

平安盈泽 1 年持有期债券型基金中基金  
(FOF)  
2024 年中期报告

2024 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月28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2024年01月01日起至06月30日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 37        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 38        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 38        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 38        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 39        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 39        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 39        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 39        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 39        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 39        |
| 7.11 本报告期投资基金情况 .....                       | 40        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 42        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 43        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 43        |
| 8.3 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 .....      | 43        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>44</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 44        |
| 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 .....      | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 44        |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....               | 44        |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 45        |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 45        |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 45        |
| 10.9 其他重大事件 .....                           | 46        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>46</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 .....    | 46        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 46        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>46</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 46        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 47        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 47        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                          |                    |
|-----------------|--------------------------|--------------------|
| 基金名称            | 平安盈泽 1 年持有期债券型基金中基金（FOF） |                    |
| 基金简称            | 平安盈泽 1 年持有债券（FOF）        |                    |
| 基金主代码           | 015882                   |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                   |                    |
| 基金合同生效日         | 2022 年 7 月 20 日          |                    |
| 基金管理人           | 平安基金管理有限公司               |                    |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司             |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 60,276,210.47 份          |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                      |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 平安盈泽 1 年持有债券（FOF）A       | 平安盈泽 1 年持有债券（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码     | 015882                   | 015883             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 57,253,345.16 份          | 3,022,865.31 份     |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金通过主动精选基金品种，并根据市场变化动态调整控制基金下行风险，力争追求基金长期稳健增值。   |
| 投资策略   | <ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产配置策略</li> <li>2、底层基金投资策略</li> <li>3、其他资产的投资策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>（1）债券投资策略</li> <li>（2）信用债投资策略</li> <li>（3）可转换债券、可交换债券投资策略</li> <li>（4）股票投资策略</li> <li>（5）资产支持证券投资策略</li> <li>（6）存托凭证投资策略</li> </ol> </li> </ol> |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%  |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型基金中基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、股票型基金和股票型基金中基金。   |

### 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                | 中国民生银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 陈特正                       | 袁耀光                |
|         | 联系电话 | 0755-22626828             | 010-58560666       |
|         | 电子邮箱 | fundservice@pingan.com.cn | tgxxpl@cmbc.com.cn |

|        |                             |                |
|--------|-----------------------------|----------------|
| 客户服务电话 | 400-800-4800                | 95568          |
| 传真     | 0755-23997878               | 010-57093382   |
| 注册地址   | 深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层 | 北京市西城区复兴门内大街2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 | 北京市西城区复兴门内大街2号 |
| 邮政编码   | 518048                      | 100031         |
| 法定代表人  | 罗春风                         | 高迎欣            |

## 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  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人住所   |

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数<br>据和指标 | 报告期(2024年1月1日-2024年6月30日) |                  |
|-------------------|---------------------------|------------------|
|                   | 平安盈泽1年持有债券（FOF）A          | 平安盈泽1年持有债券（FOF）C |
| 本期已实现收益           | 2,107,128.52              | 112,920.81       |
| 本期利润              | 1,787,985.66              | 81,628.76        |
| 加权平均基金份额<br>本期利润  | 0.0213                    | 0.0190           |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | 2.13%                     | 1.91%            |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | 1.95%                     | 1.74%            |
| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 报告期末(2024年6月30日)          |                  |
| 期末可供分配利<br>润      | 560,315.59                | 5,825.05         |
| 期末可供分配基           | 0.0098                    | 0.0019           |

|              |                  |              |
|--------------|------------------|--------------|
| 金份额利润        |                  |              |
| 期末基金资产净值     | 57,813,660.75    | 3,028,690.36 |
| 期末基金份额净值     | 1.0098           | 1.0019       |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) |              |
| 基金份额累计净值增长率  | 0.98%            | 0.19%        |

- 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；
2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；
3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安盈泽1年持有债券（FOF）A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.16%    | 0.01%       | 0.42%      | 0.03%         | -0.26% | -0.02% |
| 过去三个月      | 0.53%    | 0.02%       | 0.86%      | 0.06%         | -0.33% | -0.04% |
| 过去六个月      | 1.95%    | 0.07%       | 2.25%      | 0.06%         | -0.30% | 0.01%  |
| 过去一年       | 0.81%    | 0.09%       | 2.47%      | 0.06%         | -1.66% | 0.03%  |
| 自基金合同生效起至今 | 0.98%    | 0.09%       | 3.02%      | 0.06%         | -2.04% | 0.03%  |

平安盈泽1年持有债券（FOF）C

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.13%    | 0.01%       | 0.42%      | 0.03%         | -0.29% | -0.02% |
| 过去三个月 | 0.43%    | 0.02%       | 0.86%      | 0.06%         | -0.43% | -0.04% |
| 过去六个月 | 1.74%    | 0.07%       | 2.25%      | 0.06%         | -0.51% | 0.01%  |

