

# 平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:平安证券股份有限公司  
基金托管人:中信银行股份有限公司  
报告送出日期:2023 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称：本计划、本集合计划）管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

本计划托管人中信银行股份有限公司根据本计划合同规定，于2023年7月25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。

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

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

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》，原计划于2021年5月12日合同变更生效，变更后本计划按照《基金法》及其他有关规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年6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
<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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产(基金净值)变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.11 投资组合报告附注.....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>53</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划			
基金简称	平安安赢添利半年债券			
基金主代码	970011			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2021 年 05 月 12 日			
基金管理人	平安证券股份有限公司			
基金托管人	中信银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	126,077,122.73 份			
基金合同存续期	本集合计划存续期限为自本合同生效之日起 3 年			
下属分级基金的基金简称	平安安赢添利半年债券 A	平安安赢添利半年债券 B	平安安赢添利半年债券 C	平安安赢添利半年债券 D
下属分级基金的交易代码	970011	970012	970013	970014
报告期末下属分级基金的份额总额	121,596,637.42 份	2,526,704.14 份	1,953,781.17 份	0.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现计划资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	精选信用债做底仓配置，在获取稳健收益的基础上，通过债券波段操作、利率中性策略交易、权益资产投资等方式博取超额收益。本集合计划投资策略具有攻守兼备的特点，在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数*90%+沪深 300 指数*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安证券股份有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李薇	庄世丹
	联系电话	0755-23997814	0755-25945808
	电子邮箱	liweip@pasc.com.cn	zhuangshidan_sz@citicbank.com

客户服务电话	95511-8	95558
传真	0755-82408101	010-58810930
注册地址	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址	深圳市福田区福田街道福华三路 15 号与金田路交汇处卓越世纪中心 1 号楼 36 层	深圳市福田区中心三路卓越时代广场二期中信证券大厦 8 楼
邮政编码	518033	518048
法定代表人	何之江	朱鹤新

## 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="https://stock.pingan.com/">https://stock.pingan.com/</a>
基金中期报告备置地点	广东省深圳市福田区福田街道福华三路 15 号与金田路交汇处卓越世纪中心 1 号楼 36 层

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日）			
	平安安赢添利半年债券 A	平安安赢添利半年债券 B	平安安赢添利半年债券 C	平安安赢添利半年债券 D
本期已实现收益	-518,147.11	-21,275.18	-14,153.12	-
本期利润	1,117,736.61	43,069.47	15,709.45	-
加权平均基金份额本期利润	0.0082	0.0114	0.0057	-
本期加权平均净值利润率	0.79%	1.11%	0.56%	-
本期基金份额净值增长率	0.69%	0.53%	0.64%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）			
期末可供分配利润	3,501,077.01	55,663.40	51,175.13	-
期末可供分配基金份额利润	0.0288	0.0220	0.0262	-
期末基金资产净值	125,097,714.43	2,582,367.54	2,004,956.30	0.00

期末基金份额净值	1.0288	1.0220	1.0262	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2023 年 06 月 30 日）			
基金份额累计净值增长率	2.88%	2.20%	2.62%	0.00%

### 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

##### 平安安赢添利半年债券 A 净值表现

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	0.40%	0.27%	0.50%	0.08%	-0.10%	0.19%
过去三个月	-0.18%	0.22%	0.99%	0.08%	-1.17%	0.14%
过去六个月	0.69%	0.19%	2.34%	0.08%	-1.65%	0.11%
过去一年	-1.63%	0.19%	2.23%	0.10%	-3.86%	0.09%
自基金合同生效起至今	2.88%	0.14%	6.03%	0.12%	-3.15%	0.02%

##### 平安安赢添利半年债券 B 净值表现

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	0.37%	0.27%	0.50%	0.08%	-0.13%	0.19%
过去三个月	-0.26%	0.22%	0.99%	0.08%	-1.25%	0.14%
过去六个月	0.53%	0.19%	2.34%	0.08%	-1.81%	0.11%
过去一年	-1.92%	0.19%	2.23%	0.10%	-4.15%	0.09%
自基金合同生效起至今	2.20%	0.14%	6.15%	0.12%	-3.95%	0.02%

##### 平安安赢添利半年债券 C 净值表现

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	0.40%	0.27%	0.50%	0.08%	-0.10%	0.19%
过去三个月	-0.21%	0.21%	0.99%	0.08%	-1.20%	0.13%
过去六个月	0.64%	0.19%	2.34%	0.08%	-1.70%	0.11%
过去一年	-1.72%	0.19%	2.23%	0.10%	-3.95%	0.09%
自基金合同生效起至今	2.62%	0.14%	5.89%	0.12%	-3.27%	0.02%

##### 平安安赢添利半年债券 D 净值表现

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	0.00%	0.00%	0.50%	0.08%	-0.50%	-0.08%

过去三个月	0.00%	0.00%	0.99%	0.08%	-0.99%	-0.08%
过去六个月	0.00%	0.00%	2.34%	0.08%	-2.34%	-0.08%
过去一年	0.00%	0.00%	2.23%	0.10%	-2.23%	-0.10%
自基金合同生效起至今	0.00%	0.00%	6.03%	0.12%	-6.03%	-0.12%

### 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

平安安赢添利半年债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年05月12日-2023年06月30日)



平安安赢添利半年债券B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年05月12日-2023年06月30日)



