

平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券  
投资基金  
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <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 .....                                | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 9         |
| 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 .....             | 9         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 10        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 10        |
| 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 .....       | 10        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 11        |
| 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 ..... | 11        |
| 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 .....       | 11        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>11</b> |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 11        |
| 6.2 利润表 .....                                 | 12        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 14        |
| 6.4 报表附注 .....                                | 15        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b> .....                       | <b>33</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 33        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 33        |
| 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 .....       | 33        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 33        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 34        |
| 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 .....      | 34        |
| 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 .....   | 34        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 34        |
| 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 .....    | 34        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 34        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 35        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>37</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 37        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 37        |
| 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 .....      | 37        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 37        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>37</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>38</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 38        |
| 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 .....      | 38        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 38        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 38        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 38        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 38        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 38        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 39        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>40</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 .....    | 40        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 40        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>40</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 40        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 41        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 41        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |  |
|------------|--|
| 基金名称       | 平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金   |
| 基金简称       | 平安合颖定开债  |
| 基金主代码      | 005897   |
| 基金运作方式     | 契约型, 定期开放方式运作。本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)或自每一开放期结束之日次日(含)至3个月(含)后对应日的前一日止(若该对应日为非工作日或无该对应日, 则顺延至下一工作日)。本基金自封闭期结束之后第一个工作日起(含)进入开放期, 每个开放期最长不超过10个工作日, 开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。 |
| 基金合同生效日    | 2018年9月19日   |
| 基金管理人      | 平安基金管理有限公司   |
| 基金托管人      | 浙商银行股份有限公司   |
| 报告期末基金份额总额 | 2,465,667,973.91份  |
| 基金合同存续期    | 不定期  |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在谨慎控制组合净值波动率的前提下, 本基金追求基金产品的长期、持续增值, 并力争获得超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资策略   | 本基金通过对宏观经济周期、行业前景预测和发债主体公司研究的综合运用, 主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略, 在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上, 深入挖掘价值被低估的固定收益投资品种, 构建及调整固定收益投资组合。本基金将灵活应用组合久期配置策略、类属资产配置策略、个券选择策略、息差策略、现金头寸管理策略等, 在合理管理并控制组合风险的前提下, 获得债券市场的整体回报率及超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数(总财富)收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金, 预期收益和预期风险高于货币市场基金, 但低于混合型基金、股票型基金。  |

### 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                  | 浙商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 陈特正                         | 朱巍                |
|         | 联系电话 | 0755-22626828               | 0571-87659806     |
|         | 电子邮箱 | fundservice@pingan.com.cn   | zhuwei@czbank.com |
| 客户服务电话  |      | 400-800-4800                | 95527             |
| 传真      |      | 0755-23997878               | 0571-88268688     |
| 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 | 杭州市萧山区鸿宁路1788号    |

|       |                                    |              |
|-------|------------------------------------|--------------|
| 办公地址  | 深圳市福田区福田街道益田路<br>5033 号平安金融中心 34 层 | 杭州市延安路 368 号 |
| 邮政编码  | 518048                             | 310006       |
| 法定代表人 | 罗春风                                | 沈仁康          |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报   |
| 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<br>5033 号平安金融中心 34 层 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 31,020,925.79                       |
| 本期利润          | 43,198,808.57                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0175                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.72%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.74%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 8,090,334.01                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0033                              |
| 期末基金资产净值      | 2,489,908,323.93                    |
| 期末基金份额净值      | 1.0098                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 11.30%                              |

