

平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	59
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	59
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	59
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	62
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	63
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>63</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>67</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>67</b>
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	68
13.3 查阅方式 .....	68

## § 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	45,540,708.10 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	40,660,698.10 份	4,880,010.00 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×85%+沪深 300 指数收益率×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
	联系电话	0755-22626828
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn
		张立学
		010-68858113
		zhanglixue@psbcoa.com.cn

客户服务电话	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和 指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	平安瑞兴一年 定开混合 A	平安瑞兴一年 定开混合 C	平安瑞兴一年 定开混合 A	平安瑞兴一年 定开混合 C	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	3,638,642.47	413,476.53	1,010,375.84	136,616.58	21,264,592.63	3,254,300.01
本期利润	4,002,882.53	459,251.89	637,345.49	69,198.13	18,626,628.35	2,759,443.67
加权平均基金份额本期利润	0.0947	0.0876	0.0114	0.0062	0.0527	0.0480
本期	8.36%	7.84%	1.06%	0.58%	5.14%	4.70%

加权平均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	8.81%	8.27%	0.80%	0.30%	6.51%	5.96%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	6,989,701.31	748,920.02	3,292,370.68	347,693.70	4,018,901.92	759,555.82
期末可供分配基金份额利润	0.1719	0.1535	0.0770	0.0654	0.0685	0.0622
期末基金资产净值	47,650,399.41	5,628,930.02	46,029,689.99	5,663,322.26	62,718,310.05	12,963,421.45
期末基金份额净值	1.1719	1.1535	1.0770	1.0654	1.0685	1.0622
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	17.19%	15.35%	7.70%	6.54%	6.85%	6.22%

- 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
过去三个月	2.14%	0.13%	-0.37%	0.13%	2.51%	0.00%
过去六个月	3.11%	0.12%	-0.93%	0.13%	4.04%	-0.01%
过去一年	8.81%	0.13%	0.04%	0.13%	8.77%	0.00%
过去三年	16.82%	0.22%	-1.74%	0.17%	18.56%	0.05%
自基金合同生效起至今	17.19%	0.22%	-0.08%	0.17%	17.27%	0.05%

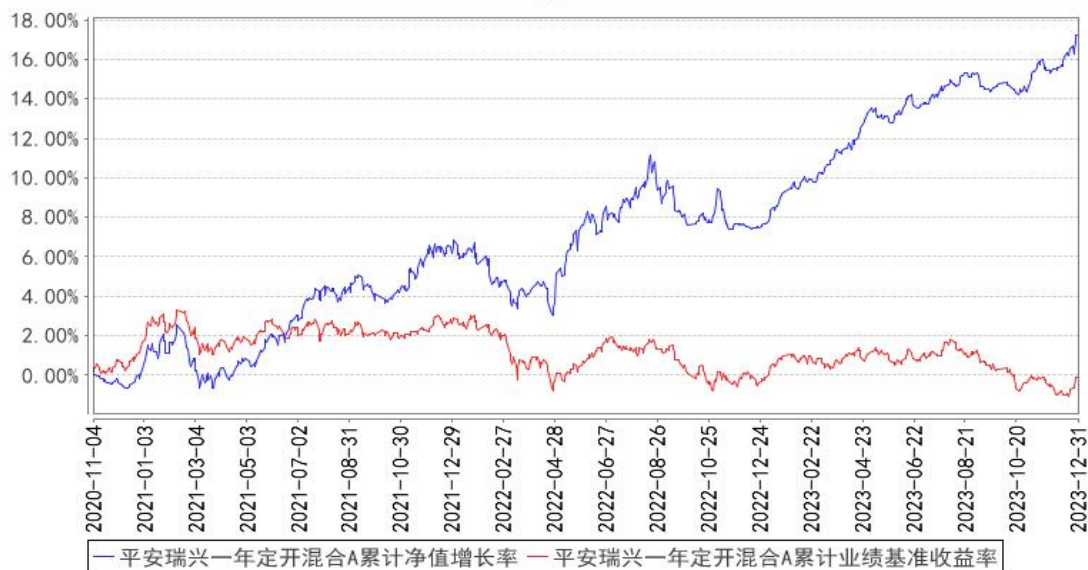
平安瑞兴一年定开混合 C

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
过去三个月	2.02%	0.13%	-0.37%	0.13%	2.39%	0.00%
过去六个月	2.85%	0.12%	-0.93%	0.13%	3.78%	-0.01%
过去一年	8.27%	0.13%	0.04%	0.13%	8.23%	0.00%
过去三年	15.06%	0.22%	-1.74%	0.17%	16.80%	0.05%
自基金合同生效起至今	15.35%	0.22%	-0.08%	0.17%	15.43%	0.05%



