

平安添润债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 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 2024 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	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.11 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安添润债券型证券投资基金	
基金简称	平安添润债券	
基金主代码	015625	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 17 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	
报告期末基金份 额总额	291,992,468.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	平安添润债券 A	平安添润债券 C
下属分级基金的交 易代码	015625	015626
报告期末下属分级 基金的份额总额	120,860,574.36 份	171,131,894.47 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、大类资产配置 2、股票（含存托凭证）投资策略 3、债券投资策略 4、国债期货投资策略 5、信用衍生品投资策略
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率（经汇率调整）×2%
风险收益特征	本基金是债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	潘琦
	联系电话	0755-22626828	0755-22168257
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座

邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	平安添润债券 A	平安添润债券 C
本期已实现收益	161,849.41	1,246,217.99
本期利润	843,442.03	2,381,905.31
加权平均基金份额 本期利润	0.0477	0.0194
本期加权平均净 值利润率	4.43%	1.81%
本期基金份额净 值增长率	6.30%	6.13%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	7,679,341.31	9,810,453.13
期末可供分配基 金份额利润	0.0635	0.0573
期末基金资产净 值	130,651,513.44	183,894,938.48
期末基金份额净 值	1.0810	1.0746
3.1.3 累计期	报告期末(2024年6月30日)	

末指标		
基金份额累计净值增长率	8.10%	7.46%

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

平安添润债券 A

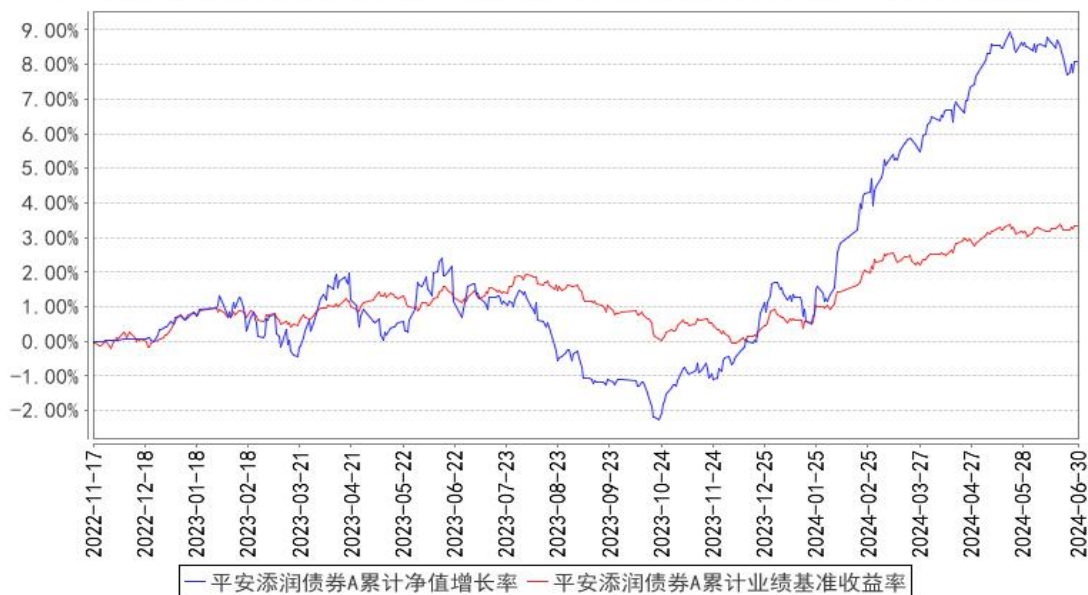
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.38%	0.19%	0.29%	0.05%	-0.67%	0.14%
过去三个月	2.01%	0.18%	0.95%	0.08%	1.06%	0.10%
过去六个月	6.30%	0.22%	2.40%	0.09%	3.90%	0.13%
过去一年	6.41%	0.20%	2.05%	0.09%	4.36%	0.11%
自基金合同生效起至今	8.10%	0.22%	3.33%	0.09%	4.77%	0.13%

平安添润债券 C

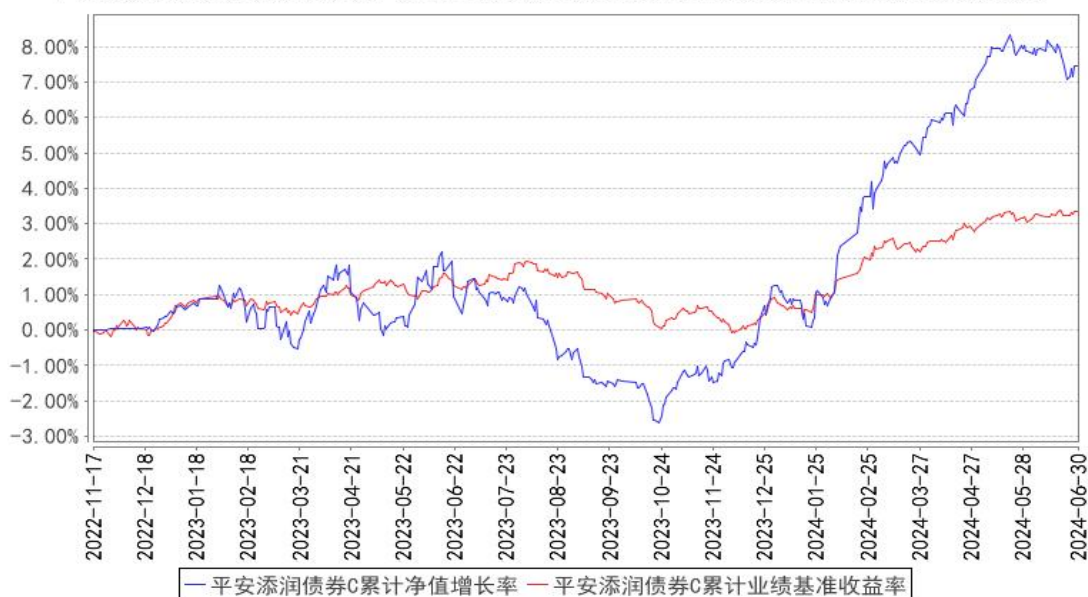
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.40%	0.19%	0.29%	0.05%	-0.69%	0.14%
过去三个月	1.93%	0.18%	0.95%	0.08%	0.98%	0.10%
过去六个月	6.13%	0.22%	2.40%	0.09%	3.73%	0.13%
过去一年	6.02%	0.20%	2.05%	0.09%	3.97%	0.11%
自基金合同生效起至今	7.46%	0.22%	3.33%	0.09%	4.13%	0.13%

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

平安添润债券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



平安添润债券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 2022 年 11 月 17 日正式生效；

