

平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资  
基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>13</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 13        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 13        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>15</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 15        |
| 7.2 利润表                                 | 16        |
| 7.3 净资产变动表                              | 17        |
| 7.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                         | 44        |
| 8.3 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 .....            | 44        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                          | 44        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                         | 44        |
| 8.6 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 .....           | 44        |
| 8.7 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 .....        | 45        |
| 8.8 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 .....        | 45        |
| 8.9 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 .....           | 45        |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                    | 45        |
| 8.14 投资组合报告附注 .....                                | 45        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                         | <b>46</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                        | 46        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                     | 46        |
| 9.3 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 .....             | 46        |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 ..... | 46        |
| 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                          | 46        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                        | <b>46</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                           | <b>47</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                             | 47        |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....             | 47        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                  | 47        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                               | 47        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                        | 47        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....                | 47        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                       | 48        |
| 11.8 其他重大事件 .....                                  | 48        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                   | <b>50</b> |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....           | 50        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                          | 50        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                           | <b>51</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                                  | 51        |
| 13.2 存放地点 .....                                    | 51        |
| 13.3 查阅方式 .....                                    | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |   |
|------------|---|
| 基金名称       | 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金  |
| 基金简称       | 平安合瑞定开债   |
| 基金主代码      | 005766  |
| 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，本基金每个开放期不少于 1 个工作日且不超过 20 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 3 月 26 日   |
| 基金管理人      | 平安基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 招商证券股份有限公司  |
| 报告期末基金份额总额 | 1,439,556,865.62 份  |
| 基金合同存续期    | 不定期   |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险及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 | 中证全债指数收益率  |
| 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                      | 招商证券股份有限公司                |
| 信息披露负责人 | 姓名                              | 陈特正                       |
|         | 联系电话                            | 0755-22626828             |
|         | 电子邮箱                            | fundservice@pingan.com.cn |
| 客户服务电话  | 400-800-4800                    | 95565                     |
| 传真      | 0755-23997878                   | 0755-82960794             |
| 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 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 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 | 深圳市福田区福田街道福华一<br>路 111 号 |
| 邮政编码  | 518048                             | 518000                   |
| 法定代表人 | 罗春风                                | 霍达                       |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报  |
| 登载基金年度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> |
| 基金年度报告备置地点          | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层                                     |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                       | 办公地址                                |
|--------|--------------------------|-------------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心<br>42 楼      |
| 注册登记机构 | 平安基金管理有限公司               | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金<br>融中心 34 层 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2023 年        | 2022 年        | 2021 年        |
|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益       | 12,790,376.17 | 25,049,001.77 | 58,451,014.04 |
| 本期利润          | 17,892,893.06 | 18,198,703.80 | 56,434,583.27 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0439        | 0.0662        | 0.0445        |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.14%         | 6.33%         | 4.29%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.94%         | 4.00%         | 5.34%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末       | 2022 年末       | 2021 年末       |
| 期末可供分配利润      | 59,511,684.41 | 11,204,843.30 | 24,298,749.90 |

|              |                  |                |                  |
|--------------|------------------|----------------|------------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0413           | 0.0561         | 0.0166           |
| 期末基金资产净值     | 1,521,463,499.32 | 212,754,716.24 | 1,518,505,116.74 |
| 期末基金份额净值     | 1.0569           | 1.0657         | 1.0346           |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2023 年末          | 2022 年末        | 2021 年末          |
| 基金份额累计净值增长率  | 29.23%           | 24.34%         | 19.55%           |