平安安赢添利半年债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年05月12日-2023年06月30日)



平安安赢添利半年债券D累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年05月12日-2023年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安证券股份有限公司（以下简称“平安证券”），是中国平安保险（集团）股份有限公司旗下重要成员，前身为 1991 年 8 月创立的平安保险证券业务部。根据中国人民银行于 1995 年 10 月

23 日下发的《关于成立平安证券有限责任公司的批复》（银复[1995]368 号），平安证券于 1996 年 7 月取得中华人民共和国国家工商行政管理局核发的《企业法人营业执照》（第 1000001002345 号），平安证券正式成立。

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

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

截至 2023 年 3 月，平安证券资产管理总规模达到 3557 亿元（含专项计划），行业排名第 7。根据中国证券投资基金业协会的统计数据，2023 年 1 季度平安证券资产管理月均规模为 1552.42 亿元（不含专项计划），行业排名第 12。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜杰特	投资经理	2021-05-12	2023-06-05	8 年	姜杰特，原平安证券资产管理事业部公募团队投资经理（现已离任），华东师范大学金融硕士。2014 年 7 月至 2015 年 10 月就职于江海证券有限公司，担任债券融资承做经理，2015 年 11 月加入平安证券股份有限公司，曾任固定收益投资经理助理。自 2017 年 9 月 28 日起至今担任平安证券稳健资本一号 7 期集合资产管理计划（已更名为平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划）投资经理。自 2017 年 9 月 28 日起至 2019 年 7 月 10 日担任平安证券橙明 1 号集合资产管理计划投资经理、平安证券橙明 2 号集合资产管理计划、平安证券橙明 3 号集合资产管理计划投资经理。自 2017 年 9 月 28 日起至 2018 年 12 月 25 日担任平安证券橙明 4 号集合资产管理计划投资经理。自 2017 年 9 月 28

					日起至 2018 年 11 月 7 日担任平安证券橙金 1 号集合资产管理计划投资经理。自 2018 年 3 月 12 日起至 2018 年 11 月 25 日担任平安证券安稳 1 号集合资产管理计划投资经理。
阮毅	投资经理	2023-05-29	-	5 年	阮毅，2011 年 6 月加入上海浦东发展银行总行资产管理部，历任债券交易员、产品经理、投资经理和固收专户投资主管，专户管理规模超过 1000 亿，管理产品曾获证券时报评选最佳开发式产品奖项，2018 年 5 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司。2018 年 10 月至 2021 年 7 月任华泰紫金智盈债券型证券投资基金基金经理。2019 年 5 月至 2021 年 7 月任华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 7 月任华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 7 月任华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月任华泰紫金智鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月任华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2021 年 8 月加入平安证券股份有限公司。2021 年 10 月至 2023 年 5 月任平安证券年年安 6 号单一资产管理计划投资经理。2021 年 10 月至 2023 年 5 月任平安证券星辰 1 号集合资产管理计划、平安证券星辰 3 号集合资产管理计划、平安证券星辰 5 号集合资产管理计划、平安证券星火 1 号集合资产管理计划、平安证券星火 2 号集合资

			<p>产管理计划、平安证券星云 1 号集合资产管理计划投资经理。2021 年 10 月至 2022 年 4 月任平安证券星耀光银 1 号集合资产管理计划、平安证券成长 5 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券成长 6 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券成长 7 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券星耀光银 2 号集合资产管理计划、平安证券星耀光银 3 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 3 月至 2022 年 4 月任平安证券成长 8 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券成长 9 号 FOF 集合资产管理计划投资经理。2022 年 4 月至 2023 年 5 月任平安证券星虹工享 1 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 6 月至 2023 年 5 月任平安证券星耀黍乾 9 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 10 月至 2023 年 5 月任平安证券星耀稳世 1 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 11 月至 2023 年 5 月任平安证券星虹工享 2 号集合资产管理计划、平安证券星虹工享 3 号集合资产管理计划投资经理。自 2023 年 5 月 29 日起至今担任《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划》《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划》投资经理。</p>
--	--	--	---

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

管理人通过建立完善规范、合规的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析等手段，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度等，建立集中交易管理机制，并重视交易执行环节的公平交易措施，以时间优先、价格优先作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，确保公平对待各投资组合。报告期，管理人公平交易制度总体执行情况良好，未发现本计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债市整体呈现倒 V 走势。1-2 月流动性明显收敛，资金中枢抬升，且波动加大。加上银行资本管理新规利空同业资产，短端大幅调整。市场对基本面复苏高度和持续性仍有分歧，长端维持窄幅波动。债市转折点出现在 3 月份，两会将全年经济增长目标设定在 5% 左右，未出现超预期政策。叠加上中小银行出现资产荒，理财规模企稳，前期积累的欠配压力释放，利率开启下行。随后 4 月 PMI 重回收缩区间，经济基本面预期开始下修；同时央行开启宽松操作，助推了利率的进一步下行。整体看，各品种收益率曲线明显下移；利差层面，信用利差下行。10 年国债到期收益率下行 20bp 至 2.64%，1 年国债到期收益率下行 22bp 至 1.87%，1 年 AAA 中短期票据到期收益率下行 24bp 至 2.47%，1 年 AAA 存单到期收益率下行 18bp 至 2.32%。权益市场受疫后恢复提振，年初涨幅较大，但随着机构对经济预期的反复，导致市场情绪的波动加剧，尤其是二季度，预期和库存的波动放大了需求不足的担忧，导致市场大幅回调。不过从当前股债反映的增长预期来看，隐含的悲观程度已超过 2022 年 5 月时的水平，接近 2022 年 10 月底的水平。

