

平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
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
§4 管理人报告	9
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
§5 托管人报告	12
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	平安瑞兴一年定开混合	
基金主代码	010056	
基金运作方式	契约型、定期开放式。本基金以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作相结合的方式运作。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起（含）至 12 个月月度对日的前一日。如该对应日期为非工作日，则顺延至下一个工作日，若该日历月度中不存在对应日期的，则顺延至该日历月最后一日的下一个工作日。本基金自每个封闭期结束后第一个工作日（含该日）起进入开放期，每个开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 5 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	2020 年 11 月 4 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,052,947.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安瑞兴一年定开混合 A	平安瑞兴一年定开混合 C
下属分级基金的交易代码	010056	010057
报告期末下属分级基金的份额总额	42,737,319.31 份	5,315,628.56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过各类资产的合理配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	（一）封闭期投资策略 1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、衍生品投资策略：（1）股指期货投资策略；（2）国债期货投资策略；5、资产支持证券投资策略（二）开放期投资策略
业绩比较基准	中债新综合指数收益率 \times 85%+沪深 300 指数收益率 \times 15%
风险收益特征	本基金是混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	韩笑微
	联系电话	0755-22626828	010-68858113
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	hanxiaowei@psbcoa.com.cn

客户服务热线	400-800-4800	95580
传真	0755-23997878	010-68858120
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	北京市西城区金融大街 3 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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	518048	100808
法定代表人	罗春风	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
和指标	平安瑞兴一年定开混合 A	平安瑞兴一年定开混合 C
本期已实现收益	2,316,871.16	270,193.03
本期利润	2,542,369.11	298,008.78
加权平均基金份 额本期利润	0.0595	0.0561
本期加权平均净 值利润率	5.34%	5.10%
本期基金份额净 值增长率	5.52%	5.27%
3.1.2 期末数据	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
和指标		
期末可供分配利 润	5,834,739.79	645,702.48
期末可供分配基 金份额利润	0.1365	0.1215

期末基金资产净值	48,572,059.10	5,961,331.04
期末基金份额净值	1.1365	1.1215
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	13.65%	12.15%

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

平安瑞兴一年定开混合 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	0.43%	0.16%	0.33%	0.13%	0.10%	0.03%
过去三个月	2.01%	0.15%	0.03%	0.12%	1.98%	0.03%
过去六个月	5.52%	0.13%	0.98%	0.12%	4.54%	0.01%
过去一年	5.11%	0.19%	-1.02%	0.14%	6.13%	0.05%
自基金合同生效起至今	13.65%	0.23%	0.86%	0.17%	12.79%	0.06%

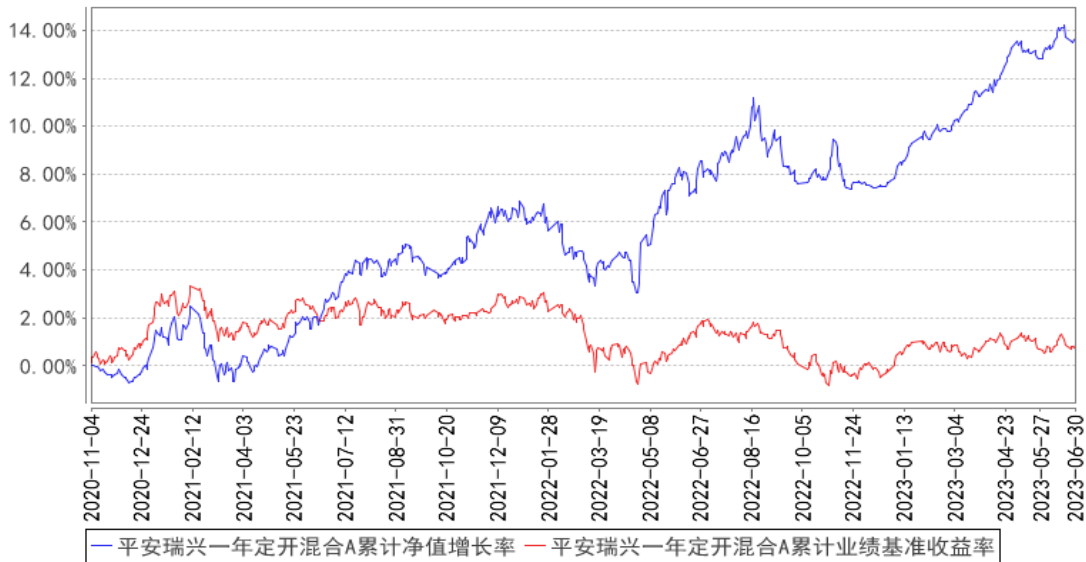
平安瑞兴一年定开混合 C

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	0.39%	0.16%	0.33%	0.13%	0.06%	0.03%
过去三个月	1.89%	0.15%	0.03%	0.12%	1.86%	0.03%
过去六个月	5.27%	0.13%	0.98%	0.12%	4.29%	0.01%
过去一年	4.60%	0.20%	-1.02%	0.14%	5.62%	0.06%

