平安中短债债券型证券投资基金
2026 年中期报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 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 10

§4 管理人报告 11

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遵规守信情况的说明 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 12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14

6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 18

§7 投资组合报告 41

7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 41
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 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 41

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 42
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 42
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 42
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 42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 42
7.11 投资组合报告附注 42
§8 基金份额持有人信息 43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 44
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 44
§9 开放式基金份额变动 44
§10 重大事件揭示 45
10.1 基金份额持有人大会决议 45
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 45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 45
10.4 基金投资策略的改变 45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 46
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 46
10.8 其他重大事件 47
§11 影响投资者决策的其他重要信息 48
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 48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 49
§12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 49
12.3 查阅方式 49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安中短债债券型证券投资基金			
基金简称	平安中短债债券			
基金主代码	004827			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2019 年 1 月 23 日			
基金管理人	平安基金管理有限公司			
基金托管人	中国工商银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	2,826,366,469.21 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	平安中短债债券 A	平安中短债债券 C	平安中短债债券 E	平安中短债债券 I
下属分级基金的交易代码	004827	004828	006851	022002
报告期末下属分级基金的份额总额	2,677,230,472.34 份	53,028,422.54 份	95,669,762.98 份	437,811.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将在分析宏观经济指标和财政货币政策等的基础上，对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测，决定组合的久期，并通过不同债券剩余期限的合理分布，有效地控制利率波动对基金净值波动的影响，并尽可能提高基金收益率。同时，本基金通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置；当收益率曲线走势难以判断时，参考基准指数的样本券久期构建组合久期，确保组合收益超过基准收益。
业绩比较基准	中债总财富（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	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李海波	郭明
	联系电话	0755-88622632	(010)66105799
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路	北京市西城区复兴门内大街 55

	5033 号平安金融中心 34 层	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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	罗春风	廖林

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	fund.pingan.com
基金中期报告置备地点	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 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)			
	平安中短债债券 A	平安中短债债券 C	平安中短债债券 E	平安中短债债券 I
本期已实现收益	21,429,998.75	353,652.87	864,661.06	3,703.41
本期利润	25,228,816.13	404,358.62	1,133,693.55	4,771.34
加权平均基金份额本期利润	0.0126	0.0128	0.0120	0.0119
本期加权平均净值利润率	1.06%	1.04%	0.99%	1.01%
本期基金份额净值增长率	1.12%	1.11%	1.00%	1.03%
3.1.2	报告期末(2026 年 6 月 30 日)			

期末数据和指标				
期末可供分配利润	351,880,523.46	8,105,481.86	15,637,268.87	55,984.19
期末可供分配基金份额利润	0.1314	0.1529	0.1635	0.1279
期末基金资产净值	3,181,288,733.71	65,533,846.06	116,817,897.12	519,311.21
期末基金份额净值	1.1883	1.2358	1.2211	1.1862
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)			
基金份额累计净值增长率	28.35%	27.54%	26.04%	3.71%

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

平安中短债债券 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	0.55%	0.01%	0.49%	0.01%	0.06%	0.00%
过去六个月	1.12%	0.01%	1.03%	0.01%	0.09%	0.00%
过去一年	2.09%	0.02%	1.81%	0.01%	0.28%	0.01%
过去三年	7.65%	0.03%	6.97%	0.02%	0.68%	0.01%
过去五年	17.65%	0.04%	13.16%	0.03%	4.49%	0.01%

过去七年	26.38%	0.05%	19.84%	0.03%	6.54%	0.02%
自基金合同生效起至今	28.35%	0.21%	21.09%	0.03%	7.26%	0.18%

平安中短债债券 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	0.52%	0.02%	0.49%	0.01%	0.03%	0.01%
过去六个月	1.11%	0.01%	1.03%	0.01%	0.08%	0.00%
过去一年	2.03%	0.02%	1.81%	0.01%	0.22%	0.01%
过去三年	7.29%	0.03%	6.97%	0.02%	0.32%	0.01%
过去五年	17.04%	0.04%	13.16%	0.03%	3.88%	0.01%
过去七年	25.63%	0.05%	19.84%	0.03%	5.79%	0.02%
自基金合同生效起至今	27.54%	0.18%	21.09%	0.03%	6.45%	0.15%

