2026 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 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,600,108,164.38 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<br>单价 | 数量（张）      | 期末估值总额           |
|----------|----------------|-------------------|------------|------------|------------------|
| 09240432 | 24 农发清<br>发 32 | 2026 年 7 月<br>1 日 | 101.01     | 1,600,000  | 161,614,909.79   |
| 09250409 | 25 农发清<br>发 09 | 2026 年 7 月<br>1 日 | 99.98      | 1,000,000  | 99,975,051.58    |
| 09250412 | 25 农发清<br>发 12 | 2026 年 7 月<br>1 日 | 100.50     | 910,000    | 91,450,902.15    |
| 160213   | 16 国开 13       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 102.81     | 4,900,000  | 503,781,854.80   |
| 210208   | 21 国开 08       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 102.52     | 1,000,000  | 102,524,171.54   |
| 210408   | 21 农发 08       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 102.81     | 1,100,000  | 113,092,960.66   |
| 230313   | 23 进出 13       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 102.05     | 500,000    | 51,025,771.78    |
| 230413   | 23 农发 13       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 102.06     | 700,000    | 71,438,948.83    |
| 240202   | 24 国开 02       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 101.51     | 200,000    | 20,302,996.44    |
| 240204   | 24 国开 04       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 101.40     | 1,300,000  | 131,820,352.69   |
| 240322   | 24 进出 22       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 100.80     | 200,000    | 20,160,918.26    |
| 250361   | 25 进出 61       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 100.07     | 3,610,000  | 361,255,952.81   |
| 250431   | 25 农发 31       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 101.22     | 6,900,000  | 698,394,976.53   |
| 260214   | 26 国开 14       | 2026 年 7 月<br>1 日 | 100.27     | 200,000    | 20,053,692.27    |
| 267703   | 26 贴现国<br>开 03 | 2026 年 7 月<br>1 日 | 99.92      | 2,000,000  | 199,841,850.03   |
| 合计       |                |                   |            | 26,120,000 | 2,646,735,310.16 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，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 540,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/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

##### 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、审计与风险控制委员会、风控负责人、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约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本报告期末，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 38.69% (上年度末:39.8%)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

回需求匹配与平衡。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026<br>年6<br>月<br>30<br>日 | 6 个月以内            | 6 个月-1 年         | 1-5 年 | 5<br>年<br>以<br>上 | 不计息            | 合计                |
|-----------------------------------|-------------------|------------------|-------|------------------|----------------|-------------------|
| 资产                                |                   |                  |       |                  |                |                   |
| 货币资金                              | 21,835,028,487.41 | 1,303,509,444.52 | -     | -                | -              | 23,138,537,931.93 |
| 结算备付金                             | 22,067,957.00     | -                | -     | -                | -              | 22,067,957.00     |
| 存出保证金                             | 105,129.66        | -                | -     | -                | -              | 105,129.66        |
| 交易性金融资产                           | 18,449,626,240.93 | 4,469,927,698.41 | -     | -                | -              | 22,919,553,939.34 |
| 衍生金融资产                            | -                 | -                | -     | -                | -              | -                 |
| 买入返售金融资产                          | 8,471,675,300.69  | -                | -     | -                | -              | 8,471,675,300.69  |
| 债权投资                              | -                 | -                | -     | -                | -              | -                 |
| 应收股利                              | -                 | -                | -     | -                | -              | -                 |
| 应收申购款                             | -                 | -                | -     | -                | 66,677.61      | 66,677.61         |
| 应收清算款                             | -                 | -                | -     | -                | 239,985,123.09 | 239,985,123.09    |
| 其他资产                              | -                 | -                | -     | -                | -              | -                 |
| 资产总计                              | 48,778,503,115.69 | 5,773,437,142.93 | -     | -                | 240,051,800.70 | 54,791,992,059.32 |
| 负债                                |                   |                  |       |                  |                |                   |

