

# 平安瑞兴 1 年持有期混合型证券投资基金

## 2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 1 月 21 日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 01 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|             |  |                |
|-------------|--|----------------|
| 基金简称        | 平安瑞兴 1 年持有混合   |                |
| 基金主代码       | 010056   |                |
| 基金运作方式      | 契约型开放式   |                |
| 基金合同生效日     | 2020 年 11 月 4 日  |                |
| 报告期末基金份额总额  | 879,569,371.07 份   |                |
| 投资目标        | 本基金在严格控制风险的前提下，通过各类资产的合理配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。  |                |
| 投资策略        | 1、大类资产配置策略；2、股票投资策略（含港股通标的股票投资策略、存托凭证投资策略）；3、债券投资策略；4、可转换债券及可交换债券投资策略；5、基金投资策略；6、股指期货投资策略；7、国债期货投资策略；8、股票期权投资策略；9、现金头寸管理；10、信用衍生品投资策略；11、资产支持证券投资策略。 |                |
| 业绩比较基准      | 中债新综合指数收益率 $\times$ 80% + 沪深 300 指数收益率 $\times$ 15% + 恒生指数收益率（经汇率调整） $\times$ 5%   |                |
| 风险收益特征      | 本基金是混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。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。   |                |
| 基金管理人       | 平安基金管理有限公司   |                |
| 基金托管人       | 中国邮政储蓄银行股份有限公司   |                |
| 下属分级基金的基金简称 | 平安瑞兴 1 年持有混合 A   | 平安瑞兴 1 年持有混合 C |

|                 |                  |                  |
|-----------------|------------------|------------------|
| 下属分级基金的交易代码     | 010056           | 010057           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 750,270,961.26 份 | 129,298,409.81 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日） |                |
|-----------------|---------------------------------------|----------------|
|                 | 平安瑞兴 1 年持有混合 A                        | 平安瑞兴 1 年持有混合 C |
| 1. 本期已实现收益      | 8,770,316.89                          | 1,958,728.55   |
| 2. 本期利润         | 11,875,670.40                         | 2,485,626.92   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0352                                | 0.0324         |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,001,750,874.30                      | 169,306,843.56 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3352                                | 1.3094         |

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；  
2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安瑞兴 1 年持有混合 A

| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 2.22%  | 0.31%         | 1.48%          | 0.31%                 | 0.74%  | 0.00%  |
| 过去六个月          | 5.63%  | 0.25%         | 4.98%          | 0.28%                 | 0.65%  | -0.03% |
| 过去一年           | 13.93% | 0.22%         | 7.23%          | 0.22%                 | 6.70%  | 0.00%  |
| 过去三年           | 24.96% | 0.22%         | 4.14%          | 0.18%                 | 20.82% | 0.04%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 33.52% | 0.22%         | 7.14%          | 0.18%                 | 26.38% | 0.04%  |

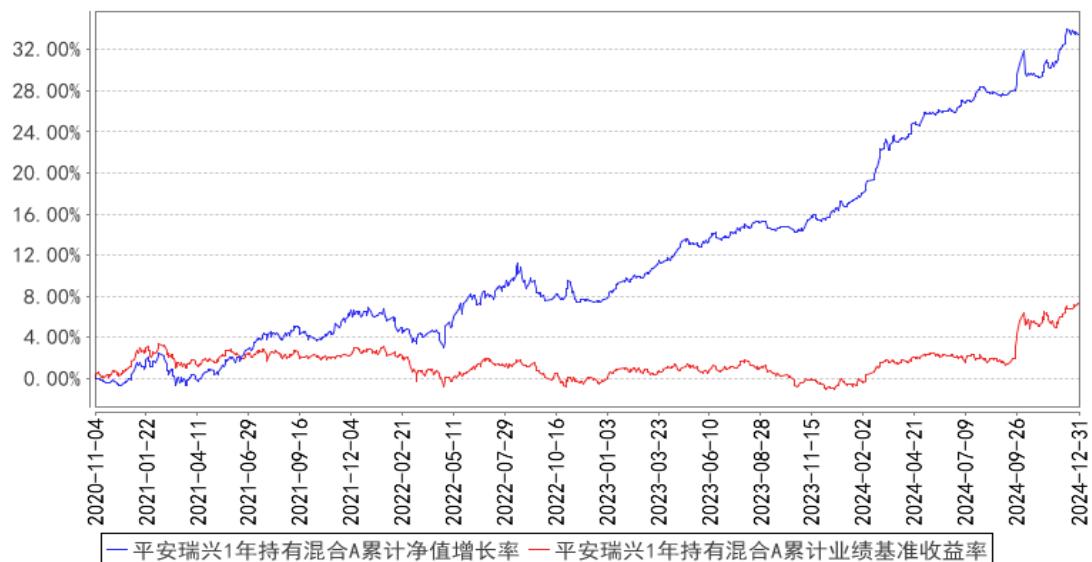
平安瑞兴 1 年持有混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|    |        |               |                |                       |     |     |