平安中短债债券 E

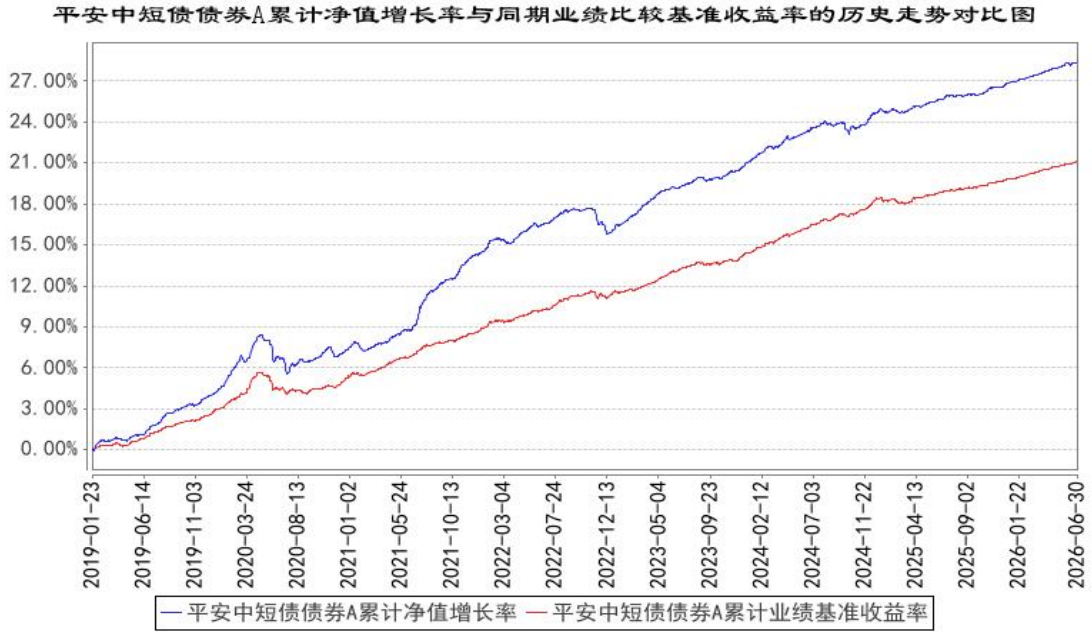
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.49%	0.01%	0.49%	0.01%	0.00%	0.00%
过去六个月	1.00%	0.01%	1.03%	0.01%	-0.03%	0.00%
过去一年	1.83%	0.02%	1.81%	0.01%	0.02%	0.01%
过去三年	6.81%	0.03%	6.97%	0.02%	-0.16%	0.01%
过去五年	16.14%	0.04%	13.16%	0.03%	2.98%	0.01%
过去七年	24.19%	0.05%	19.84%	0.03%	4.35%	0.02%
自基金合同生效起至今	26.04%	0.18%	21.09%	0.03%	4.95%	0.15%