|              |                   |                  |      |      |                |                   |
|--------------|-------------------|------------------|------|------|----------------|-------------------|
| 应付赎回款        | -                 | -                | -    | -    | -              | -                 |
| 应付管理人报酬      | -                 | -                | -    | -    | 7,032,272.74   | 7,032,272.74      |
| 应付托管费        | -                 | -                | -    | -    | 2,344,090.89   | 2,344,090.89      |
| 应付清算款        | -                 | -                | -    | -    | -              | -                 |
| 卖出回购金融资产款    | 3,140,108,164.38  | -                | -    | -    | -              | 3,140,108,164.38  |
| 应付销售服务费      | -                 | -                | -    | -    | 1,790,078.13   | 1,790,078.13      |
| 应付投资顾问费      | -                 | -                | -    | -    | -              | -                 |
| 应付利润         | -                 | -                | -    | -    | 1,798,564.31   | 1,798,564.31      |
| 应交税费         | -                 | -                | -    | -    | 160,946.41     | 160,946.41        |
| 其他负债         | -                 | -                | -    | -    | 289,765.55     | 289,765.55        |
| 负债总计         | 3,140,108,164.38  | -                | -    | -    | 13,415,718.03  | 3,153,523,882.41  |
| 利率敏感度缺口      | 45,638,394,951.31 | 5,773,437,142.93 | -    | -    | 226,636,082.67 | 51,638,468,176.91 |
| 上年度末2025年12月 | 6个月以内             | 6个月-1年           | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计                |

| 31<br>日              |                   |                  |               |                 |                    |   |
|----------------------|-------------------|------------------|---------------|-----------------|--------------------|---|
| 资产                   |                   |                  |               |                 |                    |   |
| 货币<br>资金             | 15,964,550,514.50 | 902,433,000.17   | -             | -               | -16,866,983,514.67 |   |
| 结算<br>备付<br>金        | 17,452,456.56     | -                | -             | -               | 17,452,456.56      |   |
| 存出<br>保证<br>金        | 128,957.27        | -                | -             | -               | 128,957.27         |   |
| 交易<br>性金<br>融资<br>产  | 19,450,120,500.69 | 7,339,527,525.40 | 20,611,547.35 | -               | -26,810,259,573.44 |   |
| 衍生<br>金融<br>资产       | -                 | -                | -             | -               | -                  | - |
| 买入<br>返售<br>金融<br>资产 | 21,704,297,589.14 | -                | -             | -               | -21,704,297,589.14 |   |
| 债权<br>投资             | -                 | -                | -             | -               | -                  | - |
| 应收<br>股利             | -                 | -                | -             | -               | -                  | - |
| 应收<br>申购<br>款        | -                 | -                | -             | -168,430,998.95 | 168,430,998.95     |   |
| 应收<br>清算<br>款        | -                 | -                | -             | -               | -                  | - |
| 其他<br>资产             | -                 | -                | -             | -               | -                  | - |
| 资产<br>总计             | 57,136,550,018.16 | 8,241,960,525.57 | 20,611,547.35 | -168,430,998.95 | 65,567,553,090.03  |   |
| 负债                   |                   |                  |               |                 |                    |   |
| 应付<br>赎回<br>款        | -                 | -                | -             | -               | -                  | - |
| 应付<br>管理人报<br>酬      | -                 | -                | -             | 7,963,238.68    | 7,963,238.68       |   |

|                           |                   |                  |               |                 |                   |                  |
|---------------------------|-------------------|------------------|---------------|-----------------|-------------------|------------------|
| 应付<br>托管<br>费             | -                 | -                | -             | -               | 2,654,412.90      | 2,654,412.90     |
| 应付<br>清算<br>款             | -                 | -                | -             | -               | -                 | -                |
| 卖出<br>回购<br>金融<br>资产<br>款 | 5,900,829,072.45  | -                | -             | -               | -                 | 5,900,829,072.45 |
| 应付<br>销售<br>服务<br>费       | -                 | -                | -             | -               | 1,828,270.41      | 1,828,270.41     |
| 应付<br>投资<br>顾问<br>费       | -                 | -                | -             | -               | -                 | -                |
| 应付<br>利润                  | -                 | -                | -             | -               | 2,386,868.69      | 2,386,868.69     |
| 应交<br>税费                  | -                 | -                | -             | -               | 168,909.40        | 168,909.40       |
| 其他<br>负债                  | -                 | -                | -             | -               | 689,891.01        | 689,891.01       |
| 负债<br>总计                  | 5,900,829,072.45  | -                | -             | -               | 15,691,591.09     | 5,916,520,663.54 |
| 利率<br>敏感<br>度缺<br>口       | 51,235,720,945.71 | 8,241,960,525.57 | 20,611,547.35 | -152,739,407.86 | 59,651,032,426.49 |                  |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2026 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率上升 25          | -20,037,817.96              | -26,907,757.30         |