本报告期内，本集合计划以配置高等级信用债为主，利率品种主要用以短期交易、增厚收益，另有配置少部分低价转债；股票上半年整体处于轻仓状态，降低了新能源板块的配置比例，在人工智能、国企改革等方向上增加了配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末平安安赢添利半年债券 A 基金份额净值为 1.0288 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.69%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%；截至报告期末平安安赢添利半年债券 B 基金份额净值为 1.0220 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.53%，同期业绩比较基准

收益率为 2.34%；截至报告期末平安安赢添利半年债券 C 基金份额净值为 1.0262 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.64%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%；截至报告期末平安安赢添利半年债券 D 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，预计市场主要的关注点依然是宽信用政策的发力情况。当前国内生产和需求的压力仍旧较大，市场对于资产负债表衰退的讨论空前。随着债券收益率处于相对低位区间，市场对于政策的敏感度将会进一步提高。关注政策落地情况及对实体经济的刺激效果。对于权益市场而言，当前市场本身已处在一个隐含风险溢价较高、多数行业拥挤度较低的位置，具备修复的空间。结构上，大部分板块包括消费、顺周期、高端制造等都已处于低位，TMT 也已明显回调。因此，随着经济悲观预期缓解，同时政策宽松呵护预期升温，叠加外部因素的冲击也逐步过去，市场有望迎来做多窗口。未来一个阶段，市场或将进入一个贝塔式的修复，行业板块扩散、赚钱效应提升。结构上，除了“数字经济”和“中特估”两大主线外，阶段性像军工新能源这些科技制造、中报绩优的消费股，以及一些顺周期板块，都有低位修复机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本资产管理计划管理人按照企业会计准则、中国证券监督管理委员会的相关规定、中国证券投资基金业协会多相关指引以及资产管理计划合同的约定，对资产管理计划所持有的投资品种进行估值。本资产管理计划托管人根据法律法规及资产管理计划合同要求履行估值及净值计算的复核责任。

本资产管理计划管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值决策委员会。估值决策委员会负责公司资产管理业务估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司资产管理业务估值政策、程序及方法的科学合理性，保证资产管理业务估值的公平、合理。估值决策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。

本资产管理计划管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益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

本集合计划报告期间内未进行利润分配。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，诚信地履行了托管人的职责，不存在损害本集合计划持有人利益的行为。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议对本计划管理人的投资运作进行了必要的监督。本托管人认为，平安证券股份有限公司在本计划的运作中不存在损害计划份额持有人利益的行为；在报告期间，遵守了有关法律法规，在各重要方面的运作按照计划合同的规定执行。

### 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

本托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整没有异议。

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,060,023.21	1,293,751.21
结算备付金		2,185,019.75	2,507,338.13
存出保证金		39,120.30	20,137.64
交易性金融资产	6.4.7.2	152,674,420.33	200,063,499.05
其中：股票投资		13,335,700.00	20,848,731.20
基金投资		-	-
债券投资		139,338,720.33	168,838,726.75
资产支持证券投资		-	10,376,041.10
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-

买入返售金融资产		-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		186,536.98	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.3	60,976.60	120,960.00
资产总计		156,206,097.17	204,005,686.03
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		26,191,024.65	38,588,567.14
应付清算款		-	322,865.74
应付赎回款		208,355.27	80,363.37
应付管理人报酬		44,081.34	59,721.58
应付托管费		5,510.16	7,465.20
应付销售服务费		808.83	1,998.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		46,047.86	69,481.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.4	25,230.79	39,833.73
负债合计		26,521,058.90	39,170,296.14
<b>净 资 产：</b>			
实收基金	6.4.7.5	126,077,122.73	161,353,961.11
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.6	3,607,915.54	3,481,428.78
净资产合计		129,685,038.27	164,835,389.89
负债和净资产总计		156,206,097.17	204,005,686.03

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 126,077,122.73 份。其中平安安赢添利半年债券 A 基金份额净值 1.0288 元，基金份额总额 121,596,637.42 份；平安安赢添利半年债券 B 基金份额净值 1.0220 元，基金份额总额 2,526,704.14 份；平安安赢添利半年债券 C 基金份额净值 1.0262 元，基金份额总额 1,953,781.17 份；平安安赢添利半年债券 D 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 0.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,005,606.05	4,450,430.31
1. 利息收入		29,447.77	32,626.54
其中：存款利息收入	6.4.7.7	23,870.83	32,383.23
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		5,576.94	250.61
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-7.30
2. 投资收益（损失以“-”填列）		246,067.34	4,453,627.08
其中：股票投资收益	6.4.7.8	-2,935,808.60	-823,433.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.9	2,911,417.92	5,101,704.28
资产支持证券投资收益	6.4.7.10	14,523.22	337,140.79
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	52,596.80	-61,475.70
股利收益	6.4.7.12	203,338.00	29,385.94
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-129,694.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	1,730,090.94	-35,823.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		829,090.52	1,153,428.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	293,948.25	515,814.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,743.48	64,476.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,215.39	27,104.78
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		362,862.87	469,674.19
其中：卖出回购金融资产支出		362,862.87	469,674.19
6. 信用减值损失		-	-