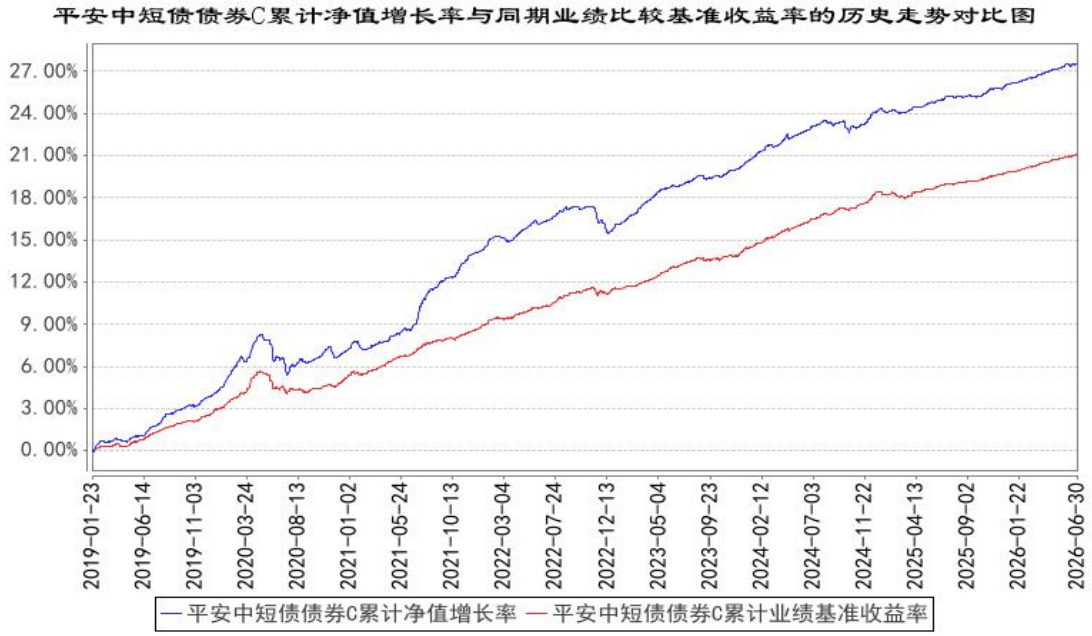
平安中短债债券 I

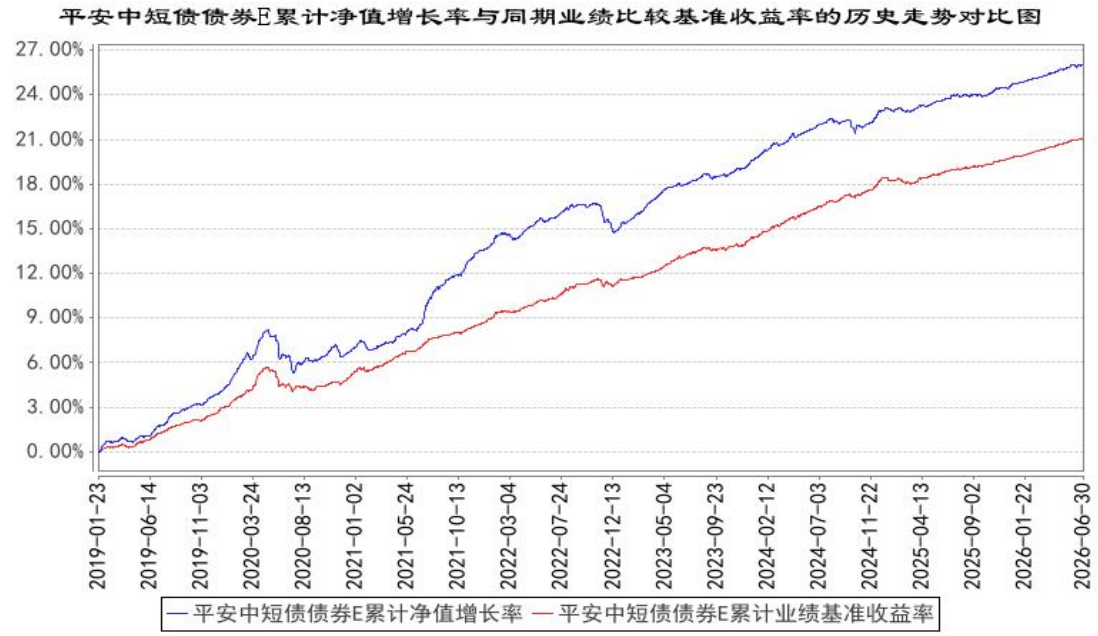
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.50%	0.02%	0.49%	0.01%	0.01%	0.01%

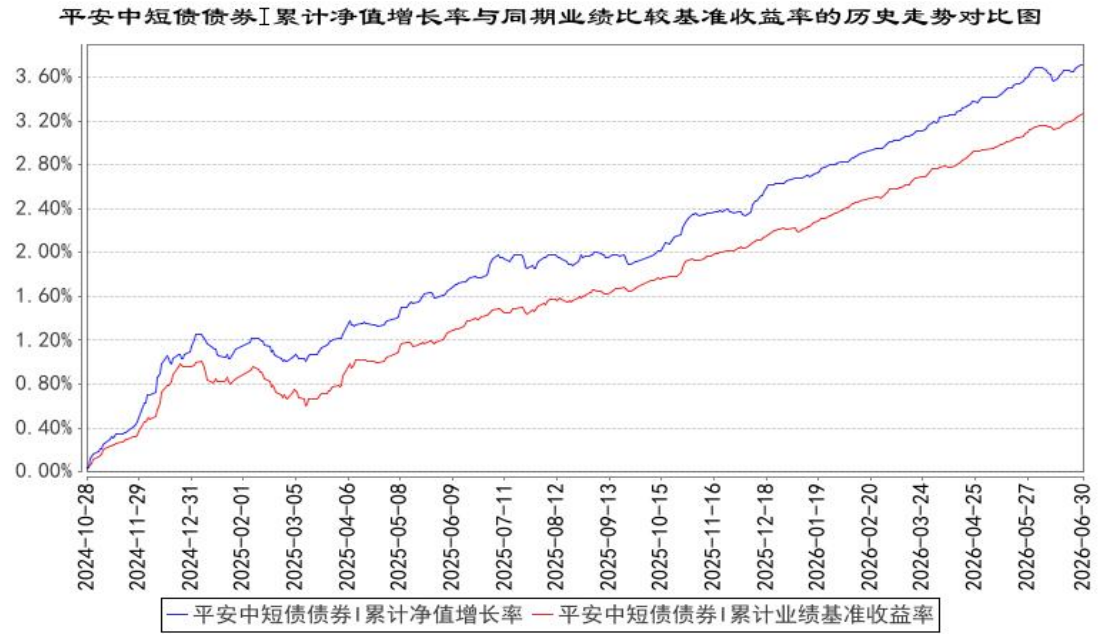
过去六个月	1.03%	0.01%	1.03%	0.01%	0.00%	0.00%
过去一年	1.88%	0.02%	1.81%	0.01%	0.07%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.71%	0.02%	3.27%	0.02%	0.44%	0.00%

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









注：1、本基金基金合同于 2019 年 1 月 23 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合同约定；

3、本基金于 2024 年 10 月 23 日增设 I 类份额，I 类份额从 2024 年 10 月 28 日开始有份额，所以以上 I 类份额走势图从 2024 年 10 月 28 日开始。

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，总部位于深圳，是中国平安集团投资板块的重要成员。公司业务范围涵盖公募基金管理业务、资本市场专户管理业务，具有受托管理保险资金资产管理人资格、合格境内机构投资者（QDII）资格。截至 2026 年上半年末，公司综合管理规模超 9500 亿元，公募管理规模 7900 亿元，累计服务客户数超 1.7 亿人，产品线涵盖货币、债券、混合、股票、指数、FOF、MOM、REITs 等各类产品。公司以“为持有人创造价值”为使命，打造了一支人才梯队完善、长期业绩优异的近 170 人投研团队，构建起“业绩可归因、策略可复制、人才可持续”的专业投研平台，为投资者创造长期稳健的投资回报，致力成为受投资者信赖、行业领先的综合型资产管理公司。