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

3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、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）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2024 年 6 月 30 日，平安基金共管理 206 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6655 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		
曾小丽	平安添润债券型证券投资基金基金经理	2022 年 11 月 17 日	-	12 年	曾小丽女士，中国人民大学世界经济专业硕士，曾先后担任大公国际资信评估有限公司信用评审委员、信用分析师、光大保德信基金管理有限公司基金经理兼固收研究团队联席团队长。2021 年 8 月加入平安基金管理有限公司，现任平安双债添益债券型证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安添润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、平安稳健增长混合型证券投资基金基金经理。
刘斌斌	平安添润债券型证券投资基金基金经理	2022 年 12 月 2 日	2024 年 2 月 6 日	11 年	刘斌斌先生，山东大学金融学专业硕士。曾任融通基金管理有限公司投资经理。2021 年 2 月加入平安基金管理有限公司，曾担任固定收益投资中心专户投资经理，现担任平安恒泽混合型证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

股票方面，2024 年上半年市场表现出分化明显，轮动加速的特征。上证指数下跌 0.25%，大盘价值全面领涨；而中证 1000 全面承压，跌幅为 16.837%。一月份大盘走低，小盘股一度遭遇了流动性危机，随后一系列维稳措施使得市场经历了快速反弹；二季度，新国九条等政策持续发力，叠加年报、一季度报的发布验证，部分高景气行业得到验证，大盘价值相对走强。转债方面，经历年初的 V 型反弹后，指数持续震荡。整体节奏与权益市场类似，区别在于 4 月底开始逐步有理财等增量资金增配的信号出现，溢价率开始有修复迹象。上半年中证转债指数下跌 0.07%，整体表现优于部分权益指数。

债券方面，利率债品种，1-2月实体经济通缩预期发酵，债券供需失衡，降准降息预期持续，利率不断突破前低。3月-5月，经济数据表现不错，农商行舆情发酵，利率整体震荡。6月，地产政策虽然发力，但经济边际走弱，市场对于央行的担忧逐步缓解后，利率下行至前低位置。信用债品种，供求矛盾突出，超长债供给增加依然不改高息资产短缺的局面，城投供给也在持续缩量，存款搬家导致非银成为重要的需求方。信用上半年整体是震荡下行，信用利差持续压缩。

报告期内，纯债部分提升了久期，增配中长期的企业中票和银行二永债，同时积极参与超长久期利率品种的交易。权益部分基本维持了年初的仓位水平，持仓结构方面主要配置上游资源和有色金属、电力等周期价值板块，其他板块选择行业处在底部复苏且估值合理的电子、机械等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安添润债券 A 的基金份额净值 1.0810 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.30%，同期业绩比较基准收益率为 2.40%；截至本报告期末平安添润债券 C 的基金份额净值 1.0746 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.13%，同期业绩比较基准收益率为 2.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从近期跟踪的宏观经济数据观察，国内经济“内需弱、外需强”的特点较为明显。地产政策的放松并没有起到立竿见影的作用，部分地产数据边际微弱改善，但同比数据整体仍然保持低位的水平，房地产投资完成额累计同比创出新低。由于地方债务化解包袱较重和土地财政的缺失，虽然有万亿特别国债的发行，但整体基建增速也保持了下行趋势。制造业投资增速保持平稳。消费数据仍然较弱。出口数据是亮点，但与企业担心加征关税，抢出口的短期因素相关，后续能否持续值得关注。今年以来美元保持强势，人民币汇率仍然承压，国内经济基本面的稳增长诉求也依然存在，下半年“预期没有那么强，现实也没有那么弱”的经济基本面情况整体有利于资本市场的平稳表现。三中全会定调未来的发展战略，科技创新和新质生产力将成为核心关注点，有利于引导资本市场围绕科技创新提供更优的服务与支持。转债市场今年的调整始于对低价转债信用资质的担忧，是前期小微盘股退市风险的衍生，我们认为并不能彻底改变转债资产整体的估值逻辑体系。只是更加坚定了我们之前一直秉持的配置理念，在关注低价转债期权价值的同时，赋予企业经营稳健性和信用资质更多的权重。债券方面，经历了半年的上涨，目前长端和超长端利率品种均又到了历史低位，而其余品种尤其是信用债收益率水平均已创了新低。对存款补息的整顿，导致银行存款流失，但并未带来资金的紧张，“存款搬家”通过理财进入非银金融体系，同时在经济增长乏力的背景下货币政策预计继续保持宽松，下半年降准降息仍然有空间，债券整体处在长周期下行通道中。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人的情形。本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末，以上情况已经消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向中国证监会或相关派出机构报告并提出了解决方案。

§ 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合

报告等内容真实、准确、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：平安添润债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,783,692.30	389,258.83
结算备付金		1,756,384.67	136,965.61
存出保证金		59,483.16	7,189.62
交易性金融资产	6.4.7.2	428,203,688.92	12,397,403.64
其中：股票投资		35,336,029.68	1,352,652.00
基金投资		-	-
债券投资		392,867,659.24	11,044,751.64
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,306,487.94	-
应收股利		211.20	-
应收申购款		904,814.94	85,909.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	19,409.03	-
资产总计		435,034,172.16	13,016,727.21
负债和净资产			
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		113,822,449.96	1,220,446.13

应付清算款		2,486,198.17	257,894.11
应付赎回款		3,655,704.75	10.09
应付管理人报酬		129,764.56	4,521.77
应付托管费		25,952.95	904.34
应付销售服务费		76,624.96	3,123.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		19,494.46	81.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	271,530.43	50,384.49
负债合计		120,487,720.24	1,537,365.16
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	291,992,468.83	11,336,908.36
未分配利润	6.4.7.12	22,553,983.09	142,453.69
净资产合计		314,546,451.92	11,479,362.05
负债和净资产总计		435,034,172.16	13,016,727.21

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 291,992,468.83 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0810 元，基金份额 120,860,574.36 份；C 类基金份额净值 1.0746 元，基金份额 171,131,894.47 份。

6.2 利润表

会计主体：平安添润债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,154,992.75	980,662.07
1. 利息收入		12,210.08	162,225.01
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,210.08	71,908.27
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		-	90,316.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		2,312,044.74	1,235,652.87
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,811,364.49	180,632.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,664,974.82	1,038,725.38
资产支持证券投	6.4.7.16	-	-

资收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	458,434.41	16,295.26
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	1,817,279.94	-417,216.31
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	13,457.99	0.50
减：二、营业总支出		929,645.41	445,970.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	357,671.07	210,024.75
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	71,534.16	42,004.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	219,190.69	7,405.00
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		236,734.73	100,430.45
其中：卖出回购金融资产支出		236,734.73	100,430.45
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		4,398.98	43.72
8. 其他费用	6.4.7.23	40,115.78	86,061.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,225,347.34	534,691.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,225,347.34	534,691.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,225,347.34	534,691.87

6.3 净资产变动表

会计主体：平安添润债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	11,336,908.36	-	142,453.69	11,479,362.05
二、本期期初净资产	11,336,908.36	-	142,453.69	11,479,362.05

