

平安盈福 6 个月持有期债券型基金中基金
(FOF)
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 22 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 04 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）
基金主代码	015938
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 8 月 9 日
报告期末基金份额总额	633,399,545.87 份
投资目标	本基金通过主动精选基金品种，并根据市场变化动态调整控制基金下行风险，力争追求基金长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 2、基金投资策略 （1）权益类基金投资策略 （2）固定收益类基金投资策略 （3）商品基金投资策略 3、股票投资策略 （1）港股通标的股票投资策略 （2）存托凭证投资策略 4、债券投资策略 （1）普通债券投资策略 （2）可转换债券、可交换债券投资策略 5、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是债券型基金中基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、股票型基金和股票型基金中

	基金。	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）A	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）C
下属分级基金的交易代码	015938	015939
报告期末下属分级基金的份额总额	453,210,612.40 份	180,188,933.47 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）	
	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）A	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）C
1. 本期已实现收益	-2,671,878.52	-1,296,275.05
2. 本期利润	3,449,901.76	1,308,149.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0070	0.0063
4. 期末基金资产净值	450,287,481.05	178,566,636.45
5. 期末基金份额净值	0.9936	0.9910

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

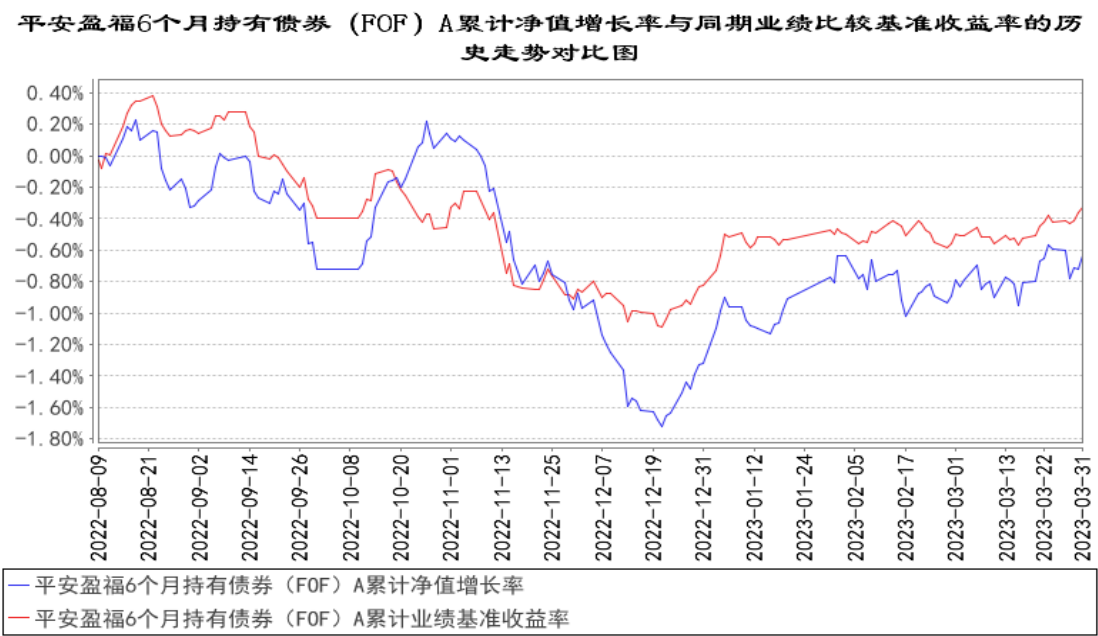
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

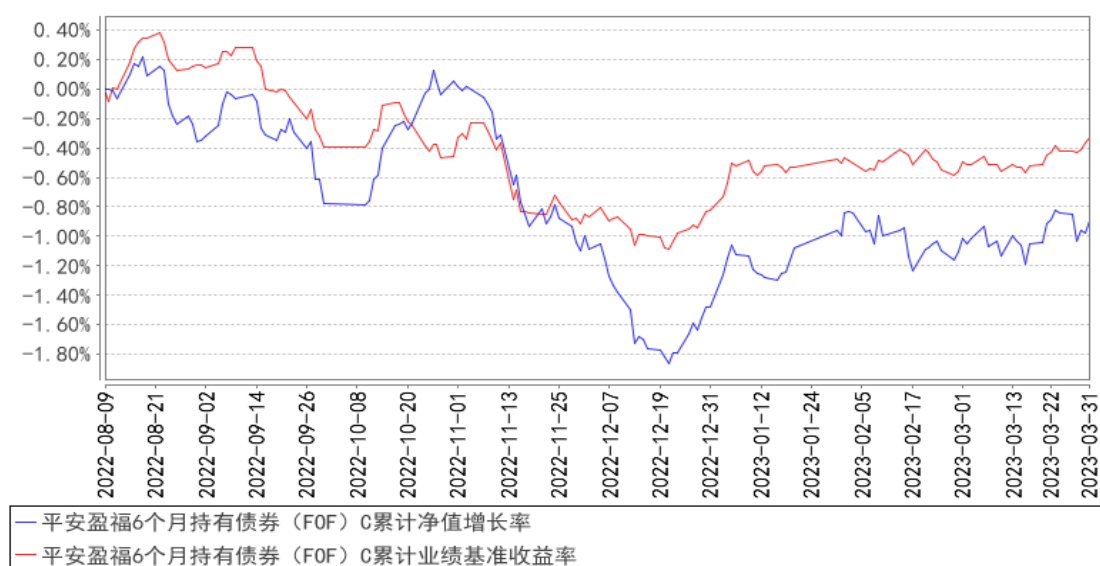
平安盈福 6 个月持有债券（FOF）A

阶段	净值增长率①	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	0.59%	0.09%	0.50%	0.05%	0.09%	0.04%
过去六个月	-0.12%	0.10%	0.07%	0.06%	-0.19%	0.04%
自基金合同生效起至今	-0.90%	0.10%	-0.33%	0.07%	-0.57%	0.03%