7. 税金及附加		9,026.54	15,564.25
8. 其他费用	6.4.7.14	119,293.99	60,794.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,176,515.53	3,297,001.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,176,515.53	3,297,001.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,176,515.53	3,297,001.56

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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（基金净值）	161,353,961.11	-	3,481,428.78	164,835,389.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	161,353,961.11	-	3,481,428.78	164,835,389.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-35,276,838.38	-	126,486.76	-35,150,351.62
（一）、综合收益总额	-	-	1,176,515.53	1,176,515.53
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-35,276,838.38	-	1,050,028.77	-36,326,867.15
其中：1. 基金申购款	22,099.78	-	507.22	22,607.00
2. 基金赎回款	-35,298,938.16	-	1,050,535.99	-36,349,474.15
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	126,077,122.73	-	3,607,915.54	129,685,038.27
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 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（基金净值）	284,264,054.47	-	9,016,979.58	293,281,034.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	284,264,054.47	-	9,016,979.58	293,281,034.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-67,766,383.90	-	846,404.14	-66,919,979.76
（一）、综合收益总额	-	-	3,297,001.56	3,297,001.56
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-67,766,383.90	-	2,450,597.42	-70,216,981.32
其中：1. 基金申购款	3,697,460.66	-	121,343.16	3,818,803.82
2. 基金赎回款	-71,463,844.56	-	2,571,940.58	-74,035,785.14
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	216,497,670.57	-	9,863,383.72	226,361,054.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

何之江

何瑜

文波

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由原平安证券稳健资本一号集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。原集合计划为非限定性集合资产管理计划，2011年8月5日经中国证监会证监许可【2011】1239号核准设立，自2011年10月11日起开始募集，于2011年11月11日结束募集工作，并于2011年11月18日正式成立。

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国

证监会申请合同变更。

本集合计划根据中国证监会《关于准予平安证券稳健资本一号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2021】261号）准予变更，自2021年5月12日起，《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《平安证券稳健资本一号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约开放式，存续期限为合同生效之日起3年。本集合计划的管理人为平安证券股份有限公司（以下简称“平安证券”），注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。托管人为中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

本集合计划的投资组合比例为：本计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率\*90%+沪深300指数收益率\*10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和资产净值变动情况。

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

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

#### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

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

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

##### (2) 金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本集合计划的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产

生的利得或损失，均计入当期损益。

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

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

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

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

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

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

本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本集合计划对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本集合计划在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 集合计划收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配，具体分配方案以公告为准；

(2) 本集合计划收益分配方式为：现金分红；

(3) 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本计划各份额类别收取的销售服务费不同，各份额类别对应的可供分配利润将有所不同

同。本计划同一类别的每一计划份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

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

(2) 本集合计划目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本集合计划自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本集合计划亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本集合计划考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本集合计划的影响不重大。

本集合计划将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。“信用减值损失”项目，反映本集合计划计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本集合计划将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准

则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,256,430.72 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 709.38 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,257,140.10 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,605,050.90 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,100.55 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,606,151.45 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 77,380.37 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 38.39 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 77,418.76 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 6,644,039.78 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 709.38 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 1,100.55 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 38.39 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 6,642,191.46 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 361,946,235.76 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 6,642,191.46 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 368,588,427.22 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 79,999,851.50 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 19,164.98 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 80,019,016.48 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 19,164.98 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 19,164.98 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本集合计划金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本集合计划本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

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

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

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，通知自 2018 年 1 月 1 日起施行。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

##### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。本集合计划分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

##### 7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

##### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计

入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

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

#### 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 2023 年 06 月 30 日
活期存款	922,400.67
等于：本金	922,119.03
加：应计利息	281.64
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	137,622.54
等于：本金	136,962.60
加：应计利息	659.94
减：坏账准备	-
合计	1,060,023.21

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	13,211,346.81	-	13,335,700.00	124,353.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,255,471.82	52,358,231.22	-281,089.90
	银行间市场	85,559,725.00	1,526,414.11	-105,650.00

	合计	136,943,574.30	2,781,885.93	139,338,720.33	-386,739.90
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	150,154,921.11	2,781,885.93	152,674,420.33	-262,386.71

#### 6.4.7.3 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,976.60
合计	60,976.60

#### 6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,013.80
其中：交易所市场	-
银行间市场	6,013.80
应付利息	-
预提费用	19,216.99
合计	25,230.79

#### 6.4.7.5 实收基金

##### 平安安赢添利半年债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	151,939,032.70	151,939,032.70
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-30,342,395.28	-30,342,395.28
本期末	121,596,637.42	121,596,637.42

##### 平安安赢添利半年债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	6,473,820.30	6,473,820.30
本期申购	22,099.78	22,099.78
本期赎回（以“-”号填列）	-3,969,215.94	-3,969,215.94
本期末	2,526,704.14	2,526,704.14

平安安赢添利半年债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,941,108.11	2,941,108.11
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-987,326.94	-987,326.94
本期末	1,953,781.17	1,953,781.17

平安安赢添利半年债券 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	0.00	0.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	-	-