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	280,655,560.47	-	22,411,529.40	303,067,089.87
(一)、综合收益总额	-	-	3,225,347.34	3,225,347.34
(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)	280,655,560.47	-	19,186,182.06	299,841,742.53
其中：1. 基金申购款	793,820,084.03	-	56,432,675.42	850,252,759.45
2. 基金赎回款	-513,164,523.56	-	-37,246,493.36	-550,411,016.92
(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	291,992,468.83	-	22,553,983.09	314,546,451.92
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	170,442,204.15	-	723,323.66	171,165,527.81
二、本期期初净资产	170,442,204.15	-	723,323.66	171,165,527.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-161,938,984.74	-	-595,478.11	-162,534,462.85
(一)、综合收益总额	-	-	534,691.87	534,691.87
(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)	-161,938,984.74	-	-1,130,169.98	-163,069,154.72
其中：1. 基金申购款	33,337,143.40	-	109,912.86	33,447,056.26
2. 基金赎回款	-195,276,128.1	-	-1,240,082.84	-196,516,210.98

	4			
(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	8,503,219.41	-	127,845.55	8,631,064.96

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：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>张南南</u>
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

平安添润债券型证券投资基金(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[2022]605号《关于准予平安添润债券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《平安添润债券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320,535,705.81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(2022)第0952号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安添润债券型证券投资基金基金合同》于2022年11月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为320,538,549.23份基金份额,其中认购资金利息折合2,843.42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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《平安添润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、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中A类基金份额分类为在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;C类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费,但不收取认购/申购费用的基金份额。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,本基金各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《平安添润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,包括国内依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票、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、定期存款以及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货、信用衍生品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相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;投资于股票和存托凭证等资产的比例不超过基金资产的 20%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产(含存托凭证)的 50%);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,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。国债期货及其他金融工具的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率 \times 90%+沪深 300 指数收益率 \times 8%+恒生指数收益率(经汇率调整) \times 2%。

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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安添润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

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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[2012]85号《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》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.10% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,783,692.30
等于：本金	2,783,523.49
加：应计利息	168.81
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	2,783,692.30

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		36,066,472.48	-	35,336,029.68	-730,442.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	99,969,341.85	465,579.01	100,570,776.57	135,855.71
	银行间市场	288,119,074.33	1,700,712.67	292,296,882.67	2,477,095.67
	合计	388,088,416.18	2,166,291.68	392,867,659.24	2,612,951.38
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		424,154,888.66	2,166,291.68	428,203,688.92	1,882,508.58

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	19,409.03
合计	19,409.03

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	246,318.17
其中：交易所市场	212,442.53
银行间市场	33,875.64
应付利息	-
预提费用	25,212.26
合计	271,530.43

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安添润债券 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	234,512.68	234,512.68
本期申购	130,721,033.17	130,721,033.17
本期赎回（以“-”号填列）	-10,094,971.49	-10,094,971.49
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	120,860,574.36	120,860,574.36

平安添润债券 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,102,395.68	11,102,395.68
本期申购	663,099,050.86	663,099,050.86
本期赎回（以“-”号填列）	-503,069,552.07	-503,069,552.07
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	171,131,894.47	171,131,894.47

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

平安添润债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,455.03	-1,501.15	3,953.88
本期期初	5,455.03	-1,501.15	3,953.88
本期利润	161,849.41	681,592.62	843,442.03
本期基金份额交易产生的变动数	7,512,036.87	1,431,506.30	8,943,543.17
其中：基金申购款	8,163,827.18	1,581,930.22	9,745,757.40
基金赎回款	-651,790.31	-150,423.92	-802,214.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,679,341.31	2,111,597.77	9,790,939.08

平安添润债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	210,831.18	-72,331.37	138,499.81
本期期初	210,831.18	-72,331.37	138,499.81
本期利润	1,246,217.99	1,135,687.32	2,381,905.31
本期基金份额交易产生的变动数	8,353,403.96	1,889,234.93	10,242,638.89
其中：基金申购款	37,690,371.60	8,996,546.42	46,686,918.02
基金赎回款	-29,336,967.64	-7,107,311.49	-36,444,279.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,810,453.13	2,952,590.88	12,763,044.01

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	8,324.72
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	3,722.76
其他	162.60
合计	12,210.08

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,811,364.49
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	-1,811,364.49

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	143,687,457.25
减：卖出股票成本总额	145,158,487.59
减：交易费用	340,334.15
买卖股票差价收入	-1,811,364.49

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,683,631.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,981,343.75
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,664,974.82

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	823,084,842.54
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	814,162,792.49
减：应计利息总额	6,891,398.76
减：交易费用	49,307.54
买卖债券差价收入	1,981,343.75

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

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	458,434.41
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	458,434.41

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	1,817,279.94
股票投资	-753,179.51
债券投资	2,570,459.45
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	1,817,279.94

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	13,307.93
基金转换费收入	150.06
合计	13,457.99

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	15,912.26
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	6,203.52
合计	40,115.78

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	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
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
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安财产保险股份有限公司（“平安财险”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
方正证券	-	-	8,122,329.00	1.75

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
方正证券	5,858.91	1.75	5,858.91	5.49

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	357,671.07	210,024.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	128,376.03	50,188.63
应支付基金管理人的净管理费	229,295.04	159,836.12

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 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	71,534.16	42,004.93

注：支付基金托管行平安银行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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安添润债券 A	平安添润债券 C	合计
陆基金	-	1,188.73	1,188.73
平安基金	-	31,757.74	31,757.74
平安人寿	-	25,791.35	25,791.35
平安银行	-	4,205.41	4,205.41
合计	-	62,943.23	62,943.23
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安添润债券 A	平安添润债券 C	合计
平安基金	-	4,528.87	4,528.87
平安银行	-	2,103.65	2,103.65
合计	-	6,632.52	6,632.52

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金前一日基金资产净值 0.35% 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：

C 类基金日销售服务费 = C 类基金前一日基金资产净值 × 0.35% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	平安添润债券 A	平安添润债券 C
基金合同生效日(2022 年 11 月 17 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	5,130,309.87
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	-	5,130,309.87
报告期末持有的基金份额	-	2.9979%

占基金总份额比例		
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	平安添润债券 A	平安添润债券 C
基金合同生效日（2022 年 11 月 17 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。

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

平安添润债券 A

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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（%）
平安财险	92,663,716.53	76.6699	-	-
平安汇通	16,113,744.08	13.3325	-	-

份额单位：份

平安添润债券 C

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	5,065,467.32	2.9600	5,065,467.32	45.6250

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
平安银行-活期	2,783,692.30	8,324.72	142,381.77	10,007.11

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
平安银行	198434 IB	24 江苏债 02	公开发行	10,000	1,000,000.00
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 99,022,449.96 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102400700	24 泰山财金	2024 年 7 月 1	105.21	50,000	5,260,312.33

	MTN002B	日			
102400724	24 苏州高新 MTN004	2024 年 7 月 1 日	101.06	96,000	9,701,611.66
102480293	24 豫航空港 MTN002	2024 年 7 月 1 日	103.12	50,000	5,156,220.77
102480695	24 河钢集 MTN002	2024 年 7 月 1 日	101.81	50,000	5,090,503.84
102480845	24 西安高新 MTN006	2024 年 7 月 1 日	102.96	155,000	15,958,328.63
102481242	24 临沂城投 MTN002	2024 年 7 月 1 日	105.73	100,000	10,572,956.16
102481296	24 豫航空港 MTN004	2024 年 7 月 1 日	102.55	100,000	10,254,868.49
102481538	24 华发集团 MTN008	2024 年 7 月 1 日	101.59	100,000	10,158,849.32
102482732	24 江北新区 MTN005	2024 年 7 月 1 日	100.05	100,000	10,004,619.18
102482738	24 豫航空港 MTN012	2024 年 7 月 1 日	100.11	70,000	7,007,873.75
132480001	24 河钢集 GN001	2024 年 7 月 1 日	103.55	30,000	3,106,591.80
232400014	24 民生银行 二级资本债 01	2024 年 7 月 1 日	100.85	100,000	10,084,520.55
合计				1,001,000	102,357,256.48

