

平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金  
(FOF)  
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42

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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.11 本报告期投资基金情况 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.9 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）	
基金简称	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）	
基金主代码	022074	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 11 月 12 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	14,460,159.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C
下属分级基金的交 易代码	022074	022075
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,348,295.35 份	13,111,864.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过资产配置及优选基金，在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 2、基金投资策略 （1）内部基金精选策略 （2）外部基金精选策略 3、股票投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中债新综合（财富）指数收益率*85%+恒生指数收益率*5%+同期银行活期存款利率*10%
风险收益特征	本基金是债券型基金中基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、股票型基金和股票型基金中基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李海波	方圆
	联系电话	0755-88622632	95559
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-800-4800	95559
传真		0755-23997878	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号

邮政编码	518048	200336
法定代表人	罗春风	任德奇

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C
本期已实现收益	-6,417.59	-259,627.16
本期利润	28,233.62	88,801.22
加权平均基金份 额本期利润	0.0031	0.0011
本期加权平均净 值利润率	0.30%	0.11%
本期基金份额净 值增长率	0.55%	0.43%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	9,205.76	67,759.32
期末可供分配基 金份额利润	0.0068	0.0052
期末基金资产净 值	1,365,870.45	13,260,924.28
期末基金份额净 值	1.0130	1.0114
3.1.3 累计期	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	

末指标		
基金份额累计净值增长率	1.30%	1.14%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A

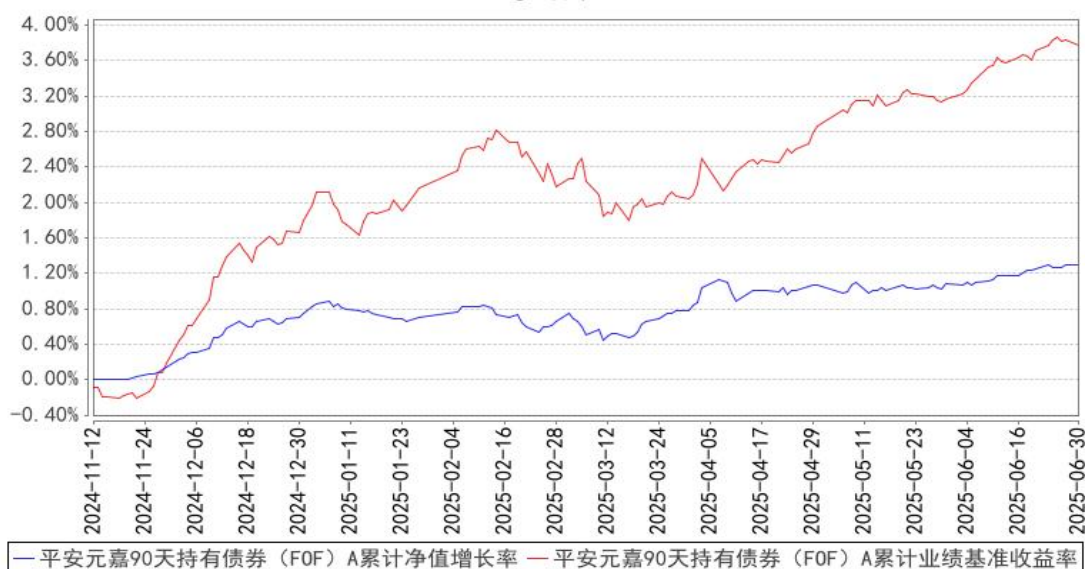
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.22%	0.02%	0.60%	0.05%	-0.38%	-0.03%
过去三个月	0.52%	0.05%	1.71%	0.08%	-1.19%	-0.03%
过去六个月	0.55%	0.05%	1.94%	0.10%	-1.39%	-0.05%
自基金合同生效起至今	1.30%	0.04%	3.78%	0.10%	-2.48%	-0.06%