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

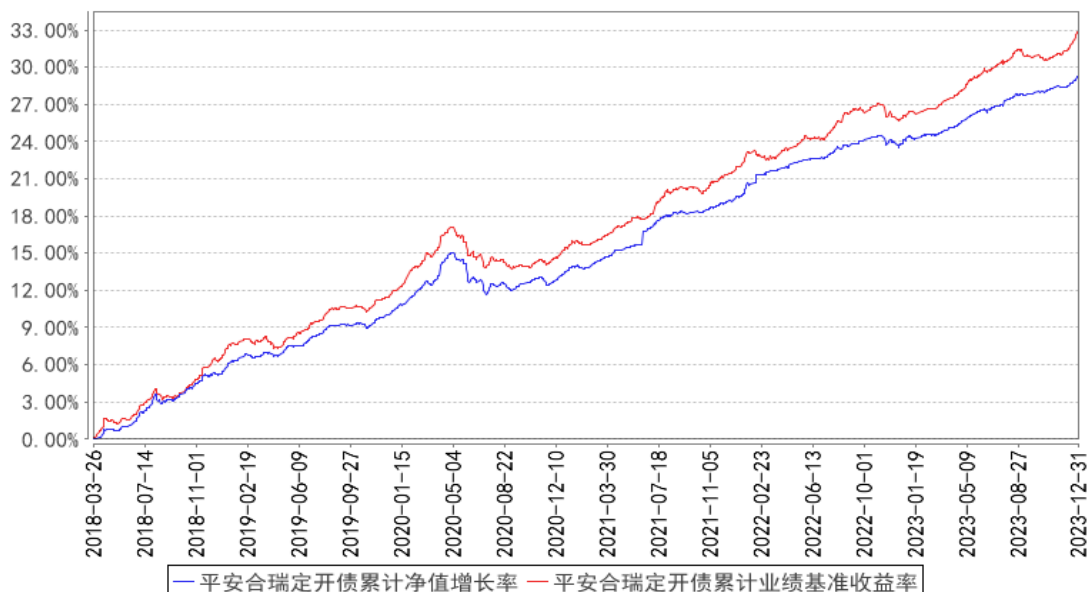
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.99%    | 0.03%       | 1.44%      | 0.05%         | -0.45% | -0.02% |
| 过去六个月      | 1.99%    | 0.04%       | 2.19%      | 0.06%         | -0.20% | -0.02% |
| 过去一年       | 3.94%    | 0.04%       | 5.23%      | 0.05%         | -1.29% | -0.01% |
| 过去三年       | 13.87%   | 0.06%       | 15.05%     | 0.06%         | -1.18% | 0.00%  |
| 过去五年       | 22.52%   | 0.06%       | 24.43%     | 0.07%         | -1.91% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.23%   | 0.06%       | 32.81%     | 0.07%         | -3.58% | -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

平安合瑞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

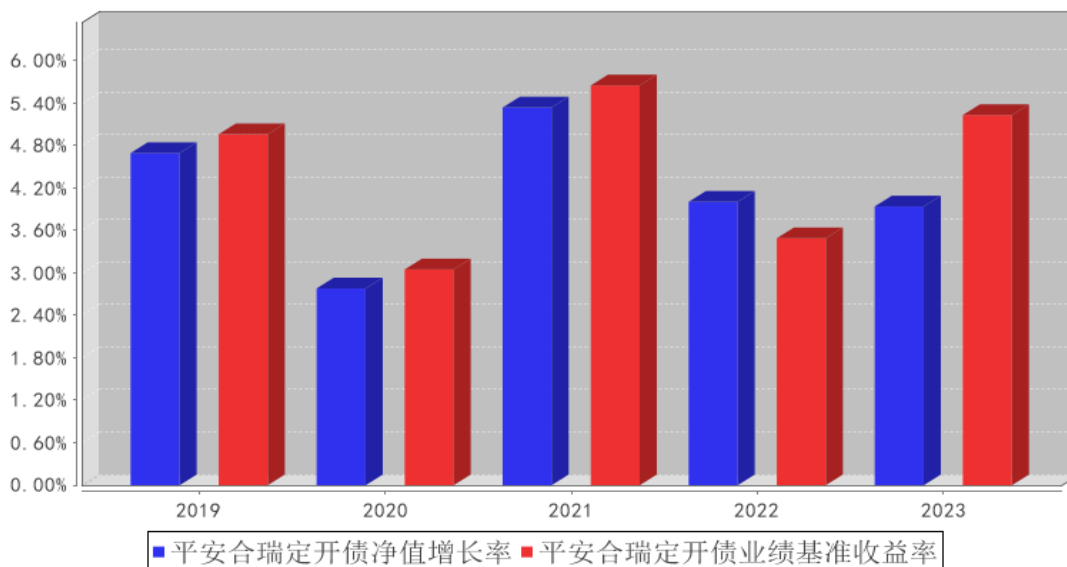


注：1、本基金基金合同于 2018 年 03 月 26 日正式生效；

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

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安合瑞定开债基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2018 年 03 月 26 日正式生效



### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度     | 每 10 份基金份额分<br>红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总<br>额 | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|-------------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2023 年 | 0.5000            | 9,981,843.46  | 45.78         | 9,981,889.24  | -  |
| 2022 年 | 0.1000            | 14,677,879.09 | 1.80          | 14,677,880.89 | -  |
| 2021 年 | 0.4100            | 50,740,948.64 | 233,229.02    | 50,974,177.66 | -  |
| 合计     | 1.0100            | 75,400,671.19 | 233,276.60    | 75,633,947.79 | -  |

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。截至 2023 年 12 月 31 日，平安基金共管理 194 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5668 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<br>(助理) 期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明  |
|-----|---|----------------------|------|------------|---|
|     |   | 任职日期                 | 离任日期 |            |   |
| 田元强 | 固定收益投资中心研究部负责人，平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 | 2021 年 6 月 7 日       | -    | 10 年       | 田元强先生，西安交通大学工商管理硕士，曾先后担任鹏元资信评估有限公司信用评级部分析师、生命保险资产管理有限公司信用评级部分析师、中国中投证券有限责任公司研究总部分析员。2016 年 11 月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心固定收益高级研究员。现任固定收益投资中心研究部负责人，同时担任平安合信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合进 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠信 3 个月定期开放债券型证券投资基金、平 |

|  |  |  |  |  |                              |
|--|--|--|--|--|------------------------------|
|  |  |  |  |  | 安元和 90 天滚动持有短债债券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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