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	固定收益投资中心副总经理，平安中短债债券型证券投资基金基金经理	2019 年 1 月 25 日	-	15 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副总经理，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 1 年持有期混合型证券投资基金、平安惠合纯债债券型证券投资基金、平安恒泰 1 年持有期混合型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、平安元裕 90 天持有期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 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 5 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 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

2026 年上半年，中国经济运行在合理区间，初步核算上半年 GDP 同比增长 4.7%，其中一季度增长 5.0%、二季度增长 4.3%，经济顶住外部压力展现出较强韧性。从物价来看，上半年 CPI 同比上涨 1.0%，核心 CPI 上涨 1.2%，PPI 由负转正、上半年同比上涨 1.5%，价格总体处于温和回升态势。政策方面，上半年更加积极的财政政策持续发力，适度宽松的货币政策继续实施。1 年期 LPR 维持在 3.0%、5 年期 LPR 维持在 3.5%，利率水平保持稳定。央行在利率调控机制上持续优化，推出隔夜逆回购操作，推动货币政策框架向价格型转型，短端利率调控精准度进一步提升。债券市场方面，上半年收益率曲线整体下行。6 月末 10 年期国债收益率为 1.73%，较年初下行约 11 个基

点，6 月初一度触及 1.70%。1 年期国债收益率较年初下行约 21 个基点，短端下行幅度更为显著。整体来看，上半年债市在”资产荒”逻辑与宽货币预期支撑下表现稳健，信用利差维持低位。

上半年本基金保持了投资组合的流动性，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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安中短债债券 A 的基金份额净值 1.1883 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.12%，同期业绩比较基准收益率为 1.03%；截至本报告期末平安中短债债券 C 的基金份额净值 1.2358 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.11%，同期业绩比较基准收益率为 1.03%；截至本报告期末平安中短债债券 E 的基金份额净值 1.2211 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.00%，同期业绩比较基准收益率为 1.03%;截至本报告期末平安中短债债券 I 的基金份额净值 1.1862 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.03%，同期业绩比较基准收益率为 1.03%。

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，本基金认为宏观经济有望延续温和复苏态势，但内需相对不足、投资增速下滑等挑战仍需关注。二季度 GDP 增速回落至 4.3%，反映经济回升基础尚需巩固，“供强需弱”的结构性矛盾依然突出。货币政策方面，预计央行将继续维持适度宽松基调，根据国内外经济金融形势灵活运用降准、逆回购、MLF、国债买卖等工具。若下半年经济下行压力加大，不排除进一步降准降息的可能，流动性环境有望保持合理充裕。财政政策方面，预计更加积极的财政政策将持续落地见效，扩投资、促消费、保民生形成合力。下半年专项债与超长期特别国债的发行与转化有望加速，推动重点技改项目落地，以投资”量”的增加带动产业结构”质”的优化。在宽货币基调延续、机构配置需求旺盛的背景下，下半年债市收益率大幅上行的风险有限，但需警惕下半年政府债券供给放量对资金面的阶段性扰动。预计债市整体维持震荡偏强格局，信用债择优配置仍有空间。

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，由研究部及投资管理部门、运营部、风险管理部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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——平安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：平安中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	69,557,597.67	8,543,084.17
结算备付金		38,633,657.42	16,816,031.01
存出保证金		45,465.75	7,171.45
交易性金融资产	6.4.7.2	3,670,054,093.14	1,809,575,648.06
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,670,054,093.14	1,809,575,648.06
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	40,001,884.93	10,000,697.04
应收清算款		75,554.81	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,550,645.13	373,990.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,820,918,898.85	1,845,316,622.13
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		438,082,194.29	246,718,569.20
应付清算款		1,796.31	31,796.87
应付赎回款		17,095,478.50	-
应付管理人报酬		937,269.99	367,184.17
应付托管费		312,423.33	122,394.73
应付销售服务费		31,139.83	23,895.58
应付投资顾问费		-	-
应交税费		134,896.14	139,480.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	163,912.36	237,465.31
负债合计		456,759,110.75	247,640,785.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,828,835,178.44	1,357,276,204.39
未分配利润	6.4.7.12	535,324,609.66	240,399,631.87
净资产合计		3,364,159,788.10	1,597,675,836.26
负债和净资产总计		3,820,918,898.85	1,845,316,622.13

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,826,366,469.21 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1883 元，A 类基金份额 2,677,230,472.34 份；下属 C 类基金份额净值 1.2358 元，C 类

基金份额 53,028,422.54 份；下属 E 类基金份额净值 1.2211 元，E 类基金份额 95,669,762.98 份；下属 I 类基金份额净值 1.1862 元，I 类基金份额 437,811.35 份。