### 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

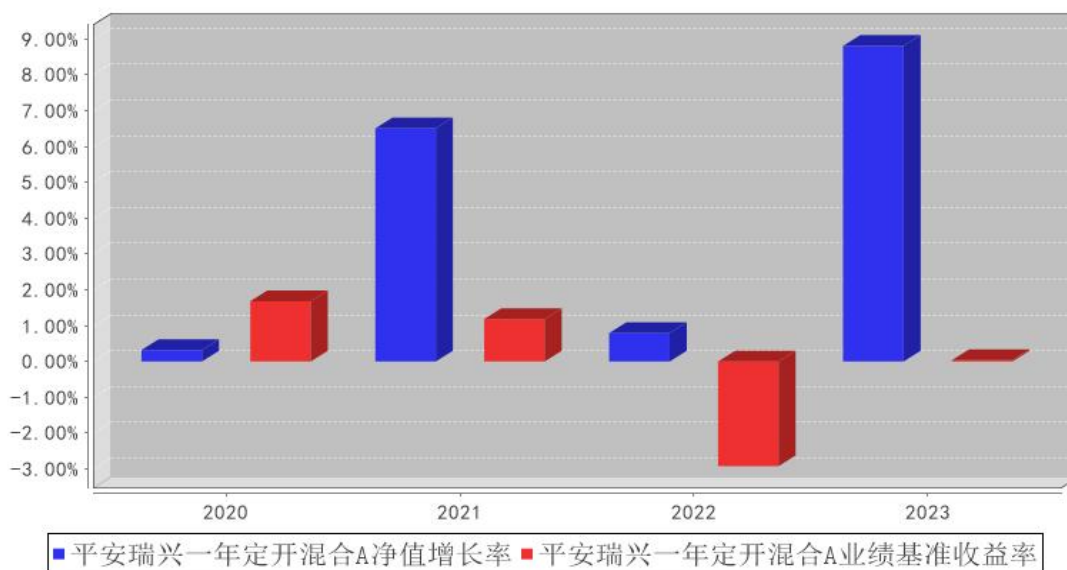


注：1、本基金基金合同于 2020 年 11 月 04 日正式生效；

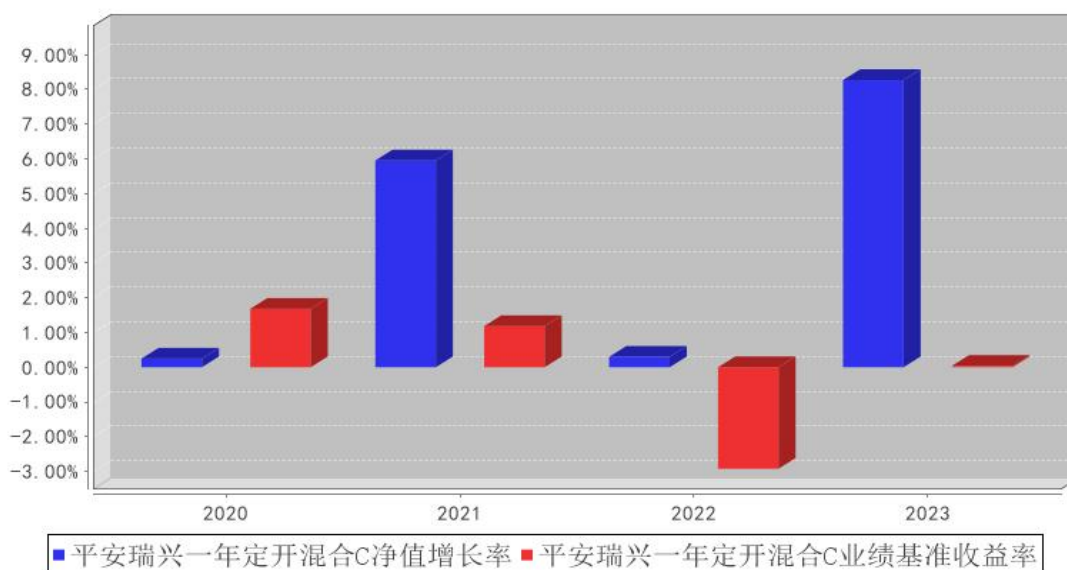
2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安瑞兴一年定开混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



平安瑞兴一年定开混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2020 年 11 月 04 日正式生效，合同生效当年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过往三年无利润分配情况。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。截至 2023 年 12 月 31 日，平安基金共管理 194 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5668 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（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	-	13 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、平安惠智纯债债券型证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年初，防疫政策放开之际，经济修复势头偏强但仍有瑕疵，消费报复性修复但工业生产恢复偏弱。通胀继续维持紧缩，证明经济内生的活力还未被彻底激活。债券市场总体以震荡为主，权益市场主要演绎春节躁动行情；3-8 月份，经济修复节奏放缓，两会设定经济目标偏谨慎，政策预期有所缓和。之后基建维持较高增速，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。经济高频数据持续验证基本面走弱，央行逐步开展降准降息，“宽货币”率先发力，市场流动性保持了合理充裕。债市收益率震荡下行，曲线呈“牛陡”状态。权益市场随着经济基本面数据的超预期回落，出现了较大幅度下调。9-10 月份，随着稳地产政策不断加码，宏观经济有所修复，市场预期和信心有所变化。由于人民币汇率压力加大，央行超预期收紧资金面，债市迎来阶段性调整。但权益市场风险偏好继续下降，各指数继续震荡下行。11-12 月份，宏观经济延续弱复苏状态，全年经济增长目标 5.0% 基本完成，但通胀大幅低于市场预期，货币政策宽松预期急剧升温。随着人民币汇率贬值压力缓解，央行通过公开市场操作等方式释放流动性，资金利率稳中有降，债市收益率再度进入下行通道，而权益市场在弱预期和弱现实的作用下再度下行。在此期间，本基金在符合基金合同约定的投资范围和投资限制的基础上，主要配置利率债和中高等级信用债，权益资产则根据市场情况进行灵活配置。

### 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 1.1719 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.81%，同期业绩比较基准收益率为 0.04%；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 1.1535 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.27%，同期业绩比较基准收益率为 0.04%。

## 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 2024 年，本基金认为当前库存周期处于磨底状态，补库或于 2024 年上半年开启。海外方面，美联储有望退出加息周期，海外库存周期有望触底反弹，出口迎来修复。国内方面，消费整体平稳，消费倾向应跟 2023 年大致持平，主要关注收入增长和变化；制造业投资层面，尽管工业企业盈利持续修复，但盈利并不高、工业产能利用率维持低位，制约制造业企业开支意愿；政

策对经济增长应有一定诉求，重点在于地产三大工程和基建，地产行业当前仍在下行状态，销售和投资均不乐观，三大工程的启动对于投资或有一定拉动；基建层面，中央加杠杆是主线，地方政府投资意愿有限、对基建效率形成部分制约。通胀方面，考虑需求端向上力度有限，通胀上行风险可控。政策方面，财政政策整体定调积极，节奏上前置发力；货币政策维持合理充裕基调，降准甚至降息值得期待，但仍受外部因素以及防资金空转的制约，资金利率大幅向下的概率不大。基于以上基本面及政策面判断，预计 2024 年债市收益率有望保持低位震荡，而权益市场随着一系列稳增长稳信心措施的出台，短期有望迎来阶段性修复行情，但中长期仍有较大不确定性。我们将密切关注各项经济领先指标，根据市场变化灵活调整债券和权益的仓位比例。