2023 年为疫后第一年，经济延续弱势，内生动能相对缺乏。具体而言，消费在上半年有所修复，但下半年再度走弱；出口全年延续弱势，下半年表现更弱；地产领域羸弱，拖累固定资产投资整体持续回落。经济偏弱背景下，货币政策整体宽松，总量和结构政策持续推出。债券收益率整体下行，全年表现较好。报告期内，本产品以信用债投资为主，赚取稳定票息和骑乘收益的同时，结合市场环境动态调整组合久期和杠杆，力争增强组合收益。

### 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 1.0569 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.94%，业绩比较基准收益率为 5.23%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年预计债市总体呈震荡偏强格局。一方面，经济内生增长动能仍然相对缺乏，且海外主要经济体可能面临持续加息后的经济降温，内外共振决定基本面偏弱。另一方面，通胀压力不大的背景下，货币政策会聚焦稳增长，稳健宽松的格局不变。因此，我们预计今年债市整体维持偏强格局，当然，年内阶段性可能出现收益率下行过快、预期充分，从而导致波动的情形，但这不改中长期债市震荡偏强格局。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，

确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.8 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 2 次，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、

基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2024)第 20678 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

|           |   |
|-----------|---|
| 审计报告标题    | 审计报告  |
| 审计报告收件人   | 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人   |
| 审计意见      | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“平安合瑞定开债基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了平安合瑞定开债基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于平安合瑞定开债基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>   |

|                 |  |
|-----------------|--|
| 强调事项            | 不适用  |
| 其他事项            | 不适用  |
| 其他信息            | -  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>平安合瑞定开债基金的基金管理人平安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估平安合瑞定开债基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算平安合瑞定开债基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安合瑞定开债基金的财务报告过程。</p>   |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对平安合瑞定开债基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致平安合瑞定开</p> |

|           |  |    |
|-----------|--|----|
|           | 债基金不能持续经营。<br>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |    |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)   |    |
| 注册会计师的姓名  | 曹翠丽  | 李崇 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼  |    |
| 审计报告日期    | 2024 年 3 月 25 日  |    |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 货币资金       | 7.4.7.1 | 1,656,924.34            | 536,615.51               |
| 结算备付金      |         | 3,964,663.74            | -                        |
| 存出保证金      |         | 67,090.85               | 326.62                   |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 1,604,564,238.87        | 294,496,547.07           |
| 其中：股票投资    |         | -                       | -                        |
| 基金投资       |         | -                       | -                        |
| 债券投资       |         | 1,604,564,238.87        | 294,496,547.07           |
| 资产支持证券投资   |         | -                       | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                       | -                        |
| 其他投资       |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产     | 7.4.7.3 | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产   | 7.4.7.4 | 10,002,006.37           | -                        |
| 债权投资       | 7.4.7.5 | -                       | -                        |
| 其中：债券投资    |         | -                       | -                        |
| 资产支持证券投资   |         | -                       | -                        |
| 其他投资       |         | -                       | -                        |
| 其他债权投资     | 7.4.7.6 | -                       | -                        |
| 其他权益工具投资   | 7.4.7.7 | -                       | -                        |
| 应收清算款      |         | 87,983,424.69           | -                        |
| 应收股利       |         | -                       | -                        |
| 应收申购款      |         | -                       | -                        |
| 递延所得税资产    |         | -                       | -                        |
| 其他资产       | 7.4.7.8 | -                       | -                        |

| 资产总计        |          | 1,708,238,348.86   | 295,033,489.20      |
|-------------|----------|--------------------|---------------------|
| 负债和净资产      | 附注号      | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
| <b>负债：</b>  |          |                    |                     |
| 短期借款        |          | -                  | -                   |
| 交易性金融负债     |          | -                  | -                   |
| 衍生金融负债      | 7.4.7.3  | -                  | -                   |
| 卖出回购金融资产款   |          | 185,991,897.89     | 82,013,317.96       |
| 应付清算款       |          | 15,833.22          | -                   |
| 应付赎回款       |          | -                  | -                   |
| 应付管理人报酬     |          | 386,039.06         | 54,027.74           |
| 应付托管费       |          | 128,679.69         | 18,009.24           |
| 应付销售服务费     |          | -                  | -                   |
| 应付投资顾问费     |          | -                  | -                   |
| 应交税费        |          | -                  | -                   |
| 应付利润        |          | -                  | -                   |
| 递延所得税负债     |          | -                  | -                   |
| 其他负债        | 7.4.7.9  | 252,399.68         | 193,418.02          |
| 负债合计        |          | 186,774,849.54     | 82,278,772.96       |
| <b>净资产：</b> |          |                    |                     |
| 实收基金        | 7.4.7.10 | 1,439,556,865.62   | 199,637,813.95      |
| 未分配利润       | 7.4.7.12 | 81,906,633.70      | 13,116,902.29       |
| 净资产合计       |          | 1,521,463,499.32   | 212,754,716.24      |
| 负债和净资产总计    |          | 1,708,238,348.86   | 295,033,489.20      |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0569 元，基金份额总额 1,439,556,865.62 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目             | 附注号      | 本期<br>2023年1月1日至2023<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 |
|----------------|----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b> |          | 20,747,086.32                   | 20,190,193.11                        |
| 1. 利息收入        |          | 280,692.88                      | 336,538.35                           |
| 其中：存款利息收入      | 7.4.7.13 | 146,153.72                      | 138,504.88                           |
| 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     |          | 134,539.16                      | 198,033.47                           |