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。

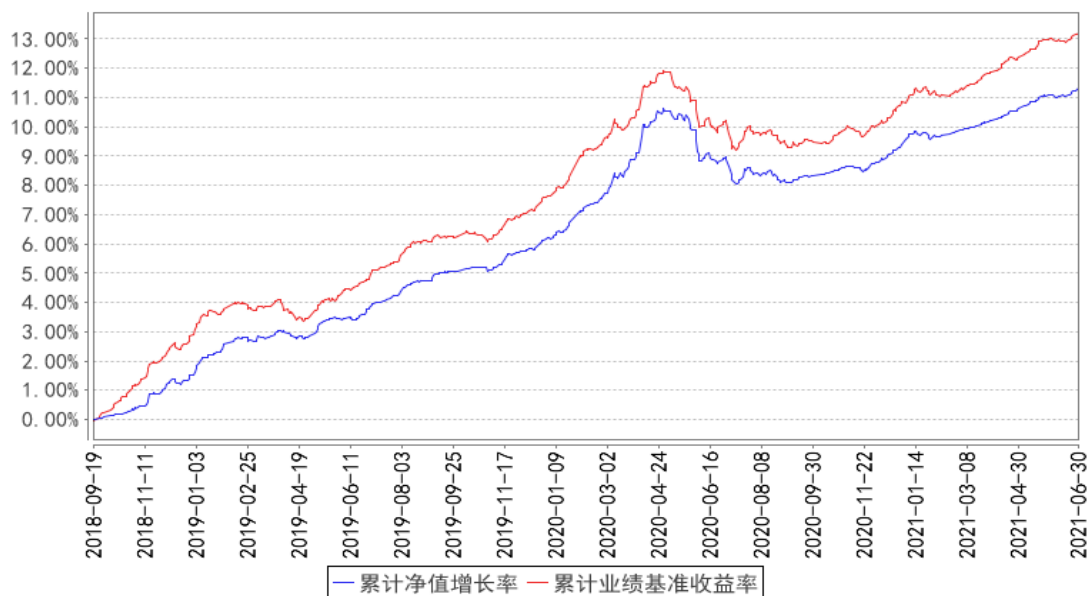
## 3.2 基金净值表现

### 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

| 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      | 0.21%    | 0.02%       | 0.20%      | 0.03%         | 0.01%  | -0.01% |
| 过去三个月      | 1.00%    | 0.02%       | 1.23%      | 0.03%         | -0.23% | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.74%    | 0.03%       | 2.14%      | 0.04%         | -0.40% | -0.01% |
| 过去一年       | 2.19%    | 0.04%       | 2.77%      | 0.06%         | -0.58% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.30%   | 0.06%       | 13.22%     | 0.07%         | -1.92% | -0.01% |

### 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

平安合颖定开债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 2018 年 09 月 19 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。

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2021 年 6 月 30 日，平安基金共管理 138 只公募基金，公募资产管理总规模约为 3,831 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务                         | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|----------------------------|-----------------|------|--------|---|
|    |                            | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 韩克 | 平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理 | 2020 年 3 月 9 日  | -    | 9 年    | 韩克先生，浙江大学金融学硕士。曾先后担任南方基金管理有限公司债券交易员、研究员、投资经理助理。2019 年 6 月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心投资经理。现担任平安可转债债券型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、平安惠轩纯债债券型证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠智纯债债券型证券投资基金、平安添裕债券型证券投资基金、平安恒泽混合型证券投资基金、平安中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金、平安瑞尚六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。 |

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济增速有所回落，房地产政策收紧的背景下，销售增速有一定放缓；而物价层面，ppi 逐季走高，同时 cpi 相对稳定，物价的结构性压力并未引起货币政策的响应，上半年货币政策操作除了在 2、3 月有所收紧外，大部分时间较为宽松。在此背景下，上半年债券市场整体表现较好，市场收益率虽然中间有一定波动，但半年维度看均有不同幅度下行。组合在上半年运作中，开局整体是一个防御的配置状态，在年初取得了较好效果；二季度在央行政策倾向与市场沟通逐