本基金认为流动性较好的中短端品种仍有较高投资价值，将保持高比例配置力度。对于长端品种，将根据经济形势和市场情况进行波段操作，以增强组合收益。权益市场随着风险逐步释放，性价比有所提升，将逐步提升仓位，重点关注部分顺周期行业和高景气行业等。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2024)审字第 70039114_H37 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于



	<p>舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	高鹤 黄拥璇
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2024年3月25日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	16,117,658.61	14,462,901.62
结算备付金		4,102,003.01	3,903,310.10
存出保证金		731,415.32	398,962.17
交易性金融资产	7.4.7.2	41,843,911.09	33,146,231.12
其中：股票投资		3,395,496.51	962,773.07
基金投资		-	-
债券投资		38,448,414.58	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		23,141.52	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		62,818,129.55	51,911,405.01
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,409,651.88	-
应付清算款		4,930,911.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		33,586.57	35,070.13
应付托管费		8,396.64	8,767.53
应付销售服务费		2,225.34	2,401.84
应付投资顾问费		-	-
应交税费		920.02	360.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	153,108.67	171,792.51
负债合计		9,538,800.12	218,392.76
<b>净资产：</b>			

实收基金	7.4.7.10	45,540,708.10	48,052,947.87
未分配利润	7.4.7.12	7,738,621.33	3,640,064.38
净资产合计		53,279,329.43	51,693,012.25
负债和净资产总计		62,818,129.55	51,911,405.01

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 45,540,708.10 份，其中，下属 A 类基金份额净值 1.1719 元，基金份额总额 40,660,698.10 份；下属 C 类基金份额净值 1.1535 元，基金份额总额 4,880,010.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		5,543,366.38	1,978,589.75
1. 利息收入		128,255.50	210,194.32
其中：存款利息收入	7.4.7.13	120,922.62	164,428.61
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		7,332.88	45,765.71
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,005,048.12	2,208,564.04
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-1,093,650.09	-4,366,034.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	6,062,618.98	7,320,295.64
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	468.63	-783,101.11
股利收益	7.4.7.19	35,610.60	37,404.13
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	410,015.42	-440,448.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	47.34	280.19
<b>减：二、营业总支出</b>		1,081,231.96	1,272,046.13

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	429,900.34	578,091.33
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	107,475.08	144,522.75
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	29,300.57	60,200.11
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		362,246.14	333,216.74
其中：卖出回购金融资产支出		362,246.14	333,216.74
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		4,809.83	4,475.20
8. 其他费用	7.4.7.23	147,500.00	151,540.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,462,134.42	706,543.62
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,462,134.42	706,543.62
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		4,462,134.42	706,543.62

### 7.3 净资产变动表

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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	48,052,947.87	-	3,640,064.38	51,693,012.25
二、本期期初净资产	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）	-2,512,239.77	-	4,098,556.95	1,586,317.18
（一）、综合收益总额	-	-	4,462,134.42	4,462,134.42
（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）	-2,512,239.77	-	-363,577.47	-2,875,817.24
其中：1. 基金申购款	10,243,105.31	-	1,576,513.60	11,819,618.91

2. 基金赎回款	-12,755,345.08	-	-1,940,091.07	-14,695,436.15
(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	45,540,708.10	-	7,738,621.33	53,279,329.43
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	70,903,273.76	-	4,778,457.74	75,681,731.50
二、本期期初净资产	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)	-22,850,325.89	-	-1,138,393.36	-23,988,719.25
(一)、综合收益总额	-	-	706,543.62	706,543.62
(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)	-22,850,325.89	-	-1,844,936.98	-24,695,262.87
其中：1. 基金申购款	20,628,478.87	-	1,559,077.74	22,187,556.61
2. 基金赎回款	-43,478,804.76	-	-3,404,014.72	-46,882,819.48
(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	48,052,947.87	-	3,640,064.38	51,693,012.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

平安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 $\times$ 85%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 15%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 7.4.3 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 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。

#### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

本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）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企业；3）股利的金额能够可靠计量。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费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。

#### 7.4.4.11 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。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。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、地方政府债券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费附加，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费附加。

### （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[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。

#### (4) 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	16,117,658.61	14,462,901.62
等于：本金	16,115,553.07	14,459,008.53
加：应计利息	2,105.54	3,893.09
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	16,117,658.61	14,462,901.62

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	3,482,565.01	-	3,395,496.51	-87,068.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	23,365,159.58	124,523.51	23,831,489.01	341,805.92
	银行间市场	14,479,830.55	24,125.57	14,616,925.57	112,969.45
	合计	37,844,990.13	148,649.08	38,448,414.58	454,775.37
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	41,327,555.14	148,649.08	41,843,911.09	367,706.87	
项目	上年度末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	989,938.59	-	962,773.07	-27,165.52	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	29,659,539.14	401,054.41	30,165,453.01	104,859.46
	银行间市场	2,000,052.49	38,005.04	2,018,005.04	-20,052.49
	合计	31,659,591.63	439,059.45	32,183,458.05	84,806.97
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	32,649,530.22	439,059.45	33,146,231.12	57,641.45	

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-9,178,250.00	-	-	
其中：国债期	-9,178,250.00	-	-	

货投资				
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,305,400.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,305,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-5,872,850.00	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,330,840.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,330,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,330,840.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的国债期货投资和股指期货投资期末合同/名义金额为初始的合约价值。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2401	IC2401	1.00	1,087,360.00	35,600.00
IM2401	IM2401	1.00	1,177,600.00	45,680.00
IM2406	IM2406	1.00	1,151,920.00	30,200.00
T2406	T2406	-3.00	-3,081,900.00	-1,350.00
TL2403	TL2403	-4.00	-4,068,000.00	-2,500.00
TL2406	TL2406	-2.00	-2,030,000.00	2,200.00
合计				109,830.00
减：可抵销期货暂收款				109,830.00
净额				0.00