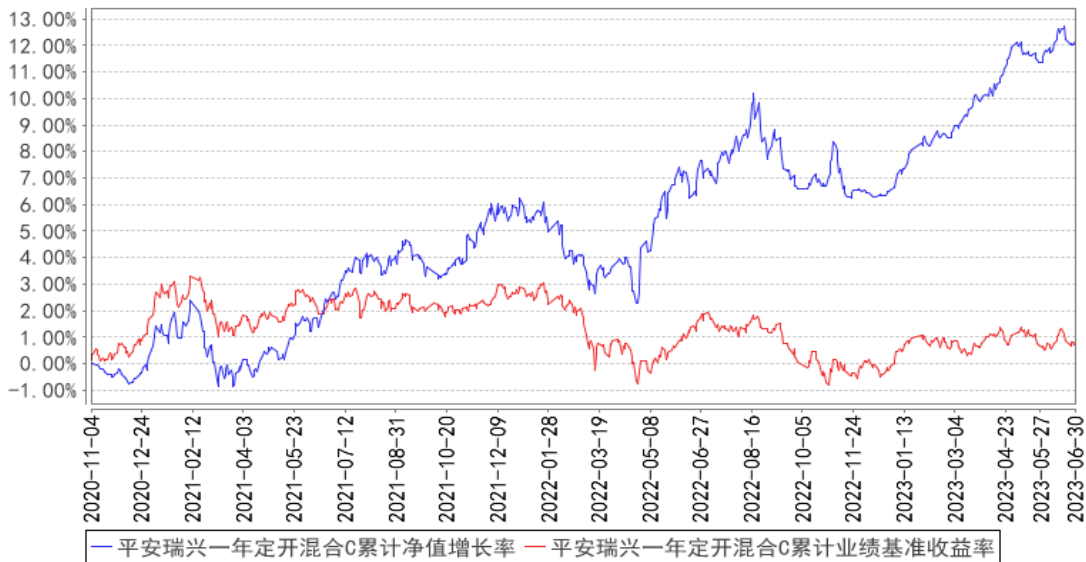
自基金合同生效起 至今	12.15%	0.23%	0.86%	0.17%	11.29%	0.06%
----------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

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

平安瑞兴一年定开混合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



平安瑞兴一年定开混合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 2020 年 11 月 04 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。

3.3 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（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）。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 2023 年 6 月 30 日，平安基金共管理 186 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5,721.58 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		
高 勇 标	固定收益投资中心总监助理，平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金基金经理	2020 年 11 月 4 日	-	12 年	高勇标先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017 年 4 月加入平安基金管理有限公司，曾任投资研究部固定收益组投资经理，现任固定收益投资中心总监助理，同时担任平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金、平安合润 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠润纯债债券型证券投资基金、平安惠合纯债债券型证券投资基金、平安双盈添益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。

4.2 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

2023 年上半年，国内经济在疫情之后总体有所反弹，消费报复性修复但工业生产恢复偏弱。基建维持较高增速，制造业投资趋稳，但房地产投资持续低迷。出口受外需走弱影响进一步承压，通胀水平在需求收缩的大背景下维持低位。货币政策维持偏宽松状态，央行总量和结构性政策并举，分别于 3 月全面降准 0.25 个百分点，6 月降息 10BP，另外增加支农再贷款、支小再贷款、再贴现额度 2000 亿，市场流动性保持了合理充裕。总体来看，上半年债市收益率呈冲高回落走势。具体来看，3 月份，在两会定调经济目标为 5%后，市场不再期待政策“强刺激”，再次调整了年初

对复苏高度的判断，收益率明显下行。二季度随着高频数据持续验证基本面走弱，市场对经济担忧、质疑、焦虑的声音浮现，收益率进一步下行，直至 6 月央行降息落地，止盈盘出现，市场情绪才有所缓和、转向震荡。权益市场方面，年初在“强预期，弱现实”背景下，出现一波快速上行的修复行情；二季度由于稳增长政策偏弱，市场对经济复苏的持续性持有怀疑态度，市场表现相对较弱。

上半年本基金保持了投资组合的流动性，债券资产主要配置中短期限的中高等级信用债，波段操作长端利率债和高等级信用债；权益资产均衡配置于偏稳增长逻辑的周期股，阶段性参与了成长板块，以及部分风险收益较好的可转债标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安瑞兴一年定开混合 A 的基金份额净值 1.1365 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.52%，同期业绩比较基准收益率为 0.98%；截至本报告期末平安瑞兴一年定开混合 C 的基金份额净值 1.1215 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.27%，同期业绩比较基准收益率为 0.98%。

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，本基金认为债市收益率有望保持区间震荡。7 月政治局会议暗示稳健的货币政策基调将延续，新增强调发挥总量和结构性货币政策的双重功能，结合此前央行有关领导提及将综合运用存款准备金、中期借贷便利等多种工具维持流动性合理充裕，未来降准可期，降息仍有机会，因此债市收益率上行风险有限；另一方面，下半年财政支出进度有望加快，伴随一揽子稳增长政策落地，经济增长悲观预期可能有所修复，债市进一步大幅下行空间也比较有限。综上，本基金管理人认为下半年中短端信用债仍有一定配置价值，利率债总体偏震荡，长端品种存在交易性机会。

权益市场方面，本基金认为二季度市场对国内中长期经济增长相对悲观，随着 7 月份政治局会议的召开，下半年稳增长政策将陆续出台，经济基本面将有所好转，涉及平台互联网、地方债务、房地产和中美关系等方面的不确定性也将逐步下降，指数单边调整可能接近尾声，未来股市的风险收益比将明显提升。

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。

4.7 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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	11,801,844.27	14,462,901.62
结算备付金		5,970,366.04	3,903,310.10
存出保证金		57,441.04	398,962.17
交易性金融资产	6.4.7.2	66,468,239.62	33,146,231.12
其中：股票投资		3,572,175.63	962,773.07
基金投资		-	-
债券投资		62,896,063.99	32,183,458.05
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		84,297,890.97	51,911,405.01
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
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		25,938,782.23	-
应付清算款		3,654,492.59	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		35,851.37	35,070.13
应付托管费		8,962.83	8,767.53
应付销售服务费		2,449.88	2,401.84
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,364.69	360.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	118,597.24	171,792.51
负债合计		29,764,500.83	218,392.76
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	48,052,947.87	48,052,947.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	6,480,442.27	3,640,064.38
净资产合计		54,533,390.14	51,693,012.25
负债和净资产总计		84,297,890.97	51,911,405.01