步清晰的背景下，逐步拉长久期适应货币政策当局思路的变化，期间对于潜在可能的风险，小幅调整组合仓位以应对。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0098 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.74%，业绩比较基准收益率为 2.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年我们面临的确定性与不确定性，相对确定的是经济运行存在一定的下行压力，而货币政策基调整体是偏宽松的；不确定的地方在于出口、房地产等领域变化的幅度，以及货币政策在应对上的力度；从最新的政治局会议也传达出在政策层面加强自主性，对于更长期海外政策退出的趋势，我们相信国内政策有更强的独立性。整体我们认为下半年的宏观环境对证券市场环境偏有利，投资中我们在注意节奏的前提下偏向于更为积极。从纯债的投资维度看，大方向我们仍积极，在结构上我们更加关注央行在下半年是否会将资金利率有所引导下行，目前央行在降准的基础上，维持了资金利率平稳；市场更大的空间有待于资金利率的下行来打开。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及本基金合同的规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

不适用。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的管理人——平安基金管理有限公司在平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在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规定进行。本报告期内，平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金进行了 1 次利润分配，分配金额为 40,680,591.89 元。

### 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

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、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：平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 5,431,610.00           | 1,915,746.69             |
| 结算备付金      |         | -                      | -                        |
| 存出保证金      |         | 7,399.97               | 7,086.96                 |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 2,739,823,000.00       | 2,699,148,933.29         |
| 其中：股票投资    |         | -                      | -                        |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 2,635,173,000.00       | 2,600,101,650.00         |
| 资产支持证券投资   |         | 104,650,000.00         | 99,047,283.29            |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 贵金属投资           |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                         | -                           |
| 应收证券清算款         |            | -                         | -                           |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 50,894,991.78             | 42,392,312.58               |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 2,796,157,001.75          | 2,743,464,079.52            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2020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       |            | 305,058,237.41            | 254,999,327.50              |
| 应付证券清算款         |            | -                         | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 617,788.87                | 702,522.87                  |
| 应付托管费           |            | 205,929.63                | 234,174.28                  |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 67,789.85                 | 46,368.25                   |
| 应交税费            |            | 21,508.03                 | 14,245.62                   |
| 应付利息            |            | 44,285.68                 | 37,257.92                   |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 233,138.35                | 219,000.00                  |
| 负债合计            |            | 306,248,677.82            | 256,252,896.44              |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 2,465,667,973.91          | 2,465,490,416.93            |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 24,240,350.02             | 21,720,766.15               |
| 所有者权益合计         |            | 2,489,908,323.93          | 2,487,211,183.08            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 2,796,157,001.75          | 2,743,464,079.52            |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0098 元，基金份额总额 2,465,667,973.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----|-----|----|---------|
|-----|-----|----|---------|

|                        |            | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>6 月 30 日 |
|------------------------|------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 一、收入                   |            | 49,562,058.72                      | 61,214,475.36                      |
| 1. 利息收入                |            | 43,023,672.69                      | 53,733,835.02                      |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 23,263.99                          | 135,923.29                         |
| 债券利息收入                 |            | 38,585,142.02                      | 50,376,275.73                      |
| 资产支持证券利息收入             |            | 2,475,485.18                       | 2,495,513.30                       |
| 买入返售金融资产收入             |            | 1,939,781.50                       | 726,122.70                         |
| 证券出借利息收入               |            | -                                  | -                                  |
| 其他利息收入                 |            | -                                  | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -5,639,496.75                      | 21,092,796.25                      |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | -                                  | -                                  |
| 基金投资收益                 | -          | -                                  | -                                  |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | -5,639,496.75                      | 21,092,796.25                      |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.13.5 | -                                  | -                                  |
| 收益                     |            |                                    |                                    |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.14   | -                                  | -                                  |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.15   | -                                  | -                                  |
| 股利收益                   | 6.4.7.16   | -                                  | -                                  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 12,177,882.78                      | -13,612,155.91                     |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                  | -                                  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | -                                  | -                                  |
| 减：二、费用                 |            | 6,363,250.15                       | 10,506,726.62                      |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 3,725,723.04                       | 4,064,120.04                       |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,241,907.69                       | 1,354,706.65                       |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -                                  | -                                  |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 71,795.30                          | 184,236.25                         |
| 5. 利息支出                |            | 1,190,047.57                       | 4,766,422.97                       |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 1,190,047.57                       | 4,766,422.97                       |
| 6. 税金及附加               |            | 11,038.20                          | 14,214.57                          |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 122,738.35                         | 123,026.14                         |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 43,198,808.57                      | 50,707,748.74                      |
| 减：所得税费用                |            | -                                  | -                                  |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 43,198,808.57                      | 50,707,748.74                      |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                |                  |
|--|--|----------------|------------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 2,465,490,416.93                           | 21,720,766.15  | 2,487,211,183.08 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 43,198,808.57  | 43,198,808.57    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 177,556.98                                 | 1,367.19       | 178,924.17       |
| 其中：1. 基金申购款                            | 177,556.98                                 | 1,367.19       | 178,924.17       |
| 2. 基金赎回款                               | -  | -              | -                |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -40,680,591.89 | -40,680,591.89   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,465,667,973.91                           | 24,240,350.02  | 2,489,908,323.93 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                  |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,971,813,946.62                           | 122,055,383.04 | 2,093,869,329.66 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本                   | -  | 50,707,748.74  | 50,707,748.74    |