注：1. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。



2. 衍生金融资产项下的国债期货投资和股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货投资和股指期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债期货投资和股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	33,808.67	47,792.51
其中：交易所市场	25,742.42	38,322.94
银行间市场	8,066.25	9,469.57
应付利息	-	-
预提费用	119,300.00	124,000.00
合计	153,108.67	171,792.51

## 7.4.7.10 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 12 月 31 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	8,568,004.39	8,568,004.39
本期赎回（以“-”号填列）	-10,644,625.60	-10,644,625.60
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	40,660,698.10	40,660,698.10

平安瑞兴一年定开混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,315,628.56	5,315,628.56
本期申购	1,675,100.92	1,675,100.92
本期赎回（以“-”号填列）	-2,110,719.48	-2,110,719.48
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	4,880,010.00	4,880,010.00

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末无其他综合收益。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,509,972.69	-1,217,602.01	3,292,370.68
本期期初	4,509,972.69	-1,217,602.01	3,292,370.68
本期利润	3,638,642.47	364,240.06	4,002,882.53
本期基金份额交易产生的变动数	-346,179.78	40,627.88	-305,551.90
其中：基金申购款	1,595,139.51	-250,098.44	1,345,041.07
基金赎回款	-1,941,319.29	290,726.32	-1,650,592.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,802,435.38	-812,734.07	6,989,701.31

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
本期期初	498,000.14	-150,306.44	347,693.70
本期利润	413,476.53	45,775.36	459,251.89
本期基金份额交易产生的变动数	-65,554.51	7,528.94	-58,025.57
其中：基金申购款	282,227.28	-50,754.75	231,472.53
基金赎回款	-347,781.79	58,283.69	-289,498.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	845,922.16	-97,002.14	748,920.02

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	48,458.69	98,639.36
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	71,435.32	63,785.60
其他	1,028.61	2,003.65
合计	120,922.62	164,428.61

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖	-1,093,650.09	-4,366,034.62

股票差价收入		
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	-1,093,650.09	-4,366,034.62

#### 7.4.7.14.2 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12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
卖出股票成交总 额	77,700,796.65	186,796,802.48
减：卖出股票成本 总额	78,609,131.74	190,685,929.73
减：交易费用	185,315.00	476,907.37
买卖股票差价收 入	-1,093,650.09	-4,366,034.62

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利 息收入	1,701,525.25	1,805,835.33
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债 券到期兑付）差价收 入	4,361,093.73	5,514,460.31
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	6,062,618.98	7,320,295.64
----	--------------	--------------

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	907,565,049.17	1,861,734,153.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	896,825,531.23	1,842,906,688.88
减：应计利息总额	6,340,783.55	13,268,082.71
减：交易费用	37,640.66	44,921.19
买卖债券差价收入	4,361,093.73	5,514,460.31

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
国债期货投资收益	-87,422.83	20,256.50
股指期货投资收益	87,891.46	-803,357.61

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	35,610.60	37,404.13
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	35,610.60	37,404.13

**7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	310,065.42	-450,328.80
股票投资	-59,902.98	-310,459.79
债券投资	369,968.40	-139,869.01
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	99,950.00	9,880.00
权证投资	-	-
期货投资	99,950.00	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	410,015.42	-440,448.80

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	47.34	0.13
基金转换费收入	-	280.06
合计	47.34	280.19

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减。赎回费计入基金财产的比例依据《平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》确定。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费按注（1）中约定的比例计入基金财产。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	30,000.00	35,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	35,340.00
其他	1,500.00	1,200.00
合计	147,500.00	151,540.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

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。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

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

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	429,900.34	578,091.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	117,950.51	224,203.15
应支付基金管理人的净管理费	311,949.83	353,888.18



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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	107,475.08	144,522.75

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	-	778.04	778.04
平安基金	-	55.87	55.87
平安人寿	-	10,822.76	10,822.76
平安证券	-	12.06	12.06
邮政储蓄银行	-	15,920.94	15,920.94
合计	-	27,589.67	27,589.67
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 12 月 31 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	-	2,935.46	2,935.46
平安基金	-	62.85	62.85
平安人寿	-	18,890.46	18,890.46
平安证券	-	7.30	7.30
邮政储蓄银行	-	36,415.64	36,415.64

合计	-	58,311.71	58,311.71
----	---	-----------	-----------

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 0.50% 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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
邮政储蓄银行	-	-	-	-	9,000,000.00	820.94
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
		平安瑞兴一年定开混合 A
基金合同生效日（2020 年 11 月 4 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	-

报告期间申购/买入总份额	5,188,067.44	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,188,067.44	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.7594%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
	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）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

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

份额单位：份

##### 平安瑞兴一年定开混合 A

关联方名称	本期末 2023年12月31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	50.2992	20,452,022.28	47.8552

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

邮政储蓄银行-活期	16,117,658.61	48,458.69	14,462,901.62	98,639.36
-----------	---------------	-----------	---------------	-----------

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111018	华康转债	2023 年 12 月 26 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	1,950	195,000.00	195,005.98	-
113069	博 23 转债	2023 年 12 月 25 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	790	79,000.00	79,005.19	-
123235	亿田转债	2023 年 12 月 21 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	1,402	140,200.00	140,210.14	-
123236	家联转债	2023 年 12 月 22 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	562	56,200.00	56,202.46	-

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4,409,651.88 元，截至 2024 年 01 月 02 日到期。该类交易要求本基金转入质押库