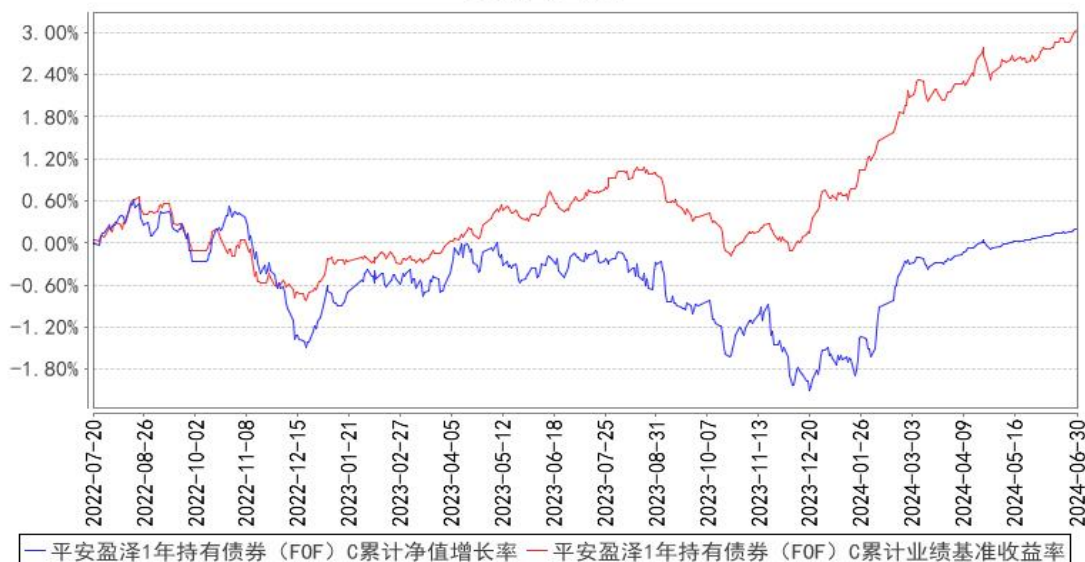
|            |       |       |       |       |        |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | 0.40% | 0.08% | 2.47% | 0.06% | -2.07% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.19% | 0.09% | 3.02% | 0.06% | -2.83% | 0.03% |

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

平安盈泽1年持有债券（FOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安盈泽1年持有债券（FOF）C累计净值增长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2022年07月20日正式生效；

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



### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于2011年1月7日，平安基金总部位于深圳，注册资本为13亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至2024年6月30日，平安基金共管理206只公募基金，公募资产管理总规模约为6655亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|--|-----------------|------|--------|--|
|     |  | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 易文斐 | 资产配置部多资产投资团队负责人，平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理 | 2022年7月20日      | -    | 15年    | 易文斐先生，复旦大学经济学硕士。曾先后担任全国社会保障基金理事会投资部副主任科员、上海国际集团资产管理公司投资经理、平安集团投资管理中心投资经理、平安寿险总部投资管理中心投资经理。2018年11月加入平安基金管理有限公司，现担任资产配置部多资产投资团队负责人，同时担任平安盈盛稳健配置三个月持有期债券型基金中基金（FOF）、平安盈悦稳进回报1年持有期混合型基金中基金（FOF）、平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）、平安盈福6个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理。 |

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、自2024年7月12日起，易文斐先生不再担任本基金基金经理。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，国民经济运行总体平稳，GDP同比增长5.0%。不过，当前外部环境错综复杂，国内有效需求依然不足，经济回升向好的基础仍需巩固。具体来看，上半年，全国规模以上工业增加值同比增长6.0%；服务业增加值同比增长4.6%；全国固定资产投资同比增长3.9%，不过房地产销售下滑仍比较严重；货物进出口总额同比增长6.1%；制造业PMI回升后重新回落至50%以下。消费增长偏弱，上半年，社会消费品零售总额同比增长3.7%；同时，CPI同比上涨0.1%；PPI同比下降2.1%。

面对较为复杂的经济形势，从政策层面看，政府工作报告提出，积极的财政政策要适度加力，

从 2024 年开始，我国将连续几年发行超长期特别国债。同时，货币政策方面，央行表示将淡化 MLF 政策利率色彩，并以 7 天逆回购操作利率承担起短端政策利率功能，三中全会后，央行便以此进行了降息操作；另一方面，央行通过借入国债的操作，实质增强了对长端利率的控制力度，利率市场化改革继续深化。

报告期内，债券市场表现较好，而权益市场波动明显。组合当前主要优选短债及中短债基金进行持有，底层资产中不含权益，组合久期较短，风险敞口较低，会随着债券市场明显波动而波动。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安盈泽 1 年持有债券（FOF）A 的基金份额净值 1.0098 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.95%，同期业绩比较基准收益率为 2.25%；截至本报告期末平安盈泽 1 年持有债券（FOF）C 的基金份额净值 1.0019 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.74%，同期业绩比较基准收益率为 2.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，国内经济仍将坚持稳中求进、以进促稳、先立后破的发展思路。我们认为，这种思路的本质是目前经济总量增长的需求和经济发展转型的需求之间的平衡问题。今年国内经济增长预期的目标是 5%，而受到房地产市场的持续拖累，众多经济主体经历了资产负债表的收缩，进而影响到了收入、支出以及对未来的预期；由此，国家出台了一系列货币、财政以及产业的支持政策，以便经济能够成功跨过转型阶段。不过，虽然 5 月央行发布了包括下调公积金贷款利率和首付比例等多项房地产支持政策，但从三中全会的决定看，我国对经济发展的结构性改革又是坚定不移的，因此，房地产市场在守住不发生系统性风险底线的情况下，或许仍将在较长时间内对经济造成负面影响。