平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C

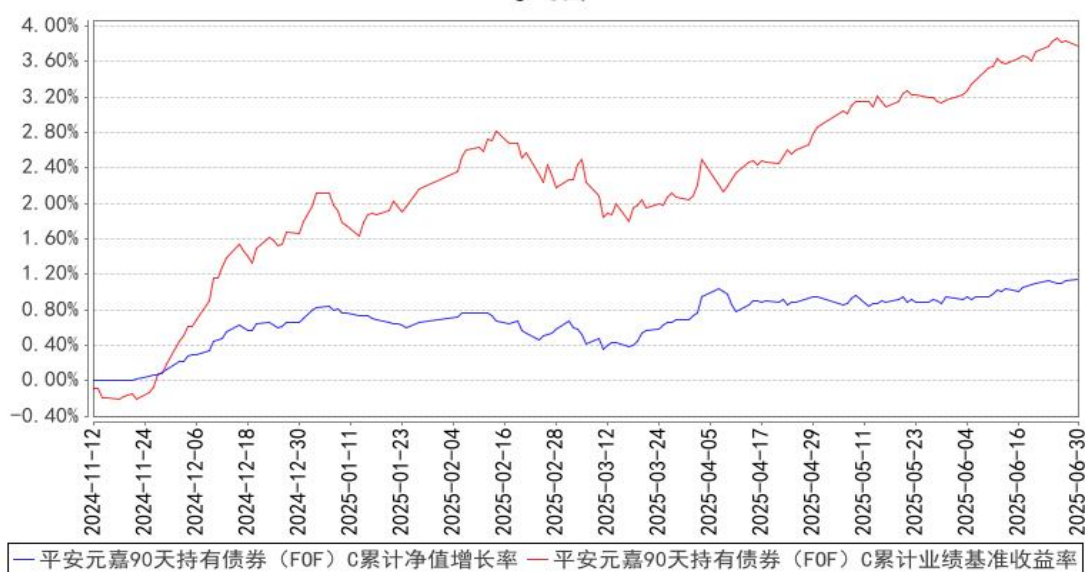
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.20%	0.02%	0.60%	0.05%	-0.40%	-0.03%
过去三个月	0.46%	0.05%	1.71%	0.08%	-1.25%	-0.03%
过去六个月	0.43%	0.05%	1.94%	0.10%	-1.51%	-0.05%
自基金合同生效起至今	1.14%	0.04%	3.78%	0.10%	-2.64%	-0.06%

### 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

平安元嘉90天持有债券（FOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安元嘉90天持有债券（FOF）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2024 年 11 月 12 日正式生效，截至报告期末未满一年；

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

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、海外、专户七大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2025 年 6 月 30 日，平安基金共管理 230 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6600 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张月	平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理	2024 年 11 月 12 日	-	10 年	张月女士，吉林大学经济学硕士研究生，曾先后担任晨星中国（深圳）有限公司金融产品分析师、私募排排网高级研究员、平安罗素投资管理（上海）有限公司研究主管、华润深国投信托有限公司投资经理、横琴淳臻投资管理中心（有限合伙）投资部研究主管。2018 年 12 月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资经理，现担任平安盈盛稳健配置三个月持有期债券型基金中基金（FOF）、平安盈福 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）、平安盈轩 90 天持有期债券型基金中基金（ETF-FOF）基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，以“对等关税”为代表的地缘政治事件进一步对宏观经济和国内市场进行了一轮压力测试。宏观上，去年的政策组合拳叠加美国关税征收前期的抢出口，宏观经济虽面临挑战仍确认了弱复苏的局面，GDP 增速略微高于市场预期；市场上，事件发生后 A 股的波动率递减，尤其二季度以来，比起扑朔迷离的宏观叙事，投资关注回归到新需求、新产品、新技术甚至持续的现金流等真切影响公司盈利和发展的因素上。

股票市场先跌后涨，上半年沪深 300 微涨 0.03%，中证 500 收益率 3.31%，中证 1000 收益率 6.69%。风格类指数方面，沪深 300 价值收益率 2.44%，沪深 300 成长收益率 0.49%。整体而言，价值风格和小盘风格表现出了显著的超额收益。债券上，中债-新综合财富（总值）指数上涨 1.05%，不同期限角度来看，中债-新综合财富（1 年以下）指数收益率 0.78%，中债-新综合财富（10 年以上）指数收益率 2.13%。