的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 26.01%（上年度末：8.90%）。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	16,117,658.61	-	-	-	16,117,658.61
结算备付金	4,102,003.01	-	-	-	4,102,003.01
存出保证金	46,321.72	-	-	685,093.60	731,415.32
交易性金融资产	6,650,159.21	8,465,657.54	23,332,597.83	3,395,496.51	41,843,911.09
应收清算款	-	-	-	23,141.52	23,141.52
资产总计	26,916,142.55	8,465,657.54	23,332,597.83	4,103,731.63	62,818,129.55
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	33,586.57	33,586.57
应付托管费	-	-	-	8,396.64	8,396.64
应付清算款	-	-	-	4,930,911.00	4,930,911.00
卖出回购金融资产款	4,409,651.88	-	-	-	4,409,651.88
应付销售服务费	-	-	-	2,225.34	2,225.34
应交税费	-	-	-	920.02	920.02
其他负债	-	-	-	153,108.67	153,108.67
负债总计	4,409,651.88	-	-	5,129,148.24	9,538,800.12
利率敏感度缺口	22,506,490.67	8,465,657.54	23,332,597.83	-1,025,416.61	53,279,329.43
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					
货币资金	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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-749,400.53	-299,837.43
市场利率下降25个基点	771,398.08	305,992.55	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

##### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场



价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的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：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	3,395,496.51	6.37	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	3,395,496.51	6.37	962,773.07	1.86

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）	
-	-	-	-

注：于本报告期末本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为6.37%（上年度末：1.86%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	9,059,956.65	1,537,795.70
第二层次	32,783,954.44	31,608,435.42
第三层次	-	-
合计	41,843,911.09	33,146,231.12

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券投资，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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：于本报告期末及上年度报告期末，本基金无属于第三层次的金融资产。

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

注：于本报告期末及上年度报告期末，本基金未使用不可观察输入值。

### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,395,496.51	5.41
	其中：股票	3,395,496.51	5.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,448,414.58	61.21
	其中：债券	38,448,414.58	61.21
	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	20,219,661.62	32.19
8	其他各项资产	754,556.84	1.20
9	合计	62,818,129.55	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	11,639.60	0.02
B	采矿业	18,851.00	0.04
C	制造业	2,856,410.96	5.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,284.00	0.00
E	建筑业	7,352.00	0.01
F	批发和零售业	1,673.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	14,721.55	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	422,379.40	0.79

J	金融业	17,996.00	0.03
K	房地产业	4,576.00	0.01
L	租赁和商务服务业	9,087.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	15,568.00	0.03
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	13,958.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	3,395,496.51	6.37

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002135	东南网架	91,900	531,182.00	1.00
2	300750	宁德时代	2,000	326,520.00	0.61
3	688331	荣昌生物	4,484	278,277.04	0.52
4	301261	恒工精密	5,200	268,424.00	0.50
5	688235	百济神州	1,350	187,704.00	0.35
6	300308	中际旭创	1,500	169,365.00	0.32
7	603383	顶点软件	3,300	162,690.00	0.31
8	002466	天齐锂业	2,900	161,791.00	0.30
9	688192	迪哲医药	3,338	159,723.30	0.30
10	688336	三生国健	6,977	157,052.27	0.29
11	300494	盛天网络	6,900	109,089.00	0.20
12	603722	阿科力	2,000	107,800.00	0.20
13	688111	金山办公	100	31,620.00	0.06
14	002262	恩华药业	1,000	27,120.00	0.05
15	603444	吉比特	100	24,512.00	0.05
16	301193	家联科技	1,000	16,980.00	0.03
17	688017	绿的谐波	100	15,350.00	0.03
18	301191	菲菱科思	130	11,986.00	0.02
19	688167	炬光科技	100	11,400.00	0.02
20	600941	中国移动	100	9,948.00	0.02
21	001965	招商公路	1,015	9,916.55	0.02
22	300624	万兴科技	100	9,460.00	0.02
23	300394	天孚通信	100	9,152.00	0.02
24	688066	航天宏图	200	8,448.00	0.02
25	605117	德业股份	100	8,390.00	0.02

26	601888	中国中免	100	8,369.00	0.02
27	300496	中科创达	100	8,006.00	0.02
28	601127	赛力斯	100	7,620.00	0.01
29	300724	捷佳伟创	100	7,401.00	0.01
30	601689	拓普集团	100	7,350.00	0.01
31	000799	酒鬼酒	100	7,315.00	0.01
32	603259	药明康德	100	7,276.00	0.01
33	002991	甘源食品	100	7,146.00	0.01
34	688041	海光信息	100	7,098.00	0.01
35	300763	锦浪科技	100	6,990.00	0.01
36	603833	欧派家居	100	6,961.00	0.01
37	603596	伯特利	100	6,930.00	0.01
38	600612	老凤祥	100	6,900.00	0.01
39	688283	坤恒顺维	100	6,863.00	0.01
40	688146	中船特气	200	6,802.00	0.01
41	002049	紫光国微	100	6,745.00	0.01
42	688031	星环科技	100	6,507.00	0.01
43	688099	晶晨股份	100	6,263.00	0.01
44	001223	欧克科技	100	6,155.00	0.01
45	300122	智飞生物	100	6,111.00	0.01
46	300408	三环集团	200	5,890.00	0.01
47	600845	宝信软件	120	5,856.00	0.01
48	605128	上海沿浦	100	5,805.00	0.01
49	603197	保隆科技	100	5,640.00	0.01
50	300718	长盛轴承	300	5,565.00	0.01
51	600036	招商银行	200	5,564.00	0.01
52	688981	中芯国际	100	5,302.00	0.01
53	300811	铂科新材	100	5,287.00	0.01
54	002959	小熊电器	100	5,193.00	0.01
55	688311	盟升电子	100	5,101.00	0.01
56	300413	芒果超媒	200	5,040.00	0.01
57	300863	卡倍亿	100	5,004.00	0.01
58	300502	新易盛	100	4,932.00	0.01
59	603638	艾迪精密	300	4,875.00	0.01
60	688378	奥来德	100	4,734.00	0.01
61	605300	佳禾食品	300	4,698.00	0.01
62	603185	弘元绿能	140	4,659.20	0.01
63	688326	经纬恒润	40	4,642.00	0.01
64	002230	科大讯飞	100	4,638.00	0.01
65	688475	萤石网络	100	4,490.00	0.01
66	688595	芯海科技	100	4,330.00	0.01
67	002460	赣锋锂业	100	4,280.00	0.01
68	603606	东方电缆	100	4,275.00	0.01