|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 其他利息收入                     |            | -             | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 15,363,876.55 | 26,703,952.73 |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.14   | -             | -             |
| 基金投资收益                     |            | -             | -             |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.15   | 15,363,876.55 | 26,703,952.73 |
| 资产支持证券投资                   | 7.4.7.16   | -             | -             |
| 收益                         |            |               |               |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.17   | -             | -             |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.18   | -             | -             |
| 股利收益                       | 7.4.7.19   | -             | -             |
| 其他投资收益                     |            | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.20   | 5,102,516.89  | -6,850,297.97 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.21   | -             | -             |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 2,854,193.26  | 1,991,489.31  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 1,260,129.31  | 928,660.48    |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -             | -             |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 420,043.17    | 309,553.54    |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | -             | -             |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -             |
| 5. 利息支出                    |            | 934,926.97    | 546,375.29    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 934,926.97    | 546,375.29    |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.22   | -             | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | 1,593.81      | -             |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.23   | 237,500.00    | 206,900.00    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 17,892,893.06 | 18,198,703.80 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 17,892,893.06 | 18,198,703.80 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 17,892,893.06 | 18,198,703.80 |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日      |        |                |                  |
|--|---|--------|----------------|------------------|
|  | 实收基金  | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 199,637,813.95                              | -      | 13,116,902.29  | 212,754,716.24   |
| 二、本期期初净资产                                | 199,637,813.95                              | -      | 13,116,902.29  | 212,754,716.24   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 1,239,919,051.67                            | -      | 68,789,731.41  | 1,308,708,783.08 |
| (一)、综合收益总额                               | -   | -      | 17,892,893.06  | 17,892,893.06    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 1,239,919,051.67                            | -      | 60,878,727.59  | 1,300,797,779.26 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 1,430,104,531.24                            | -      | 69,893,520.54  | 1,499,998,051.78 |
| 2. 基金赎回款                                 | -190,185,479.57                             | -      | -9,014,792.95  | -199,200,272.52  |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -   | -      | -9,981,889.24  | -9,981,889.24    |
| 四、本期期末净资产                                | 1,439,556,865.62                            | -      | 81,906,633.70  | 1,521,463,499.32 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |        |                |                  |
|  | 实收基金  | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 1,467,788,001.76                            | -      | 50,717,114.98  | 1,518,505,116.74 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,467,788,001.76                            | -      | 50,717,114.98  | 1,518,505,116.74 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -1,268,150,187.                             | -      | -37,600,212.69 | -1,305,750,400.5 |

|  |                           |   |                |                           |
|--|---------------------------|---|----------------|---------------------------|
|  | 81                        |   |                | 0                         |
| (一)、综合收益总额                               | -                         | - | 18,198,703.80  | 18,198,703.80             |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -<br>1,268,150,187.<br>81 | - | -41,121,035.60 | -<br>1,309,271,223.4<br>1 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 228,635,880.51            | - | 11,363,121.29  | 239,999,001.80            |
| 2. 基金赎回款                                 | -<br>1,496,786,068.<br>32 | - | -52,484,156.89 | -<br>1,549,270,225.2<br>1 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                         | - | -14,677,880.89 | -14,677,880.89            |
| 四、本期期末净资产                                | 199,637,813.95            | - | 13,116,902.29  | 212,754,716.24            |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金(原名为平安大华合瑞定期开放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]403号《关于准予平安大华合瑞定期开放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《平安大华合瑞定期开放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509,999,000.00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 0026 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 509,999,000.00 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,基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金。

根据《平安合瑞定期开放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《平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、金融债、次级债、央行票据、企业债、中小企业私募债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、债券回购、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、现金等货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,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:中证全债指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

##### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际

利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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，基金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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价



值变动损益；于处置时，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后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资（红利再投资不受封闭期限制）；若投资者不选择，本基金默认的分红方式是现金分红；(2) 基金分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(3) 每份基金份额享有同等分配权；(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和可交换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和可交换债券除外），