6.2 利润表

会计主体：平安中短债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		33,884,675.42	25,321,319.26
1.利息收入		712,679.38	555,664.21
其中：存款利息收入	6.4.7.13	131,831.65	135,198.28
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		580,847.73	420,465.93
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,304,705.03	31,126,222.02
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	28,118,374.40	32,368,503.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	186,330.63	-1,242,281.68
股利收益	6.4.7.19	-	-
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	4,119,623.55	-6,366,324.85
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	747,667.46	5,757.88
减：二、营业总支出		7,113,035.78	8,361,402.22
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,726,992.28	3,495,553.65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	1,242,330.71	1,165,184.58

3．销售服务费	6.4.10.2.3	166,318.96	186,214.84
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		1,765,411.44	3,232,659.64
其中：卖出回购金融资产支出		1,765,411.44	3,232,659.64
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		77,753.55	140,369.26
8．其他费用	6.4.7.23	134,228.84	141,420.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,771,639.64	16,959,917.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,771,639.64	16,959,917.04
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		26,771,639.64	16,959,917.04

6.3 净资产变动表

会计主体：平安中短债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,357,276,204.39	240,399,631.87	1,597,675,836.26
二、本期期初净资产	1,357,276,204.39	240,399,631.87	1,597,675,836.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,471,558,974.05	294,924,977.79	1,766,483,951.84
（一）、综合收益总额	-	26,771,639.64	26,771,639.64
（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）	1,471,558,974.05	268,153,338.15	1,739,712,312.20
其中：1.基金申购款	3,136,099,573.37	576,688,196.24	3,712,787,769.61
2.基金赎回款	-1,664,540,599.32	-308,534,858.09	-1,973,075,457.41
（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	2,828,835,178.44	535,324,609.66	3,364,159,788.10
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,302,420,395.60	362,760,607.30	2,665,181,002.90
二、本期期初净资产	2,302,420,395.60	362,760,607.30	2,665,181,002.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-497,050,935.48	-63,347,613.92	-560,398,549.40
（一）、综合收益总额	-	16,959,917.04	16,959,917.04
（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）	-497,050,935.48	-80,307,530.96	-577,358,466.44
其中：1.基金申购款	1,241,093,721.65	196,005,428.08	1,437,099,149.73
2.基金赎回款	-1,738,144,657.13	-276,312,959.04	-2,014,457,616.17
（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	1,805,369,460.12	299,412,993.38	2,104,782,453.50

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	肖宇鹏	马杰
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安中短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据原平安鑫荣混合型证券投资基金(以下简称“平安鑫荣混合基金”)《平安基金管理有限公司关于召开平安鑫荣混合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》的约定，由原平安鑫荣混合基金转型而来。原平安鑫荣混合基金为契约型开放式基金，存续期限不定，经基金份额持有人大会审议通过转型

事项，自 2019 年 1 月 23 日正式转型为平安中短债债券型证券投资基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《平安中短债债券型证券投资基金招募说明书》，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，但不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额，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、E 类、I 类基金份额。本基金 A 类、C 类、E 类和 I 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、C 类、E 类和 I 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债、资产支持证券、资产支持票据、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款以及定期存款等其他银行存款)、同业存单、国债期货、现金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。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中债总财富(1-3 年)指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安中短债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前,对证券投资基金管理人运用基金资产买卖债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入，

暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	69,557,597.67
等于：本金	69,556,282.62
加：应计利息	1,315.05
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	69,557,597.67

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	836,456,742.23	6,610,028.52	841,738,028.52	-1,328,742.23
	银行间市场	2,797,205,667.30	28,840,064.62	2,828,316,064.62	2,270,332.70
	合计	3,633,662,409.53	35,450,093.14	3,670,054,093.14	941,590.47
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,633,662,409.53	35,450,093.14	3,670,054,093.14	941,590.47

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：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	40,001,884.93	-
合计	40,001,884.93	-

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：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	72.56
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	62,799.95
其中：交易所市场	-
银行间市场	62,799.95
应付利息	-
预提费用	101,039.85
合计	163,912.36

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安中短债债券 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,266,240,930.65	1,266,486,700.00
本期申购	3,032,178,234.83	3,032,708,051.80
本期赎回（以“-”号填列）	-1,621,188,693.14	-1,621,482,534.38
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	2,677,230,472.34	2,677,712,217.42

平安中短债债券 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	219,527.37	227,613.96
本期申购	62,551,761.46	64,892,848.37

本期赎回（以“-”号填列）	-9,742,866.29	-10,105,075.64
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	53,028,422.54	55,015,386.69

平安中短债债券 E

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	90,186,416.47	90,186,416.47
本期申购	38,136,998.17	38,136,998.17
本期赎回（以“-”号填列）	-32,653,651.66	-32,653,651.66
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	95,669,762.98	95,669,762.98

平安中短债债券 I

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	375,473.96	375,473.96
本期申购	361,675.03	361,675.03
本期赎回（以“-”号填列）	-299,337.64	-299,337.64
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	437,811.35	437,811.35