|  |                  |                 |                  |
|--|------------------|-----------------|------------------|
| 期利润)                                       |                  |                 |                  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)      | 1,475,513,495.22 | 25,319,915.23   | 1,500,833,410.45 |
| 其中: 1. 基金申购款                               | 1,475,513,495.22 | 25,319,915.23   | 1,500,833,410.45 |
| 2. 基金赎回款                                   | -                | -               | -                |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动<br>(净值减少以“-”号填列) | -                | -176,501,401.78 | -176,501,401.78  |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                            | 3,447,327,441.84 | 21,581,645.23   | 3,468,909,087.07 |

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:

罗春风

林婉文

张南南

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

平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(原名为平安大华合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金,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[2018]621号《关于准予平安大华合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于2018年10月25日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,009,999,000.00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(2018)第0567号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年9月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,009,999,000.00份基金份额,无认购资金利息份额。

本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司（以下简称“浙商银行”）。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

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》，平安大华合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金。

根据《平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起（包括基金合同生效日）或者每一个开放期结束之日次日起（包括该日）3 个月的期间内，本基金采取封闭运作模式，基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起至 3 个月后的对应日前一日的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起至 3 个月后的对应日前一日的期间，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务，开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款）、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的相关规定）。本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；在开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数（总财富）收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投



资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 5,431,610.00           |
| 定期存款           | -                      |
| 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           | -                      |
| 合计             | 5,431,610.00           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                  |                  |               |
|---------------|------------------------|------------------|------------------|---------------|
|               | 成本                     | 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                  | -                | -                |               |
|               | 银行间市场                  | 2,643,087,200.60 | 2,635,173,000.00 | -7,914,200.60 |
|               | 合计                     | 2,643,087,200.60 | 2,635,173,000.00 | -7,914,200.60 |
| 资产支持证券        | 99,047,283.29          | 104,650,000.00   | 5,602,716.71     |               |
| 基金            | -                      | -                | -                |               |
| 其他            | -                      | -                | -                |               |
| 合计            | 2,742,134,483.89       | 2,739,823,000.00 | -2,311,483.89    |               |

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 750.49            |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | -                 |
| 应收债券利息     | 46,668,134.21     |
| 应收资产支持证券利息 | 4,226,104.11      |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 应收出借证券利息   | -                 |
| 其他         | 2.97              |
| 合计         | 50,894,991.78     |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 67,789.85         |
| 合计          | 67,789.85         |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |

|      |            |
|------|------------|
| 预提费用 | 233,138.35 |
| 合计   | 233,138.35 |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                  |
|---------------|----------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额             |
| 上年度末          | 2,465,490,416.93           | 2,465,490,416.93 |
| 本期申购          | 177,556.98                 | 177,556.98       |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                          | -                |
| - 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           | 2,465,667,973.91           | 2,465,667,973.91 |