按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于 2024 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 1,656,924.34       | 536,615.51          |
| 等于：本金        | 1,651,089.57       | 536,365.43          |
| 加：应计利息       | 5,834.77           | 250.08              |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 定期存款         | -                  | -                   |
| 等于：本金        | -                  | -                   |
| 加：应计利息       | -                  | -                   |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 其中：存款期限1个月以内 | -                  | -                   |
| 存款期限1-3个月    | -                  | -                   |
| 存款期限3个月以上    | -                  | -                   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 等于：本金        | -                  | -                   |
| 加：应计利息       | -                  | -                   |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 合计           | 1,656,924.34       | 536,615.51          |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年12月31日 |                  |               |                  |              |
|---------------|--------------------|------------------|---------------|------------------|--------------|
|               | 成本                 | 应计利息             | 公允价值          | 公允价值变动           |              |
| 股票            | -                  | -                | -             | -                |              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -                | -             | -                |              |
| 债券            | 交易所市场              | 280,379,402.58   | 1,536,109.60  | 281,963,109.60   | 47,597.42    |
|               | 银行间市场              | 1,300,637,639.60 | 17,571,129.27 | 1,322,601,129.27 | 4,392,360.40 |
|               | 合计                 | 1,581,017,042.18 | 19,107,238.87 | 1,604,564,238.87 | 4,439,957.82 |
| 资产支持证券        | -                  | -                | -             | -                |              |
| 基金            | -                  | -                | -             | -                |              |
| 其他            | -                  | -                | -             | -                |              |

| 合计            | 1,581,017,042.18    | 19,107,238.87  | 1,604,564,238.87 | 4,439,957.82   |
|---------------|---------------------|----------------|------------------|----------------|
| 项目            | 上年度末<br>2022年12月31日 |                |                  |                |
|               | 成本                  | 应计利息           | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            | -                   | -              | -                | -              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -              | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场               | -              | -                | -              |
|               | 银行间市场               | 291,098,559.07 | 4,060,547.07     | 294,496,547.07 |
|               | 合计                  | 291,098,559.07 | 4,060,547.07     | 294,496,547.07 |
| 资产支持证券        | -                   | -              | -                | -              |
| 基金            | -                   | -              | -                | -              |
| 其他            | -                   | -              | -                | -              |
| 合计            | 291,098,559.07      | 4,060,547.07   | 294,496,547.07   | -662,559.07    |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2023年12月31日  |           |
|-------|---------------------|-----------|
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                   | -         |
| 银行间市场 | 10,002,006.37       | -         |
| 合计    | 10,002,006.37       | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2022年12月31日 |           |
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                   | -         |
| 银行间市场 | -                   | -         |
| 合计    | -                   | -         |

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | -                   |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 43,099.68          | 14,418.02           |
| 其中：交易所市场    | -                  | -                   |
| 银行间市场       | 43,099.68          | 14,418.02           |
| 应付利息        | -                  | -                   |
| 预提费用        | 209,300.00         | 179,000.00          |
| 合计          | 252,399.68         | 193,418.02          |

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |                  |
|---------------|-----------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额             |
| 上年度末          | 199,637,813.95              | 199,637,813.95   |
| 本期申购          | 1,430,104,531.24            | 1,430,104,531.24 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -190,185,479.57             | -190,185,479.57  |
| 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           | 1,439,556,865.62            | 1,439,556,865.62 |

注：1. 申购含红利再投份额。

2. 根据《平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金的封闭期为自 2018 年 3 月 26 日（基金合同生效日）（含）或自每一开放期结束之日次日起（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，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期最长不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末无其他综合收益。

## 7.4.7.12 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           | 11,204,843.30 | 1,912,058.99  | 13,116,902.29 |
| 本期期初           | 11,204,843.30 | 1,912,058.99  | 13,116,902.29 |
| 本期利润           | 12,790,376.17 | 5,102,516.89  | 17,892,893.06 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 45,498,354.18 | 15,380,373.41 | 60,878,727.59 |
| 其中：基金申购款       | 52,310,990.50 | 17,582,530.04 | 69,893,520.54 |
| 基金赎回款          | -6,812,636.32 | -2,202,156.63 | -9,014,792.95 |
| 本期已分配利润        | -9,981,889.24 | -             | -9,981,889.24 |
| 本期末            | 59,511,684.41 | 22,394,949.29 | 81,906,633.70 |

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022 |
|----|----------------------------|---------------------------|
|    |                            |                           |

|           | 日          | 年 12 月 31 日 |
|-----------|------------|-------------|
| 活期存款利息收入  | 136,990.69 | 138,244.98  |
| 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 | 8,965.92   | 255.36      |
| 其他        | 197.11     | 4.54        |
| 合计        | 146,153.72 | 138,504.88  |