海外方面，随着美国通胀和就业数据边际走弱，美联储年内降息的确定性也在不断增强。于此同时，美国大选关乎国际经济政策以及地缘政治局势等多维度变化，仍是今年最大的不确定因素之一。

对于资本市场而言，短时间内经济的发展格局难以改变，政策适度且持续支持的概率比较高，对于债市而言，中期或维持目前偏强势的局面。股市方面，全面性的机会较难出现，结构性的机会中，或延续上半年的几种思路，其一是市场对经营模式更加可靠、投资结果更有保障的行业给与了高于以往的估值，下半年继续寻找有稳定回报的投资方向，行业上以石油石化、基建、电力、银行、通信等央国企为主的高股息板块为主，其二是政策支持力度较大的新质生产力方向以及由海外人工智能领域科技不断创新所产生的新需求上，行业上以高技术制造业、通信以及电子等行

业为主。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）

报告截止日：2024年6月30日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2024年6月30日         | 上年度末<br>2023年12月31日         |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                           |                             |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 3,393,674.13              | 11,238,033.06               |
| 结算备付金         |            | 8,126.55                  | 82,565.95                   |
| 存出保证金         |            | 6,535.01                  | 33,296.02                   |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 58,610,570.39             | 110,807,648.62              |
| 其中：股票投资       |            | -                         | 7,394,289.00                |
| 基金投资          |            | 55,964,220.53             | 101,790,057.18              |
| 债券投资          |            | 2,646,349.86              | 1,623,302.44                |
| 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    | -                         | -                           |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                         | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                         | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                         | -                           |
| 其他投资          |            | -                         | -                           |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                         | -                           |
| 应收清算款         |            | 500,460.00                | -                           |
| 应收股利          |            | 36,537.83                 | -                           |
| 应收申购款         |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 62,555,903.91             | 122,161,543.65              |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2023年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                           |                             |
| 短期借款          |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                         | -                           |

|             |          |               |                |
|-------------|----------|---------------|----------------|
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3  | -             | -              |
| 卖出回购金融资产款   |          | -             | -              |
| 应付清算款       |          | -             | -              |
| 应付赎回款       |          | 1,595,006.89  | 1,836,561.46   |
| 应付管理人报酬     |          | 28,446.39     | 60,485.86      |
| 应付托管费       |          | 4,475.28      | 9,707.53       |
| 应付销售服务费     |          | 1,088.88      | 1,749.67       |
| 应付投资顾问费     |          | -             | -              |
| 应交税费        |          | -             | -              |
| 应付利润        |          | -             | -              |
| 递延所得税负债     |          | -             | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 84,535.36     | 174,980.69     |
| 负债合计        |          | 1,713,552.80  | 2,083,485.21   |
| <b>净资产：</b> |          |               |                |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 60,276,210.47 | 121,254,192.21 |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | 566,140.64    | -1,176,133.77  |
| 净资产合计       |          | 60,842,351.11 | 120,078,058.44 |
| 负债和净资产总计    |          | 62,555,903.91 | 122,161,543.65 |

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额60,276,210.47份，其中下属A类基金份额净值1.0098元，基金份额57,253,345.16份；C类基金份额净值1.0019元，基金份额3,022,865.31份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2024年1月1日至2024<br>年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年<br>6月30日 |
|-------------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 2,256,021.52                   | 4,553,640.87                        |
| 1. 利息收入           |          | 11,712.17                      | 27,008.62                           |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 11,712.17                      | 25,594.92                           |
| 债券利息收入            |          | -                              | -                                   |
| 资产支持证券利息收入        |          | -                              | -                                   |
| 买入返售金融资产收入        |          | -                              | 1,413.70                            |
| 其他利息收入            |          | -                              | -                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 2,594,744.26                   | -1,066,632.54                       |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.14 | 98,929.83                      | -1,867,012.79                       |
| 基金投资收益            | 6.4.7.15 | 2,065,493.06                   | -1,291,144.90                       |

|                            |            |              |              |
|----------------------------|------------|--------------|--------------|
| 债券投资收益                     | 6.4.7.16   | 28,877.69    | 152,851.87   |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.17   | -            | -            |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.18   | -            | -            |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.19   | -            | -            |
| 股利收益                       | 6.4.7.20   | 401,443.68   | 1,938,673.28 |
| 其他投资收益                     |            | -            | -            |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.21   | -350,434.91  | 5,593,264.79 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -            | -            |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.22   | -            | -            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 386,407.10   | 1,112,601.50 |
| 1.管理人报酬                    | 6.4.10.2.1 | 252,894.82   | 845,848.45   |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -            | -            |
| 2.托管费                      | 6.4.10.2.2 | 38,173.53    | 155,762.27   |
| 3.销售服务费                    | 6.4.10.2.3 | 8,532.74     | 21,713.29    |
| 4.投资顾问费                    |            | -            | -            |
| 5.利息支出                     |            | -            | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -            | -            |
| 6.信用减值损失                   | 6.4.7.24   | -            | -            |
| 7.税金及附加                    |            | 6.08         | 1,287.04     |
| 8.其他费用                     | 6.4.7.25   | 86,799.93    | 87,990.45    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 1,869,614.42 | 3,441,039.37 |
| 减：所得税费用                    |            | -            | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 1,869,614.42 | 3,441,039.37 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -            | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 1,869,614.42 | 3,441,039.37 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |        |               |                |
|-----------|----------------------------|--------|---------------|----------------|
|           | 实收基金                       | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产 | 121,254,192.21             | -      | -1,176,133.77 | 120,078,058.44 |