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 48,052,947.87 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1365 元，基金份额 42,737,319.31 份；C 类基金份额净值 1.1215 元，基金份额 5,315,628.56 份。

6.2 利润表

会计主体：平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,431,780.54	1,503,964.08
1. 利息收入		52,835.93	99,075.06
其中：存款利息收入	6.4.7.13	52,835.93	81,694.85
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		-	17,380.21
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,125,630.91	1,325,018.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-411,223.98	-2,008,666.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,522,615.64	3,979,917.01
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-

收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-3,485.48	-669,331.99
股利收益	6.4.7.19	17,724.73	23,100.00
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）	6.4.7.20	253,313.70	79,870.61
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		591,402.65	635,436.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	211,971.04	296,766.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	52,992.77	74,191.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,498.25	31,737.92
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		233,255.61	155,562.74
其中：卖出回购金融资产 支出		233,255.61	155,562.74
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,757.31	2,210.56
8. 其他费用	6.4.7.23	75,927.67	74,967.67
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		2,840,377.89	868,527.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		2,840,377.89	868,527.50
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		2,840,377.89	868,527.50

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期 末 净	48,052,947.87	-	3,640,064.38	51,693,012.25

资产(基金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	48,052,947.87	-	3,640,064.38	51,693,012.25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	2,840,377.89	2,840,377.89
(一)、综合收益总额	-	-	2,840,377.89	2,840,377.89
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产	-	-	-	-

生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	48,052,947.87	-	6,480,442.27	54,533,390.14
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	70,903,273.76	-	4,778,457.74	75,681,731.50
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	70,903,273.76	-	4,778,457.74	75,681,731.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	868,527.50	868,527.50
(一)、综合收益总额	-	-	868,527.50	868,527.50
(二)、本期基	-	-	-	-

金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)				
其中:1. 基 金 申 购 款	-	-	-	-
2 . 基 金 赎 回 款	-	-	-	-
(三)、 本 期 向 基 金 份 额 持 有 人 分 配 利 润 产 生 的 基 金 净 值 变 动 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	-	-	-	-
(四)、 其 他 综 合 收 益 结 转 留 存 收 益	-	-	-	-
四、本期 期 末 净 资 产 (基 金 净 值)	70,903,273.76	-	5,646,985.24	76,550,259.00

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
基金管理人负责人

林婉文
主管会计工作负责人

张南南
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金（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[2020]1676 号《关于准予平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准，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《平安瑞兴一年定期开放混合型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 475,819,405.90 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（2020）第 0931 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 476,101,219.51 份基金份额，其中认购资金利息折合 281,813.61 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金基金招募说明书》，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，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、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发售在外的该类别基金份额总数。

根据《平安瑞兴一年定期开放混合型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）12 个月月度对日的前一日，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。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务（红利再投资除外），也不上市交易。每一个封闭期结束后第一个工作日起（含），本基金即进入开放期，本基金每个开放期不少于 5 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。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，开放期未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《平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票）、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、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、

地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）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、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不高于基金资产的 30%；本基金投资于同业存单的比例不得超过基金资产的 20%。在开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

本基金的业绩比较基准为：中债新综合指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 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

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

（2）增值税

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。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	11,801,844.27
等于：本金	11,801,351.02
加：应计利息	493.25
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	11,801,844.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,645,271.99	-	3,572,175.63	-73,096.36
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	40,921,168.73	412,981.69	41,574,159.05	240,008.63
	银行间市场	21,000,477.12	167,504.94	21,321,904.94	153,922.88
	合计	61,921,645.85	580,486.63	62,896,063.99	393,931.51
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	65,566,917.84	580,486.63	66,468,239.62	320,835.15
----	---------------	------------	---------------	------------

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：本基金本报告期末无衍生金融资产/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：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	52,269.57
其中：交易所市场	39,103.56
银行间市场	13,166.01
应付利息	-
预提费用	66,327.67
合计	118,597.24

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安瑞兴一年定开混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,737,319.31	42,737,319.31
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	42,737,319.31	42,737,319.31

平安瑞兴一年定开混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,315,628.56	5,315,628.56
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,315,628.56	5,315,628.56

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

平安瑞兴一年定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,509,972.69	-1,217,602.01	3,292,370.68
本期利润	2,316,871.16	225,497.95	2,542,369.11
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,826,843.85	-992,104.06	5,834,739.79

平安瑞兴一年定开混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	498,000.14	-150,306.44	347,693.70
本期利润	270,193.03	27,815.75	298,008.78
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	768,193.17	-122,490.69	645,702.48

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,725.75
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	34,500.80
其他	609.38
合计	52,835.93

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-411,223.98
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-411,223.98

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	43,992,409.79
减：卖出股票成本总额	44,292,191.47
减：交易费用	111,442.30
买卖股票差价收入	-411,223.98

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 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	891,711.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,630,904.60
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	3,522,615.64

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	354,257,656.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	349,237,086.41
减：应计利息总额	2,374,662.08
减：交易费用	15,002.91
买卖债券差价收入	2,630,904.60

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-58,982.78
股指期货投资收益	55,497.30

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	17,724.73
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,724.73

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	263,193.70
股票投资	-45,930.84
债券投资	309,124.54
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-9,880.00
权证投资	-
期货投资	-9,880.00
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	253,313.70

6.4.7.21 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	900.00
合计	75,927.67

6.4.7.24 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，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
中国邮政储蓄银行股份有限公司(“邮政储蓄银行”)	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
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
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	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
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：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	211,971.04	296,766.23
其中：支付销售机构的客户维护费	59,225.08	118,766.93

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 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	52,992.77	74,191.46

注：支付基金托管行邮政储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安瑞兴一年定开混合 A	平安瑞兴一年定开混合 C	合计
陆基金	—	390.37	390.37
平安基金	—	27.15	27.15
平安人寿	—	5,373.78	5,373.78