平安元嘉当前策略定位为低波动产品，目前的持仓中主要包含短债基金、中长期纯债基金、海外债券基金，其中短债基金优选为核心策略（包含长期维持较低久期的中长期纯债），旨在通过模型动态筛选出中长期表现稳健优秀的短久期品种进行配置，获取超额收益。在补充收益上，主要采用两个卫星策略：1）海外高静态债券基金；2）中长久期信用债基。今年以来，部分由于策略定位约束，部分由于对美国新一届政府政策的误判，两个方向的增强资产都没有达到预期效果。从 6 月开始，为了更好的提高风险调整后收益，逐渐增加了股票敞口，具体的方法上，一是配置二级债基，二是小仓位启用了量化 ETF 行业趋势跟踪模型。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A 的基金份额净值 1.0130 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.94%；截至本报告期末平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C 的基金份额净值 1.0114 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.43%，同期业绩比较基准收益率为 1.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，偏弱的现实大概率延续，弱地产、弱外需、弱价格指数综合成一个可上可下的弱复苏；偏强的政策预期局面却有可能改变，得益于上半 GDP 增长目标完成较好，全年目标实现压力不大促增长的急迫性有所缓解，那么国家政策的着力点更可能落在结构调整上，比如疏导恶性竞争、督促债务置换、扩展非美出口市场等，而结构性调整的效果往往是长期有利短期不显著的。那么在具体的投资策略上，则着重关注在有现实基础的基本面逻辑上，而国内的主要逻辑落实在中国产业创新的不断涌现与无风险利率的实质性下降，那么以半导体、创新药、军工等为代表的创新驱动的成长型公司和以银行、公用、水电等为代表的高分红类资产仍然是最主要的配置方向。而债券市场，出于对弱复苏环境的呵护以及国家财政降低债务置换成本的考量，大概率保持宽松的货币环境和较低的利率水平，高票息的信用品种相对具有更高的性价比。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

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

本基金本报告期内出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人的情形。截至报告期末，以上情况未消除。本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末，以上情况未消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向中国证监会或相关派出机构报告并提出了解决方案。

## § 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，基金托管人在平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，平安基金管理有限公司在平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由平安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,210,887.02	29,500,476.48
结算备付金		-	-
存出保证金		327.42	-
交易性金融资产	6.4.7.2	14,426,398.34	238,284,665.25
其中：股票投资		-	-
基金投资		13,522,521.68	238,284,665.25
债券投资		903,876.66	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,194,380.44	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	6,510.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		16,831,993.22	267,791,652.57
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,123,197.82	-
应付管理人报酬		4,734.32	67,842.03
应付托管费		706.43	10,614.21
应付销售服务费		3,605.63	49,417.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	72,954.29	20,000.00
负债合计		2,205,198.49	147,873.85
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	14,460,159.76	265,740,394.26
未分配利润	6.4.7.12	166,634.97	1,903,384.46

净资产合计		14,626,794.73	267,643,778.72
负债和净资产总计		16,831,993.22	267,791,652.57

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 14,460,159.76 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0130 元，基金份额总额 1,348,295.35 份；下属 C 类基金份额净值 1.0114 元，基金份额总额 13,111,864.41 份。

6.2 利润表

会计主体：平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		464,387.79
1. 利息收入		31,518.46
其中：存款利息收入	6.4.7.13	27,791.20
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		3,727.26
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,789.74
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益	6.4.7.15	-151,254.79
债券投资收益	6.4.7.16	9,643.69
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	191,400.84
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		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	383,079.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	-
减：二、营业总支出		347,352.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	144,295.90
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	22,611.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	107,469.13
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		22.05

其中：卖出回购金融资产支出		22.05
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.25	72,954.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		117,034.84
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		117,034.84
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		117,034.84

6.3 净资产变动表

会计主体：平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	265,740,394.26	1,903,384.46	267,643,778.72
二、本期期初净资产	265,740,394.26	1,903,384.46	267,643,778.72
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-251,280,234.50	-1,736,749.49	-253,016,983.99
（一）、综合收益总额	-	117,034.84	117,034.84
（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）	-251,280,234.50	-1,853,784.33	-253,134,018.83
其中：1. 基金申购款	485,929.29	3,347.83	489,277.12
2. 基金赎回款	-251,766,163.79	-1,857,132.16	-253,623,295.95
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	14,460,159.76	166,634.97	14,626,794.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]849 号文《关于准予平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册，由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》作为管理人向社会公开募集，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2024）验字第 70039114\_H12 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》于 2024 年 11 月 12 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金募集期间为 2024 年 10 月 21 日至 2024 年 11 月 8 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 265,429,412.10 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 137,250.68 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 265,566,662.78 元，折合 265,566,662.78 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，但不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额类别，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产净值中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（以下简称“证券投资基金”，包含封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金（LOF）和交易型开放式指数基金（ETF）、QDII 基金、香港互认基金、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）等中国证监会允许投资的基金）、股票、债券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。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金、股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国