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 12,158,987.54                   | 9,367,194.20                         |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,204,889.01                    | 17,336,758.53                        |
| 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                           | 15,363,876.55                   | 26,703,952.73                        |

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 |
|----------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 4,362,768,535.25                | 3,102,511,262.85                     |

|                        |                  |                  |
|------------------------|------------------|------------------|
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,318,523,207.89 | 3,042,499,971.86 |
| 减：应计利息总额               | 40,963,900.85    | 42,642,144.85    |
| 减：交易费用                 | 76,537.50        | 32,387.61        |
| 买卖债券差价收入               | 3,204,889.01     | 17,336,758.53    |

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。



**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.19 股利收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2023年1月1日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 5,102,516.89                    | -6,850,297.97                        |
| 股票投资                   | -                               | -                                    |
| 债券投资                   | 5,102,516.89                    | -6,850,297.97                        |
| 资产支持证券投资               | -                               | -                                    |
| 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                     | 5,102,516.89                    | -6,850,297.97                        |

**7.4.7.21 其他收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他收入。

**7.4.7.22 信用减值损失**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

**7.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023年1月1日至2023年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31<br>日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用    | 80,000.00                       | 50,000.00                            |
| 信息披露费   | 120,000.00                      | 120,000.00                           |
| 证券出借违约金 | -                               | -                                    |
| 账户维护费   | 36,000.00                       | 35,700.00                            |
| 其他      | 1,500.00                        | 1,200.00                             |
| 合计      | 237,500.00                      | 206,900.00                           |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内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。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |                         | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31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>(%) |
| 招商证券  | 776,205,052.20              | 100.00                  | 5,226,572.80                     | 100.00                  |

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31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>(%) |
|------|------------------|---------------------------|---------------|---------------------------|
| 招商证券 | 2,105,700,000.00 | 100.00                    | 38,090,000.00 | 100.00                    |

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2023年1月1日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 |
|------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,260,129.31                    | 928,660.48                           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 2.48                            | 156,174.88                           |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,260,126.83                    | 772,485.60                           |

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年1月1日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 420,043.17                      | 309,553.54                           |

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

注：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。

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

注：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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                         | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                            | 2023年1月1日至2023年12月31日 | 2022年1月1日至2022年12月31日 |
| 基金合同生效日（2018年3月26日）持有的基金份额 | -                     | -                     |
| 报告期初持有的基金份额                | -                     | 11,334,956.56         |
| 报告期间申购/买入总份额               | -                     | 0.00                  |
| 报告期间因拆分变动份额                | -                     | 0.00                  |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额             | -                     | 11,334,956.56         |
| 报告期末持有的基金份额                | -                     | 0.00                  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | -                     | 0.0000%               |

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。

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末          |                     | 上年度末         |                     |
|-------|--------------|---------------------|--------------|---------------------|
|       | 2023年12月31日  |                     | 2022年12月31日  |                     |
|       | 持有的基金份额      | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） | 持有的基金份额      | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） |
| 平安汇通  | 9,450,446.99 | 0.6565              | 9,450,446.99 | 4.7338              |

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称   | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月<br>31 日 |            | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |            |
|---------|---|------------|---|------------|
|         | 期末余额                                      | 当期利息收入     | 期末余额  | 当期利息收入     |
| 招商证券-活期 | 1,656,924.34                              | 136,990.69 | 536,615.51                                  | 138,244.98 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券保管，按银行同业存款利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日                 | 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<br>形式<br>发放总<br>额 | 本期利润分配<br>合计 | 备注 |
|----|---------------------------|-----|---------------------------|--------------------------|--------------|-----------------------|--------------|----|
|    |                           | 场内  | 场外                        |                          |              |                       |              |    |
| 1  | 2023<br>年 5 月<br>25 日     | -   | 2023<br>年 5 月<br>25 日     | 0.2000                   | 3,992,737.52 | 18.05                 | 3,992,755.57 | -  |
| 2  | 2023<br>年 10<br>月 12<br>日 | -   | 2023<br>年 10<br>月 12<br>日 | 0.3000                   | 5,989,105.94 | 27.73                 | 5,989,133.67 | -  |
| 合计 | -                         | -   | -                         | 0.5000                   | 9,981,843.46 | 45.78                 | 9,981,889.24 | -  |

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 185,991,897.89 元，截至 2024 年 01 月 02 日到期。该类交易要求本基金转入质押