平安证券	-	3.62	3.62
邮政储蓄银行	-	8,109.99	8,109.99
合计	-	13,904.91	13,904.91
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安瑞兴一年定开混合 A	平安瑞兴一年定开混合 C	合计
陆基金	-	1,596.07	1,596.07
平安基金	-	31.08	31.08
平安人寿	-	9,844.10	9,844.10
平安证券	-	3.62	3.62
邮政储蓄银行	-	19,286.26	19,286.26
合计	-	30,761.13	30,761.13

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 0.50% 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 × 0.50% / 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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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

份额单位：份

平安瑞兴一年定开混合 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 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	20,452,022.28	47.8552	20,452,022.28	47.8552

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
邮政储蓄银行-活期	11,801,844.27	17,725.75	18,006,687.64	56,148.69

注：本基金的银行存款由基金托管人邮政储蓄银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 9,043,136.70 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102281461	22 华发实业 MTN001B	2023 年 7 月 3 日	106.36	3,000	319,081.51
102381364	23 新乡投资 MTN003	2023 年 7 月 3 日	100.15	40,000	4,005,994.32
102281461	22 华发实业 MTN001B	2023 年 7 月 5 日	106.36	3,000	319,081.51

102380410	23 江津华信 MTN001B	2023 年 7 月 5 日	102.53	50,000	5,126,745.90
102381260	23 川能投 MTN001B	2023 年 7 月 5 日	100.45	3,000	301,355.80
合计				99,000	10,072,259.04

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 16,895,645.53 元，于 2023 年 07 月 03 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。（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 102.75%（上年末：8.90%）。

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 个工作日内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 个工作日内可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,801,844.27	-	-	-	11,801,844.27
结算备付金	5,970,366.04	-	-	-	5,970,366.04
存出保证金	57,441.04	-	-	-	57,441.04
交易性金融资产	30,676,144.79	25,354,478.20	6,865,441.00	3,572,175.63	66,468,239.62
资产总计	48,505,796.14	25,354,478.20	6,865,441.00	3,572,175.63	84,297,890.97
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	35,851.37	35,851.37
应付托管费	-	-	-	8,962.83	8,962.83

应付清算款	-	-	-	3,654,492.59	3,654,492.59
卖出回购金融资产款	25,938,782.23	-	-	-	25,938,782.23
应付销售服务费	-	-	-	2,449.88	2,449.88
应交税费	-	-	-	5,364.69	5,364.69
其他负债	-	-	-	118,597.24	118,597.24
负债总计	25,938,782.23	-	-	3,825,718.60	29,764,500.83
利率敏感度缺口	22,567,013.91	25,354,478.20	6,865,441.00	-253,542.97	54,533,390.14
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,462,901.62	-	-	-	14,462,901.62
结算备付金	3,903,310.10	-	-	-	3,903,310.10
存出保证金	94,577.37	-	-	304,384.80	398,962.17
交易性金融资产	23,840,744.62	-	8,342,713.43	962,773.07	33,146,231.12
资产总计	42,301,533.71	-	8,342,713.43	1,267,157.87	51,911,405.01
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	35,070.13	35,070.13
应付托管费	-	-	-	8,767.53	8,767.53
应付销售服务费	-	-	-	2,401.84	2,401.84
应交税费	-	-	-	360.75	360.75
其他负债	-	-	-	171,792.51	171,792.51
负债总计	-	-	-	218,392.76	218,392.76
利率敏感度缺口	42,301,533.71	-	8,342,713.43	1,048,765.11	51,693,012.25

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-587,393.16	-299,837.43
	市场利率下降 25 个基点	597,845.61	305,992.55

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注: 无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	3,572,175.63	6.55	962,773.07	1.86
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	3,572,175.63	6.55	962,773.07	1.86

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		
	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 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	203,745.96	313,478.07

	沪深 300 指数下降 5%	-203,745.96	-313,478.07
--	-------------------	-------------	-------------

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	7,847,989.29	1,537,795.70
第二层次	58,620,250.33	31,608,435.42
第三层次	-	-
合计	66,468,239.62	33,146,231.12

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

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,572,175.63	4.24
	其中：股票	3,572,175.63	4.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,896,063.99	74.61
	其中：债券	62,896,063.99	74.61
	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	17,772,210.31	21.08
8	其他各项资产	57,441.04	0.07
9	合计	84,297,890.97	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

金额单位：人民币元

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	24,207.40	0.04
B	采矿业	19,653.50	0.04
C	制造业	2,675,112.13	4.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,616.00	0.01
E	建筑业	71,185.00	0.13
F	批发和零售业	1,858.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	35,471.40	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	579,591.80	1.06
J	金融业	42,131.00	0.08
K	房地产业	9,699.00	0.02
L	租赁和商务服务业	12,020.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	70,495.40	0.13

N	水利、环境和公共设施管理业	3,899.00	0.01
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	19,236.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	3,572,175.63	6.55