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

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

平安中短债债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	153,263,258.38	68,181,148.41	221,444,406.79
本期期初	153,263,258.38	68,181,148.41	221,444,406.79
本期利润	21,429,998.75	3,798,817.38	25,228,816.13
本期基金份额交易产	177,187,266.33	79,716,027.04	256,903,293.37

生的变动数			
其中：基金申购款	385,799,619.78	170,638,316.79	556,437,936.57
基金赎回款	-208,612,353.45	-90,922,289.75	-299,534,643.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	351,880,523.46	151,695,992.83	503,576,516.29

平安中短债债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,342.28	9,340.30	40,682.58
本期期初	31,342.28	9,340.30	40,682.58
本期利润	353,652.87	50,705.75	404,358.62
本期基金份额交易产生的变动数	7,720,486.71	2,352,931.46	10,073,418.17
其中：基金申购款	9,175,432.56	2,786,886.42	11,962,318.98
基金赎回款	-1,454,945.85	-433,954.96	-1,888,900.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,105,481.86	2,412,977.51	10,518,459.37

平安中短债债券 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,915,062.31	4,934,108.16	18,849,170.47
本期期初	13,915,062.31	4,934,108.16	18,849,170.47
本期利润	864,661.06	269,032.49	1,133,693.55
本期基金份额交易产生的变动数	857,545.50	307,724.62	1,165,270.12
其中：基金申购款	6,061,240.84	2,161,628.30	8,222,869.14
基金赎回款	-5,203,695.34	-1,853,903.68	-7,057,599.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,637,268.87	5,510,865.27	21,148,134.14

平安中短债债券 I

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	44,547.06	20,824.97	65,372.03
本期期初	44,547.06	20,824.97	65,372.03
本期利润	3,703.41	1,067.93	4,771.34
本期基金份额交易产生的变动数	7,733.72	3,622.77	11,356.49
其中：基金申购款	44,389.47	20,682.08	65,071.55
基金赎回款	-36,655.75	-17,059.31	-53,715.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,984.19	25,515.67	81,499.86

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,561.42

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	85,561.81
其他	10,708.42
合计	131,831.65

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

注：本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票买卖差价收入。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	34,160,174.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,041,800.30
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	28,118,374.40

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,671,574,783.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,628,857,028.68
减：应计利息总额	48,698,007.65
减：交易费用	61,547.50
买卖债券差价收入	-6,041,800.30

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	186,330.63

6.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	4,119,623.55

股票投资	-
债券投资	4,119,623.55
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
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	4,119,623.55

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	747,428.79
基金转换费收入	238.67
合计	747,667.46

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根据《平安中短债债券型证券投资基金招募说明书》确认。

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。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	23,888.99
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	134,228.84

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

截至本财务报表批准报出日，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、关联关系

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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	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
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	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
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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,726,992.28	3,495,553.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	994,548.48	966,901.80
应支付基金管理人的净管理费	2,732,443.80	2,528,651.85

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 0.30%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×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,242,330.71	1,165,184.58

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	平安中短债债券 A	平安中短债债券 C	平安中短债债券 E	平安中短债债券 I	合计
方正证券	-	-	410.46	-	410.46
工商银行	-	2,822.44	-	-	2,822.44
陆基金	-	-	16,555.21	-	16,555.21
平安基金	-	-	14.48	-	14.48

平安人寿	-	-	12,003.06	-	12,003.06
平安银行	-	-	25,842.91	-	25,842.91
平安证券	-	-	2,042.70	-	2,042.70
合计	-	2,822.44	56,868.82	-	59,691.26

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	平安中短债债券 A	平安中短债债券 C	平安中短债债券 E	平安中短债债券 I	合计
工商银行	-	406.20	-	-	406.20
陆基金	-	-	18,566.79	-	18,566.79
平安基金	-	-	14.46	-	14.46
平安人寿	-	-	18,710.38	-	18,710.38
平安银行	-	-	28,860.94	-	28,860.94
平安证券	-	-	2,383.11	-	2,383.11
合计	-	406.20	68,535.68	-	68,941.88

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 0.10%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×0.10%/当年天数；

支付基金销售机构的销售服务费按 E 类基金份额前一日基金资产净值 0.26%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 E 类基金份额销售服务费＝前一日 E 类基金份额基金资产净值×0.26%/当年天数；

支付基金销售机构的销售服务费按 I 类基金份额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 I 类基金份额销售服务费＝前一日 I 类基金份额基金资产净值×0.20%/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

单位：人民币元

本期

2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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
工商银行	130,137,084.11	-	-	-	-	-

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	平安中短债债券 A	平安中短债债券 C	平安中短债债券 E	平安中短债债券 I
基金合同生效日（2019 年 1 月 23 日）持有的基金份额	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	28,421,653.91	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-	-	-

报告期末持有的基金份额	28,421,653.91	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.0616%	-	-	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	平安中短债债券 A	平安中短债债券 C	平安中短债债券 E	平安中短债债券 I
基金合同生效日（2019 年 1 月 23 日）持有的基金份额	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	28,421,653.91	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-	-	-
报告期末持有的基金份额	28,421,653.91	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.6744%	-	-	-