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 14,800,000.00 元,于 2024 年 07 月 01 日先后到期。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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念,将风险管理融入业务中,建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负

责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，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 108.52%（上年度末：50.95%）。

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 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，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	2,783,692.30	-	-	-	2,783,692.30
结算备付金	1,756,384.67	-	-	-	1,756,384.67
存出保证金	59,483.16	-	-	-	59,483.16
交易性金融资产	88,210,102.36	259,131,151.91	45,526,404.97	35,336,029.68	428,203,688.92
应收股利	-	-	-	211.20	211.20
应收申购款	-	-	-	904,814.94	904,814.94
应收清算款	-	-	-	1,306,487.94	1,306,487.94
其他资产	-	-	-	19,409.03	19,409.03
资产总计	92,809,662.49	259,131,151.91	45,526,404.97	37,566,952.79	435,034,172.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,655,704.75	3,655,704.75
应付管理人报酬	-	-	-	129,764.56	129,764.56
应付托管费	-	-	-	25,952.95	25,952.95
应付清算款	-	-	-	2,486,198.17	2,486,198.17
卖出回购金融资产款	113,822,449.96	-	-	-	113,822,449.96
应付销售服务费	-	-	-	76,624.96	76,624.96
应交税费	-	-	-	19,494.46	19,494.46
其他负债	-	-	-	271,530.43	271,530.43
负债总计	113,822,449.96	-	-	6,665,270.28	120,487,720.24
利率敏感度缺口	-21,012,787.47	259,131,151.91	45,526,404.97	30,901,682.51	314,546,451.92
上年度末 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	389,258.83	-	-	-	389,258.83
结算备付金	136,965.61	-	-	-	136,965.61
存出保证金	7,189.62	-	-	-	7,189.62
交易性金融资产	6,174,191.14	4,870,560.50	-	1,352,652.00	12,397,403.64
应收申购款	-	-	-	85,909.51	85,909.51
资产总计	6,707,605.20	4,870,560.50	-	1,438,561.51	13,016,727.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	10.09	10.09
应付管理人报酬	-	-	-	4,521.77	4,521.77

应付托管费	-	-	-	904.34	904.34
应付清算款	-	-	-	257,894.11	257,894.11
卖出回购金融资产款	1,220,446.13	-	-	-	1,220,446.13
应付销售服务费	-	-	-	3,123.08	3,123.08
应交税费	-	-	-	81.15	81.15
其他负债	-	-	-	50,384.49	50,384.49
负债总计	1,220,446.13	-	-	316,919.03	1,537,365.16
利率敏感度缺口	5,487,159.07	4,870,560.50	-	1,121,642.48	11,479,362.05

注：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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-3,898,216.52	-33,987.69
市场利率下降25个基点	4,028,764.79	34,291.30	

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,046,248.12	-	4,046,248.12
资产合计	-	4,046,248.12	-	4,046,248.12

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,046,248.12	-	4,046,248.12
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

注:无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
	所有外币相对于人民币贬值 5%		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对于人民币贬值 5%	-202,312.41	-
	所有外币相对于人民币升值 5%	202,312.41	-

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，

所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	35,336,029.68	11.23	1,352,652.00	11.78
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	35,336,029.68	11.23	1,352,652.00	11.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深300指数”以外的其他市场变量保持不变		
	沪深300指数上升5%		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）	
分析	沪深300指数上升5%	-	-
	沪深300指数下降5%	-	-

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11.23%（上年度末：11.78%），因此除市场利率和外币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）。

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	76,402,402.97	2,835,497.94
第二层次	351,801,285.95	9,561,905.70
第三层次	-	-
合计	428,203,688.92	12,397,403.64

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	35,336,029.68	8.12
	其中：股票	35,336,029.68	8.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	392,867,659.24	90.31
	其中：债券	392,867,659.24	90.31
	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	4,540,076.97	1.04
8	其他各项资产	2,290,406.27	0.53
9	合计	435,034,172.16	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 4,046,248.12 元，占净值比例 1.29%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,401,185.00	3.31
C	制造业	16,009,575.56	5.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	508,939.00	0.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	660,000.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,783,157.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	304,665.00	0.10
J	金融业	1,604,989.00	0.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,271.00	0.01

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	-	-
S	综合	-	-
	合计	31,289,781.56	9.95

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	841,454.45	0.27
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	-	-
能源	1,235,723.08	0.39
金融	674,068.94	0.21
医疗	-	-
工业	-	-
地产业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	1,295,001.65	0.41
公用事业	-	-
合计	4,046,248.12	1.29

注：以上分类采用全球行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601088	中国神华	44,500	1,974,465.00	0.63
1	01088	中国神华	9,000	295,297.61	0.09
2	601899	紫金矿业	107,200	1,883,504.00	0.60
3	000333	美的集团	27,900	1,799,550.00	0.57
4	600031	三一重工	107,400	1,772,100.00	0.56
5	601225	陕西煤业	68,700	1,770,399.00	0.56
6	600036	招商银行	45,900	1,569,321.00	0.50
7	00883	中国海洋石油	46,000	940,425.47	0.30
7	600938	中国海油	18,100	597,300.00	0.19
8	000528	柳工	125,700	1,406,583.00	0.45
9	688012	中微公司	9,437	1,333,070.62	0.42
10	688169	石头科技	3,211	1,260,638.60	0.40
11	00700	腾讯控股	3,500	1,189,587.11	0.38
12	601598	中国外运	209,700	1,180,611.00	0.38
13	601600	中国铝业	153,800	1,173,494.00	0.37
14	601001	晋控煤业	70,700	1,167,964.00	0.37