|  |                                 |        |               |                |
|--|---------------------------------|--------|---------------|----------------|
| 二、本期期初净资产                                | 121,254,192.21                  | -      | -1,176,133.77 | 120,078,058.44 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -60,977,981.74                  | -      | 1,742,274.41  | -59,235,707.33 |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -      | 1,869,614.42  | 1,869,614.42   |
| (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)      | -60,977,981.74                  | -      | -127,340.01   | -61,105,321.75 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 246.29                          | -      | 1.12          | 247.41         |
| 2. 基金赎回款                                 | -60,978,228.03                  | -      | -127,341.13   | -61,105,569.16 |
| (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) | -                               | -      | -             | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 60,276,210.47                   | -      | 566,140.64    | 60,842,351.11  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |        |               |                |
|  | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 325,018,394.14                  | -      | -2,920,905.38 | 322,097,488.76 |
| 二、本期期初净资产                                | 325,018,394.14                  | -      | -2,920,905.38 | 322,097,488.76 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 17,434.60                       | -      | 3,440,991.67  | 3,458,426.27   |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -      | 3,441,039.37  | 3,441,039.37   |
| (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)      | 17,434.60                       | -      | -47.70        | 17,386.90      |
| 其中：1. 基金申购款                              | 17,434.60                       | -      | -47.70        | 17,386.90      |
| 2. 基金赎回款                                 | -                               | -      | -             | -              |



|   |                |   |            |                |
|---|----------------|---|------------|----------------|
| 回款  |                |   |            |                |
| (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) | -              | - | -          | -              |
| 四、本期期末净资产                                 | 325,035,828.74 | - | 520,086.29 | 325,555,915.03 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安盈泽 1 年持有期债券型基金中基金 (FOF) (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 [2021] 3979 号《关于准予平安盈泽 1 年持有期债券型基金中基金 (FOF) 注册的批复》核准, 由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安盈泽 1 年持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 264,613,135.03 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 (2022) 第 0540 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《平安盈泽 1 年持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金合同》于 2022 年 7 月 20 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 264,696,647.75 份基金份额, 其中认购资金利息折合 83,512.72 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, 基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《平安盈泽 1 年持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金招募说明书》, 本基金根据是否收取认购/申购费用、销售服务费的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取认购、申购费用, 而不计提销售服务费的, 称为 A 类基金份额; 在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用, 而是从本类别基金资产中计提销售服务费的, 称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同, 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值, 投资者在认购、申购基金份额时可自行选择基金份额类别。计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安盈泽 1 年持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额(包括香港互认基金、QDII 基金、商品基金)、国内依法公开发行上市交易的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券, 债券回购, 银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等)、同业存单、现金, 以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股指期货、国债期货及股票期权。本基金的投资组合比例为: 本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金占基金资产的比例不低于 80%, 其中投资于债券型证券投资基金(包括债券指数基金)的比例不低于本基金资产的 80%; 本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: 中债综合全价指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安盈泽 1 年持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售

股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目           | 本期末        |              |
|--------------|------------|--------------|
|              | 2024年6月30日 |              |
| 活期存款         |            | 3,393,674.13 |
| 等于：本金        |            | 3,393,255.57 |
| 加：应计利息       |            | 418.56       |
| 减：坏账准备       |            | -            |
| 定期存款         |            | -            |
| 等于：本金        |            | -            |
| 加：应计利息       |            | -            |
| 减：坏账准备       |            | -            |
| 其中：存款期限1个月以内 |            | -            |
| 存款期限1-3个月    |            | -            |
| 存款期限3个月以上    |            | -            |
| 其他存款         |            | -            |
| 等于：本金        |            | -            |
| 加：应计利息       |            | -            |
| 减：坏账准备       |            | -            |
| 合计           |            | 3,393,674.13 |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末          |           |              |         |
|---------------|--------------|-----------|--------------|---------|
|               | 2024年6月30日   |           |              |         |
|               | 成本           | 应计利息      | 公允价值         | 公允价值变动  |
| 股票            | -            | -         | -            | -       |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -            | -         | -            | -       |
| 债券            |              |           |              |         |
| 交易所市场         | 2,606,570.00 | 40,629.86 | 2,646,349.86 | -850.00 |

|  |        |               |           |               |            |
|--|--------|---------------|-----------|---------------|------------|
|  | 银行间市场  | -             | -         | -             | -          |
|  | 合计     | 2,606,570.00  | 40,629.86 | 2,646,349.86  | -850.00    |
|  | 资产支持证券 | -             | -         | -             | -          |
|  | 基金     | 55,787,760.90 | -         | 55,964,220.53 | 176,459.63 |
|  | 其他     | -             | -         | -             | -          |
|  | 合计     | 58,394,330.90 | 40,629.86 | 58,610,570.39 | 175,609.63 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

## 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024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      | -                 |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 84,535.36         |
| 合计          | 84,535.36         |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 平安盈泽1年持有债券（FOF）A