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 17,749,628.31  | 3,971,137.84  | 21,720,766.15  |
| 本期利润           | 31,020,925.79  | 12,177,882.78 | 43,198,808.57  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 371.80         | 995.39        | 1,367.19       |
| 其中：基金申购款       | 371.80         | 995.39        | 1,367.19       |
| 基金赎回款          | -              | -             | -              |
| 本期已分配利润        | -40,680,591.89 | -             | -40,680,591.89 |
| 本期末            | 8,090,334.01   | 16,150,016.01 | 24,240,350.02  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |           |
|-----------|----------------------------|-----------|
|           | 活期存款利息收入                   | 23,159.42 |
| 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 | 68.54                      |           |
| 其他        | 36.03                      |           |
| 合计        | 23,263.99                  |           |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

**6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

**6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入**

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -5,639,496.75              |
| 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                            | -5,639,496.75              |

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 4,570,386,489.47           |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,521,200,002.25           |
| 减：应收利息总额                | 54,825,983.97              |
| 买卖债券差价收入                | -5,639,496.75              |

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 12,177,882.78        |
| 股票投资       | -                    |
| 债券投资       | 6,575,166.07         |
| 资产支持证券投资   | 5,602,716.71         |
| 基金投资       | -                    |
| 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                     | 12,177,882.78 |

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 320.30               |
| 银行间市场交易费用 | 71,475.00            |
| 合计        | 71,795.30            |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 审计费用    | 44,630.98            |
| 信息披露费   | 59,507.37            |
| 证券出借违约金 | -                    |
| 账户维护费   | 18,000.00            |
| 其他      | 600.00               |
| 合计      | 122,738.35           |

#### 6.4.7.21 分部报告

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

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系             |
|--------------------|---------------------|
| 平安基金管理有限公司（“平安基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 浙商银行                     | 基金托管人         |
| 平安信托有限责任公司               | 基金管理人的股东      |
| 大华资产管理有限公司               | 基金管理人的股东      |
| 三亚盈湾旅业有限公司               | 基金管理人的股东      |
| 深圳平安汇通投资管理有限公司(“平安汇通”)   | 基金管理人的子公司     |
| 中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”) | 基金管理人的最终控股母公司 |
| 平安证券股份有限公司(“平安证券”)       | 基金管理人的股东的子公司  |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 平安证券  | 20,000,000.00              | 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>2021年1月1日至2021年6月30日 |                           | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                           |
|-------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 平安证券  | -                          | -                         | 4,847,500,000.00                | 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>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020<br>年6月30日 |
|---------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费      | 3,725,723.04                   | 4,064,120.04                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护<br>费 | -                              | -                                   |

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 0.30%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 × 0.30% / 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>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020<br>年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,241,907.69                   | 1,354,706.65                        |

注：支付基金托管行浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 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 × 0.10% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 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>2021年1月1日至2021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         |
| 浙商银行                       | -      | -    | -     | -    | 1,177,000<br>,000.00 | 74,8<br>76.4 |

|  |                |               |       |      |                |           |
|--|----------------|---------------|-------|------|----------------|-----------|
|  |                |               |       |      |                | 5         |
| 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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      |
| 浙商银行                                       | 130,341,918.69 | 74,079,238.85 | -     | -    | 834,390,000.00 | 61,110.00 |

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------------------------------|---------------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2018 年 9 月 19 日）持有的基金份额 | -                                     | -  |
| 报告期初持有的基金份额                     | 10,843,888.83                         | 10,000,000.00                              |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 177,556.98                            | 822,302.50                                 |
| 报告期间因拆分变动份额                     | 0.00                                  | 0.00                                       |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | 0.00                                  | 0.00                                       |
| 报告期末持有的基金份额                     | 11,021,445.81                         | 10,822,302.50                              |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 0.4470%                               | 0.3139%                                    |