债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款以及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，其中投资于债券型证券投资基金（包括债券指数基金）的比例不低于本基金资产的 80%，投资于 QDII 基金、香港互认基金的比例合计不超过本基金资产的 20%，投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产（含存托凭证）的 50%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中债新综合（财富）指数收益率\*85%+恒生指数收益率\*5%+同期银行活期存款利率\*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、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 3 号《半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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编

制期间系自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金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基金的金融资产（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

本基金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

本基金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

本基金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。

本基金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，本基金运用简化计量方法，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，本基金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，本基金按照相当于未来 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，本基金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，本基金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。

本基金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。本基金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。

本基金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的有关过去事项、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。

当本基金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，本基金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。

本基金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。本基金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，本基金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）是本基金在计量日能够进入的交易市场。

本基金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，本基金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，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）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，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，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

当本基金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，同时本基金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金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基金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

别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

#### 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收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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务工具投资的，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。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金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本基金；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

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 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

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）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）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

本基金本报告期无其他需要说明的重要会计政策和会计估计。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### （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‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### （2）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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

（3）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。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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。

（5）境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,210,887.02

等于：本金	1,210,665.52
加：应计利息	221.50
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	1,210,887.02

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	898,695.00	4,776.66	903,876.66	405.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	898,695.00	4,776.66	903,876.66	405.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		13,530,308.86	-	13,522,521.68	-7,787.18
其他		-	-	-	-
合计		14,429,003.86	4,776.66	14,426,398.34	-7,382.18

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	72,954.29
合计	72,954.29

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,449,636.09	33,449,636.09
本期申购	271,792.53	271,792.53
本期赎回（以“-”号填列）	-32,373,133.27	-32,373,133.27
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	1,348,295.35	1,348,295.35

平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	232,290,758.17	232,290,758.17
本期申购	214,136.76	214,136.76
本期赎回（以“-”号填列）	-219,393,030.52	-219,393,030.52
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	13,111,864.41	13,111,864.41

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	298,568.60	-49,126.38	249,442.22
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	298,568.60	-49,126.38	249,442.22
本期利润	-6,417.59	34,651.21	28,233.62
本期基金份额交易产生的变动数	-282,945.25	22,844.51	-260,100.74
其中：基金申购款	2,123.60	-483.87	1,639.73
基金赎回款	-285,068.85	23,328.38	-261,740.47

本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,205.76	8,369.34	17,575.10

平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,994,943.54	-341,001.30	1,653,942.24
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,994,943.54	-341,001.30	1,653,942.24
本期利润	-259,627.16	348,428.38	88,801.22
本期基金份额交易产生的变动数	-1,667,557.06	73,873.47	-1,593,683.59
其中：基金申购款	1,816.24	-108.14	1,708.10
基金赎回款	-1,669,373.30	73,981.61	-1,595,391.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,759.32	81,300.55	149,059.87

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,779.88
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	11.12
其他	0.20
合计	27,791.20

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票买卖差价收入。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	345,712,502.13
减：卖出/赎回基金成本总额	345,849,341.13

减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	14,415.79
基金投资收益	-151,254.79

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	8,478.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,165.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,643.69

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,240,667.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,198,319.00
减：应计利息总额	41,183.81
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	1,165.00

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	191,400.84
合计	191,400.84

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	383,079.59
股票投资	-
债券投资	405.00
资产支持证券投资	-
基金投资	382,674.59
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	383,079.59

6.4.7.22 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	8,372.19
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	146,061.59
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	33,082.14

注：上述费用按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法估算得出，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	21,013.38
信息披露费	51,940.91
证券出借违约金	-
合计	72,954.29

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
上海陆金所基金销售有限公司（“陆基金”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”）	基金管理人的最终控股母公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	144,295.90

其中：应支付销售机构的客户维护费	74,810.63
应支付基金管理人的净管理费	69,485.27

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,611.58

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×0.05% /当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C	合计
交通银行	-	107,265.71	107,265.71
合计	-	107,265.71	107,265.71

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费＝前一日 C 类基金份额基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期	1,210,887.02	27,779.88

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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

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

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购、赎回自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说

明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券（上年度末：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该