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 116,018,021.15             | 116,018,021.15 |
| 本期申购          | 232.70                     | 232.70         |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -58,764,908.69             | -58,764,908.69 |
| 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           | 57,253,345.16              | 57,253,345.16  |

## 平安盈泽1年持有债券（FOF）C

| 项目   | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |              |
|------|----------------------------|--------------|
|      | 基金份额（份）                    | 账面金额         |
| 上年度末 | 5,236,171.06               | 5,236,171.06 |
| 本期申购 | 13.59                      | 13.59        |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,213,319.34 | -2,213,319.34 |
| 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           | 3,022,865.31  | 3,022,865.31  |

#### 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

平安盈泽1年持有债券（FOF）A

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
|----------------|--------------|-------------|---------------|
| 上年度末           | -934,813.41  | -161,704.01 | -1,096,517.42 |
| 本期期初           | -934,813.41  | -161,704.01 | -1,096,517.42 |
| 本期利润           | 2,107,128.52 | -319,142.86 | 1,787,985.66  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,875.62     | -135,028.27 | -131,152.65   |
| 其中：基金申购款       | 1.22         | -0.11       | 1.11          |
| 基金赎回款          | 3,874.40     | -135,028.16 | -131,153.76   |
| 本期已分配利润        | -            | -           | -             |
| 本期末            | 1,176,190.73 | -615,875.14 | 560,315.59    |

平安盈泽1年持有债券（FOF）C

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分      | 未分配利润合计    |
|----------------|------------|------------|------------|
| 上年度末           | -72,326.52 | -7,289.83  | -79,616.35 |
| 本期期初           | -72,326.52 | -7,289.83  | -79,616.35 |
| 本期利润           | 112,920.81 | -31,292.05 | 81,628.76  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,478.21  | 6,290.85   | 3,812.64   |
| 其中：基金申购款       | 0.14       | -0.13      | 0.01       |
| 基金赎回款          | -2,478.35  | 6,290.98   | 3,812.63   |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -          |
| 本期末            | 38,116.08  | -32,291.03 | 5,825.05   |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 活期存款利息收入  | 11,475.41            |
| 定期存款利息收入  | -                    |
| 其他存款利息收入  | -                    |
| 结算备付金利息收入 | 102.63               |
| 其他        | 134.13               |

|    |           |
|----|-----------|
| 合计 | 11,712.17 |
|----|-----------|

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 98,929.83                  |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                          |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                          |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                          |
| 合计               | 98,929.83                  |

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 9,920,255.20               |
| 减：卖出股票成本总额 | 9,807,014.17               |
| 减：交易费用     | 14,311.20                  |
| 买卖股票差价收入   | 98,929.83                  |

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-------------------|----------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额       | 123,750,134.91             |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 121,669,123.90             |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 50.63                      |
| 减：交易费用            | 15,467.32                  |
| 基金投资收益            | 2,065,493.06               |

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 28,380.69                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 497.00                     |



|                |           |
|----------------|-----------|
| 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             | 28,877.69 |

#### 6.4.7.16.2 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>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 3,762,043.53               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,699,439.00               |
| 减：应计利息总额               | 62,107.53                  |
| 减：交易费用                 | -                          |
| 买卖债券差价收入               | 497.00                     |

#### 6.4.7.16.3 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。

#### 6.4.7.16.4 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。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 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。

##### 6.4.7.17.2 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。

##### 6.4.7.17.3 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。

##### 6.4.7.17.4 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。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 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。

##### 6.4.7.18.2 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。

**6.4.7.18.3 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。

**6.4.7.18.4 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。

**6.4.7.19 衍生工具收益****6.4.7.19.1 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。

**6.4.7.19.2 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。

**6.4.7.20 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |
|---------------|----------------------|
|               | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | -                    |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                    |
| 基金投资产生的股利收益   | 401,443.68           |
| 合计            | 401,443.68           |

**6.4.7.21 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产             | -350,434.91          |
| 股票投资                   | 644,443.17           |
| 债券投资                   | -1,464.00            |
| 资产支持证券投资               | -                    |
| 基金投资                   | -993,414.08          |
| 贵金属投资                  | -                    |
| 其他                     | -                    |
| 2. 衍生工具                | -                    |
| 权证投资                   | -                    |
| 3. 其他                  | -                    |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                    |
| 合计                     | -350,434.91          |

**6.4.7.22 其他收入**

注：本基金本报告期无其他收入。

## 6.4.7.23 持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------------------|----------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | -                          |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 113,090.69                 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 30,748.67                  |

## 6.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 24,863.02                  |
| 信息披露费   | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行费用    | 2,264.57                   |
| 合计      | 86,799.93                  |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系                     |
|------------------------|-----------------------------|
| 平安基金管理有限公司（“平安基金”）     | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构         |
| 中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）   | 基金托管人、基金销售机构                |
| 大华资产管理有限公司             | 基金管理人的股东                    |
| 三亚盈湾旅业有限公司             | 基金管理人的股东                    |
| 平安信托有限责任公司             | 基金管理人的股东                    |
| 深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”） | 基金管理人的子公司                   |
| 平安证券股份有限公司（“平安证券”）     | 基金管理人的股东的子公司、基金销售机构         |
| 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 |