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。

## 6.4.10.5.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2021年6月30日 |                             | 上年度末<br>2020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(%) |
| 浙商银行  | 2,454,646,528.10  | 99.5530                     | 2,454,646,528.10    | 99.5602                     |

## 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>2021年1月1日至2021年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |           |
|---------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|         | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 浙商银行-活期 | 5,431,610.00               | 23,159.42 | 2,212,398.01                    | 94,167.41 |

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，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

本基金本报告期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

| 序号 | 权益<br>登记<br>日            | 除息日 |                          | 每 10<br>份基金<br>份额分<br>红数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|----|--------------------------|-----|--------------------------|--------------------------|---------------|---------------|---------------|----|
|    |                          | 场内  | 场外                       |                          |               |               |               |    |
| 1  | 2021<br>年 6<br>月 15<br>日 | -   | 2021<br>年 6<br>月 15<br>日 | 0.1650                   | 40,501,667.72 | 178,924.17    | 40,680,591.89 | -  |
| 合计 | -                        | -   | -                        | 0.1650                   | 40,501,667.72 | 178,924.17    | 40,680,591.89 | -  |

## 6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 305,058,237.41 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称       | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|--------|------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 210202 | 21 国开 02   | 2021 年 7 月 1 日 | 100.09 | 568,000   | 56,851,120.00  |
| 180408 | 18 农发 08   | 2021 年 7 月 2 日 | 102.73 | 1,031,000 | 105,914,630.00 |
| 190011 | 19 付息国债 11 | 2021 年 7 月 6 日 | 100.26 | 1,547,000 | 155,102,220.00 |
| 合计     |            |                |        | 3,146,000 | 317,867,970.00 |

#### 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市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 40.50%（上年末：40.80%）。

#### 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期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市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。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，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 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----|-------|-------|-------|-----|----|
|     |       |       |       |     |    |

|                             |                  |                  |               |               |                  |
|-----------------------------|------------------|------------------|---------------|---------------|------------------|
| 2021 年 6 月 30 日             |                  |                  |               |               |                  |
| 资产                          |                  |                  |               |               |                  |
| 银行存款                        | 5,431,610.00     | -                | -             | -             | 5,431,610.00     |
| 存出保证金                       | 7,399.97         | -                | -             | -             | 7,399.97         |
| 交易性金融资产                     | 967,589,000.00   | 1,711,442,000.00 | 60,792,000.00 | -             | 2,739,823,000.00 |
| 应收利息                        | -                | -                | -             | 50,894,991.78 | 50,894,991.78    |
| 资产总计                        | 973,028,009.97   | 1,711,442,000.00 | 60,792,000.00 | 50,894,991.78 | 2,796,157,001.75 |
| 负债                          |                  |                  |               |               |                  |
| 应付管理人报酬                     | -                | -                | -             | 617,788.87    | 617,788.87       |
| 应付托管费                       | -                | -                | -             | 205,929.63    | 205,929.63       |
| 卖出回购金融资产款                   | 305,058,237.41   | -                | -             | -             | 305,058,237.41   |
| 应付交易费用                      | -                | -                | -             | 67,789.85     | 67,789.85        |
| 应付利息                        | -                | -                | -             | 44,285.68     | 44,285.68        |
| 应交税费                        | -                | -                | -             | 21,508.03     | 21,508.03        |
| 其他负债                        | -                | -                | -             | 233,138.35    | 233,138.35       |
| 负债总计                        | 305,058,237.41   | -                | -             | 1,190,440.41  | 306,248,677.82   |
| 利率敏感度缺口                     | 667,969,772.56   | 1,711,442,000.00 | 60,792,000.00 | 49,704,551.37 | 2,489,908,323.93 |
| 上年度末<br>2020 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内            | 1-5 年            | 5 年以上         | 不计息           | 合计               |
| 资产                          |                  |                  |               |               |                  |
| 银行存款                        | 1,915,746.69     | -                | -             | -             | 1,915,746.69     |
| 存出保证金                       | 7,086.96         | -                | -             | -             | 7,086.96         |
| 交易性金融资产                     | 1,229,823,933.29 | 1,410,777,000.00 | 58,548,000.00 | -             | 2,699,148,933.29 |
| 应收利息                        | -                | -                | -             | 42,392,312.58 | 42,392,312.58    |
| 资产总计                        | 1,231,746,766.94 | 1,410,777,000.00 | 58,548,000.00 | 42,392,312.58 | 2,743,464,079.52 |
| 负债                          |                  |                  |               |               |                  |
| 应付管理人报酬                     | -                | -                | -             | 702,522.87    | 702,522.87       |
| 应付托管费                       | -                | -                | -             | 234,174.28    | 234,174.28       |
| 卖出回购金融资产款                   | 254,999,327.50   | -                | -             | -             | 254,999,327.50   |
| 应付交易费用                      | -                | -                | -             | 46,368.25     | 46,368.25        |
| 应付利息                        | -                | -                | -             | 37,257.92     | 37,257.92        |
| 应交税费                        | -                | -                | -             | 14,245.62     | 14,245.62        |
| 其他负债                        | -                | -                | -             | 219,000.00    | 219,000.00       |
| 负债总计                        | 254,999,327.50   | -                | -             | 1,213,168.64  | 256,212,496.14   |
| 利率敏感度缺口                     | 976,747,439.44   | 1,410,777,000.00 | 58,548,000.00 | 41,138,743.64 | 2,487,211,183.08 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |
|----|--------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |
|----|--------------------|