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603596	伯特利	2,800	221,928.00	0.41
2	688036	传音控股	1,378	202,566.00	0.37
3	300394	天孚通信	1,600	170,928.00	0.31
4	002475	立讯精密	4,300	139,535.00	0.26
5	300750	宁德时代	600	137,274.00	0.25
6	603345	安井食品	900	132,120.00	0.24
7	002230	科大讯飞	1,800	122,328.00	0.22
8	000651	格力电器	3,200	116,832.00	0.21
9	300002	神州泰岳	8,100	113,400.00	0.21
10	688378	奥来德	2,191	108,235.40	0.20
11	688283	坤恒顺维	1,558	103,638.16	0.19
12	300308	中际旭创	700	103,215.00	0.19
13	603383	顶点软件	1,500	83,130.00	0.15
14	002410	广联达	2,200	71,478.00	0.13
15	002460	赣锋锂业	1,100	67,056.00	0.12
16	002599	盛通股份	7,200	65,160.00	0.12
17	300811	铂科新材	1,080	64,195.20	0.12
18	601138	工业富联	2,400	60,480.00	0.11
19	002276	万马股份	4,900	59,339.00	0.11
20	688981	中芯国际	1,108	55,976.16	0.10
21	603105	芯能科技	3,300	55,737.00	0.10
22	601800	中国交建	5,100	55,641.00	0.10
23	605333	沪光股份	3,100	51,274.00	0.09
24	603444	吉比特	100	49,111.00	0.09
25	002466	天齐锂业	700	48,937.00	0.09
26	300502	新易盛	700	47,579.00	0.09
27	688111	金山办公	100	47,222.00	0.09
28	688169	石头科技	100	32,068.00	0.06
29	002371	北方华创	100	31,765.00	0.06

30	300778	新城市	1,707	31,067.40	0.06
31	605117	德业股份	180	26,919.00	0.05
32	000568	泸州老窖	100	20,957.00	0.04
33	600809	山西汾酒	100	18,507.00	0.03
34	002959	小熊电器	200	16,700.00	0.03
35	603477	巨星农牧	500	16,675.00	0.03
36	688686	奥普特	100	16,448.00	0.03
37	601601	中国太保	600	15,588.00	0.03
38	688531	日联科技	100	14,851.00	0.03
39	301191	菲菱科思	130	13,444.60	0.02
40	300938	信测标准	300	13,140.00	0.02
41	002011	盾安环境	900	12,447.00	0.02
42	601965	中国汽研	600	12,390.00	0.02
43	601799	星宇股份	100	12,360.00	0.02
44	603667	五洲新春	800	11,904.00	0.02
45	300624	万兴科技	100	11,715.00	0.02
46	601872	招商轮船	2,000	11,580.00	0.02
47	300724	捷佳伟创	100	11,235.00	0.02
48	601888	中国中免	100	11,053.00	0.02
49	002444	巨星科技	500	10,940.00	0.02
50	688167	炬光科技	100	10,755.00	0.02
51	001965	招商公路	1,100	10,560.00	0.02
52	300763	锦浪科技	100	10,410.00	0.02
53	002180	纳思达	300	10,275.00	0.02
54	300496	中科创达	100	9,635.00	0.02
55	603833	欧派家居	100	9,580.00	0.02
56	300863	卡倍亿	150	9,436.50	0.02
57	603112	华翔股份	800	9,408.00	0.02
58	002049	紫光国微	100	9,325.00	0.02
59	001223	欧克科技	100	9,099.00	0.02
60	600309	万华化学	100	8,784.00	0.02
61	600893	航发动力	200	8,452.00	0.02
62	688332	中科蓝讯	100	8,368.00	0.02
63	301095	广立微	100	8,265.00	0.02
64	601111	中国国航	1,000	8,240.00	0.02
65	688636	智明达	149	8,195.00	0.02
66	601689	拓普集团	100	8,070.00	0.01
67	002991	甘源食品	100	7,670.00	0.01
68	002916	深南电路	100	7,537.00	0.01
69	603185	弘元绿能	100	7,455.00	0.01
70	601336	新华保险	200	7,354.00	0.01
71	603893	瑞芯微	100	7,285.00	0.01
72	603936	博敏电子	600	7,200.00	0.01

73	688521	芯原股份	100	7,192.00	0.01
74	002738	中矿资源	140	7,131.60	0.01
75	300260	新莱应材	180	7,113.60	0.01
76	300428	立中集团	300	6,918.00	0.01
77	300413	芒果超媒	200	6,842.00	0.01
78	688041	海光信息	100	6,827.00	0.01
79	600027	华电国际	1,000	6,690.00	0.01
80	600036	招商银行	200	6,552.00	0.01
81	002791	坚朗五金	100	6,471.00	0.01
82	603259	药明康德	100	6,231.00	0.01
83	603638	艾迪精密	300	6,156.00	0.01
84	300620	光库科技	100	6,128.00	0.01
85	600845	宝信软件	120	6,097.20	0.01
86	000999	华润三九	100	6,066.00	0.01
87	300014	亿纬锂能	100	6,050.00	0.01
88	688326	经纬恒润	40	5,775.60	0.01
89	601728	中国电信	1,000	5,630.00	0.01
90	002965	祥鑫科技	100	5,568.00	0.01
91	300570	太辰光	100	5,471.00	0.01
92	300827	上能电气	143	5,155.15	0.01
93	603019	中科曙光	100	5,090.00	0.01
94	688385	复旦微电	100	5,010.00	0.01
95	603606	东方电缆	100	4,903.00	0.01
96	000977	浪潮信息	100	4,850.00	0.01
97	300604	长川科技	100	4,749.00	0.01
98	688533	上声电子	100	4,673.00	0.01
99	300494	盛天网络	180	4,462.20	0.01
100	603283	赛腾股份	100	4,450.00	0.01
101	603348	文灿股份	100	4,381.00	0.01
102	603997	继峰股份	300	4,290.00	0.01
103	688475	萤石网络	100	4,286.00	0.01
104	688088	虹软科技	100	4,275.00	0.01
105	300059	东方财富	300	4,260.00	0.01
106	002714	牧原股份	100	4,215.00	0.01
107	603690	至纯科技	120	4,180.80	0.01
108	002129	TCL 中环	125	4,150.00	0.01
109	002368	太极股份	100	4,117.00	0.01
110	002315	焦点科技	100	4,000.00	0.01
111	300034	钢研高纳	100	3,939.00	0.01
112	001979	招商蛇口	300	3,909.00	0.01
113	002837	英维克	130	3,892.20	0.01
114	688248	南网科技	100	3,839.00	0.01
115	300759	康龙化成	100	3,828.00	0.01

