平安盈盛稳健配置三个月持有期债券型基金中基金（FOF）
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)	
基金主代码	012909	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 25 日	
报告期末基金份额总额	58,069,218.02 份	
投资目标	本基金通过主动精选基金品种，并根据市场变化动态调整控制基金下行风险，力争追求基金长期稳健增值。	
投资策略	本基金在深入研究宏观经济走势、货币政策和市场资金供求状况的基础上，通过专业的组合管理和风险管理，对基金、债券、现金等资产进行合理配置。运用适度的风格配置策略，精选底层个基，在严格控制风险的前提下，力争获取超越基准的超额收益，追求基金长期资产增值。1、资产配置策略；2、底层基金投资策略；3、其他资产投资策略。	
业绩比较基准	中债新综合财富（1-3 年）指数收益率*80%＋一年期定期存款利率（税后）*20%	
风险收益特征	本基金是债券型基金中基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、股票型基金和股票型基金中基金。	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)A	平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)C

下属分级基金的交易代码	012909	012910
报告期末下属分级基金的份额总额	51,834,398.12 份	6,234,819.90 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)A	平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)C
1.本期已实现收益	-337,119.95	-48,605.56
2.本期利润	-192,351.27	-29,657.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0033	-0.0041
4.期末基金资产净值	55,395,310.23	6,578,444.41
5.期末基金份额净值	1.0687	1.0551

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

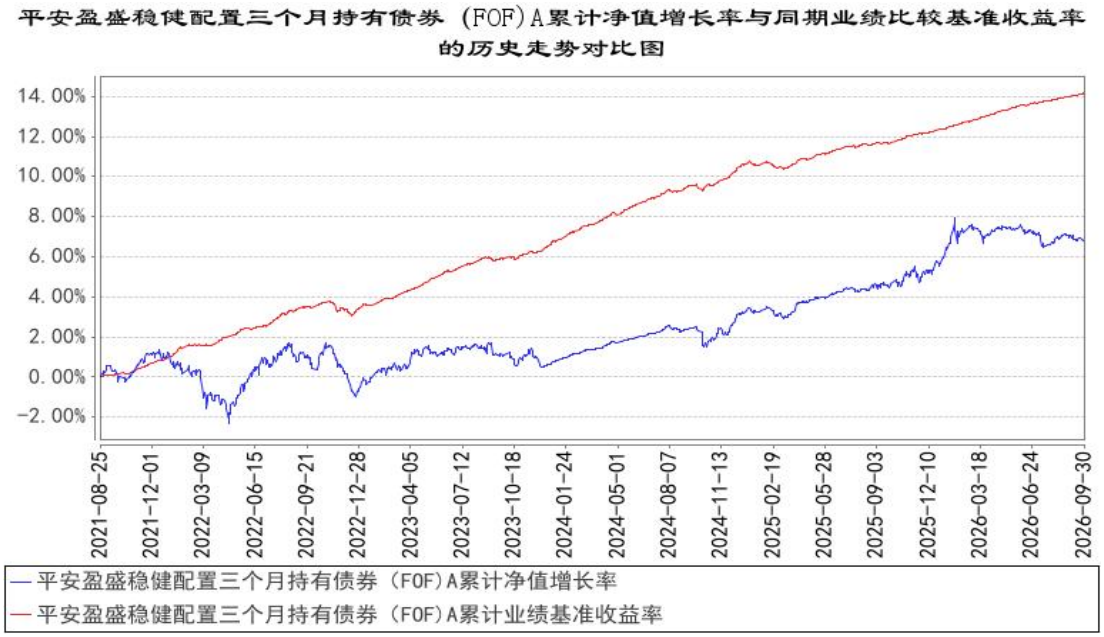
平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)A