15	600988	赤峰黄金	66,100	1,080,074.00	0.34
16	600150	中国船舶	21,900	891,549.00	0.28
17	000552	甘肃能化	251,600	873,052.00	0.28
18	01378	中国宏桥	78,000	841,454.45	0.27
19	601918	新集能源	83,100	810,225.00	0.26
20	600584	长电科技	24,700	783,237.00	0.25
21	00939	建设银行	128,000	674,068.94	0.21
22	601028	玉龙股份	52,800	660,000.00	0.21
23	601702	华峰铝业	33,700	615,362.00	0.20
24	600026	中远海能	38,600	602,546.00	0.19
25	300124	汇川技术	11,200	574,560.00	0.18
26	002859	洁美科技	23,900	479,912.00	0.15
27	600023	浙能电力	66,900	475,659.00	0.15
28	000039	中集集团	50,600	468,556.00	0.15
29	300502	新易盛	4,300	453,865.00	0.14
30	601766	中国中车	60,000	450,600.00	0.14
31	601137	博威合金	28,000	426,720.00	0.14
32	002384	东山精密	17,000	351,900.00	0.11
33	601233	桐昆股份	21,000	335,160.00	0.11
34	601799	星宇股份	2,800	313,712.00	0.10
35	603383	顶点软件	9,500	304,665.00	0.10
36	688981	中芯国际	6,119	282,085.90	0.09
37	603019	中科曙光	6,600	273,900.00	0.09
38	603225	新凤鸣	16,600	258,794.00	0.08
39	000902	新洋丰	21,400	254,018.00	0.08
40	00941	中国移动	1,500	105,414.54	0.03
41	600348	华阳股份	9,400	93,624.00	0.03
42	601958	金钼股份	7,400	77,034.00	0.02
43	601666	平煤股份	3,200	35,840.00	0.01
44	600547	山东黄金	1,300	35,594.00	0.01
45	601658	邮储银行	6,600	33,462.00	0.01
46	600098	广州发展	5,200	33,280.00	0.01
47	600933	爱柯迪	1,700	25,143.00	0.01
48	600521	华海药业	1,400	23,870.00	0.01
49	603018	华设集团	1,900	17,271.00	0.01
50	002142	宁波银行	100	2,206.00	0.00
51	002128	电投能源	100	2,110.00	0.00
52	688041	海光信息	17	1,195.44	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	600036	招商银行	3,889,894.00	33.89
2	601088	中国神华	3,249,607.00	28.31
2	01088	中国神华	299,933.79	2.61
3	600031	三一重工	3,408,260.00	29.69
4	601899	紫金矿业	3,335,912.00	29.06
5	601225	陕西煤业	3,317,003.00	28.90
6	600985	淮北矿业	3,198,489.00	27.86
7	000034	神州数码	3,090,913.00	26.93
8	600988	赤峰黄金	2,680,060.00	23.35
9	600188	兖矿能源	2,609,308.00	22.73
10	000333	美的集团	2,511,571.00	21.88
11	601001	晋控煤业	2,308,409.00	20.11
12	601699	潞安环能	2,127,061.00	18.53
13	000690	宝新能源	2,059,933.00	17.94
14	000657	中钨高新	2,042,873.10	17.80
15	600150	中国船舶	2,007,637.00	17.49
16	600276	恒瑞医药	1,964,944.00	17.12
17	000568	泸州老窖	1,940,242.00	16.90
18	002111	威海广泰	1,925,260.80	16.77
19	00883	中国海洋石油	966,989.82	8.42
19	600938	中国海油	941,630.00	8.20
20	600023	浙能电力	1,863,623.00	16.23
21	601600	中国铝业	1,836,897.00	16.00
22	002126	银轮股份	1,829,904.00	15.94
23	300498	温氏股份	1,775,980.00	15.47
24	603993	洛阳钼业	1,771,633.00	15.43
25	300502	新易盛	1,764,458.00	15.37
26	002714	牧原股份	1,743,965.00	15.19
27	603019	中科曙光	1,724,710.00	15.02
28	601598	中国外运	1,712,141.00	14.91
29	002142	宁波银行	1,700,661.00	14.81
30	603878	武进不锈	1,675,575.00	14.60
31	688169	石头科技	1,623,962.15	14.15
32	600519	贵州茅台	1,507,474.00	13.13
33	300049	福瑞股份	1,505,141.00	13.11
34	300750	宁德时代	1,500,405.00	13.07
35	300693	盛弘股份	1,497,224.00	13.04
36	000425	徐工机械	1,496,442.00	13.04
37	688037	芯源微	1,492,578.72	13.00
38	603383	顶点软件	1,487,409.75	12.96
39	300856	科思股份	1,434,523.00	12.50
40	688012	中微公司	1,406,578.38	12.25
41	000528	柳工	1,390,279.00	12.11

42	601689	拓普集团	1,366,889.00	11.91
43	002371	北方华创	1,297,525.00	11.30
44	601666	平煤股份	1,291,411.50	11.25
45	603067	振华股份	1,255,285.00	10.94
46	300274	阳光电源	1,254,290.00	10.93
47	00700	腾讯控股	1,245,390.47	10.85
48	601702	华峰铝业	1,232,286.00	10.73
49	600027	华电国际	1,222,398.00	10.65
50	300298	三诺生物	1,184,220.00	10.32
51	601918	新集能源	1,160,734.00	10.11
52	601028	玉龙股份	1,154,832.00	10.06
53	002043	兔宝宝	1,148,207.00	10.00
54	600600	青岛啤酒	1,136,433.00	9.90
55	301096	百诚医药	1,134,293.00	9.88
56	000708	中信特钢	1,103,433.00	9.61
57	601166	兴业银行	1,095,860.00	9.55
58	600348	华阳股份	1,093,257.00	9.52
59	601138	工业富联	1,085,143.00	9.45
60	600026	中远海能	1,071,744.00	9.34
61	688036	传音控股	1,029,815.16	8.97
62	688041	海光信息	1,022,388.68	8.91
63	002444	巨星科技	1,011,834.00	8.81
64	601101	昊华能源	998,151.00	8.70
65	601766	中国中车	986,959.00	8.60
66	688187	时代电气	947,739.67	8.26
67	603477	巨星农牧	944,365.00	8.23
68	600547	山东黄金	943,528.00	8.22
69	002155	湖南黄金	941,352.00	8.20
70	601958	金钼股份	936,725.00	8.16
71	09926	康方生物	935,179.20	8.15
72	600941	中国移动	799,770.00	6.97
72	00941	中国移动	133,432.79	1.16
73	301155	海力风电	925,785.00	8.06
74	601995	中金公司	911,916.00	7.94
75	300394	天孚通信	909,659.00	7.92
76	000552	甘肃能化	903,292.00	7.87
77	01378	中国宏桥	897,796.74	7.82
78	603606	东方电缆	893,551.00	7.78
79	688777	中控技术	887,290.28	7.73
80	300373	扬杰科技	885,263.00	7.71
81	688111	金山办公	884,689.98	7.71
82	605077	华康股份	874,954.00	7.62
83	002487	大金重工	872,222.00	7.60