|  |                  |               |               |
|--|------------------|---------------|---------------|
|  | 个基点              |               |               |
|  | 市场利率下降 25<br>个基点 | 20,087,513.23 | 26,973,746.17 |

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：于本报告期末，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：于本报告期末，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）。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

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：<br><br>第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。<br><br>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。<br><br>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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                      | -                        |
| 第二层次          | 22,919,553,939.34      | 26,810,259,573.44        |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 22,919,553,939.34      | 26,810,259,573.44        |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                    | 金额                | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-----------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资                | 22,919,553,939.34 | 41.83         |
|    | 其中：债券                 | 22,919,553,939.34 | 41.83         |
|    | 资产支持证券                | -                 | -             |
| 2  | 买入返售金融资产              | 8,471,675,300.69  | 15.46         |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                 | -             |
| 3  | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 23,160,605,888.93 | 42.27         |
| 4  | 其他各项资产                | 240,156,930.36    | 0.44          |
| 5  | 合计                    | 54,791,992,059.32 | 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 | 4.47             |               |
|    | 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 | 3,140,108,164.38 | 6.08          |
|    | 其中：买断式回购融资   | —                | —             |

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

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：本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    | 86 |
| 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 | 64 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 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                 | 41.38              | 6.08               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.04               | —                  |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 11.36              | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 7.57               | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 6.26               | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 39.27              | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |

|    |        |      |
|----|--------|------|
| 合计 | 105.84 | 6.08 |
|----|--------|------|

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：本基金本报告期内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                             | 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                             | 3,297,362,467.16  | 6.39         |
|    | 其中：政策<br>性金融债                    | 2,940,595,532.78  | 5.69         |
| 4  | 企业债券                             | 820,169,550.26    | 1.59         |
| 5  | 企业短期融<br>资券                      | 1,660,978,717.64  | 3.22         |
| 6  | 中期票据                             | 41,089,504.68     | 0.08         |
| 7  | 同业存单                             | 17,099,953,699.60 | 33.11        |
| 8  | 其他                               | -                 | -            |
| 9  | 合计                               | 22,919,553,939.34 | 44.38        |
| 10 | 剩余存续期<br>超过 397 天的<br>浮动利率债<br>券 | 20,053,692.27     | 0.04         |

7.6 期末按公允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<br>(张) | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|-----------|------------------|-------------|----------------|------------------|
| 1  | 112605157 | 26 建设银行<br>CD157 | 10,000,000  | 993,178,708.94 | 1.92             |
| 2  | 112614028 | 26 江苏银行<br>CD028 | 8,000,000   | 795,522,595.31 | 1.54             |
| 3  | 112604021 | 26 中国银行<br>CD021 | 8,000,000   | 794,542,967.16 | 1.54             |
| 4  | 112602114 | 26 工商银行<br>CD114 | 8,000,000   | 794,509,370.84 | 1.54             |
| 5  | 112604029 | 26 中国银行<br>CD029 | 8,000,000   | 791,346,971.03 | 1.53             |
| 6  | 112614078 | 26 江苏银行<br>CD078 | 8,000,000   | 790,367,139.33 | 1.53             |
| 7  | 250431    | 25 农发 31         | 6,900,000   | 698,394,976.53 | 1.35             |
| 8  | 112620050 | 26 广发银行<br>CD050 | 6,000,000   | 595,496,330.36 | 1.15             |
| 9  | 112604006 | 26 中国银行          | 6,000,000   | 595,470,829.45 | 1.15             |

|    |        |          |           |                |      |
|----|--------|----------|-----------|----------------|------|
|    |        | CD006    |           |                |      |
| 10 | 160213 | 16 国开 13 | 4,900,000 | 503,781,854.80 | 0.98 |