库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 92.06%（上年度末：28.43%）。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本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、流通受限制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上市公司发行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票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023年12月31日  | 1年以内                  | 1-5年                    | 5年以上                 | 不计息                  | 合计                      |
|---------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|----------------------|-------------------------|
| <b>资产</b>           |                       |                         |                      |                      |                         |
| 货币资金                | 1,656,924.34          | -                       | -                    | -                    | 1,656,924.34            |
| 结算备付金               | 3,964,663.74          | -                       | -                    | -                    | 3,964,663.74            |
| 存出保证金               | 67,090.85             | -                       | -                    | -                    | 67,090.85               |
| 交易性金融资产             | 286,508,452.10        | 1,255,347,669.28        | 62,708,117.49        | -                    | 1,604,564,238.87        |
| 买入返售金融资产            | 10,002,006.37         | -                       | -                    | -                    | 10,002,006.37           |
| 应收清算款               | -                     | -                       | -                    | 87,983,424.69        | 87,983,424.69           |
| <b>资产总计</b>         | <b>302,199,137.40</b> | <b>1,255,347,669.28</b> | <b>62,708,117.49</b> | <b>87,983,424.69</b> | <b>1,708,238,348.86</b> |
| <b>负债</b>           |                       |                         |                      |                      |                         |
| 应付管理人报酬             | -                     | -                       | -                    | 386,039.06           | 386,039.06              |
| 应付托管费               | -                     | -                       | -                    | 128,679.69           | 128,679.69              |
| 应付清算款               | -                     | -                       | -                    | 15,833.22            | 15,833.22               |
| 卖出回购金融资产款           | 185,991,897.89        | -                       | -                    | -                    | 185,991,897.89          |
| 其他负债                | -                     | -                       | -                    | 252,399.68           | 252,399.68              |
| <b>负债总计</b>         | <b>185,991,897.89</b> | <b>-</b>                | <b>-</b>             | <b>782,951.65</b>    | <b>186,774,849.54</b>   |
| <b>利率敏感度缺口</b>      | <b>116,207,239.51</b> | <b>1,255,347,669.28</b> | <b>62,708,117.49</b> | <b>87,200,473.04</b> | <b>1,521,463,499.32</b> |
| 上年度末<br>2022年12月31日 | 1年以内                  | 1-5年                    | 5年以上                 | 不计息                  | 合计                      |



| 资产        |               |                |   |             |                |
|-----------|---------------|----------------|---|-------------|----------------|
| 货币资金      | 536,615.51    | -              | - | -           | 536,615.51     |
| 存出保证金     | 326.62        | -              | - | -           | 326.62         |
| 交易性金融资产   | 90,630,423.77 | 203,866,123.30 | - | -           | 294,496,547.07 |
| 资产总计      | 91,167,365.90 | 203,866,123.30 | - | -           | 295,033,489.20 |
| 负债        |               |                |   |             |                |
| 应付管理人报酬   | -             | -              | - | 54,027.74   | 54,027.74      |
| 应付托管费     | -             | -              | - | 18,009.24   | 18,009.24      |
| 卖出回购金融资产款 | 82,013,317.96 | -              | - | -           | 82,013,317.96  |
| 其他负债      | -             | -              | - | 193,418.02  | 193,418.02     |
| 负债总计      | 82,013,317.96 | -              | - | 265,455.00  | 82,278,772.96  |
| 利率敏感度缺口   | 9,154,047.94  | 203,866,123.30 | - | -265,455.00 | 212,754,716.24 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设           | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|--------------|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析           | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|              |                    | 本期末（2023年12月31日）            | 上年度末（2022年12月31日） |
|              | 市场利率上升 25个基点       | -7,928,006.17               | -1,153,714.39     |
| 市场利率下降 25个基点 | 8,016,058.05       | 1,164,002.28                |                   |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

#### 7.4.13.4.3 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，

所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：于本报告期末，本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 1,604,564,238.87        | 294,496,547.07           |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 1,604,564,238.87        | 294,496,547.07           |

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生的当期期初为确认各层次之间转换的时点。本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生

重大变动。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：于本报告期末及上年度报告期末，本基金无属于第三层次的金融资产。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：于本报告期末及上年度报告期末，本基金未使用不可观察输入值。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,604,564,238.87 | 93.93         |
|    | 其中：债券             | 1,604,564,238.87 | 93.93         |
|    | 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          | 10,002,006.37    | 0.59          |
|    | 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      | 5,621,588.08     | 0.33          |
| 8  | 其他各项资产            | 88,050,515.54    | 5.15          |
| 9  | 合计                | 1,708,238,348.86 | 100.00        |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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。

### 8.2.2 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。

## 8.3 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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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。

### 8.4.2 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。

### 8.4.3 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。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -             |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 1,322,601,129.27 | 86.93         |
|    | 其中：政策性金融债 | 203,942,806.91   | 13.40         |
| 4  | 企业债券      | 281,963,109.60   | 18.53         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -             |
| 6  | 中期票据      | -                | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -             |
| 8  | 同业存单      | -                | -             |
| 9  | 其他        | -                | -             |
| 10 | 合计        | 1,604,564,238.87 | 105.46        |