6.4.7.6 未分配利润

平安安赢添利半年债券 A

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
本期期初	5,380,087.01	-2,064,247.19	3,315,839.82
本期利润	-518,147.11	1,635,883.72	1,117,736.61
本期基金份额交易产生的变动数	-1,068,236.31	135,736.89	-932,499.42
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,068,236.31	135,736.89	-932,499.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,793,703.59	-292,626.58	3,501,077.01

平安安赢添利半年债券 B

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
本期期初	194,927.54	-87,415.30	107,512.24
本期利润	-21,275.18	64,344.65	43,069.47

本期基金份额交易产生的变动数	-111,965.36	17,047.05	-94,918.31
其中：基金申购款	646.69	-139.47	507.22
基金赎回款	-112,612.05	17,186.52	-95,425.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	61,687.00	-6,023.60	55,663.40

#### 平安安赢添利半年债券 C

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
本期期初	98,122.59	-40,045.87	58,076.72
本期利润	-14,153.12	29,862.57	15,709.45
本期基金份额交易产生的变动数	-27,986.87	5,375.83	-22,611.04
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-27,986.87	5,375.83	-22,611.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,982.60	-4,807.47	51,175.13

#### 6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	6,242.52
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	17,372.31
其他	256.00
合计	23,870.83

#### 6.4.7.8 股票投资收益

##### 6.4.7.8.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	105,770,746.53
减：卖出股票成本总额	108,584,575.57
减：交易费用	121,979.56
买卖股票差价收入	-2,935,808.60

#### 6.4.7.9 债券投资收益

##### 6.4.7.9.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2,723,110.25

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	188,307.67
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	2,911,417.92

#### 6.4.7.9.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	209,977,910.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	206,087,953.00
减：应计利息总额	3,697,253.67
减：交易费用	4,395.78
买卖债券差价收入	188,307.67

#### 6.4.7.10 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.10.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
资产支持证券投资收益——利息收入	14,523.22
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	14,523.22

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

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出资产支持证券成交总额	10,390,000.00
减：卖出资产支持证券成本总额	10,000,000.00
减：应计利息总额	390,000.00
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

#### 6.4.7.11 衍生工具收益

##### 6.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	53,000.00
减：交易费用	403.20
合计	52,596.80

#### 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	203,338.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	203,338.00

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,730,090.94
——股票投资	923,430.82
——债券投资	807,660.12
——资产支持证券投资	-1,000.00
——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	1,730,090.94

#### 6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,983.40
证券出借违约金	-
其他费用	21,613.60
账户维护费	27,780.00
合计	119,293.99

#### 6.4.7.15 分部报告

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

本集合计划目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本计划无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本计划无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安证券股份有限公司	管理人、销售机构
中信银行股份有限公司	托管人、代理销售机构
平安银行股份有限公司	管理人最终母公司控制的公司、代理销售机构
上海陆金所基金销售有限公司	管理人最终母公司控制的公司、代理销售机构

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
平安证券	205,918,860.08	100.00%	110,361,973.18	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

注：报告期内，本集合计划未涉及权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至
-------	----	---------------------------

	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
平安证券	49,381,627.22	100.00%	76,180,406.80	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
平安证券	2,075,350,000.00	100.00%	2,351,900,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：平安证券已免除本集合计划的交易佣金。

#### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	293,948.25	515,814.36
其中：支付销售机构的客户维护费	-	0

注：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.4% 年费率计提，计算方法如下：

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

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，经托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管	36,743.48	64,476.81

费		
---	--	--

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 年费率计提，计算方法如下：

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令，经托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	平安安赢添利半年债券 A	平安安赢添利半年债券 B	平安安赢添利半年债券 C	平安安赢添利半年债券 D	合计
中信银行股份有限公司	-	5.43	-	-	5.43
平安银行股份有限公司	-	1,249.10	437.80	-	1,686.90
上海陆金所基金销售有限公司	-	325.82	-	-	325.82
平安证券代销（管理人）	-	4,229.79	719.47	-	4,949.26
合计	-	5,810.14	1,157.27	-	6,967.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	平安安赢添利半年债券 A	平安安赢添利半年债券 B	平安安赢添利半年债券 C	平安安赢添利半年	合计

				年 债 券 D	
中信银行股份有限 公司	-	5.43	-	-	5.43
平安银行股份有限 公司	-	7,684.26	450.45	-	8,134.71
上海陆金所基金销 售有限公司	-	693.60	-	-	693.60
平安证券代销（管 理人）	-	13,256.74	4,867.37	-	18,124.11
合计	-	21,640.03	5,317.82	-	26,957.85

注：本计划 A 类及 D 类计划份额不收取销售服务费，B 类计划份额的销售服务费年费率为 0.3%，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.1%。本计划销售服务费主要用于本计划份额持有人服务等各项费用。销售服务费按前一日 B 类或 C 类计划份额资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的 B 类或 C 类计划份额销售服务费

E 为前一日的 B 类或 C 类计划份额的资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划销售服务费划付指令，经托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中划出。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

#### 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：报告期内管理人未运用固有资金投资本集合计划。

#### 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：报告期内管理人之外的其他关联方未投资本集合计划。

#### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	922,400.67	5,073.79	2,408,223.75	10,473.04

#### 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：报告期内本集合计划未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划报告期由关联方平安期货保管的结算备付金的期末余额及当期产生的利息收入情况如下：