|    | 相关风险变量的变动     | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|----|---------------|-----------------------------|------------------------|
|    |               | 本期末（2021 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 市场利率下降 25 个基点 | 12,838,370.23               | 11,244,754.87          |
|    | 市场利率上升 25 个基点 | -12,755,016.76              | -11,129,522.91         |

#### 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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 2,739,823,000.00 | 97.99         |
|    | 其中：债券             | 2,635,173,000.00 | 94.24         |
|    | 资产支持证券            | 104,650,000.00   | 3.74          |
| 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      | 5,431,610.00     | 0.19          |
| 8  | 其他各项资产            | 50,902,391.75    | 1.82          |
| 9  | 合计                | 2,796,157,001.75 | 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

注：本基金本报告期内未持有股票。

#### 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

注：本基金本报告期内未持有股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未持有股票。

## 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      | 340,474,000.00   | 13.67         |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 2,245,604,000.00 | 90.19         |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,390,948,000.00 | 55.86         |
| 4  | 企业债券      | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -             |
| 6  | 中期票据      | 49,095,000.00    | 1.97          |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -             |
| 8  | 同业存单      | -                | -             |
| 9  | 其他        | -                | -             |
| 10 | 合计        | 2,635,173,000.00 | 105.83        |

## 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  | 1828004 | 18 招商银行 01     | 2,300,000 | 231,955,000.00 | 9.32          |
| 2  | 210202  | 21 国开 02       | 2,300,000 | 230,207,000.00 | 9.25          |
| 3  | 190011  | 19 付息国债 11     | 2,000,000 | 200,520,000.00 | 8.05          |
| 4  | 180408  | 18 农发 08       | 1,900,000 | 195,187,000.00 | 7.84          |
| 5  | 1928005 | 19 浦发银行 小微债 01 | 1,900,000 | 191,216,000.00 | 7.68          |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（份）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|---------|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 139100 | 18 侨鑫 A | 1,000,000 | 104,650,000.00 | 4.20          |

## 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

## 7.10.3 本期国债期货投资评价

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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