116	600248	陕建股份	800	3,816.00	0.01
117	603816	顾家家居	100	3,815.00	0.01
118	000988	华工科技	100	3,801.00	0.01
119	002568	百润股份	100	3,635.00	0.01
120	002472	双环传动	100	3,630.00	0.01
121	600383	金地集团	500	3,605.00	0.01
122	600348	华阳股份	450	3,559.50	0.01
123	601319	中国人保	600	3,504.00	0.01
124	601628	中国人寿	100	3,496.00	0.01
125	002555	三七互娱	100	3,488.00	0.01
126	605305	中际联合	100	3,486.00	0.01
127	603876	鼎胜新材	180	3,454.20	0.01
128	603186	华正新材	100	3,440.00	0.01
129	002906	华阳集团	100	3,419.00	0.01
130	601858	中国科传	100	3,360.00	0.01
131	300212	易华录	100	3,323.00	0.01
132	300788	中信出版	100	3,321.00	0.01
133	300761	立华股份	180	3,317.40	0.01
134	301185	鸥玛软件	100	3,302.00	0.01
135	688676	金盘科技	108	3,271.32	0.01
136	002240	盛新锂能	100	3,187.00	0.01
137	000938	紫光股份	100	3,185.00	0.01
138	002487	大金重工	100	3,084.00	0.01
139	601088	中国神华	100	3,075.00	0.01
140	688400	凌云光	100	3,048.00	0.01
141	000065	北方国际	200	3,004.00	0.01
142	600188	兖矿能源	100	2,992.00	0.01
143	603209	兴通股份	140	2,969.40	0.01
144	002541	鸿路钢构	100	2,881.00	0.01
145	601012	隆基绿能	100	2,867.00	0.01
146	300687	赛意信息	100	2,778.00	0.01
147	002859	洁美科技	100	2,770.00	0.01
148	002271	东方雨虹	100	2,726.00	0.00
149	300458	全志科技	100	2,725.00	0.00
150	600197	伊力特	100	2,717.00	0.00
151	300229	拓尔思	100	2,597.00	0.00
152	300601	康泰生物	100	2,539.00	0.00
153	000967	盈峰环境	500	2,525.00	0.00
154	601117	中国化学	300	2,484.00	0.00
155	300115	长盈精密	200	2,382.00	0.00
156	603298	杭叉集团	100	2,355.00	0.00
157	600547	山东黄金	100	2,348.00	0.00
158	688001	华兴源创	62	2,196.04	0.00

159	002463	沪电股份	100	2,094.00	0.00
160	300554	三超新材	100	2,083.00	0.00
161	300188	美亚柏科	100	2,079.00	0.00
162	601900	南方传媒	100	2,051.00	0.00
163	688379	华光新材	100	2,031.00	0.00
164	600761	安徽合力	100	1,993.00	0.00
165	688279	峰岬科技	15	1,980.00	0.00
166	002236	大华股份	100	1,975.00	0.00
167	000928	中钢国际	200	1,930.00	0.00
168	603108	润达医疗	100	1,858.00	0.00
169	603363	傲农生物	200	1,834.00	0.00
170	601225	陕西煤业	100	1,819.00	0.00
171	600938	中国海油	100	1,812.00	0.00
172	300499	高澜股份	100	1,762.00	0.00
173	000100	TCL 科技	440	1,733.60	0.00
174	601615	明阳智能	100	1,688.00	0.00
175	002149	西部材料	100	1,679.00	0.00
176	600031	三一重工	100	1,663.00	0.00
177	601699	潞安环能	100	1,632.00	0.00
178	603239	浙江仙通	100	1,627.00	0.00
179	600522	中天科技	100	1,591.00	0.00
180	002517	恺英网络	100	1,574.00	0.00
181	002436	兴森科技	100	1,550.00	0.00
182	002001	新 和 成	100	1,540.00	0.00
183	600487	亨通光电	100	1,466.00	0.00
184	600183	生益科技	100	1,420.00	0.00
185	600176	中国巨石	100	1,416.00	0.00
186	300925	法本信息	100	1,413.00	0.00
187	601677	明泰铝业	100	1,388.00	0.00
188	601688	华泰证券	100	1,377.00	0.00
189	000035	中国天楹	300	1,374.00	0.00
190	688031	星环科技	10	1,332.40	0.00
191	600373	中文传媒	100	1,332.00	0.00
192	600048	保利发展	100	1,303.00	0.00
193	300224	正海磁材	100	1,286.00	0.00
194	600026	中远海能	100	1,264.00	0.00
195	000719	中原传媒	100	1,170.00	0.00
196	002609	捷顺科技	100	1,166.00	0.00
197	601098	中南传媒	100	1,160.00	0.00
198	300170	汉得信息	100	1,154.00	0.00
199	601668	中国建筑	200	1,148.00	0.00
200	601058	赛轮轮胎	100	1,139.00	0.00
201	600489	中金黄金	100	1,033.00	0.00