2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日，结算备付金当期利息收入 0.00 元，期末余额 472,077.75 元。

2021 年 5 月 12 日(集合计划合同变更生效日)至 2021 年 12 月 31 日，结算备付金当期利息收入 0.00 元，期末余额 1,381,673.65 元。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：报告期内本集合计划未分配利润。

#### 6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本集合计划期末未持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划期末未持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本计划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人民币 0.00 元，无质押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 38,588,567.14 元，于 2023 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本计划在回购期内持有的证券交易所的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本集合计划当期末参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定范围之内。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。管理人搭建了完善的信用风险管理体系，建立了覆盖投前投中投后全流程的管理要求及标准，投前有效识别和评估、重点防范问题债券入池，投中实时测算债券投资相关限制要求，投后加强对于债券监控预警。投前严格准入，坚守质量底线，目前管理人建立了科学的内部信用评级管理机制，评级结果在信用债投资全流程中有效运用。债券投前按照先入池后投资的原则，在获取有效债券内部评级，严格履行内部准入审批程序入池，同时，债券投资需满足管理人内部限额管理、公平交易及价格偏离相关规范要求，在发行人授信额度限额、各类集中度限额及价格合理偏离范围内开展。投中依托系统对各项准入标

准、集中度指标、审批授权、价格偏离等管理要求实时监控预警，确保债券交易中符合投前准入标准、符合各项额度要求且交易价格公允，交易结束后通过各投资组合价差监控分析确保各投资组合债券投资活动公平对待。投后持续加强风险应对和处置能力，通过持续的限额监控、舆情监控、债券池定期检视、债券内部评级跟踪、债券风险分类分级管理等，及时发现风险债券，并匹配相应的应对处置措施。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	40,362,272.72	18,714,450.69
合计	40,362,272.72	18,714,450.69

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	80,195,439.44	139,011,830.16
AAA 以下	873,303.18	771,643.16
未评级	17,907,704.99	10,340,802.74
合计	98,976,447.61	150,124,276.06

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	10,376,041.10
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	10,376,041.10

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指未能以合理价格及时变现产品资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 3 年	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------------	--------	--------	-------------	-------	-------	-----	----

06 月 30 日							
资产							
银行存款	5,501,718 .96	-	-	-	-	-	5,501,718. 96
结算备付金	2,185,019 .75	-	-	-	-	-	2,185,019. 75
存出保证金	39,120.30	-	-	-	-	-	39,120.30
交易性金融资产	30,874,26 5.75	37,628,32 2.36	48,042,42 9.23	22,793,70 2.99	-	13,335,70 0.00	152,674,42 0.33
应收清算款	-	-	-	-	-	186,536.9 8	186,536.98
其他资产	-	-	-	-	-	60,976.60	60,976.60
资产总计	38,600,12 4.76	37,628,32 2.36	48,042,42 9.23	22,793,70 2.99	-	13,583,21 3.58	160,647,79 2.92
负债							
卖出	26,191,02 4.65	-	-	-	-	-	26,191,024 .65

回购金融资产款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	208,355.27	208,355.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	39,673.21	39,673.21
应付托管费	-	-	-	-	-	5,510.16	5,510.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	808.83	808.83
应交税费	-	-	-	-	-	46,047.86	46,047.86
其他负债	-	-	-	-	-	29,638.92	29,638.92
负债总计	26,191,024.65	-	-	-	-	330,034.25	26,521,058.90
利	12,409,10	37,628,32	48,042,42	22,793,70	-	13,253,17	134,126,73

率 敏 感 度 缺 口	0.11	2.36	9.23	2.99		9.33	4.02
上 年 度 末 202 2 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	1,293,751 .21	-	-	-	-	-	1,293,751. 21
结 算 备 付 金	2,507,338 .13	-	-	-	-	-	2,507,338. 13
存 出 保 证 金	20,137.64	-	-	-	-	-	20,137.64
交 易 性 金 融 资 产	19,048,67 2.61	10,041,81 9.18	92,064,97 2.61	57,566,21 4.76	493,088 .69	20,848,73 1.20	200,063,49 9.05
其 他 资 产	-	-	-	-	-	120,960.0 0	120,960.00

资产总计	22,869,89 9.59	10,041,81 9.18	92,064,97 2.61	57,566,21 4.76	493,088 .69	20,969,69 1.20	204,005,68 6.03
负债							
卖出回购金融资产款	38,588,56 7.14	-	-	-	-	-	38,588,567 .14
应付清算款	-	-	-	-	-	322,865.7 4	322,865.74
应付赎回款	-	-	-	-	-	80,363.37	80,363.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	59,721.58	59,721.58
应付托管费	-	-	-	-	-	7,465.20	7,465.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,998.12	1,998.12

应交税费	-	-	-	-	-	69,481.26	69,481.26
其他负债	-	-	-	-	-	39,833.73	39,833.73
负债总计	38,588,567.14	-	-	-	-	581,729.00	39,170,296.14
利率敏感度缺口	-15,718,667.55	10,041,819.18	92,064,972.61	57,566,214.76	493,088.69	20,387,962.20	164,835,389.89

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点		-144,156.51
市场利率下降 25 个基点		144,156.51	298,186.24

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划不涉及境外投资，所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	13,335,700.00	10.28	20,848,731.20	12.65
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	139,338,720.33	107.44	179,214,767.85	108.72
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	152,674,420.33	117.73	200,063,499.05	121.37