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 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 |
|--------------------------|---------------|

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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

###### 6.4.10.1.4 基金交易

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基金交易。

###### 6.4.10.1.5 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。

###### 6.4.10.1.6 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>2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 252,894.82                 | 845,848.45                      |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 133,721.10                 | 392,978.36                      |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 119,173.72                 | 452,870.09                      |

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的0.60%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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 × 0.60% / 当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2024年1月1日至2024年6月30日 | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 38,173.53            | 155,762.27           |

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人民生银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的0.10%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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×0.10% /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                   |                  |           |
|----------------|----------------------|------------------|-----------|
|                | 2024年1月1日至2024年6月30日 |                  |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |                  |           |
|                | 平安盈泽1年持有债券（FOF）A     | 平安盈泽1年持有债券（FOF）C | 合计        |
| 民生银行           | -                    | 8,512.72         | 8,512.72  |
| 合计             | -                    | 8,512.72         | 8,512.72  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间              |                  |           |
|                | 2023年1月1日至2023年6月30日 |                  |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |                  |           |
|                | 平安盈泽1年持有债券（FOF）A     | 平安盈泽1年持有债券（FOF）C | 合计        |
| 民生银行           | -                    | 21,708.16        | 21,708.16 |
| 合计             | -                    | 21,708.16        | 21,708.16 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按C类基金前一日基金资产净值0.40%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：

C类基金日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称   | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023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    |
| 民生银行-活期 | 3,393,674.13               | 11,475.41 | 17,245,377.23                   | 24,465.36 |

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有基金管理人平安基金所管理的公开募集证券投资基金合计 7,041,631.17 元，占本基金资产净值的比例为 11.57%。（于 2023-06-30，本基金持有基金管理人平安基金所管理的公开募集证券投资基金合计 33,318,258.54 元，占本基金资产净值的比例为 5.12%。）

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

| 项目              | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | -                          | -                               |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | -                          | -                               |

|                      |          |           |
|----------------------|----------|-----------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | -        | -         |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 3,898.95 | 34,106.11 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 1,080.43 | 11,303.57 |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购、赎回自身管理的其他基金（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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（不含本基金所投资的基金份额）市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券（不含本基金所投资的基金份额），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，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券（上年度末：同）。

### 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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额）市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额）不得超过该证券的10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中7个工作日内可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日内可变现资产的可变现价值。

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

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年6月30日   | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|---------------------|---------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产                  |               |      |      |               |               |
| 货币资金                | 3,393,674.13  | -    | -    | -             | 3,393,674.13  |
| 结算备付金               | 8,126.55      | -    | -    | -             | 8,126.55      |
| 存出保证金               | 6,535.01      | -    | -    | -             | 6,535.01      |
| 交易性金融资产             | 2,646,349.86  | -    | -    | 55,964,220.53 | 58,610,570.39 |
| 应收股利                | -             | -    | -    | 36,537.83     | 36,537.83     |
| 应收清算款               | -             | -    | -    | 500,460.00    | 500,460.00    |
| 资产总计                | 6,054,685.55  | -    | -    | 56,501,218.36 | 62,555,903.91 |
| 负债                  |               |      |      |               |               |
| 应付赎回款               | -             | -    | -    | 1,595,006.89  | 1,595,006.89  |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 28,446.39     | 28,446.39     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 4,475.28      | 4,475.28      |
| 应付销售服务费             | -             | -    | -    | 1,088.88      | 1,088.88      |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 84,535.36     | 84,535.36     |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 1,713,552.80  | 1,713,552.80  |
| 利率敏感度缺口             | 6,054,685.55  | -    | -    | 54,787,665.56 | 60,842,351.11 |
| 上年度末<br>2023年12月31日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                  |               |      |      |               |               |
| 货币资金                | 11,238,033.06 | -    | -    | -             | 11,238,033.06 |
| 结算备付金               | 82,565.95     | -    | -    | -             | 82,565.95     |
| 存出保证金               | 33,296.02     | -    | -    | -             | 33,296.02     |

|         |               |   |   |                |                |
|---------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 交易性金融资产 | 1,623,302.44  | - | - | 109,184,346.18 | 110,807,648.62 |
| 资产总计    | 12,977,197.47 | - | - | 109,184,346.18 | 122,161,543.65 |
| 负债      |               |   |   |                |                |
| 应付赎回款   | -             | - | - | 1,836,561.46   | 1,836,561.46   |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | 60,485.86      | 60,485.86      |
| 应付托管费   | -             | - | - | 9,707.53       | 9,707.53       |
| 应付销售服务费 | -             | - | - | 1,749.67       | 1,749.67       |
| 其他负债    | -             | - | - | 174,980.69     | 174,980.69     |
| 负债总计    | -             | - | - | 2,083,485.21   | 2,083,485.21   |
| 利率敏感度缺口 | 12,977,197.47 | - | - | 107,100,860.97 | 120,078,058.44 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

注：于本报告期末，本基金持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为4.35%（上年度末：1.35%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