## 8.6 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<br>(张) | 公允价值           | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|---------|---------------|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 2228007 | 22 浦发银行<br>01 | 1,300,000 | 133,601,648.22 | 8.78             |
| 2  | 2120116 | 21 南京银行<br>01 | 1,200,000 | 120,706,819.67 | 7.93             |

|   |           |                   |           |                |      |
|---|-----------|-------------------|-----------|----------------|------|
| 3 | 2220031   | 22 浙商银行<br>小微债 02 | 1,000,000 | 102,657,158.47 | 6.75 |
| 4 | 212380003 | 23 华夏银行<br>债 01   | 1,000,000 | 102,545,300.55 | 6.74 |
| 5 | 212380008 | 23 交行债 01         | 900,000   | 91,038,688.52  | 5.98 |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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。

### 8.9 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投资。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

#### 8.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 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

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，浙商银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、上海银行股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 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 | 67,090.85     |
| 2  | 应收清算款 | 87,983,424.69 |
| 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  | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 8 | 其他 | -             |
| 9 | 合计 | 88,050,515.54 |

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有股票。

#### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>例 (%) | 持有份额  | 占总份额比<br>例 (%) |
| 205          | 7,022,228.61  | 1,439,556,865.62 | 100.00         | -     | -              |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

### 9.3 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、基金投资和研<br>究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                 |

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管 理的产品情况

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018 年 3 月 26 日）<br>基金份额总额 | 509,999,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 199,637,813.95 |

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本报告期基金总申购份额   | 1,430,104,531.24 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 190,185,479.57   |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 1,439,556,865.62 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：本报告期内，公司 4 名董事发生变更，董事在最近 12 个月内变更未超过百分之五十。

基金托管人：2023 年 7 月 23 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部副总经理职务，另有任用。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 6 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 80,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施                    | 内容                                    |
|-----------------------|---------------------------------------|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 平安基金管理有限公司                            |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2023 年 12 月 29 日                      |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 中国证券监督管理委员会深圳监管局                      |
| 受到的具体措施类型             | 出具警示函                                 |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 公司管理的两只基金在债券投资过程中，参考外部评级机构的范围不符合监管规定。 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 已完成整改                                 |
| 其他                    | 无                                     |

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 国盛证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 招商证券 | 4      | -    | -                | -         | -              | -  |

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

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

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

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |                  | 债券回购交易           |                    | 权证交易 |                  |
|------|----------------|------------------|------------------|--------------------|------|------------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 国盛证券 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 招商证券 | 776,205,052.20 | 100.00           | 2,105,700,000.00 | 100.00             | -    | -                |

### 11.8 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关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023年01月05日 |
| 2  | 平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023年01月19日 |



|    |   |              |                  |
|----|---|--------------|------------------|
|    | 台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告                      |              |                  |
| 3  | 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 01 月 20 日 |
| 4  | 关于平安合瑞定期开放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 | 2023 年 01 月 20 日 |
| 5  | 平安基金管理有限公司关于暂停上海爱建基金销售有限公司办理相关销售业务的公告     | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 02 月 09 日 |
| 6  | 平安基金管理有限公司关于新增平安证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告      | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 03 月 20 日 |
| 7  | 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年年度报告           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 03 月 30 日 |
| 8  | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江同花顺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 | 2023 年 04 月 13 日 |
| 9  | 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 04 月 22 日 |
| 10 | 平安合瑞定期开放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 | 2023 年 05 月 24 日 |
| 11 | 关于平安合瑞定期开放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 | 2023 年 06 月 02 日 |
| 12 | 平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 07 月 07 日 |
| 13 | 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年第 2 季度报告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 07 月 21 日 |
| 14 | 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年中期报告           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 08 月 30 日 |
| 15 | 关于平安合瑞定期开放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 | 2023 年 09 月 22 日 |
| 16 | 平安基金管理有限公司关于平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金延长开放期的公告  | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 09 月 27 日 |
| 17 | 平安合瑞定期开放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 | 2023 年 09 月 28 日 |
| 18 | 平安合瑞定期开放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 | 2023 年 09 月 28 日 |
| 19 | 平安基金管理有限公司关于平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资            | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 10 月 10 日 |

|    |                                      |              |                  |
|----|--------------------------------------|--------------|------------------|
|    | 基金暂停大额申购及转换转入业务的公告                   |              |                  |
| 20 | 平安合瑞定期开放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 | 2023 年 10 月 11 日 |
| 21 | 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年第 3 季度报告  | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 10 月 25 日 |
| 22 | 平安基金管理有限公司关于新增国金证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 11 月 22 日 |
| 23 | 平安基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告               | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 12 月 05 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

| 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              | 2023 年 01 月 01 日-2023 年 10 月 16 日 | 190,185,431.72 | 0.00             | 190,185,431.72 | 0.00             | -        |
|       | 2              | 2023 年 10 月 17 日-2023 年 12 月 31 日 | 0.00           | 1,430,104,481.66 | 0.00           | 1,430,104,481.66 | 99.34    |
| 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- (3) 平安合瑞定期开放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

### 13.2 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

### 13.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日