上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,210,887.02	-	-	-	1,210,887.02
存出保证金	327.42	-	-	-	327.42
交易性金融资产	903,876.66	-	-	13,522,521.68	14,426,398.34
应收清算款	-	-	-	1,194,380.44	1,194,380.44
资产总计	2,115,091.10	-	-	14,716,902.12	16,831,993.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,123,197.82	2,123,197.82
应付管理人报酬	-	-	-	4,734.32	4,734.32
应付托管费	-	-	-	706.43	706.43
应付销售服务费	-	-	-	3,605.63	3,605.63
其他负债	-	-	-	72,954.29	72,954.29
负债总计	-	-	-	2,205,198.49	2,205,198.49
利率敏感度缺口	2,115,091.10	-	-	12,511,703.63	14,626,794.73
上年度末 2024 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	29,500,476.48	-	-	-	29,500,476.48
交易性金融资产	-	-	-	238,284,665.25	238,284,665.25
应收申购款	-	-	-	6,510.84	6,510.84
资产总计	29,500,476.48	-	-	238,291,176.09	267,791,652.57
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	67,842.03	67,842.03
应付托管费	-	-	-	10,614.21	10,614.21
应付销售服务费	-	-	-	49,417.61	49,417.61
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	147,873.85	147,873.85
利率敏感度缺口	29,500,476.48	-	-	238,143,302.24	267,643,778.72

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,217.10	-

	市场利率上升 25 个基点	-1,214.78	-
--	---------------	-----------	---

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大的价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	13,522,521.68	92.45	238,284,665.25	89.03
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	13,522,521.68	92.45	238,284,665.25	89.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变
----	---------------------------

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	-12,850.09	0.00
	沪深 300 指数下降 5%	12,850.09	0.00

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	13,522,521.68	238,284,665.25
第二层次	903,876.66	-
第三层次	-	-
合计	14,426,398.34	238,284,665.25

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如审计费、信息披露费等。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	13,522,521.68	80.34
3	固定收益投资	903,876.66	5.37
	其中：债券	903,876.66	5.37
	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	1,210,887.02	7.19
8	其他各项资产	1,194,707.86	7.10
9	合计	16,831,993.22	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

注：本基金本报告期内未买入股票。

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

注：本基金本报告期内未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未持有股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	903,876.66	6.18
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	903,876.66	6.18

## 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	019766	25 国债 01	9,000	903,876.66	6.18

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

## 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 7.11 本报告期投资基金情况

### 7.11.1 投资政策及风险说明

基金的投资组合比例为：本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于债券型证券投资基金（包括债券指数基金）的比例不低于本基金资产的 80%；投资于 QDII 基金、香港互认基金的比例不超过基金资产的 20%；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产（含存托凭证）的 50%。本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	968114	华夏精选固定收益配置基金 R 类人民币	契约型开放式	1,362,088.66	1,671,827.62	11.43	否
2	531021	建信纯债债券 C	契约型开放式	549,759.00	873,622.03	5.97	否
3	006546	兴银中短债 C	契约型开放式	638,101.79	782,823.28	5.35	否
4	020968	国投瑞银顺昌纯债债券 C	契约型开放式	692,427.80	782,651.14	5.35	否
5	009731	中信保诚安鑫回报债券 C	契约型开放式	675,670.67	748,575.54	5.12	否
6	006542	财通资管鸿利中短债债券 A	契约型开	641,474.13	715,436.10	4.89	否

			放式				
7	006829	鹏扬利沣短债 A	契约 型开 放式	637,215.28	684,687.82	4.68	否
8	010145	格林中短债 A	契约 型开 放式	627,049.73	636,204.66	4.35	否
9	006824	创金合信鑫日 享短债债券 A	契约 型开 放式	499,732.00	624,315.19	4.27	否
10	006989	建信中短债纯 债债券 A	契约 型开 放式	534,683.83	568,796.66	3.89	否
11	007542	永赢开泰中高 等级中短债 A	契约 型开 放式	490,269.63	565,575.05	3.87	否
12	008204	交银稳利中短 债债券 A	契约 型开 放式	481,913.80	561,140.43	3.84	否
13	006635	永赢伟益债券 A	契约 型开 放式	461,459.98	553,152.08	3.78	否
14	022503	富国全球债券 (QDII)人民币 E	契约 型开 放式	395,256.92	513,280.64	3.51	否
15	004247	德邦锐乾债券 C	契约 型开 放式	472,723.83	501,938.16	3.43	否
16	014815	财通资管鸿慧 中短债发起式 A	契约 型开 放式	388,784.68	431,395.48	2.95	否
17	015502	中欧中短债债 券发起 A	契约 型开 放式	400,002.94	429,483.16	2.94	否
18	008569	中航瑞智纯债 A	契约 型开	351,248.34	393,152.27	2.69	否