84	601137	博威合金	871,866.00	7.60
85	601658	邮储银行	855,953.00	7.46
86	601038	一拖股份	807,549.00	7.03
87	600919	江苏银行	770,689.00	6.71
88	600048	保利发展	767,183.00	6.68
89	600584	长电科技	747,670.00	6.51
90	601100	恒立液压	743,659.00	6.48
91	03690	美团-W	731,214.32	6.37
92	00688	中国海外发展	730,272.62	6.36
93	000858	五粮液	728,193.00	6.34
94	002463	沪电股份	676,254.00	5.89
95	00939	建设银行	675,064.77	5.88
96	002080	中材科技	659,097.00	5.74
97	603596	伯特利	647,395.00	5.64
98	603612	索通发展	625,362.00	5.45
99	000596	古井贡酒	617,714.00	5.38
100	002668	TCL 智家	608,738.00	5.30
101	300124	汇川技术	601,571.00	5.24
102	603659	璞泰来	599,621.00	5.22
103	688308	欧科亿	599,300.64	5.22
104	603300	华铁应急	597,051.00	5.20
105	601825	沪农商行	594,301.00	5.18
106	002452	长高电新	583,921.00	5.09
107	600536	中国软件	582,354.00	5.07
108	601668	中国建筑	580,915.00	5.06
109	688697	纽威数控	580,759.80	5.06
110	002128	电投能源	579,896.00	5.05
111	601233	桐昆股份	554,215.00	4.83
112	002230	科大讯飞	551,103.00	4.80
113	603199	九华旅游	545,004.00	4.75
114	600585	海螺水泥	542,836.00	4.73
115	603556	海兴电力	542,728.00	4.73
116	000408	藏格矿业	542,197.00	4.72
117	601186	中国铁建	540,645.00	4.71
118	002709	天赐材料	533,549.00	4.65
119	603278	大业股份	530,664.00	4.62
120	600961	株冶集团	527,898.00	4.60
121	601882	海天精工	524,947.00	4.57
122	688506	百利天恒	513,203.50	4.47
123	600098	广州发展	509,413.00	4.44
124	002594	比亚迪	506,500.00	4.41
125	688425	铁建重工	506,299.52	4.41
126	00317	中船防务	331,018.10	2.88

126	600685	中船防务	166,234.00	1.45
127	002859	洁美科技	494,350.00	4.31
128	600933	爱柯迪	488,497.00	4.26
129	300371	汇中股份	482,687.00	4.20
130	300260	新莱应材	480,537.00	4.19
131	000039	中集集团	473,278.00	4.12
132	300624	万兴科技	468,199.00	4.08
133	688059	华锐精密	464,247.94	4.04
134	300442	润泽科技	459,252.00	4.00
135	600096	云天化	449,215.00	3.91
136	600809	山西汾酒	431,991.00	3.76
137	688627	精智达	429,911.79	3.75
138	002597	金禾实业	428,763.00	3.74
139	300857	协创数据	427,466.00	3.72
140	003021	兆威机电	426,806.80	3.72
141	600559	老白干酒	411,951.00	3.59
142	600557	康缘药业	409,437.00	3.57
143	603728	鸣志电器	409,293.00	3.57
144	600346	恒力石化	406,781.00	3.54
145	300636	同和药业	401,494.00	3.50
146	002812	恩捷股份	398,216.00	3.47
147	688636	智明达	397,045.08	3.46
148	000729	燕京啤酒	386,300.00	3.37
149	000932	华菱钢铁	375,915.00	3.27
150	002920	德赛西威	374,543.00	3.26
151	600521	华海药业	360,780.80	3.14
152	603136	天目湖	358,706.00	3.12
153	600066	宇通客车	347,361.00	3.03
154	003816	中国广核	345,858.00	3.01
155	002408	齐翔腾达	341,924.00	2.98
156	601989	中国重工	340,340.00	2.96
157	000625	长安汽车	334,006.00	2.91
158	600535	天士力	330,058.00	2.88
159	002384	东山精密	319,567.00	2.78
160	601799	星宇股份	314,131.00	2.74
161	000157	中联重科	308,622.00	2.69
162	688326	经纬恒润	301,518.78	2.63
163	000682	东方电子	291,840.00	2.54
164	688981	中芯国际	291,622.46	2.54
165	002810	山东赫达	285,848.00	2.49
166	002837	英维克	285,004.00	2.48
167	600012	皖通高速	271,568.00	2.37
168	603018	华设集团	269,755.00	2.35

169	000902	新洋丰	261,718.00	2.28
170	603225	新凤鸣	251,434.00	2.19
171	688177	百奥泰	251,081.63	2.19
172	300308	中际旭创	240,694.00	2.10
173	603816	顾家家居	238,630.00	2.08
174	002847	盐津铺子	234,988.00	2.05

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000034	神州数码	3,048,661.00	26.56
2	600985	淮北矿业	3,031,385.00	26.41
3	600188	兖矿能源	2,550,520.00	22.22
4	600036	招商银行	2,298,818.00	20.03
5	601699	潞安环能	2,054,435.00	17.90
6	002111	威海广泰	2,037,257.00	17.75
7	000690	宝新能源	1,993,962.00	17.37
8	300498	温氏股份	1,921,640.00	16.74
9	002126	银轮股份	1,912,327.00	16.66
10	000657	中钨高新	1,855,918.00	16.17
11	600276	恒瑞医药	1,844,283.00	16.07
12	002714	牧原股份	1,825,420.00	15.90
13	603993	洛阳钼业	1,758,861.00	15.32
14	000568	泸州老窖	1,756,037.00	15.30
15	601225	陕西煤业	1,741,081.00	15.17
16	002142	宁波银行	1,612,739.00	14.05
17	601088	中国神华	1,600,697.00	13.94
18	603878	武进不锈	1,551,797.00	13.52
19	600023	浙能电力	1,538,809.00	13.41
20	600031	三一重工	1,524,189.00	13.28
21	688037	芯源微	1,515,193.40	13.20
22	300750	宁德时代	1,515,103.00	13.20
23	600519	贵州茅台	1,490,448.00	12.98
24	300693	盛弘股份	1,485,422.00	12.94
25	000425	徐工机械	1,474,477.00	12.84
26	601899	紫金矿业	1,453,068.00	12.66
27	601689	拓普集团	1,416,062.00	12.34
28	300049	福瑞股份	1,405,183.00	12.24
29	600988	赤峰黄金	1,388,759.00	12.10
30	603019	中科曙光	1,376,952.00	12.00
31	601666	平煤股份	1,363,262.00	11.88
32	002371	北方华创	1,359,167.00	11.84

33	300502	新易盛	1,329,516.00	11.58
34	300298	三诺生物	1,279,976.00	11.15
35	300856	科思股份	1,257,607.00	10.96
36	600027	华电国际	1,221,986.00	10.65
37	600150	中国船舶	1,216,843.00	10.60
38	300274	阳光电源	1,197,566.00	10.43
39	600348	华阳股份	1,152,092.00	10.04
40	601101	昊华能源	1,145,865.00	9.98
41	603067	振华股份	1,129,379.00	9.84
42	603383	顶点软件	1,110,306.84	9.67
43	601166	兴业银行	1,108,790.00	9.66
44	002043	兔宝宝	1,070,517.00	9.33
45	600600	青岛啤酒	1,060,213.00	9.24
46	601138	工业富联	1,048,193.00	9.13
47	002444	巨星科技	1,044,299.00	9.10
48	301096	百诚医药	1,029,984.00	8.97
49	601001	晋控煤业	1,028,389.00	8.96
50	688041	海光信息	1,028,134.21	8.96
51	000708	中信特钢	1,003,704.00	8.74
52	600547	山东黄金	981,843.00	8.55
53	603477	巨星农牧	948,681.00	8.26
54	603606	东方电缆	936,601.00	8.16
55	688036	传音控股	931,518.14	8.11
56	601995	中金公司	923,261.00	8.04
57	002155	湖南黄金	922,212.00	8.03
58	688187	时代电气	921,720.58	8.03
59	301155	海力风电	917,918.00	8.00
60	300394	天孚通信	901,239.00	7.85
61	605077	华康股份	899,958.30	7.84
62	09926	康方生物	886,612.43	7.72
63	601958	金钼股份	885,886.00	7.72
64	002487	大金重工	857,525.00	7.47
65	600941	中国移动	817,233.00	7.12
65	00941	中国移动	30,739.31	0.27
66	600048	保利发展	830,249.00	7.23
67	300373	扬杰科技	823,099.00	7.17
68	688777	中控技术	808,786.49	7.05
69	688111	金山办公	783,253.56	6.82
70	601658	邮储银行	782,209.00	6.81
71	03690	美团-W	778,988.34	6.79
72	601038	一拖股份	753,803.00	6.57
73	600919	江苏银行	752,612.00	6.56
74	000858	五粮液	737,707.00	6.43