69	300014	亿纬锂能	100	4,220.00	0.01
70	600938	中国海油	200	4,194.00	0.01
71	688177	百奥泰	100	4,124.00	0.01
72	002714	牧原股份	100	4,118.00	0.01
73	002965	祥鑫科技	100	4,117.00	0.01
74	688088	虹软科技	100	4,104.00	0.01
75	688443	智翔金泰	100	3,995.00	0.01
76	605333	沪光股份	200	3,980.00	0.01
77	603019	中科曙光	100	3,949.00	0.01
78	300570	太辰光	100	3,905.00	0.01
79	688556	高测股份	100	3,899.00	0.01
80	688385	复旦微电	100	3,863.00	0.01
81	300604	长川科技	100	3,799.00	0.01
82	603288	海天味业	100	3,795.00	0.01
83	300761	立华股份	180	3,774.60	0.01
84	300911	亿田智能	100	3,763.00	0.01
85	603477	巨星农牧	100	3,747.00	0.01
86	002126	银轮股份	200	3,734.00	0.01
87	002738	中矿资源	100	3,731.00	0.01
88	002988	豪美新材	155	3,699.85	0.01
89	300938	信测标准	100	3,589.00	0.01
90	002837	英维克	130	3,572.40	0.01
91	002906	华阳集团	100	3,525.00	0.01
92	603816	顾家家居	100	3,500.00	0.01
93	603186	华正新材	100	3,470.00	0.01
94	002475	立讯精密	100	3,445.00	0.01
95	600363	联创光电	100	3,400.00	0.01
96	002997	瑞鹄模具	100	3,332.00	0.01
97	300705	九典制药	100	3,323.00	0.01
98	000977	浪潮信息	100	3,320.00	0.01
99	002315	焦点科技	100	3,313.00	0.01
100	300818	耐普矿机	100	3,301.00	0.01
101	605305	中际联合	100	3,231.00	0.01
102	000651	格力电器	100	3,217.00	0.01
103	300212	易华录	100	3,145.00	0.01
104	601088	中国神华	100	3,135.00	0.01
105	301005	超捷股份	100	3,113.00	0.01
105	601336	新华保险	100	3,113.00	0.01
106	300260	新莱应材	100	3,043.00	0.01
107	300580	贝斯特	100	3,028.00	0.01
108	300482	万孚生物	100	3,017.00	0.01
109	000988	华工科技	100	2,976.00	0.01
110	002368	太极股份	100	2,953.00	0.01

111	300788	中信出版	100	2,910.00	0.01
112	001979	招商蛇口	300	2,859.00	0.01
113	601628	中国人寿	100	2,835.00	0.01
114	300601	康泰生物	100	2,715.00	0.01
115	688400	凌云光	100	2,700.00	0.01
116	002487	大金重工	100	2,662.00	0.00
117	300115	长盈精密	200	2,650.00	0.00
118	002472	双环传动	100	2,602.00	0.00
119	601595	上海电影	100	2,583.00	0.00
120	688248	南网科技	100	2,497.00	0.00
121	603298	杭叉集团	100	2,488.00	0.00
122	002568	百润股份	100	2,461.00	0.00
123	300054	鼎龙股份	100	2,420.00	0.00
124	601601	中国太保	100	2,378.00	0.00
125	603667	五洲新春	100	2,340.00	0.00
126	601012	隆基绿能	100	2,290.00	0.00
127	600547	山东黄金	100	2,287.00	0.00
128	300458	全志科技	100	2,269.00	0.00
129	002180	纳思达	100	2,263.00	0.00
130	300630	普利制药	100	2,262.00	0.00
130	688590	新致软件	100	2,262.00	0.00
131	600585	海螺水泥	100	2,256.00	0.00
132	002444	巨星科技	100	2,252.00	0.00
133	000065	北方国际	200	2,244.00	0.00
134	002517	恺英网络	200	2,234.00	0.00
135	002463	沪电股份	100	2,212.00	0.00
136	601965	中国汽研	100	2,206.00	0.00
137	601699	潞安环能	100	2,191.00	0.00
138	300687	赛意信息	100	2,178.00	0.00
139	600197	伊力特	100	2,175.00	0.00
140	002541	鸿路钢构	100	2,173.00	0.00
141	688001	华兴源创	62	2,166.90	0.00
142	605077	华康股份	100	2,164.00	0.00
143	601225	陕西煤业	100	2,089.00	0.00
144	301185	鸥玛软件	100	2,036.00	0.00
145	600188	兖矿能源	100	1,981.00	0.00
146	300583	赛托生物	100	1,978.00	0.00
147	688379	华光新材	100	1,977.00	0.00
148	000938	紫光股份	100	1,935.00	0.00
149	002271	东方雨虹	100	1,920.00	0.00
150	688279	峰昭科技	15	1,891.80	0.00
151	002555	三七互娱	100	1,881.00	0.00
152	002236	大华股份	100	1,845.00	0.00