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

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

银保监会于 2020 年 7 月 13 日作出银保监罚决字（2020）24 号处罚决定，由于华夏银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）内控制度执行不到位，严重违反审慎经营规则；（二）生产系统存在重大风险隐患，严重违反审慎经营规则；（三）账务管理工作存在重大错漏，长期未发现异常挂账情况，严重违反审慎经营规则；（四）长期未处置风险监控预警信息，严重违反审慎经营规则。根据相关规定对公司罚款 110 万元。

银保监会于 2021 年 5 月 17 日作出银保监罚决字（2021）19 号处罚决定，由于华夏银行股份有限公司（以下简称“公司”）违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、第四十七条和相关审慎经营规则，根据相关规定对公司罚款 9830 万元。

国家开发银行违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 25 日做出银保监罚决字（2020）67 号处罚决定，罚款 4880 万元。

国家开发银行海南省分行因擅自提供对外担保，违反《中华人民共和国外汇管理条例》（中华人民共和国国务院令 532 号）第四十三条相关规定，国家外汇管理局海南省分局于 2021 年 3 月

3 日作出琼汇检罚〔2021〕2 号处罚决定，对该分行给予警告，处人民币 4266.16 万元的罚款。

渤海银行股份有限公司（以下简称“公司”）因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日作出银保监罚决字〔2021〕13 号处罚，对公司罚款 9720 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日作出银保监罚决字〔2021〕16 号处罚决定，由于招商银行股份有限公司（以下简称“公司”）：为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位等违规经营。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，对公司罚款 7170 万元。

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 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   | 7,399.97      |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 50,894,991.78 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 50,902,391.75 |

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 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。

### 7.11.6 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

| 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（%） |
| 3        | 821,889,324.64 | 2,465,667,973.91 | 100.00    | -     | -         |

### 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                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 11,021,445.81 | 0.45            | 10,000,000.00 | 0.41            | 3年         |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -               | -             | -               | -          |
| 基金经理等人员     | -             | -               | -             | -               | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -               | -             | -               | -          |
| 其他          | -             | -               | -             | -               | -          |
| 合计          | 11,021,445.81 | 0.45            | 10,000,000.00 | 0.41            | 3年         |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2018年9月19日） | 1,009,999,000.00 |
|---------------------|------------------|

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 基金份额总额                   |                  |
| 本报告期期初基金份额总额             | 2,465,490,416.93 |
| 本报告期基金总申购份额              | 177,556.98       |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 本报告期期末基金份额总额             | 2,465,667,973.91 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021年3月2日，王金涛担任平安基金管理有限公司总经理助理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

注：1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、基金交易单元的选择标准如下：

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

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 平安证券 | 20,000,000.00 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                    | 法定披露方式       | 法定披露日期           |
|----|---|--------------|------------------|
| 1  | 平安基金管理有限公司 2020 年 12 月 31 日基金净值公告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 01 月 01 日 |
| 2  | 平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 01 月 20 日 |
| 3  | 平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 03 日 |
| 4  | 平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 03 日 |
| 5  | 关于平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 13 日 |
| 6  | 平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2020 年年度报告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 29 日 |
| 7  | 平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 04 月 21 日 |
| 8  | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告  | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 06 月 02 日 |

|    |  |              |                  |
|----|--|--------------|------------------|
| 9  | 平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金分红公告               | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 06 月 11 日 |
| 10 | 关于平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告  | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 06 月 24 日 |
| 11 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 06 月 25 日 |

## § 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                  |      | 报告期末持有基金情况 |                  |          |
|-------|----------------|-------------------------|------------------|------|------------|------------------|----------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额       | 持有份额             | 份额占比 (%) |
| 机构    | 1              | 2021/01/01--2021/06/30  | 1,401,295,676.16 | -    | -          | 1,401,295,676.16 | 56.83    |
|       | 2              | 2021/01/01--2021/06/30  | 1,053,350,851.94 | -    | -          | 1,053,350,851.94 | 42.72    |
| 个人    | -              | -                       | -                | -    | -          | -                | -        |

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金募集注册的文件



- (2) 平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同
- (3) 平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金托管协议
- (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，客户服务热线：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日