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况    |
|-------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数 | 0       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0340% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0084% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0220% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内未出现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：本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金按实际利率计算账面价值，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。

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

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行、中国建设银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额             |
|----|-------|----------------|
| 1  | 存出保证金 | 105,129.66     |
| 2  | 应收清算款 | 239,985,123.09 |
| 3  | 应收利息  | —              |
| 4  | 应收申购款 | 66,677.61      |
| 5  | 其他应收款 | —              |
| 6  | 待摊费用  | —              |
| 7  | 其他    | —              |

|   |    |                |
|---|----|----------------|
| 8 | 合计 | 240,156,930.36 |
|---|----|----------------|

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级<br>别   | 持有人户<br>数（户） | 户均持有的<br>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<br>份额<br>比例<br>（%） | 持有份额              | 占总<br>份额<br>比例<br>（%） |
| 平安日<br>鑫 A | 921,799      | 46,549.57     | 37,506,654,459.86 | 87.41                 | 5,402,689,725.90  | 12.59                 |
| 平安日<br>鑫 C | 533,337      | 12,699.75     | 100,887,479.90    | 1.49                  | 6,672,359,850.78  | 98.51                 |
| 平安日<br>鑫 D | 31,127       | 12,267.42     | 285,875.59        | 0.07                  | 381,562,210.33    | 99.93                 |
| 场内货<br>币   | 2,567        | 6,131.78      | 5,863,239.22      | 37.25                 | 9,877,046.53      | 62.75                 |
| 合计         | 1,466,197    | 34,156.52     | 37,613,691,054.57 | 75.11                 | 12,466,488,833.54 | 24.89                 |

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 | 2,673,596,963.08 | 5.18      |
| 2  | 其他机构  | 1,707,610,742.54 | 3.31      |
| 3  | 银行类机构 | 1,504,701,089.17 | 2.91      |
| 4  | 银行类机构 | 1,105,897,863.56 | 2.14      |
| 5  | 银行类机构 | 1,020,432,375.94 | 1.98      |
| 6  | 银行类机构 | 1,013,240,016.60 | 1.96      |
| 7  | 银行类机构 | 1,003,218,609.41 | 1.94      |
| 8  | 银行类机构 | 1,000,000,000.00 | 1.94      |
| 9  | 银行类机构 | 911,226,793.45   | 1.76      |
| 10 | 银行类机构 | 903,992,942.01   | 1.75      |

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 | 平安日鑫 A | 395,054.90   | 0.0009 |
|                  | 平安日鑫 C | 841,165.28   | 0.0124 |
|                  | 平安日鑫 D | 19,092.27    | 0.0050 |
|                  | 场内货币   | —            | —      |
|                  | 合计     | 1,255,312.45 | 0.0025 |

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

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别   | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|--------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 平安日鑫 A | 0~10              |
|                                | 平安日鑫 C | 0~10              |
|                                | 平安日鑫 D | 0                 |
|                                | 场内货币   | 0                 |
|                                | 合计     | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 平安日鑫 A | 0                 |
|                                | 平安日鑫 C | 0                 |
|                                | 平安日鑫 D | 0                 |
|                                | 场内货币   | 0                 |
|                                | 合计     | 0                 |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 平安日鑫 A             | 平安日鑫 C            | 平安日鑫 D           | 场内货币          |
|--------------------------------|--------------------|-------------------|------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2016 年 9 月 23 日）基金份额总额 | 205,870,400.09     | —                 | —                | 13,846,570.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 51,761,726,919.09  | 6,565,336,542.32  | 119,158,284.60   | 12,048,106.80 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 181,772,477,340.15 | 27,986,855,021.95 | 1,352,410,736.77 | 4,663,693.37  |
| 减：本报                           | 190,624,860,073.   | 27,778,944,233.5  | 1,089,720,935.45 | 971,514.43    |

|                      |                   |                  |                |               |
|----------------------|-------------------|------------------|----------------|---------------|
| 告期基金<br>总赎回份<br>额    | 48                | 9                |                |               |
| 本报告期<br>基金拆分<br>变动份额 | -                 | -                | -              | 0.01          |
| 本报告期<br>期末基金<br>份额总额 | 42,909,344,185.76 | 6,773,247,330.68 | 381,848,085.92 | 15,740,285.75 |