152	300476	胜宏科技	100	1,845.00	0.00
153	600183	生益科技	100	1,831.00	0.00
154	600761	安徽合力	100	1,821.00	0.00
155	002410	广联达	100	1,714.00	0.00
156	601607	上海医药	100	1,673.00	0.00
157	603209	兴通股份	100	1,629.00	0.00
158	300188	国投智能	100	1,602.00	0.00
159	002129	TCL 中环	100	1,564.00	0.00
160	601137	博威合金	100	1,553.00	0.00
161	603239	浙江仙通	100	1,527.00	0.00
162	601138	工业富联	100	1,512.00	0.00
163	002436	兴森科技	100	1,473.00	0.00
164	300499	高澜股份	100	1,434.00	0.00
165	300059	东方财富	100	1,404.00	0.00
166	601688	华泰证券	100	1,395.00	0.00
167	600031	三一重工	100	1,377.00	0.00
168	002011	盾安环境	100	1,375.00	0.00
169	600066	宇通客车	100	1,325.00	0.00
170	600373	中文传媒	100	1,318.00	0.00
171	601900	南方传媒	100	1,299.00	0.00
172	000060	中金岭南	300	1,296.00	0.00
173	603278	大业股份	100	1,260.00	0.00
174	601615	明阳智能	100	1,254.00	0.00
175	600522	中天科技	100	1,249.00	0.00
176	600026	中远海能	100	1,224.00	0.00
177	600487	亨通光电	100	1,194.00	0.00
178	300925	法本信息	100	1,175.00	0.00
178	601058	赛轮轮胎	100	1,175.00	0.00
179	300224	正海磁材	100	1,172.00	0.00
180	000928	中钢国际	200	1,166.00	0.00
181	603105	芯能科技	100	1,158.00	0.00
182	002609	捷顺科技	100	1,142.00	0.00
183	600633	浙数文化	100	1,106.00	0.00
184	000050	深天马 A	100	1,065.00	0.00
185	002790	瑞尔特	100	1,044.00	0.00
186	600489	中金黄金	100	996.00	0.00
187	600048	保利发展	100	990.00	0.00
188	600176	中国巨石	100	983.00	0.00
189	601668	中国建筑	200	962.00	0.00
190	603528	多伦科技	100	908.00	0.00
191	300002	神州泰岳	100	885.00	0.00
192	601198	东兴证券	100	823.00	0.00
193	601949	中国出版	100	808.00	0.00



194	002252	上海莱士	100	800.00	0.00
195	600011	华能国际	100	770.00	0.00
196	601186	中国铁建	100	761.00	0.00
197	601800	中国交建	100	760.00	0.00
198	002130	沃尔核材	100	755.00	0.00
199	002063	远光软件	120	741.60	0.00
200	601111	中国国航	100	734.00	0.00
201	002244	滨江集团	100	727.00	0.00
202	300058	蓝色光标	100	718.00	0.00
203	600256	广汇能源	100	714.00	0.00
204	601857	中国石油	100	706.00	0.00
205	000700	模塑科技	100	700.00	0.00
206	601636	旗滨集团	100	684.00	0.00
207	002599	盛通股份	100	667.00	0.00
208	000589	贵州轮胎	100	612.00	0.00
209	601872	招商轮船	100	588.00	0.00
210	601390	中国中铁	100	568.00	0.00
211	600028	中国石化	100	558.00	0.00
212	600105	永鼎股份	100	554.00	0.00
213	601728	中国电信	100	541.00	0.00
214	600027	华电国际	100	514.00	0.00
215	601669	中国电建	100	489.00	0.00
216	601319	中国人保	100	484.00	0.00
217	600050	中国联通	100	438.00	0.00
218	600248	陕建股份	100	402.00	0.00
219	600984	建设机械	100	375.00	0.00
220	601000	唐山港	100	350.00	0.00
221	601975	招商南油	100	280.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

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	3,604,275.18	6.97
2	002463	沪电股份	2,574,961.00	4.98
3	000719	中原传媒	2,454,468.60	4.75
4	603278	大业股份	1,663,737.29	3.22
5	603019	中科曙光	1,227,456.72	2.37
6	300911	亿田智能	1,051,506.60	2.03
7	000060	中金岭南	922,193.00	1.78
8	600941	中国移动	887,488.00	1.72
9	300260	新莱应材	833,535.00	1.61
10	002517	恺英网络	820,125.00	1.59

11	605077	华康股份	789,085.00	1.53
12	300059	东方财富	787,056.00	1.52
13	300308	中际旭创	764,137.00	1.48
14	601601	中国太保	745,546.00	1.44
15	300229	拓尔思	741,238.00	1.43
16	601628	中国人寿	741,226.00	1.43
17	600547	山东黄金	738,311.00	1.43
18	688036	传音控股	734,504.43	1.42
19	300750	宁德时代	707,467.00	1.37
20	605333	沪光股份	697,245.00	1.35

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	3,714,139.98	7.18
2	002463	沪电股份	2,504,699.00	4.85
3	000719	中原传媒	2,331,968.97	4.51
4	603278	大业股份	1,663,713.67	3.22
5	603019	中科曙光	1,190,285.00	2.30
6	300911	亿田智能	982,091.52	1.90
7	000060	中金岭南	902,482.00	1.75
8	600941	中国移动	857,560.00	1.66
9	300059	东方财富	817,633.80	1.58
10	300260	新莱应材	809,138.20	1.57
11	601601	中国太保	764,352.00	1.48
12	605077	华康股份	761,283.68	1.47
13	600547	山东黄金	751,615.80	1.45
14	300229	拓尔思	748,531.00	1.45
15	688036	传音控股	744,736.87	1.44
16	002517	恺英网络	738,753.00	1.43
17	601628	中国人寿	724,611.00	1.40
18	600309	万华化学	700,199.00	1.35
19	605333	沪光股份	687,294.00	1.33
20	688533	上声电子	686,555.64	1.33

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。

#### 8.4.3 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	81,101,758.16
卖出股票收入（成交）总额	77,700,796.65

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	24,590,531.51	46.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,115,931.51	5.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	4,607,067.65	8.65
7	可转债（可交换债）	6,134,883.91	11.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,448,414.58	72.16

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	230028	23 付息国债 28	100,000	10,009,857.92	18.79
2	019689	22 国债 24	50,000	5,251,563.01	9.86
3	102383241	23 济南城投 MTN003B	40,000	4,091,792.35	7.68
4	019710	23 国债 17	40,000	4,022,007.67	7.55
5	152321	19 众鑫 01	50,000	3,115,931.51	5.85