202	601186	中国铁建	100	985.00	0.00
203	002036	联创电子	100	971.00	0.00
204	300058	蓝色光标	100	967.00	0.00
205	002790	瑞尔特	100	960.00	0.00
206	600011	华能国际	100	926.00	0.00
207	002244	滨江集团	100	882.00	0.00
208	002063	远光软件	100	868.00	0.00
209	601636	旗滨集团	100	862.00	0.00
210	601975	招商南油	300	858.00	0.00
211	601611	中国核建	100	845.00	0.00
212	002130	沃尔核材	100	812.00	0.00
213	601390	中国中铁	100	758.00	0.00
214	601857	中国石油	100	747.00	0.00
215	600105	永鼎股份	100	745.00	0.00
216	002121	科陆电子	100	733.00	0.00
217	600028	中国石化	100	636.00	0.00
218	601669	中国电建	100	574.00	0.00
219	600050	中国联通	100	480.00	0.00
220	000060	中金岭南	100	475.00	0.00
221	600984	建设机械	100	452.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601900	南方传媒	3,331,118.18	6.44
2	000719	中原传媒	2,454,468.60	4.75
3	603019	中科曙光	1,227,456.72	2.37
4	600941	中国移动	726,713.00	1.41
5	300260	新莱应材	669,538.00	1.30
6	600547	山东黄金	629,501.00	1.22
7	300059	东方财富	623,513.00	1.21
8	002236	大华股份	606,987.00	1.17
9	600522	中天科技	582,261.00	1.13
10	601628	中国人寿	576,841.00	1.12
11	605333	沪光股份	533,966.00	1.03
12	002368	太极股份	528,203.00	1.02
13	300229	拓尔思	522,159.00	1.01
14	688036	传音控股	514,335.66	0.99
15	601728	中国电信	510,362.00	0.99
16	300170	汉得信息	500,571.72	0.97
17	000060	中金岭南	482,963.00	0.93
18	600050	中国联通	476,819.00	0.92

19	688475	萤石网络	446,872.26	0.86
20	600487	亨通光电	426,394.00	0.82

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601900	南方传媒	3,432,085.98	6.64
2	000719	中原传媒	2,330,893.97	4.51
3	603019	中科曙光	1,190,285.00	2.30
4	600941	中国移动	706,333.00	1.37
5	002236	大华股份	676,188.00	1.31
6	600547	山东黄金	647,527.80	1.25
7	300059	东方财富	646,584.80	1.25
8	300260	新莱应材	639,415.00	1.24
9	600522	中天科技	580,861.00	1.12
10	601628	中国人寿	557,751.00	1.08
11	300229	拓尔思	535,679.00	1.04
12	002368	太极股份	532,214.00	1.03
13	300170	汉得信息	502,952.78	0.97
14	601728	中国电信	487,296.00	0.94
15	605333	沪光股份	479,240.00	0.93
16	000060	中金岭南	466,221.00	0.90
17	600050	中国联通	462,519.00	0.89
18	688475	萤石网络	437,370.32	0.85
19	600487	亨通光电	426,717.00	0.83
20	300274	阳光电源	417,642.00	0.81

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	46,947,524.87
卖出股票收入（成交）总额	43,992,409.79

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	6,865,441.00	12.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	30,432,904.39	55.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	21,321,904.94	39.10
7	可转债（可交换债）	4,275,813.66	7.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	62,896,063.99	115.33

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	019547	16 国债 19	60,000	6,299,141.92	11.55
2	138879	23 同安 01	50,000	5,145,597.26	9.44
3	102380410	23 江津华信 MTN001B	50,000	5,126,745.90	9.40
4	185944	22 兴投 07	50,000	5,092,818.36	9.34
5	115032	23 江公 01	50,000	5,089,886.30	9.33

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为偏债混合型基金，以套期保值为目的开展股指期货投资，选择流动性好、交易活跃的期货合约进行交易。本基金投资基础资产为上证 50、沪深 300 和中证 500 的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理和套期保值为投资目标。

本基金参与股指期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金为混合型基金，以套期保值为目的开展国债期货投资，选择流动性好、交易活跃的主力合约进行交易。本基金投资基础资产为国债的国债期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理和套期保值为投资目标。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

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

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。

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	57,441.04
2	应收清算款	-
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	57,441.04

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113663	新化转债	230,705.26	0.42
2	110060	天路转债	229,725.35	0.42
3	123162	东杰转债	216,891.14	0.40
4	128081	海亮转债	216,834.77	0.40
5	123149	通裕转债	216,636.10	0.40
6	123112	万讯转债	215,093.20	0.39
7	127074	麦米转 2	214,197.01	0.39
8	128143	锋龙转债	179,786.94	0.33
9	127020	中金转债	176,147.77	0.32
10	113044	大秦转债	175,584.57	0.32
11	128036	金农转债	163,662.67	0.30
12	128132	交建转债	119,868.89	0.22
13	113628	晨丰转债	119,331.76	0.22
14	123085	万顺转 2	114,802.25	0.21

15	113637	华翔转债	59,779.77	0.11
16	123072	乐歌转债	54,666.42	0.10
17	113646	永吉转债	54,547.43	0.10
18	123031	晶瑞转债	53,153.88	0.10
19	123075	贝斯转债	51,789.61	0.09
20	113537	文灿转债	26,153.51	0.05
21	113534	鼎胜转债	25,546.75	0.05
22	110062	烽火转债	24,952.74	0.05
23	118021	新致转债	21,167.36	0.04
24	127029	中钢转债	19,382.68	0.04
25	128140	润建转债	19,124.15	0.04
26	127058	科伦转债	18,897.21	0.03
27	123012	万顺转债	18,199.50	0.03
28	127037	银轮转债	18,160.26	0.03
29	110058	永鼎转债	17,972.98	0.03
30	110061	川投转债	17,490.27	0.03
31	113519	长久转债	16,190.34	0.03
32	110091	合力转债	15,600.77	0.03
33	123050	聚飞转债	14,800.64	0.03
34	113588	润达转债	14,582.60	0.03
35	113664	大元转债	14,486.24	0.03
36	128074	游族转债	14,240.38	0.03
37	127038	国微转债	14,035.76	0.03
38	110090	爱迪转债	13,947.48	0.03
39	113530	大丰转债	13,746.60	0.03
40	123138	丝路转债	13,721.56	0.03
41	123142	申昊转债	13,426.51	0.02
42	123130	设研转债	13,169.42	0.02
43	127007	湖广转债	13,089.32	0.02
44	128075	远东转债	13,040.38	0.02
45	113057	中银转债	13,030.68	0.02
46	111008	沿浦转债	13,009.13	0.02
47	110083	苏租转债	12,881.34	0.02
48	113631	皖天转债	12,721.60	0.02
49	118009	华锐转债	12,713.77	0.02
50	123172	漱玉转债	12,707.02	0.02
51	127030	盛虹转债	12,660.28	0.02
52	113639	华正转债	12,650.85	0.02
53	123167	商络转债	12,643.81	0.02
54	123161	强联转债	12,609.29	0.02
55	110053	苏银转债	12,571.62	0.02
56	127012	招路转债	12,551.21	0.02
57	123059	银信转债	12,515.93	0.02