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。

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

平安中短债债券 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	6,976,112.08	0.2606	6,976,112.08	0.5509
平安人寿	170,531,207.37	6.3697	170,531,207.37	13.4675

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
工商银行-活期	69,557,597.67	35,561.42	749,670.18	24,140.44

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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

本基金本报告期内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（2026 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 2026 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 110,032,194.29 元，是以如下债券作为质押：

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
102381761	23 青岛海	2026 年 7 月 1	103.64	200,000	20,728,586.30

	控 MTN001	日			
102483958	24 科学城 MTN002(项目收益)	2026 年 7 月 1 日	103.89	200,000	20,777,726.03
102485184	24 钟山资产 MTN003	2026 年 7 月 1 日	101.65	300,000	30,495,859.73
102584791	25 潞安 MTN006A	2026 年 7 月 1 日	101.83	178,000	18,125,812.17
102680382	26 河钢集 MTN002	2026 年 7 月 1 日	101.68	200,000	20,335,514.52
102580353	25 知识城 MTN001	2026 年 7 月 3 日	102.03	106,000	10,815,435.56
合计				1,184,000	121,278,934.31

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，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 328,050,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 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、审计与风险控制委员会、风控负责人、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 77.91%(上年度末:100.15%)。

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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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 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。

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，并按照合约规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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	69,557,597.67	-	-	-	69,557,597.67
结算备付金	38,633,657.42	-	-	-	38,633,657.42
存出保证金	45,465.75	-	-	-	45,465.75
交易性金融资产	929,475,945.77	2,295,123,922.16	445,454,225.21	-	3,670,054,093.14
买入返售金融资产	40,001,884.93	-	-	-	40,001,884.93
应收申购款	-	-	-	2,550,645.13	2,550,645.13
应收清算款	-	-	-	75,554.81	75,554.81
资产总计	1,077,714,551.54	2,295,123,922.16	445,454,225.21	2,626,199.94	3,820,918,898.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,095,478.50	17,095,478.50
应付管理人报酬	-	-	-	937,269.99	937,269.99
应付托管费	-	-	-	312,423.33	312,423.33
应付清算款	-	-	-	1,796.31	1,796.31
卖出回购金融资产款	438,082,194.29	-	-	-	438,082,194.29
应付销售服务费	-	-	-	31,139.83	31,139.83
应交税费	-	-	-	134,896.14	134,896.14
其他负债	-	-	-	163,912.36	163,912.36
负债总计	438,082,194.29	-	-	18,676,916.46	456,759,110.75
利率敏感度缺口	639,632,357.25	2,295,123,922.16	445,454,225.21	-16,050,716.52	3,364,159,788.10
上年度末 2025 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	8,543,084.17	-	-	-	8,543,084.17
结算备付金	16,816,031.01	-	-	-	16,816,031.01
存出保证金	7,171.45	-	-	-	7,171.45
交易性金融资产	805,947,973.44	728,320,075.63	275,307,598.99	-	1,809,575,648.06
买入返售金融资产	10,000,697.04	-	-	-	10,000,697.04
应收申购款	-	-	-	373,990.40	373,990.40
资产总计	841,314,957.11	728,320,075.63	275,307,598.99	373,990.40	1,845,316,622.13
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	367,184.17	367,184.17
应付托管费	-	-	-	122,394.73	122,394.73
应付清算款	-	-	-	31,796.87	31,796.87
卖出回购金融资产款	246,718,569.20	-	-	-	246,718,569.20
应付销售服务费	-	-	-	23,895.58	23,895.58
应交税费	-	-	-	139,480.01	139,480.01
其他负债	-	-	-	237,465.31	237,465.31
负债总计	246,718,569.20	-	-	922,216.67	247,640,785.87
利率敏感度缺口	594,596,387.91	728,320,075.63	275,307,598.99	-548,226.27	1,597,675,836.26

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 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-18,112,053.10	-5,978,356.40
	市场利率下降 25 个基点	18,292,479.87	6,025,381.79

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，所面临的最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

注：于本报告期末，本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于本报告期末，本基金未持有权益类资产（上年度末：同），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	3,670,054,093.14	1,809,575,648.06
第三层次	-	-
合计	3,670,054,093.14	1,809,575,648.06

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生的当期期初为确认各层次之间转换的时点。本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2025 年 12 月 31 日：同）。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,670,054,093.14	96.05
	其中：债券	3,670,054,093.14	96.05
	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	40,001,884.93	1.05
	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	108,191,255.09	2.83
8	其他各项资产	2,671,665.69	0.07
9	合计	3,820,918,898.85	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

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期内未买入股票。

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

注：本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未持有股票。

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	172,186,361.64	5.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,314,399,264.65	39.07
	其中：政策性金融债	876,795,780.82	26.06
4	企业债券	714,403,877.29	21.24
5	企业短期融资券	20,217,107.40	0.60
6	中期票据	1,115,978,014.22	33.17
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	332,869,467.94	9.89
10	合计	3,670,054,093.14	109.09

