平安盈福 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）
2026 年第 2 季度报告

2026 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 07 月 20 日

§1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 17 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 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）
基金主代码	015938
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 8 月 9 日
报告期末基金份额总额	185,518,627.38 份
投资目标	本基金通过主动精选基金品种，并根据市场变化动态调整控制基金下行风险，力争追求基金长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 2、基金投资策略 （1）权益类基金投资策略 （2）固定收益类基金投资策略 （3）商品基金投资策略 （4）公募 REITs 投资策略 3、股票投资策略 （1）港股通标的股票投资策略 （2）存托凭证投资策略 4、债券投资策略 （1）普通债券投资策略 （2）可转换债券、可交换债券投资策略 5、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是债券型基金中基金，其预期收益及预期风险水

	平高于货币市场基金、货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、股票型基金和股票型基金中基金。	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）A	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）C
下属分级基金的交易代码	015938	015939
报告期末下属分级基金的份额总额	125,533,300.63 份	59,985,326.75 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 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	
	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）A	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）C
1.本期已实现收益	411,085.92	267,542.71
2.本期利润	1,096,740.77	663,228.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0084	0.0083
4.期末基金资产净值	137,167,734.31	64,533,115.91
5.期末基金份额净值	1.0927	1.0758

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安盈福 6 个月持有债券（FOF）A

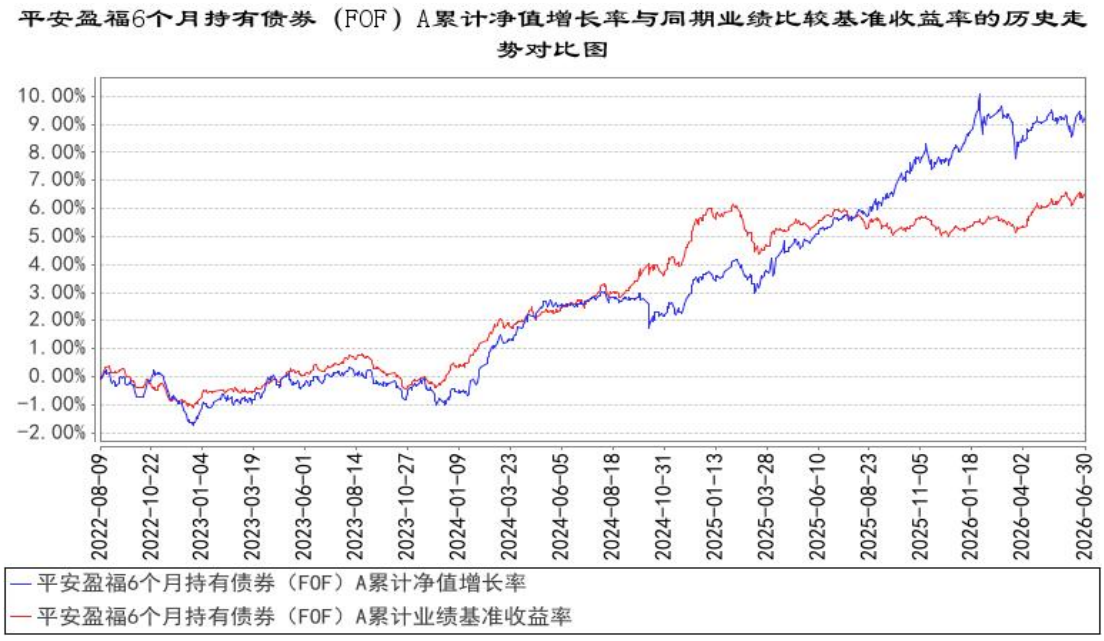
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.85%	0.12%	1.15%	0.08%	-0.30%	0.04%
过去六个月	1.16%	0.17%	1.23%	0.07%	-0.07%	0.10%
过去一年	3.71%	0.15%	0.76%	0.07%	2.95%	0.08%