#### 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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|----|-------------------|---------------------|
|----|-------------------|---------------------|

|               | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|---------------|---------------|--------------|----------------|--------------|
| 交易性金融资产—股票投资  | -             | -            | 7,394,289.00   | 6.16         |
| 交易性金融资产—基金投资  | 55,964,220.53 | 91.98        | 101,790,057.18 | 84.77        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -             | -            | -              | -            |
| 衍生金融资产—权证投资   | -             | -            | -              | -            |
| 其他            | -             | -            | -              | -            |
| 合计            | 55,964,220.53 | 91.98        | 109,184,346.18 | 90.93        |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设        | 除“沪深300指数”以外的其他市场变量保持不变     |                   |             |
|-----------|-----------------------------|-------------------|-------------|
|           | 沪深300指数上升5%                 |                   |             |
| 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（2024年6月30日）             | 上年度末（2023年12月31日） |             |
| 分析        | 沪深300指数上升5%                 | 107,413.39        | 439,399.71  |
|           | 沪深300指数下降5%                 | -107,413.39       | -439,399.71 |

#### 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：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 55,964,220.53     | 109,184,346.18      |
| 第二层次          | 2,646,349.86      | 1,623,302.44        |
| 第三层次          | -                 | -                   |
| 合计            | 58,610,570.39     | 110,807,648.62      |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资   | -             | -             |
|    | 其中：股票  | -             | -             |
| 2  | 基金投资   | 55,964,220.53 | 89.46         |
| 3  | 固定收益投资 | 2,646,349.86  | 4.23          |
|    | 其中：债券  | 2,646,349.86  | 4.23          |
|    | 资产支持证券 | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资  | -             | -             |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 5 | 金融衍生品投资           | -             | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -             | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 3,401,800.68  | 5.44   |
| 8 | 其他各项资产            | 543,532.84    | 0.87   |
| 9 | 合计                | 62,555,903.91 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额   | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|
| 1  | 600256 | 广汇能源 | 596,261.00 | 0.50           |
| 2  | 601825 | 沪农商行 | 591,282.00 | 0.49           |
| 3  | 600096 | 云天化  | 342,319.00 | 0.29           |
| 4  | 601717 | 郑煤机  | 238,420.00 | 0.20           |

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 000521 | 长虹美菱 | 2,087,476.00 | 1.74           |
| 2  | 601882 | 海天精工 | 1,319,918.20 | 1.10           |
| 3  | 601088 | 中国神华 | 964,141.00   | 0.80           |
| 4  | 600760 | 中航沈飞 | 929,175.00   | 0.77           |
| 5  | 601717 | 郑煤机  | 846,142.00   | 0.70           |
| 6  | 600765 | 中航重机 | 749,216.00   | 0.62           |
| 7  | 601825 | 沪农商行 | 612,081.00   | 0.51           |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 605,379.00   | 0.50           |
| 9  | 600256 | 广汇能源 | 575,212.00   | 0.48           |
| 10 | 002230 | 科大讯飞 | 492,939.00   | 0.41           |
| 11 | 600096 | 云天化  | 385,387.00   | 0.32           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 12 | 002465 | 海格通信 | 353,189.00 | 0.29 |
|----|--------|------|------------|------|

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |              |
|--------------|--------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,768,282.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 9,920,255.20 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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      | 2,646,349.86 | 4.35         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 2,646,349.86 | 4.35         |

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019727 | 23 国债 24 | 20,000 | 2,036,980.82 | 3.35         |
| 2  | 019709 | 23 国债 16 | 6,000  | 609,369.04   | 1.00         |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 7.11 本报告期投资基金情况

### 7.11.1 投资政策及风险说明

基金的投资组合比例为：本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金占基金资产的比例不低于80%，其中投资于债券型证券投资基金（包括债券指数基金）的比例不低于本基金资产的80%。本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称        | 运作方式   | 持有份额（份）      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-------------|--------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| 1  | 008497 | 鹏扬浦利中短债A    | 契约型开放式 | 6,880,705.53 | 7,252,263.63 | 11.92        | 否                      |
| 2  | 014856 | 建信鑫享短债债券A   | 契约型开放式 | 6,646,579.19 | 7,155,042.50 | 11.76        | 否                      |
| 3  | 015832 | 永赢宏泰短债A     | 契约型开放式 | 6,410,145.18 | 6,471,682.57 | 10.64        | 否                      |
| 4  | 110051 | 易方达安和中短债债券A | 契约型开放式 | 5,831,433.15 | 6,316,608.39 | 10.38        | 否                      |
| 5  | 016662 | 平安元福短债      | 契约型开放式 | 5,718,642.78 | 6,034,311.86 | 9.92         | 是                      |



|    |        |                                   |                |              |              |      |   |
|----|--------|-----------------------------------|----------------|--------------|--------------|------|---|
|    |        | 发起<br>式 A                         |                |              |              |      |   |
| 6  | 006829 | 鹏扬<br>利洋<br>短债<br>A               | 契约<br>型开<br>放式 | 4,611,457.79 | 5,356,208.22 | 8.80 | 否 |
| 7  | 006629 | 招商<br>鑫悦<br>中短<br>债 A             | 契约<br>型开<br>放式 | 4,273,527.53 | 4,859,855.51 | 7.99 | 否 |
| 8  | 006662 | 易方<br>达安<br>悦超<br>短债<br>债券<br>A   | 契约<br>型开<br>放式 | 3,877,628.40 | 3,950,140.05 | 6.49 | 否 |
| 9  | 007754 | 上银<br>慧永<br>利中<br>短期<br>债券<br>A   | 契约<br>型开<br>放式 | 3,212,302.20 | 3,329,230.00 | 5.47 | 否 |
| 10 | 006874 | 创金<br>合信<br>恒兴<br>中短<br>债债<br>券 A | 契约<br>型开<br>放式 | 2,051,676.48 | 2,443,957.02 | 4.02 | 否 |
| 11 | 016396 | 交银<br>稳益<br>短债<br>债券<br>A         | 契约<br>型开<br>放式 | 1,666,422.02 | 1,705,083.01 | 2.80 | 否 |
| 12 | 005754 | 平安<br>短债<br>A                     | 契约<br>型开<br>放式 | 831,739.17   | 1,007,319.31 | 1.66 | 是 |