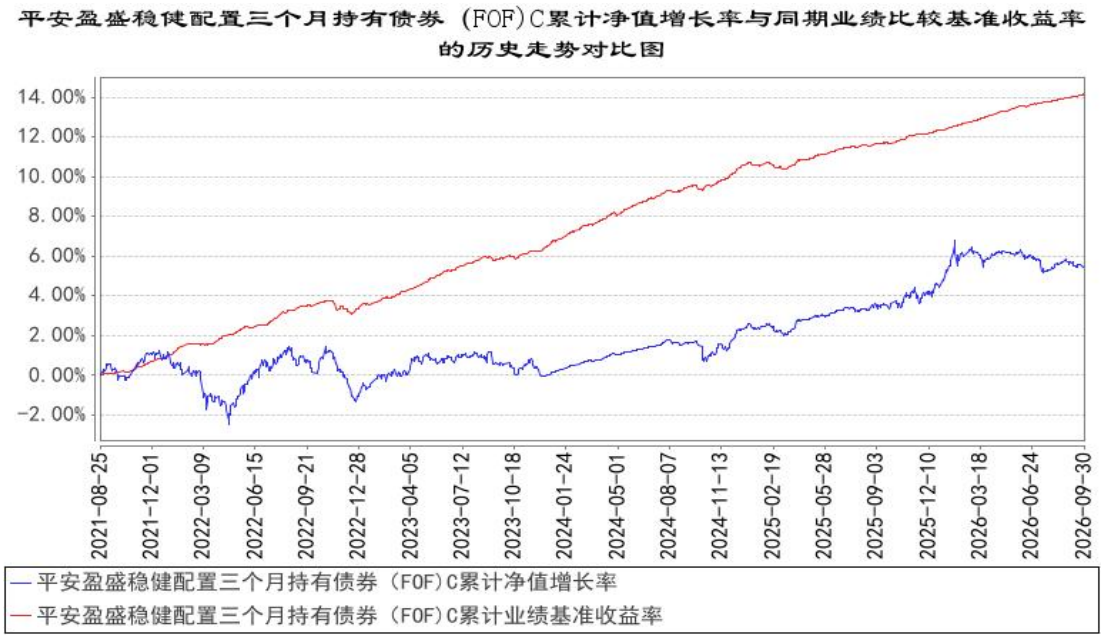
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.28%	0.07%	0.41%	0.01%	-0.69%	0.06%
过去六个月	-0.18%	0.07%	0.98%	0.01%	-1.16%	0.06%
过去一年	2.11%	0.12%	2.19%	0.01%	-0.08%	0.11%
过去三年	5.69%	0.09%	7.76%	0.02%	-2.07%	0.07%
过去五年	6.86%	0.11%	13.97%	0.02%	-7.11%	0.09%
自基金合同生效起至今	6.87%	0.11%	14.15%	0.02%	-7.28%	0.09%

平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.34%	0.07%	0.41%	0.01%	-0.75%	0.06%
过去六个月	-0.30%	0.07%	0.98%	0.01%	-1.28%	0.06%
过去一年	1.85%	0.12%	2.19%	0.01%	-0.34%	0.11%
过去三年	4.90%	0.09%	7.76%	0.02%	-2.86%	0.07%
过去五年	5.53%	0.11%	13.97%	0.02%	-8.44%	0.09%
自基金合同生效起至今	5.51%	0.11%	14.15%	0.02%	-8.64%	0.09%

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





注：1、本基金基金合同于 2021 年 08 月 25 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：本基金本报告期内无其他指标。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张月	平安盈盛稳健配置三个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理	2024 年 6 月 28 日	-	12 年	张月女士，吉林大学经济学硕士研究生，曾先后担任晨星中国(深圳)有限公司金融产品分析师、私募排排网高级研究员、平安罗素投资管理（上海）有限公司研究主管、华润深国投信托有限公司投资经理、横琴淳臻投资管理中心（有限合伙）投资部研究主管。2018 年 12 月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资经理，现担任平安盈盛稳健配置三个月持有期债券型基金中基金（FOF）、平安盈福 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、平安元嘉 90 天持有期债券型基金中基金(FOF)、平安盈轩 90 天持有期债券型基金中基金

					（ETF-FOF）、平安元亨 120 天持有期债券型基金中基金（FOF）、平安盈顺 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）、平安盈安 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）、平安兴福多元稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，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的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的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超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 2 次，为公司旗下的指数量化投资组合与其他组合因投资策略需要而发生的同日反向交易，或为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，市场节奏快速切换。7 月份是 AI 极端转折的行情：负面信息叠加冲击市场，Meta 宣布出租闲置算力，OpenAI 和 Anthropic 开启价格战，韩国监管提高杠杆保证金水平，美联储政

策取向愈加鹰派，连续推动市场巨震，日内振幅逼近极限、大量杠杆资金爆仓，恐慌情绪在北美和东亚循环传递，几乎演化成金融危机。9 月则是美债收益率超预期连涨，全球资产价格承压：美债总额突破 40 万亿，投资者配置意愿下降，财政部扩大长债回购规模却未扭转趋势，十年美债收益率摸高 5.2%，股市情绪恶化，科技反弹行情被迫中断。同时，美伊冲突无法实质性和解，油价冲高强化通胀预期，日本、美国连续加息，美元指数企稳，国际金价冲高回落，国内债券市场因为难得的确定性成为了资金避风港。

在具体资产价格上，上证综指下跌 6.16%，创业板下跌 27.8%；纳斯达克指数上涨 2.01%，上期所黄金价格上涨 4.06%，中债新综合财富指数上涨 1.07%。