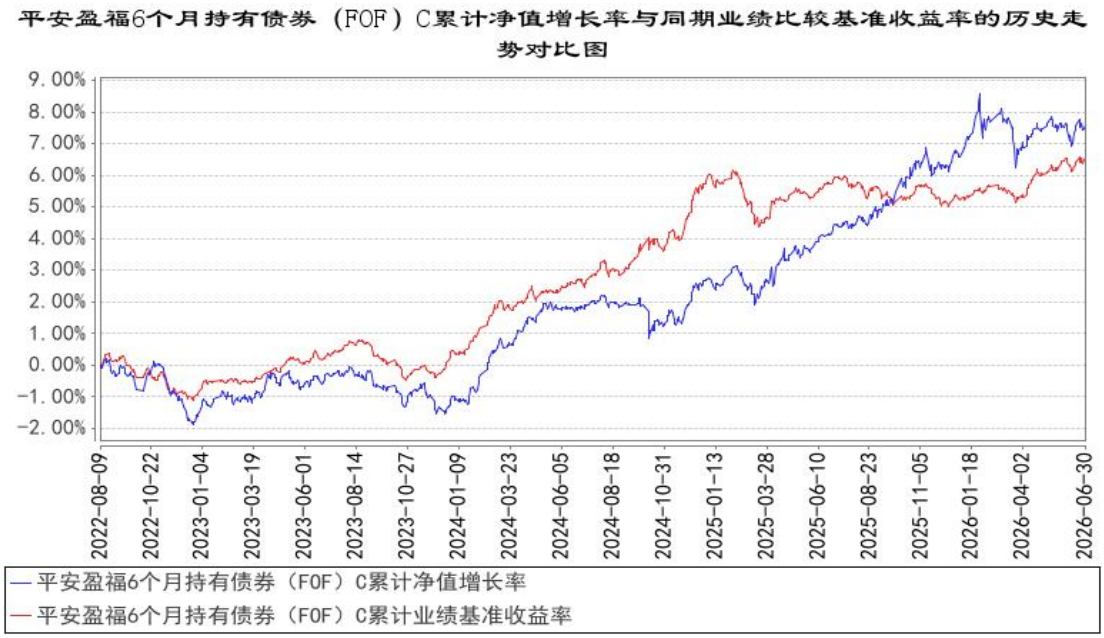
过去三年	9.23%	0.12%	6.25%	0.07%	2.98%	0.05%
自基金合同生效起至今	9.27%	0.12%	6.53%	0.07%	2.74%	0.05%

平安盈福 6 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	0.75%	0.12%	1.15%	0.08%	-0.40%	0.04%
过去六个月	0.96%	0.17%	1.23%	0.07%	-0.27%	0.10%
过去一年	3.30%	0.15%	0.76%	0.07%	2.54%	0.08%
过去三年	7.93%	0.12%	6.25%	0.07%	1.68%	0.05%
自基金合同生效起至今	7.58%	0.12%	6.53%	0.07%	1.05%	0.05%

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 2022 年 08 月 09 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	平安盈福 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理	2024 年 9 月 13 日	-	11 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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，“AI 通胀”成为全球资本市场的核心主题，基本面与资金面共振引起全球范围的结构性行情，具体体现为“AI”大涨，其它资产承压。首先，Anthropic 的 AI 模型使用收入加速增长，大幅提高了市场对算力端资本开支的增长空间和持续性的预期，叠加存储等硬件产能瓶颈阶段性难以突破的现状，相关供应商一季度营业利润大幅增长，同时市场预期这种翻倍增长可持续。

纳斯达克、韩国、日本以及 A 股市场受益于“AI 通货膨胀”的个股股价暴涨，纳斯达克指数上涨 21.41%，韩国综合指数上涨 67.77%，A 股创业板指上涨 36.35%。

相对应的，美伊冲突导致霍尔木兹海峡迟迟无法通行，原油价格高位震荡导致全球主要经济体在 4-5 月 CPI 较大幅度上行，通货膨胀的担忧压制货币宽松预期。尤其凯文沃什上任后政策指引模糊化，市场甚至开始交易美联储年内加息 2 次。加息预期和地缘冲突影响叠加，美债下跌、美元走强、大宗商品承压，黄金一度跌破 4000 美元大关，因而强化了结构性行情。