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	运用定量分析方法对本集合计划的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对集合计划资产净值产生的影响。正数表示可能增加集合计划资产净值，负数表示可能减少集合计划资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	1,403,439.33	2,938,848.62
	业绩比较基准下降 5%	-1,403,439.33	-2,938,848.62

#### 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。

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

##### 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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	17,971,331.38	25,647,303.14
第二层次	134,703,088.95	174,416,195.91
第三层次	-	-
合计	152,674,420.33	200,063,499.05

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期未发生公允价值所属层次间的重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本财务报表根据《关于 2022 年基金中期和年度报告填报相关建议及调整说明》的相关要求调整了比较数据的列报。

上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额；上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

## § 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	13,335,700.00	8.54
	其中：股票	13,335,700.00	8.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	139,338,720.33	89.20
	其中：债券	139,338,720.33	89.20
	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	3,245,042.96	2.08
8	其他各项资产	286,633.88	0.18
9	合计	156,206,097.17	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,533,600.00	3.50
C	制造业	5,769,700.00	4.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	281,700.00	0.22
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,750,700.00	2.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,335,700.00	10.28

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	250,000	1,590,000.00	1.23
2	600438	通威股份	45,000	1,543,950.00	1.19
3	601857	中国石油	200,000	1,494,000.00	1.15
4	300308	中际旭创	10,000	1,474,500.00	1.14
5	600938	中国海油	80,000	1,449,600.00	1.12

6	600941	中国移动	15,000	1,399,500.00	1.08
7	601728	中国电信	240,000	1,351,200.00	1.04
8	000333	美的集团	20,000	1,178,400.00	0.91
9	688503	聚和材料	10,000	975,000.00	0.75
10	600685	中船防务	10,000	299,500.00	0.23
11	300847	中船汉光	13,000	298,350.00	0.23
12	600072	中船科技	10,000	281,700.00	0.22

## 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	600438	通威股份	4,003,495.00	2.43
2	600938	中国海油	3,604,726.00	2.19
3	601186	中国铁建	3,593,991.00	2.18
4	603019	中科曙光	3,345,508.10	2.03
5	300014	亿纬锂能	3,244,310.00	1.97
6	601728	中国电信	3,020,182.00	1.83
7	600028	中国石化	2,993,172.00	1.82
8	600941	中国移动	2,947,254.00	1.79
9	601857	中国石油	2,747,222.00	1.67
10	300274	阳光电源	2,655,626.00	1.61
11	300499	高澜股份	2,536,697.00	1.54
12	300125	聆达股份	2,514,506.00	1.53
13	688202	美迪西	1,998,812.96	1.21
14	600009	上海机场	1,996,206.00	1.21
15	600754	锦江酒店	1,988,409.00	1.21
16	600859	王府井	1,981,190.00	1.20
17	301260	格力博	1,977,594.00	1.20
18	300118	东方日升	1,947,490.00	1.18
19	600415	小商品城	1,937,643.00	1.18
20	002938	鹏鼎控股	1,917,262.00	1.16

注：本项买入包括集合计划二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，“买入金额”（或“买入股票成本”）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	300014	亿纬锂能	4,194,949.46	2.54
2	300750	宁德时代	3,996,943.00	2.42
3	601186	中国铁建	3,359,943.00	2.04
4	300499	高澜股份	3,266,639.00	1.98
5	603019	中科曙光	2,844,405.00	1.73
6	300274	阳光电源	2,655,559.96	1.61
7	600438	通威股份	2,321,939.00	1.41
8	600938	中国海油	2,231,982.00	1.35
9	600754	锦江酒店	2,205,616.89	1.34
10	688630	芯碁微装	2,089,325.96	1.27
11	688256	寒武纪	2,055,715.10	1.25
12	300820	英杰电气	2,028,612.00	1.23
13	688202	美迪西	2,009,843.76	1.22
14	600519	贵州茅台	1,995,305.00	1.21
15	600859	王府井	1,961,011.00	1.19
16	600009	上海机场	1,929,553.00	1.17
17	300125	聆达股份	1,888,455.00	1.15
18	600845	宝信软件	1,859,185.00	1.13
19	600011	华能国际	1,837,924.00	1.12
20	300118	东方日升	1,772,145.00	1.08

注：本项卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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	100,148,113.55
卖出股票收入（成交）总额	105,770,746.53

注：本项的买入包括集合计划二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（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	央行票据	-	-
3	金融债券	27,584,297.31	21.27
	其中：政策性金融债	7,363,971.97	5.68

4	企业债券	40,739,742.94	31.41
5	企业短期融资券	30,285,565.19	23.35
6	中期票据	36,093,483.51	27.83
7	可转债(可交换债)	4,635,631.38	3.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	139,338,720.33	107.44

## 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	102101328	21 靖江北辰 MTN002	100,000	10,481,048.08	8.08
2	CND10000B082	16 苏南通一带债	500,000	10,457,822.60	8.06
3	CND10001LGR5	18 格地 02	100,000	10,318,520.82	7.96
4	102100162	21 合川投资 MTN001	100,000	10,312,208.90	7.95
5	188939	21 上唐 01	100,000	10,257,672.74	7.91