|    |        |            |             |           |           |      |   |
|----|--------|------------|-------------|-----------|-----------|------|---|
| 13 | 511360 | 海富通中证短融ETF | 交易型开放式(ETF) | 400.00    | 44,004.40 | 0.07 | 否 |
| 14 | 006965 | 财通安瑞短债债券A  | 契约型开放式      | 32,305.03 | 38,514.06 | 0.06 | 否 |

### 7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

注：

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.12.3 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 | 6,535.01   |
| 2  | 应收清算款 | 500,460.00 |
| 3  | 应收股利  | 36,537.83  |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | -          |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 543,532.84 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别             | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额  | 持有人结构 |           |               |           |
|------------------|----------|------------|-------|-----------|---------------|-----------|
|                  |          |            | 机构投资者 |           | 个人投资者         |           |
|                  |          |            | 持有份额  | 占总份额比例（%） | 持有份额          | 占总份额比例（%） |
| 平安盈泽1年持有债券（FOF）A | 523      | 109,471.02 | -     | -         | 57,253,345.16 | 100.00    |
| 平安盈泽1年持有债券（FOF）C | 48       | 62,976.36  | -     | -         | 3,022,865.31  | 100.00    |
| 合计               | 567      | 106,307.25 | -     | -         | 60,276,210.47 | 100.00    |

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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

### 8.3 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 | 平安盈泽1年持有债券（FOF）A | 0                 |
|                                | 平安盈泽1年持有债券（FOF）C | 0                 |
|                                | 合计               | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 平安盈泽1年持有债券（FOF）A | 0                 |
|                                | 平安盈泽1年持有债券（FOF）C | 0                 |
|                                | 合计               | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 平安盈泽 1 年持有债券（FOF）A | 平安盈泽 1 年持有债券（FOF）C |
|--|--------------------|--------------------|
| 基金合同生效日<br>(2022 年 7 月 20 日)<br>基金份额总额 | 253,700,251.70     | 10,996,396.05      |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 116,018,021.15     | 5,236,171.06       |
| 本报告期基金总申购份额                            | 232.70             | 13.59              |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | 58,764,908.69      | 2,213,319.34       |
| 本报告期基金拆分变动份额                           | -                  | -                  |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 57,253,345.16      | 3,022,865.31       |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

### 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期持有的上银慧永利中短期债券型证券投资基金的基金管理人发布了关于该基金的基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告。

公告陈述了基金份额持有人大会会议情况、基金份额持有人大会决议生效情况以及基金份额持有人大会决议相关事项的实施情况。

《关于上银慧永利中短期债券型证券投资基金调整基金赎回费率的议案》有效通过，决议当日生效。该基金的基金管理人已对《上银慧永利中短期债券型证券投资基金招募说明书》及基金产品资料概要进行了修订，并自基金份额持有人大会决议生效公告之日，即2024年5月8日起实施新的赎回费率。

## 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

## 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 兴业证券 | 2      | 11,688,537.20 | 100.00           | 8,601.39  | 100.00         | -  |
| 中信证券 | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

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

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

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 | 基金交易 |
|----|------|--------|------|------|
|----|------|--------|------|------|

| 名称       | 成交金额         | 占当期<br>债券成<br>交总额<br>的比例<br>(%) | 成交金<br>额 | 占当期<br>债券回<br>购成交<br>总额的<br>比例<br>(%) | 成交金<br>额 | 占当<br>期权<br>证成<br>交总<br>额的<br>比例<br>(%) | 成交金额         | 占当期<br>基金成<br>交总额<br>的比例<br>(%) |
|----------|--------------|---------------------------------|----------|---------------------------------------|----------|---|--------------|---------------------------------|
| 兴业<br>证券 | 6,306,119.00 | 100.00                          | -        | -                                     | -        | -                                       | 3,177,724.40 | 100.00                          |
| 中信<br>证券 | -            | -                               | -        | -                                     | -        | -                                       | -            | -                               |

### 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                      | 法定披露方式       | 法定披露日期      |
|----|---|--------------|-------------|
| 1  | 平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024年01月15日 |
| 2  | 平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）2023年第4季度报告         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024年01月19日 |
| 3  | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告  | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024年02月05日 |
| 4  | 平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）2023年年度报告           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024年03月28日 |
| 5  | 平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）2024年第1季度报告         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024年04月19日 |
| 6  | 平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）招募说明书（更新）           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024年05月31日 |
| 7  | 平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024年05月31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盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）募集注册的文件
- （2）平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同

(3) 平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）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

2024年8月29日