75	002668	TCL 智家	715,175.00	6.23
76	601100	恒立液压	704,191.00	6.13
77	688308	欧科亿	689,325.52	6.00
78	002080	中材科技	682,348.00	5.94
79	603300	华铁应急	670,084.00	5.84
80	00688	中国海外发展	669,855.14	5.84
81	002463	沪电股份	667,757.00	5.82
82	603596	伯特利	654,493.00	5.70
83	000596	古井贡酒	652,616.00	5.69
84	000333	美的集团	635,394.00	5.54
85	002128	电投能源	634,858.00	5.53
86	601702	华峰铝业	582,848.00	5.08
87	601668	中国建筑	582,030.00	5.07
88	601825	沪农商行	577,320.00	5.03
89	603659	璞泰来	575,668.29	5.01
90	601600	中国铝业	571,095.00	4.97
91	688697	纽威数控	569,544.70	4.96
92	603612	索通发展	567,039.00	4.94
93	603556	海兴电力	566,208.00	4.93
94	601598	中国外运	561,568.00	4.89
95	600536	中国软件	560,330.88	4.88
96	688506	百利天恒	558,847.24	4.87
97	002452	长高电新	556,990.00	4.85
98	601766	中国中车	553,062.00	4.82
99	601186	中国铁建	552,948.00	4.82
100	601882	海天精工	538,238.00	4.69
101	601028	玉龙股份	535,806.00	4.67
102	002230	科大讯飞	533,882.00	4.65
103	002594	比亚迪	530,694.00	4.62
104	300442	润泽科技	529,585.00	4.61
105	603278	大业股份	527,541.79	4.60
106	000408	藏格矿业	515,221.00	4.49
107	600585	海螺水泥	509,432.00	4.44
108	00317	中船防务	339,492.74	2.96
108	600685	中船防务	167,700.00	1.46
109	002709	天赐材料	490,117.00	4.27
110	688059	华锐精密	488,227.76	4.25
111	688425	铁建重工	481,586.79	4.20
112	600961	株冶集团	479,106.00	4.17
113	600026	中远海能	474,213.00	4.13
114	600346	恒力石化	471,163.00	4.10
115	600098	广州发展	451,933.00	3.94
116	300260	新莱应材	450,940.00	3.93

117	600933	爱柯迪	441,008.00	3.84
118	603199	九华旅游	440,915.00	3.84
119	600938	中国海油	438,242.00	3.82
120	600559	老白干酒	435,112.00	3.79
121	300371	汇中股份	431,942.00	3.76
122	600809	山西汾酒	431,349.00	3.76
123	300624	万兴科技	426,068.00	3.71
124	003021	兆威机电	422,623.00	3.68
125	000729	燕京啤酒	413,170.00	3.60
126	600096	云天化	406,720.00	3.54
127	688636	智明达	399,296.98	3.48
128	000932	华菱钢铁	397,120.00	3.46
129	300857	协创数据	392,313.00	3.42
130	601137	博威合金	392,068.00	3.42
131	601918	新集能源	383,188.00	3.34
132	002597	金禾实业	381,636.00	3.32
133	688627	精智达	381,626.93	3.32
134	002812	恩捷股份	379,263.00	3.30
135	300636	同和药业	371,954.00	3.24
136	601989	中国重工	370,172.00	3.22
137	603728	鸣志电器	360,484.00	3.14
138	603136	天目湖	359,054.00	3.13
139	002920	德赛西威	358,208.00	3.12
140	000157	中联重科	353,624.00	3.08
141	600557	康缘药业	352,390.00	3.07
142	000625	长安汽车	349,077.00	3.04
143	003816	中国广核	346,524.00	3.02
144	002408	齐翔腾达	334,097.00	2.91
145	600521	华海药业	328,051.00	2.86
146	688326	经纬恒润	317,280.40	2.76
147	600535	天士力	298,691.00	2.60
148	600012	皖通高速	294,165.00	2.56
149	600066	宇通客车	293,862.00	2.56
150	300308	中际旭创	283,500.00	2.47
151	688169	石头科技	276,300.03	2.41
152	000682	东方电子	275,333.00	2.40
153	002810	山东赫达	266,499.00	2.32
154	002837	英维克	261,485.00	2.28
155	002847	盐津铺子	259,359.00	2.26
156	300760	迈瑞医疗	243,541.00	2.12
157	603018	华设集团	240,951.00	2.10
158	603816	顾家家居	231,636.00	2.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	179,895,044.78
卖出股票收入（成交）总额	143,687,457.25

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	36,033,503.71	11.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	55,953,266.77	17.79
	其中：政策性金融债	15,494,212.53	4.93
4	企业债券	57,278,243.83	18.21
5	企业短期融资券	4,962,255.72	1.58
6	中期票据	185,854,955.21	59.09
7	可转债（可交换债）	41,066,373.29	13.06
8	同业存单	-	-
9	其他	11,719,060.71	3.73
10	合计	392,867,659.24	124.90

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	230023	23 付息国债 23	300,000	33,807,344.26	10.75
2	242480003	24 广州农商行 永续债 01	200,000	20,365,433.42	6.47
3	240937	24 厦贸 Y3	200,000	20,199,972.60	6.42
4	242480005	24 杭州银行永 续债 01	200,000	20,093,620.82	6.39
5	102480850	24 吉利 MTN001(科创 票据)	170,000	17,321,281.37	5.51

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

本基金本报告期无国债期货投资。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

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，杭州银行股份有限公司、广州农村商业银行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规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

7.11.3 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	59,483.16
2	应收清算款	1,306,487.94
3	应收股利	211.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	904,814.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	19,409.03
8	其他	-
9	合计	2,290,406.27

7.11.4 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	113065	齐鲁转债	2,398,509.85	0.76
2	113055	成银转债	1,954,652.58	0.62
3	118036	力合转债	1,571,810.63	0.50
4	118031	天23转债	1,392,768.49	0.44
5	123185	能辉转债	1,360,052.70	0.43
6	127101	豪鹏转债	1,292,941.24	0.41
7	123226	中富转债	1,163,457.86	0.37
8	113046	金田转债	1,145,452.60	0.36
9	110079	杭银转债	1,113,473.89	0.35