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

## § 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

管理人：公司副总经理林婉文因达到退休年龄，于报告期辞去公司副总经理兼财务负责人职务。林婉文离任后，由公司总经理肖宇鹏兼任公司财务负责人。

托管人：本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

管理人：本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务的诉讼或仲裁。

托管人：本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好
- (2) 经营行为规范
- (3) 合规风控能力较高
- (4) 交易、研究等服务能力较强

2、基金管理人根据上述标准，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。

3、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易           |                  | 债券回购交易            |                    | 权证交易 |                  |
|--------|----------------|------------------|-------------------|--------------------|------|------------------|
|        | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 国泰海通证券 | 501,666,680.00 | 100.00           | 28,769,489,000.00 | 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  | 平安交易型货币市场基金 2025 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 01 月 21 日 |

|    |                                                      |              |                  |
|----|------------------------------------------------------|--------------|------------------|
| 2  | 平安基金管理有限公司关于新增万和证券股份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 | 2026 年 01 月 22 日 |
| 3  | 平安基金管理有限公司关于新增上海攀赢基金销售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 | 2026 年 01 月 22 日 |
| 4  | 平安基金管理有限公司关于新增平安交易型货币市场基金 D 类份额销售机构的公告               | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 02 月 09 日 |
| 5  | 平安交易型货币市场基金春节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告                | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 02 月 11 日 |
| 6  | 平安基金管理有限公司关于新增东兴证券股份有限公司为平安交易型货币市场基金（E 类）申购赎回代办机构的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 03 月 06 日 |
| 7  | 平安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告                          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 03 月 11 日 |
| 8  | 平安基金管理有限公司关于旗下基金新增上海证券有限责任公司为销售机构的公告                 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 03 月 16 日 |
| 9  | 平安基金管理有限公司关于旗下 ETF 基金新增华福证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 03 月 16 日 |
| 10 | 平安基金管理有限公司关于恢复泰信财富基金销售有限公司办理旗下部分基金相关销售业务的公告          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 03 月 20 日 |
| 11 | 平安交易型货币市场基金基金产品资料概要更新                                | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 03 月 20 日 |
| 12 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 变更扩位简称的公告                       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 03 月 20 日 |
| 13 | 平安交易型货币市场基金 2025 年年度报告                               | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 03 月 27 日 |
| 14 | 平安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告                    | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 03 月 31 日 |
| 15 | 平安基金管理有限公司关于平安交易型货币市场基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 04 月 04 日 |
| 16 | 平安交易型货币市场基金 2026 年第 1 季度报告                           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 04 月 21 日 |
| 17 | 平安基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为旗下部                       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 04 月 22 日 |

|    |                                                 |              |                  |
|----|-------------------------------------------------|--------------|------------------|
|    | 分基金销售机构的公告                                      |              |                  |
| 18 | 平安基金管理有限公司关于新增易方达财富管理基金销售（广州）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 | 2026 年 04 月 24 日 |
| 19 | 平安交易型货币市场基金劳动节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 04 月 28 日 |
| 20 | 平安基金管理有限公司对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露              | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 04 月 30 日 |
| 21 | 平安基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司相关销售业务合作的公告      | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 05 月 29 日 |
| 22 | 平安基金管理有限公司关于新增上海华夏财富投资管理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 | 2026 年 06 月 01 日 |
| 23 | 平安基金管理有限公司关于新增和讯信息科技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 | 2026 年 06 月 04 日 |
| 24 | 平安基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售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 | 2026 年 06 月 10 日 |
| 25 | 平安基金管理有限公司关于新增汇添富基金销售（上海）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 | 2026 年 06 月 18 日 |
| 26 | 平安基金管理有限公司关于新增中信银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告            | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 06 月 25 日 |
| 27 | 平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告                       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 06 月 26 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

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 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

2026 年 08 月 27 日