平安盈盛的管理仍然坚持低波动 FOF 策略，目前的持仓中债券基金占最大比例，旨在通过模型动态筛选出中长期表现稳健优秀的短久期品种进行配置，获取超额收益。补充收益主要来自三个部分：1）中长久期信用债基；2）权益基金；3）黄金 ETF。三季度以来的主要操作除了依据打分模型调整了基金持仓外，一方面仍然保持中长期纯债基金的敞口，享受债券市场上涨带来的收益；同时因为地缘和美联储政策不确定性增加，逐渐增加黄金资产的敞口。产品 A 股仓位保持稳定，基于低波定位，持仓风格以低估值红利类股票为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)A 的基金份额净值 1.0687 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.28%，同期业绩比较基准收益率为 0.41%；截至本报告期末平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)C 的基金份额净值 1.0551 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.34%，同期业绩比较基准收益率为 0.41%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,750,390.00	6.03
	其中：股票	3,750,390.00	6.03
2	基金投资	53,250,360.50	85.56
3	固定收益投资	4,032,370.49	6.48
	其中：债券	4,032,370.49	6.48

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,016,227.14	1.63
8	其他资产	186,819.49	0.30
9	合计	62,236,167.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	565,615.00	0.91
C	制造业	1,403,619.00	2.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,086.00	0.14
E	建筑业	99,386.00	0.16
F	批发和零售业	139,188.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	156,483.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,080,057.00	1.74
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	75,852.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	53,664.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	88,440.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,750,390.00	6.05

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002078	太阳纸业	21,300	291,810.00	0.47
2	601398	工商银行	27,600	228,528.00	0.37
3	300979	华利集团	4,700	157,121.00	0.25
4	601166	兴业银行	6,700	120,935.00	0.20
5	600036	招商银行	2,800	115,528.00	0.19
6	600546	山煤国际	8,300	108,896.00	0.18
7	601699	潞安环能	6,800	102,612.00	0.17
8	601077	渝农商行	15,000	100,650.00	0.16
9	601939	建设银行	9,100	100,646.00	0.16
10	601101	昊华能源	7,900	100,567.00	0.16

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,032,370.49	6.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,032,370.49	6.51

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019835	26 国债 09	23,000	2,309,470.33	3.73
2	019792	25 国债 19	17,000	1,722,900.16	2.78

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

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

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

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	18,529.29
2	应收证券清算款	167,720.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	569.84
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	186,819.49

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	008974	长城稳健增利债券 C	契约型开放式	2,321,025.88	3,430,476.25	5.54	否
2	001023	华夏亚债中国指数 C	契约型开放式	2,664,489.57	3,299,703.88	5.32	否
3	007419	国寿安保泰弘纯债债券	契约型开放式	2,828,897.28	3,295,665.33	5.32	否
4	270048	广发纯债债券 A	契约型开放式	2,628,019.27	3,282,921.67	5.30	否
5	511060	海富通上证 5 年期地方政府债 ETF	交易型开放式(ETF)	30,000.00	3,264,000.00	5.27	否
6	013520	富荣中短债债券 A	契约型开放式	3,254,273.89	3,223,358.29	5.20	否
7	002550	嘉实稳荣债券	契约型开放式	3,055,362.41	3,212,102.50	5.18	否
8	003156	招商招悦纯债 A	契约型开放式	2,681,652.42	3,199,479.50	5.16	否
9	003860	招商招旭纯债 C	契约型开放式	2,242,863.69	3,197,202.19	5.16	否
10	000914	中加纯债债券	契约型开放式	3,007,034.31	3,175,428.23	5.12	否

6.1.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名公开募集不动产投资信托基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2026 年 7 月 1 日至 2026 年 9 月 30 日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基

		金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	2,952.93	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	10,538.36	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	43,416.55	125.60
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	12,863.76	41.81
当期交易基金产生的交易费（元）	957.65	-
当期交易基金产生的转换费（元）	120.35	-

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金持有的鹏华中证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司以通讯方式召开了该基金的基金份额持有人大会，审议《关于鹏华中证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金调整收益分配条款并修改基金合同的议案》。会议投票表决起止时间：自 2026 年 8 月 29 日起，至 2026 年 9 月 27 日 17：00 止，本基金参与并投了同意票。

基金管理人于 2026 年 9 月 29 日发布了《关于鹏华中证 5 年地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)A	平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)C
报告期期初基金份额总额	63,737,638.42	8,413,910.10
报告期期间基金总申购份额	60,051.26	392,751.20
减：报告期期间基金总赎回份额	11,963,291.56	2,571,841.40
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	51,834,398.12	6,234,819.90

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)A	平安盈盛稳健配置三个月持有债券（FOF)C
报告期期初管理人持有的本基金份额	34,560,815.51	-
报告期期间买入/申购总份额	0.00	-

报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	34,560,815.51	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	66.68	-

注：1、申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

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。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2026/07/01-2026/09/30	34,560,815.51	0.00	0.00	34,560,815.51	59.52
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

（1）中国证监会准予平安盈盛稳健配置三个月持有期债券型基金中基金（FOF)募集注册的文

件

（2）平安盈盛稳健配置三个月持有期债券型基金中基金（FOF)基金合同

（3）平安盈盛稳健配置三个月持有期债券型基金中基金（FOF)托管协议

（4）法律意见书

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

10.2 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

10.3 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

2026 年 10 月 27 日