10	110086	精工转债	1,093,667.12	0.35
11	113059	福莱转债	1,068,120.55	0.34
12	118043	福立转债	1,009,075.39	0.32
13	113662	豪能转债	980,245.78	0.31
14	113677	华懋转债	975,970.18	0.31
15	111003	聚合转债	930,956.73	0.30
16	113052	兴业转债	915,521.50	0.29
17	123234	中能转债	864,788.38	0.27
18	123193	海能转债	839,513.94	0.27
19	123200	海泰转债	827,555.12	0.26
20	113654	永 02 转债	815,841.53	0.26
21	123085	万顺转 2	801,933.90	0.25
22	127075	百川转 2	794,575.73	0.25
23	118034	晶能转债	780,984.99	0.25
24	113639	华正转债	710,936.74	0.23
25	118012	微芯转债	678,148.44	0.22
26	123190	道氏转 02	646,122.05	0.21
27	113050	南银转债	639,601.62	0.20
28	113640	苏利转债	619,909.32	0.20
29	128105	长集转债	616,244.71	0.20
30	127094	红墙转债	606,289.97	0.19
31	123191	智尚转债	604,531.61	0.19
32	123182	广联转债	581,953.42	0.19
33	123197	光力转债	580,655.07	0.18
34	127068	顺博转债	557,368.60	0.18
35	123219	宇瞳转债	552,856.92	0.18
36	123202	祥源转债	537,745.62	0.17
37	123166	蒙泰转债	496,884.66	0.16
38	128144	利民转债	491,786.99	0.16
39	111009	盛泰转债	477,293.15	0.15
40	123217	富仕转债	460,206.50	0.15
41	111010	立昂转债	458,177.77	0.15
42	127093	章鼓转债	453,843.29	0.14
43	127054	双箭转债	422,241.94	0.13
44	113679	芯能转债	418,518.89	0.13
45	118040	宏微转债	366,264.92	0.12
46	123231	信测转债	358,267.73	0.11
47	113030	东风转债	324,188.73	0.10
48	123131	奥飞转债	314,221.78	0.10
49	123227	雅创转债	313,480.47	0.10
50	123161	强联转债	186,861.62	0.06
51	113062	常银转债	2,447.07	0.00
52	127088	赫达转债	1,112.39	0.00

53	123235	亿田转债	831.50	0.00
----	--------	------	--------	------

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

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 (%)
平安添润债券 A	1,172	103,123.36	108,777,460.61	90.00	12,083,113.75	10.00
平安添润债券 C	9,558	17,904.57	49,346,761.63	28.84	121,785,132.84	71.16
合计	10,615	27,507.53	158,124,222.24	54.15	133,868,246.59	45.85

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	平安添润债券 A	1,202,417.64	0.9949
	平安添润债券 C	276,987.46	0.1619
	合计	1,479,405.10	0.5067

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	平安添润债券 A	10~50
	平安添润债券 C	0

	合计	10~50
本基金基金经理持有本 开放式基金	平安添润债券 A	0~10
	平安添润债券 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安添润债券 A	平安添润债券 C
基金合同生效日 (2022 年 11 月 17 日) 基金份额总额	251,128,828.71	69,409,720.52
本报告期期初基金份 额总额	234,512.68	11,102,395.68
本报告期基金总申购 份额	130,721,033.17	663,099,050.86
减：本报告期基金总 赎回份额	10,094,971.49	503,069,552.07
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	120,860,574.36	171,131,894.47

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人自 2023 年 12 月 4 日至 2023 年 12 月 29 日 17:00 以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议审议并通过了《关于持续运作平安添润债券型证券投资基金的议案》。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。
本报告期内，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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东北证券	3	104,108,403.64	32.18	76,614.30	32.10	-
东吴证券	2	54,920,122.96	16.98	40,416.20	16.93	-
申万宏源证券	2	52,640,095.67	16.27	38,735.98	16.23	-
开源证券	2	45,235,663.48	13.98	33,288.97	13.95	-
国信证券	2	29,931,694.41	9.25	22,109.72	9.26	-
国泰君安证券	2	12,320,453.33	3.81	9,066.75	3.80	新增1个
长江证券	1	9,435,826.00	2.92	6,943.79	2.91	-
天风证券	2	8,407,234.43	2.60	6,725.81	2.82	-
华创证券	2	3,071,022.30	0.95	2,260.24	0.95	-
中信证券	3	3,034,905.00	0.94	2,233.35	0.94	退租1个
西部证券	1	423,516.53	0.13	311.69	0.13	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-

方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	退租 1 个
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	退租 2 个
世纪证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	退租 2 个
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	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(%)

东北证 券	122,367,698 .29	32.00	-	-	-	-
东吴证 券	51,651,395. 39	13.51	36,900,000.0 0	16.41	-	-
申万宏 源证券	27,013,454. 08	7.07	83,043,000.0 0	36.93	-	-
开源证 券	31,613,770. 76	8.27	17,500,000.0 0	7.78	-	-
国信证 券	95,868,842. 97	25.07	14,947,000.0 0	6.65	-	-
国泰君 安证券	16,518,300. 01	4.32	43,803,000.0 0	19.48	-	-
长江证 券	16,858,506. 89	4.41	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	7,429,533.4 6	1.94	26,200,000.0 0	11.65	-	-
中信证 券	12,997,372. 91	3.40	-	-	-	-
西部证 券	22,495.20	0.01	2,500,000.00	1.11	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
大通证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-

海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

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	平安添润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	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月03日
2	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	2024年01月15日
3	平安添润债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月22日
4	平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年02月03日

5	平安添润债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 02 月 07 日
6	平安添润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	2024 年 02 月 08 日
7	平安添润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	2024 年 02 月 08 日
8	平安基金管理有限公司关于新增海通证券股份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	2024 年 02 月 29 日
9	平安基金管理有限公司关于新增旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 15 日
10	平安基金管理有限公司关于旗下基金参与中国平安人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 15 日
11	平安添润债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 30 日
12	平安添润债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 22 日
13	平安添润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	2024 年 05 月 31 日
14	平安添润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	2024 年 05 月 31 日
15	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 06 月 13 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024 年 01 月 01 日-2024 年 03 月 07 日	5,130,309.87	0.00	0.00	5,130,309.87	1.76
	2	2024 年 01 月 01 日-2024 年 03 月 07 日; 2024 年 03 月 18 日-2024 年 03 月 24 日; 2024 年 04 月	5,065,467.32	16,113,744.08	0.00	21,179,211.40	7.25

		01 日-2024 年 04 月 01 日					
	3	2024 年 06 月 25 日-2024 年 06 月 30 日	0.00	92,663,7 16.53	0.00	92,663,716.53	31.73
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为保护基金份额持有人的利益，依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定及《平安添润债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，经与基金托管人平安银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）协商一致，基金管理人平安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定自 2023 年 12 月 4 日至 2023 年 12 月 29 日 17:00 止以通讯方式召开平安添润债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会，审议《关于持续运作平安添润债券型证券投资基金的议案》。本次大会决议自 2024 年 1 月 2 日起生效。详细内容请阅读本公司于 2024 年 1 月 3 日发布的《平安添润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》。

§ 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添润债券型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安添润债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安添润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

2024 年 8 月 31 日