58	110075	南航转债	12,513.06	0.02
59	127039	北港转债	12,484.44	0.02
60	118014	高测转债	12,464.25	0.02
61	110085	通 22 转债	12,312.13	0.02
62	127052	西子转债	12,270.71	0.02
63	113024	核建转债	12,101.14	0.02
64	113060	浙 22 转债	12,095.49	0.02
65	127018	本钢转债	12,079.27	0.02
66	128123	国光转债	12,020.30	0.02
67	113609	永安转债	12,007.00	0.02
68	123154	火星转债	11,982.70	0.02
69	128142	新乳转债	11,979.74	0.02
70	113058	友发转债	11,969.19	0.02
71	123124	晶瑞转 2	11,911.98	0.02
72	123122	富瀚转债	11,848.05	0.02
73	127045	牧原转债	11,809.97	0.02
74	123014	凯发转债	11,799.60	0.02
75	127051	博杰转债	11,699.72	0.02
76	113629	泉峰转债	11,676.14	0.02
77	110088	淮 22 转债	11,599.71	0.02
78	113021	中信转债	11,511.46	0.02
79	113049	长汽转债	11,383.76	0.02
80	110064	建工转债	11,290.60	0.02
81	118020	芳源转债	11,153.79	0.02
82	113569	科达转债	11,114.48	0.02
83	127056	中特转债	11,020.05	0.02
84	110073	国投转债	10,817.98	0.02
85	127005	长证转债	10,781.66	0.02
86	127024	盈峰转债	10,663.91	0.02
87	128127	文科转债	10,436.04	0.02
88	113052	兴业转债	10,171.31	0.02
89	128111	中矿转债	5,434.79	0.01
90	113063	赛轮转债	4,115.05	0.01
91	118027	宏图转债	1,341.18	0.00
92	113654	永 02 转债	1,338.08	0.00
93	113047	旗滨转债	1,217.69	0.00
94	123129	锦鸡转债	1,140.24	0.00
95	127042	嘉美转债	1,123.17	0.00
96	123064	万孚转债	1,115.04	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末投资前十名股票不存在流通受限的情况。

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 (%)
平安瑞兴 一年定开 混合 A	939	45,513.65	20,452,022.28	47.86	22,285,297.03	52.14
平安瑞兴 一年定开 混合 C	686	7,748.73	-	-	5,315,628.56	100.00
合计	1,555	30,902.22	20,452,022.28	42.56	27,600,925.59	57.44

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	平安瑞兴一年定开混合 A	-	-
	平安瑞兴一年定开混合 C	20.02	0.0004
	合计	20.02	0.0000

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	平安瑞兴一年定开混合 A	0
	平安瑞兴一年定开混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安瑞兴一年定开混合 A	0
	平安瑞兴一年定开混合 C	0

	合计	0
--	----	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安瑞兴一年定开混合 A	平安瑞兴一年定开混合 C
基金合同生效日 (2020 年 11 月 4 日) 基金份额总额	409,943,673.15	66,157,546.36
本报告期期初基金份 额总额	42,737,319.31	5,315,628.56
本报告期基金总申购 份额	—	—
减：本报告期基金总 赎回份额	—	—
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	42,737,319.31	5,315,628.56

§ 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

本基金管理人公司董事杨玉萍女士因工作安排不再出任公司第四届董事会董事，公司股东平安信托有限责任公司根据《公司章程》推荐郭晓涛先生接替杨玉萍女士出任公司董事。经公司 2023 年第二次股东会审议，同意郭晓涛先生出任公司董事，杨玉萍女士不再担任公司董事。上述变更自 2023 年 3 月 17 日公司 2023 年第二次股东会做出决议之日起生效。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华西证券	1	45,814,839.44	54.44	33,046.11	54.33	-
西部证券	1	25,837,485.11	30.70	18,636.34	30.64	-
东兴证券	2	12,019,621.00	14.28	8,790.09	14.45	-
华创证券	1	489,339.00	0.58	352.96	0.58	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期权

		券 成交总额 的比例 (%)		回购成交总 额的比例 (%)		证 成交总额 的比例 (%)
华西证 券	146,714,506 .22	36.74	1,329,922,00 0.00	83.29	-	-
西部证 券	79,608,511. 69	19.93	218,214,000. 00	13.67	-	-
东兴证 券	167,679,010 .11	41.98	48,558,000.0 0	3.04	-	-
华创证 券	5,377,902.7 0	1.35	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司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旗下部分基金改聘会计师事务所公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 14 日
3	平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 19 日
4	平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 19 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	关于暂停浦领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 13 日
7	平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 29 日
8	平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 21 日
9	平安基金管理有限公司关于新增深圳新华信通基金销售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 04 月 26 日

10	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享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 05 月 12 日
11	平安瑞兴一年定期开放混合型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 05 月 31 日
12	平安瑞兴一年定期开放混合型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 05 月 31 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2023/01/01--2023/06/30	20,452,022.28	0.00	0.00	20,452,022.28	42.56
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2023 年 8 月 29 日