			放式				
19	006554	华安鼎益债券 C	契约型开放式	321,735.59	368,708.99	2.52	否
20	008797	国联恒安纯债 C	契约型开放式	320,759.26	336,316.08	2.30	否
21	004105	中信保诚稳鑫债券 C	契约型开放式	287,979.69	335,813.12	2.30	否
22	020174	大成惠明纯债债券 C	契约型开放式	262,891.69	285,079.75	1.95	否
23	007754	上银慧永利中短期债券 A	契约型开放式	131,991.57	138,855.13	0.95	否
24	513500	博时标普 500ETF	交易型开放式 (ETF)	2,900.00	6,095.80	0.04	否
25	513300	华夏纳斯达克 100ETF (QDII)	交易型开放式 (ETF)	1,400.00	2,843.40	0.02	否
26	159997	天弘中证电子 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,100.00	2,379.30	0.02	否
27	512980	广发中证传媒 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,400.00	2,061.60	0.01	否
28	516630	华夏中证云计算与大数据主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,400.00	1,621.20	0.01	否

29	512400	南方中证申万有色金属 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,400.00	1,594.60	0.01	否
30	513660	华夏沪港通恒生 ETF	交易型开放式 (ETF)	400.00	1,188.00	0.01	否
31	513120	广发中证香港创新药 (QDII-ETF)	交易型开放式 (ETF)	900.00	1,022.40	0.01	否
32	159792	富国中证港股通互联网 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,000.00	885.00	0.01	否

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

注：本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

## 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	327.42
2	应收清算款	1,194,380.44
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	1,194,707.86
---	----	--------------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A	25	53,931.81	0.00	0.00	1,348,295.35	100.00
平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C	97	135,173.86	0.00	0.00	13,111,864.41	100.00
合计	118	122,543.73	0.00	0.00	14,460,159.76	100.00

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A	—	—
	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C	9.95	0.0001
	合计	9.95	0.0001

注：上述从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别

的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A	0
	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A	0
	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）A	平安元嘉 90 天持有债券（FOF）C
基金合同生效日（2024 年 11 月 12 日）基金份额总额	33,403,756.49	232,162,906.29
本报告期初基金份额总额	33,449,636.09	232,290,758.17
本报告期基金总申购份额	271,792.53	214,136.76
减：本报告期基金总赎回份额	32,373,133.27	219,393,030.52
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,348,295.35	13,111,864.41

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，李海波先生新任公司督察长，原督察长陈特正先生转任风控负责人；游自强先生新任公司信息技术负责人，副总经理林婉文女士不再兼任信息技术负责人。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
川财证券	2	-	-	-	-	
方正证券	3	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国盛证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
天风证券	1	-	-	-	-	
信达证券	1	-	-	-	-	
中信建投证券	2	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好
  - (2) 经营行为规范
  - (3) 合规风控能力较高
  - (4) 交易、研究等服务能力较强
- 2、基金管理人根据上述标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。
- 3、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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 (%)
川财证券	-	-	3,500,000.00	87.50	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	1,098,405.00	17.73	-	-	-	-	-	-
华泰证券	4,098,327.00	66.14	-	-	-	-	16,265.00	83.41
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	999,766.00	16.13	500,000.00	12.50	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	3,236.00	16.59

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 15 日
2	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 08 日
3	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 28 日
4	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 11 日

5	平安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 31 日
6	平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 21 日
7	平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 30 日
8	平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 30 日
9	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 12 日
10	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	2025 年 06 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2025 年 05 月 26 日-2025 年 05 月 26 日	6,001,890.00	0.00	6,001,890.00	0.00	0.00
产品特有风险							
<p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（1）中国证监会准予平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）募集注册的文件

- （2）平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同
- （3）平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金（FOF）托管协议
- （4）法律意见书
- （5）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

## 12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## 12.3 查阅方式

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

平安基金管理有限公司

2025 年 08 月 29 日