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	232680011	26 建行二级资本债 01BC	1,300,000	130,313,474.52	3.87
2	115102	GC 风电 K1	1,100,000	111,120,493.15	3.30
3	260202	26 国开 02	1,100,000	110,713,945.21	3.29
4	230415	23 农发 15	1,000,000	104,558,958.90	3.11
5	240203	24 国开 03	1,000,000	103,102,876.71	3.06

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本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。

7.10.2 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、中国农业发

展银行、中国建设银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、广发证券股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.11.2 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。

7.11.3 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	45,465.75
2	应收清算款	75,554.81
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,550,645.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,671,665.69

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 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（%）
平安中短债债券A	18,352	145,882.22	2,314,723,375.09	86.46	362,507,097.25	13.54
平安中短债债券C	17	3,119,318.97	48,830,807.06	92.08	4,197,615.48	7.92

平安中短债债券 E	14,967	6,392.05	0.00	0.00	95,669,762.98	100.00
平安中短债债券 I	50	8,756.23	0.00	0.00	437,811.35	100.00
合计	33,181	85,180.27	2,363,554,182.15	83.63	462,812,287.06	16.37

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	平安中短债债券 A	530.90	0.0000
	平安中短债债券 C	-	-
	平安中短债债券 E	39.99	0.0000
	平安中短债债券 I	8.74	0.0020
	合计	579.63	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	平安中短债债券 A	0
	平安中短债债券 C	0
	平安中短债债券 E	0
	平安中短债债券 I	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安中短债债券 A	0
	平安中短债债券 C	0
	平安中短债债券 E	0
	平安中短债债券 I	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安中短债债券 A	平安中短债债券 C	平安中短债债券 E	平安中短债债券 I
基金合同生效日	11,529,428.50	62,499,813.19	-	-

（2019年1月23日）基金份额总额				
本报告期期初基金份额总额	1,266,240,930.65	219,527.37	90,186,416.47	375,473.96
本报告期基金总申购份额	3,032,178,234.83	62,551,761.46	38,136,998.17	361,675.03
减：本报告期基金总赎回份额	1,621,188,693.14	9,742,866.29	32,653,651.66	299,337.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,677,230,472.34	53,028,422.54	95,669,762.98	437,811.35

§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

管理人：公司副总经理林婉文因达到退休年龄，于报告期辞去公司副总经理兼财务负责人职务。林婉文离任后，由公司总经理肖宇鹏兼任公司财务负责人。

托管人：本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

管理人：本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务的诉讼或仲裁。

托管人：本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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

本基金聘用容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
诚通证券	2	-	-	-	-	
东方证券	2	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国盛证券	1	-	-	-	-	
国泰海通证券	2	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
太平洋证券	2	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
招商证券	1	-	-	-	-	
中泰证券	2	-	-	-	-	
中信建投证券	2	-	-	-	-	

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

（1）财务状况良好

（2）经营行为规范

（3）合规风控能力较高

（4）交易、研究等服务能力较强

2、基金管理人根据上述标准，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。

3、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	6,082,362,000.00	29.24	-	-
广发证券	41,814,585.00	5.39	817,842,000.00	3.93	-	-
国盛证券	20,066,060.00	2.59	268,094,000.00	1.29	-	-
国泰海通证券	703,828,300.00	90.73	11,247,446,000.00	54.08	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	10,061,330.00	1.30	330,062,000.00	1.59	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	2,052,230,000.00	9.87	-	-
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	平安中短债债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 01 月 21 日
2	平安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 11 日
3	平安基金管理有限公司关于新增上海证达通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	2026 年 03 月 18 日
4	平安基金管理有限公司关于恢复泰信财富基金销售有限公司办理旗下部分基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 20 日
5	平安中短债债券型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 30 日

6	平安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 31 日
7	平安中短债债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 04 月 22 日
8	平安基金管理有限公司关于新增易方达财富管理基金销售（广州）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	2026 年 04 月 24 日
9	平安基金管理有限公司对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 04 月 30 日
10	平安基金管理有限公司关于新增中国平安人寿保险股份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	2026 年 05 月 15 日
11	平安基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司相关销售业务合作的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 05 月 29 日
12	平安中短债债券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	2026 年 05 月 29 日
13	平安中短债债券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	2026 年 05 月 29 日
14	平安基金管理有限公司关于新增泰信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	2026 年 06 月 10 日
15	平安基金管理有限公司关于新增华源证券股份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	2026 年 06 月 10 日
16	平安基金管理有限公司关于新增万家财富基金销售（天津）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	2026 年 06 月 15 日
17	平安基金管理有限公司关于新增汇添富基金销售（上海）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	2026 年 06 月 18 日
18	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 06 月 26 日
19	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 06 月 27 日
20	平安中短债债券型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 06 月 27 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

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与各基金托管人协商一致，平安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定自 2026 年 7 月 27 日起调整旗下部分基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。详细内容请阅读本基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的《平安基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》。

§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中短债债券型证券投资基金设立的文件

（2）平安中短债债券型证券投资基金基金合同

（3）平安中短债债券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

2026 年 8 月 31 日