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	731,415.32
2	应收清算款	23,141.52
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	754,556.84

### 8.12.4 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	118025	奕瑞转债	590,920.55	1.11
2	127073	天赐转债	545,218.08	1.02
3	118034	晶能转债	532,262.97	1.00
4	111000	起帆转债	334,250.19	0.63
5	113530	大丰转债	284,753.10	0.53
6	118026	利元转债	267,848.02	0.50

7	123121	帝尔转债	253,604.07	0.48
8	123185	能辉转债	212,265.03	0.40
9	113588	润达转债	160,263.32	0.30
10	128095	恩捷转债	132,010.16	0.25
11	127012	招路转债	51,621.86	0.10
12	113615	金诚转债	32,254.96	0.06
13	113044	大秦转债	23,266.20	0.04
14	110062	烽火转债	22,349.67	0.04
15	113594	淳中转债	13,668.70	0.03
16	111011	冠盛转债	13,651.87	0.03
17	118003	华兴转债	13,599.23	0.03
18	113577	春秋转债	13,561.14	0.03
19	113546	迪贝转债	13,105.68	0.02
20	113066	平煤转债	12,961.76	0.02
21	118004	博瑞转债	12,893.61	0.02
22	113628	晨丰转债	12,700.71	0.02
23	110088	淮 22 转债	12,650.95	0.02
24	113639	华正转债	12,440.98	0.02
25	118009	华锐转债	12,336.93	0.02
26	113602	景 20 转债	12,323.74	0.02
27	111004	明新转债	12,189.43	0.02
28	110045	海澜转债	12,161.86	0.02
29	118024	冠宇转债	12,091.56	0.02
30	113030	东风转债	12,062.16	0.02
31	127086	恒邦转债	12,031.90	0.02
32	118033	华特转债	12,007.81	0.02
33	118015	芯海转债	11,989.16	0.02
34	127018	本钢转债	11,981.22	0.02
35	113669	景 23 转债	11,939.88	0.02
36	127020	中金转债	11,899.16	0.02
37	113609	永安转债	11,845.49	0.02
38	113616	韦尔转债	11,295.32	0.02
39	110073	国投转债	10,950.23	0.02
40	113653	永 22 转债	10,880.65	0.02
41	127058	科伦转债	1,811.03	0.00
42	123054	思特转债	1,780.09	0.00
43	110077	洪城转债	1,576.34	0.00
44	128082	华锋转债	1,555.11	0.00
45	110048	福能转债	1,513.00	0.00
46	128122	兴森转债	1,417.33	0.00
47	110058	永鼎转债	1,396.76	0.00
48	123129	锦鸡转债	1,392.57	0.00
49	110060	天路转债	1,362.86	0.00

50	110052	贵广转债	1,335.84	0.00
51	113597	佳力转债	1,298.32	0.00
52	128101	联创转债	1,265.97	0.00
53	123107	温氏转债	1,265.79	0.00
54	113662	豪能转债	1,245.02	0.00
55	118027	宏图转债	1,140.05	0.00
56	113047	旗滨转债	1,092.51	0.00
57	113048	晶科转债	1,091.75	0.00
58	113024	核建转债	1,069.37	0.00
59	113668	鹿山转债	1,065.35	0.00

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	780	52,129.10	25,640,089.72	63.06	15,020,608.38	36.94
平安瑞兴一年定开混合 C	642	7,601.26	-	-	4,880,010.00	100.00
合计	1,353	33,659.06	25,640,089.72	56.30	19,900,618.38	43.70

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）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	平安瑞兴一年定开混合 A	0

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 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

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

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### § 10 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	8,568,004.39	1,675,100.92
减：本报告期基金总赎回份额	10,644,625.60	2,110,719.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	40,660,698.10	4,880,010.00

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

基金托管人：本报告期内，基金托管人中国邮政储蓄银行任命张立学同志为托管业务部副总经理，向监管部门的相关报备手续正在办理中。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 30,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华西证券	1	71,086,775.14	48.23	51,410.47	48.02	-
西部证券	1	33,931,242.17	23.02	24,514.00	22.90	-
中信建投证券	1	15,283,973.52	10.37	11,247.43	10.51	-
东兴证券	2	12,019,621.00	8.15	8,790.09	8.21	-
华创证券	1	11,333,392.8	7.69	8,332.85	7.78	-



		1				
中泰证券	1	3,751,027.12	2.54	2,760.32	2.58	-
广发证券	1	-	-	-	-	退租 1个
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	-

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

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

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华西证券	286,868,655.83	35.28	1,791,301,000.00	67.74	-	-
西部证券	120,629,788.23	14.84	392,330,000.00	14.84	-	-
中信建投证券	65,167,350.95	8.01	43,294,000.00	1.64	-	-
东兴证券	217,009,810.11	26.69	48,558,000.00	1.84	-	-
华创证券	111,919,846.00	13.76	368,895,000.00	13.95	-	-
中泰证券	11,495,873.74	1.41	4,000.00	0.00	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于提醒投资	中国证监会规定报刊及	2023年01月05日

	者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	网站	
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
4	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
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
13	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 07 月 07 日
14	平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 07 月 20 日
15	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成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 08 月 02 日
16	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	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 29 日
17	平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 24 日
18	关于平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 26 日

19	平安基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 05 日
20	平安基金管理有限公司关于新增中国中金财富证券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 12 月 18 日
21	平安基金管理有限公司关于旗下基金所持中文传媒（代码 600373）估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 21 日
22	平安基金管理有限公司关于新增上海中欧财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 29 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023 年 01 月 01 日-2023 年 12 月 31 日	20,452,022.28	0.00	0.00	20,452,022.28	44.91
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

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

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安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

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 13.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

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

平安基金管理有限公司

2024 年 3 月 28 日