## 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

## 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：本集合计划不涉及贵金属投资，报告期末未持有贵金属。

## 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：本集合计划不涉及权证投资，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

本集合计划在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，运用交易活跃度高的国债期货合约，结合宏观经济和债券市场运行趋势的研究，通过多头或空头套期保值等策略进行操作。管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，以达到降低投资组合整体风险的目的。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

通过对宏观经济的全面分析和债券市场的趋势研究，本集合计划在本报告期内以套期保值为主

要目的进行了国债期货投资，有效对冲了利率风险和流动性风险对本集合计划的影响，降低了产品净值波动，符合既定的投资政策和投资目的。

## 7.11 投资组合报告附注

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

投资的前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会及其地方机构、上交所、深交所、中国人民银行的处罚。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本计划投资前十名股票未超出本计划合同规定的备选股票库。

### 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	39,120.30
2	应收清算款	186,536.98
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,976.60
8	其他	-
9	合计	286,633.88

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127040	国泰转债	873,303.18	0.67
2	113055	成银转债	840,481.25	0.65
3	110075	南航转债	838,389.45	0.65
4	113050	南银转债	788,106.79	0.61
5	CND100048552	苏行转债	630,700.94	0.49
6	110079	杭银转债	264,534.56	0.20

## § 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
平安安赢添利半年债券 A	1,579	77,008.64	468,000.00	0.38%	121,128,637.42	99.62%
平安安赢添利半年债券 B	155	16,301.32	-	-	2,526,704.14	100%
平安安赢添利半年债券 C	4	488,445.29	-	-	1,953,781.17	100%
平安安赢添利半年债券 D	0	0.00	-	-	-	-
合计	1,738	72,541.50	468,000.00	0.37%	125,609,122.73	99.63%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安安赢添利半年债券 A	441,136.11	0.3628%
	平安安赢添利半年债券 B	3,074.08	0.1217%
	平安安赢添利半年债券 C	-	-
	平安安赢添利半年债券 D	-	-
	合计	444,210.19	0.3523%

## 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	平安安赢添利半年债券 A	0
	平安安赢添利半年债券 B	0
	平安安赢添利半年债券 C	0
	平安安赢添利半年债券 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安安赢添利半年债券 A	0
	平安安赢添利半年债券 B	0
	平安安赢添利半年债券 C	0
	平安安赢添利半年债券 D	0

	合计	0
--	----	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	平安安赢添利半年债券 A	平安安赢添利半年债券 B	平安安赢添利半年债券 C	平安安赢添利半年债券 D
基金合同生效日（2021 年 05 月 12 日）基金份额总额	787,155,713.62	-	-	-
本报告期期初基金份额总额	151,939,032.70	6,473,820.30	2,941,108.11	0.00
本报告期基金总申购份额	-	22,099.78	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	30,342,395.28	3,969,215.94	987,326.94	-
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	121,596,637.42	2,526,704.14	1,953,781.17	0.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本集合计划报告期内未召开份额持有人大会，无份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，管理人公司执行委员会委员袁玉平 2023 年 2 月 26 日离职，2023 年 5 月 29 日管理人聘任阮毅为本集合计划投资经理，原投资经理姜杰特于 2022 年 6 月 5 日因离职离任；除此之外，本集合计划管理人、托管人的专门托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及管理人、集合计划财产、托管人基金托管业务的重大诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划未发生投资策略的改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本计划未改聘会计师事务所。

## 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	4	102,401,496.00	100.00%	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
平安证券	34,358,557.05	100.00%	959,250,000.00	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	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-01-20
2	平安证券股份有限公司旗下大集合产品季度报告提示性公告	指定报刊	2023-01-20
3	平安证券股份有限公司高级管理人员变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2023-02-28
4	平安证券股份有限公司旗下大集合产品年度报告提示性公告	指定报刊	2023-03-30
5	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划 2022 年年度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-03-30
6	平安证券股份有限公司旗下大集合产品季度报告提示性公告	指定报刊	2023-04-21
7	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年第 1 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-04-21
8	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-05-11
9	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（B 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-05-11
10	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-05-11
11	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（D 类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-05-11
12	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书更新及产品资料概要更新的提示性公告	指定报刊	2023-05-11
13	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划投资经理变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2023-05-29
14	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书更新及产品资料概要	指定报刊	2023-05-29

	更新的提示性公告		
15	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（A类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-05-29
16	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（B类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-05-29
17	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（C类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-05-29
18	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（D类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-05-29
19	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书更新及产品资料概要更新的提示性公告	指定报刊	2023-06-05
20	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（A类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-06-05
21	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（B类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-06-05
22	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（C类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-06-05
23	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（D类份额）基金产品资料概要（更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-06-05

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

2022年12月29日，中国证券投资基金业协会下发了《关于发布〈关于固定收益品种的估值处

理标准>的通知》(中基协字〔2022〕566号),管理人已按监管要求在2023年3月31日前对管理的资产管理产品统一实施新标准

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1)《关于准予平安证券稳健资本一号集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函[2021]261号);
- (2)《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》
- (3)《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划更新的招募说明书》
- (4)《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》
- (5)《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同生效公告》
- (6)管理人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

广东省深圳市福田区福田街道福华三路15号与金田路交汇处卓越世纪中心1号楼36层。

### 12.3 查阅方式

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

平安证券股份有限公司  
二〇二三年八月三十日