受益于我国多元化的能源供给结构和强势的出口增长，强美元的环境下，人民币汇率仍然保持较强韧性，国内债券市场相对平稳，尤其四月因为理财资金的入场推助了一波上涨，二季度中债新综合财富指数上涨 1.19%，收益率曲线平行移动，期限利差保持稳定。

产品当前定位量化多资产策略，资产配置比例和底层标的选择都遵循量化模型，在风险预算稳健的前提下，综合配置股票基金、债券基金、海外权益和黄金 ETF，通过低相关性和多重收益来源获得较高的风险调整后收益。本季度市场对地缘事件脱敏，资产配置模型的配置比例相对稳定，但是因为前期净值高点还没有恢复，产品的整体仓位较低，同时选基模型一直偏好均衡型配置，也没有主动提高科技敞口，因而整体弹性表现一般。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安盈福 6 个月持有债券（FOF）A 的基金份额净值 1.0927 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.15%；截至本报告期末平安盈福 6 个月持有债券（FOF）C 的基金份额净值 1.0758 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准收益率为 1.15%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	188,687,128.66	91.11
3	固定收益投资	13,254,008.14	6.40
	其中：债券	13,254,008.14	6.40

	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	4,742,317.90	2.29
8	其他资产	403,517.83	0.19
9	合计	207,086,972.53	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

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	13,254,008.14	6.57
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	13,254,008.14	6.57

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	019785	25 国债 13	75,000	7,594,691.10	3.77
2	019792	25 国债 19	56,000	5,659,317.04	2.81

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	32,366.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	371,151.10
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	403,517.83

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：本基金本报告期末未持有股票。

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	511030	平安中高等级公司债利差因子 ETF	交易型开放式(ETF)	96,000.00	10,373,664.00	5.14	是
2	007419	国寿安保泰弘纯债债券	契约型开放式	8,064,379.41	9,336,132.04	4.63	否
3	003157	招商招悦纯债 C	契约型开放式	7,820,277.57	9,175,531.67	4.55	否
4	000032	易方达信用债债券 A	契约型开放式	7,384,490.19	8,346,689.26	4.14	否
5	019977	博时富信纯债债券 C	契约型开放式	7,437,818.03	8,247,796.41	4.09	否
6	016270	博时富鑫纯债债券 C	契约型开放式	6,814,052.53	7,823,895.11	3.88	否
7	270048	广发纯债债券 A	契约型开放式	6,169,401.33	7,704,348.38	3.82	否
8	003417	中加丰泽纯债债券 A	契约型开放式	7,073,716.81	7,696,203.89	3.82	否
9	007542	永赢开泰中高等级中短债 A	契约型开放式	6,497,854.44	7,651,223.60	3.79	否
10	159650	博时中债	交易型开放	70,000.00	7,546,210.00	3.74	否

		0-3 年国开行 ETF	式(ETF)				

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 4 月 1 日至 2026 年 6 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)	11,414.55	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	7,251.73	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	28,974.53	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	183,423.29	4,179.14
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	46,087.39	1,393.06
当期交易基金产生的交易费(元)	1,383.22	-
当期交易基金产生的转换费(元)	43,526.01	-

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金持仓：中加纯债债券型证券投资基金

3 月 13 日，中加基金管理有限公司发布关于以通讯方式召开中加纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告，会议投票表决起止时间：自 2026 年 3 月 18 日起至 2026 年 4 月 13 日 17：00 止，会议审议事项《关于中加纯债债券型证券投资基金调整赎回费率的议案》。对此，本基金管理人已投票同意。

4 月 15 日，中加基金管理有限公司发布关于中加纯债债券型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，基金份额持有人大会对本次会议议案的表决结果为：本次会议议案获得通过。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）A	平安盈福 6 个月持有债券（FOF）C

报告期期初基金份额总额	121,568,020.93	85,575,957.58
报告期期间基金总申购份额	18,663,490.45	1,455,703.13
减：报告期期间基金总赎回份额	14,698,210.75	27,046,333.96
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	125,533,300.63	59,985,326.75

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

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

注：无。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

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

（2）平安盈福 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同

（3）平安盈福 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）托管协议

（4）法律意见书

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

10.2 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 07 月 20 日