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



平安盈福6个月持有债券（FOF）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2022 年 08 月 09 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：本基金本报告期内无其他指标。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易文斐	资产配置部多资产投资团队负责人，平安盈福6个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理	2022年8月9日	-	14年	易文斐先生，复旦大学经济学硕士。曾先后

					个月持有期债券型基金中基金（FOF）、平安盈诚积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，中债总财富指数上涨 0.95%，结构上，和 2022 年 4 季度的情况相反，2023 年一季度信用债资产表现明显优于利率债。权益资产方面，一季度权益市场环境较好，万得全 A 上涨

产占比较低，在一月权益市场上涨行情中受益不多，且结构上偏向军工等和宏观经济景气度关联较小的行业，基金经理计划看到更多宏观经济复苏确定性信号后再增加权益资产占比，2、3 月中，组合提升了权益资产占比。和组合成立以来的平均权益仓位相比，本季度末，组合权益仓位属中性偏高水平，且结构上也更加均衡。

展望二季度，基金经理认为宏观经济景气度虽然有一定压力，但预计下行风险不大，债券市场预计较平稳，权益市场的总体环境偏积极。人工智能主题等热门板块交投活跃，对提升权益市场热度有帮助，可能吸引更多资金进入资本市场，从而可能构成 A 股的正向催化剂。组合倾向保持当前的运作策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安盈福 6 个月持有债券（FOF）A 的基金份额净值 0.9936 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.69%，同期业绩比较基准收益率为 0.50%；截至本报告期末平安盈福 6 个月持有债券（FOF）C 的基金份额净值 0.9910 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.59%，同期业绩比较基准收益率为 0.50%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	28,032,450.69	4.34
	其中：股票	28,032,450.69	4.34
2	基金投资	549,774,941.38	85.06
3	固定收益投资	21,051,633.48	3.26
	其中：债券	21,051,633.48	3.26
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 3,772,141.69 元，占净值比例 0.60%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	3,287,341.00	0.52
C	制造业	15,417,498.00	2.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,021,470.00	0.32
J	金融业	3,534,000.00	0.56
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	24,260,309.00	3.86

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	—	—

公用事业	-	-
合计	3,772,141.69	0.60

注：以上分类采用全球行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	01347	华虹半导体	124,000	3,772,141.69	0.60
2	600901	江苏金租	600,000	3,534,000.00	0.56
3	601058	赛轮轮胎	314,700	3,395,613.00	0.54
4	601882	海天精工	111,000	3,297,810.00	0.52
5	600765	中航重机	118,400	2,905,536.00	0.46
6	600416	湘电股份	93,100	1,916,929.00	0.30
7	600893	航发动力	42,200	1,820,930.00	0.29
8	000975	银泰黄金	133,300	1,755,561.00	0.28
9	600547	山东黄金	69,500	1,531,780.00	0.24
10	002938	鹏鼎控股	48,400	1,501,368.00	0.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.7 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：本基金报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本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。

5.10.2 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

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,684.17
2	应收证券清算款	2,972,303.13
3	应收	

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

5.10.6 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。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	519723	交银双轮动债券 A	契约型开放式	47,545,969.57	51,197,500.03	8.14	否
2	000402	工银纯债债券 A	契约型开放式	41,280,086.49	48,615,557.86	7.73	否
3	519137	海富通瑞福债券 A	契约型开放式	42,167,266.98	45,802,085.39	7.28	否
4	003327	万家鑫璟纯债债券 A	契约型开放式	37,586,895.00	45,145,619.58	7.18	否
5	009721	平安中债 1-5 年政策性金融债 A	契约型开放式	42,987,730.71	44,801,812.95	7.12	是
6	009306	平安惠铭纯债债券	契约型开放式	39,543,833.08	42,485,894.26	6.76	是
7	007347	永赢昌利债券					

		金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	35,550.16	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	114,476.72	18,442.00
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	28,825.61	-
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	510,314.69	130,427.51
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	152,975.28	41,218.87
当期持有基金产生的转换费(元)	43,146.22	-
当期持有基金产生的交易费(元)	5,822.62	-

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）A	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）C
报告期期初基金份额总额	519,184,779.63	232,378,556.12
报告期期间基金总申购份额	8,044,717.01	1,024.08
减:报告期期间基金总赎回份额	74,018,884.24	52,190,646.73
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	453,210,612.40	180,188,933.47

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

类别							
机构	1	2023/01/01--2023/02/05; 2023/02/13--2023/03/31	151,132,493.70	-	-	151,132,493.70	23.86
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。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予平安盈福 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）募集注册的文件
- （2）平安盈福 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同
- （3）平安盈福 6 个月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

10.

平安基金管理有限公司

2023 年 4 月 22 日