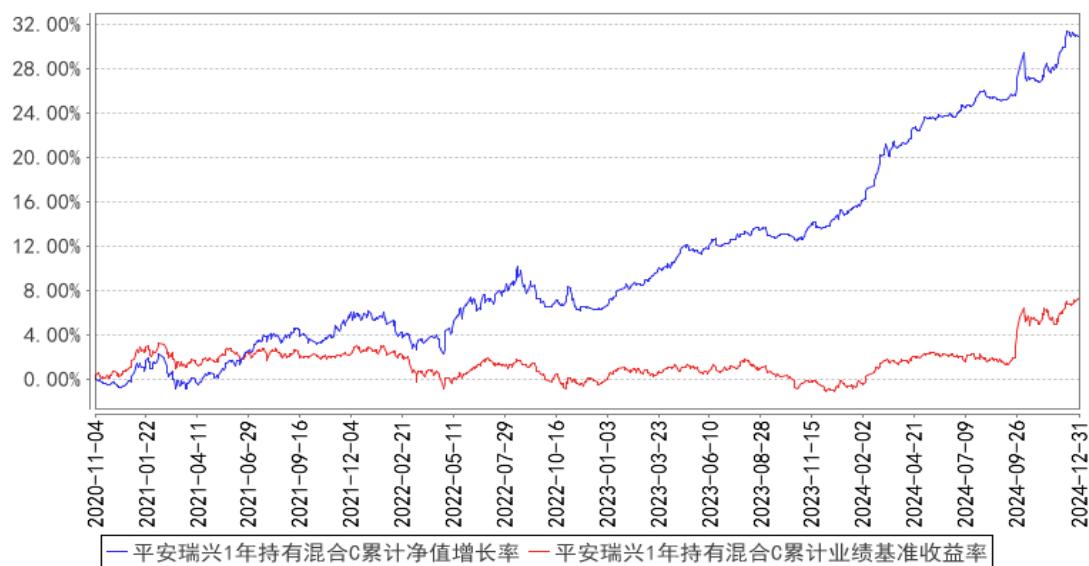
|                |        |       |       | 准差④   |        |        |
|----------------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 过去三个月          | 2.14%  | 0.31% | 1.48% | 0.31% | 0.66%  | 0.00%  |
| 过去六个月          | 5.50%  | 0.25% | 4.98% | 0.28% | 0.52%  | -0.03% |
| 过去一年           | 13.52% | 0.22% | 7.23% | 0.22% | 6.29%  | 0.00%  |
| 过去三年           | 23.27% | 0.22% | 4.14% | 0.18% | 19.13% | 0.04%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 30.94% | 0.22% | 7.14% | 0.18% | 23.80% | 0.04%  |

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

平安瑞兴1年持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安瑞兴 1 年持有混合 C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2020 年 11 月 04 日正式生效；

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

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                                    | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|---------------------------------------|-----------------|------|--------|--|
|     |                                       | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 高勇标 | 固定收益投资中心总监助理，平安瑞兴 1 年持有期混合型证券投资基金基金经理 | 2020 年 11 月 4 日 | -    | 14 年   | 高勇标先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017 年 4 月加入平安基金管理有限公司，曾任投资研究部固定收益组投资经理，现任固定收益投资中心总监助理，同时担任平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、平安瑞兴 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 |

|     |   |                   |   |      |  |
|-----|---|-------------------|---|------|--|
|     |   |                   |   |      | 基金、平安惠智纯债债券型证券投资基<br>金基金经理。  |
| 张文平 | 公司总经理助理兼<br>固定收益<br>投资总<br>监，平安<br>瑞兴 1 年<br>持有期混<br>合型证券<br>投资基金<br>基金经理 | 2024 年 8 月 7<br>日 | - | 13 年 | 张文平先生，南京大学硕士。先后担任<br>毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分<br>公司审计一部审计师、大成基金管理有<br>限公司固定收益部基金经理。2018 年 3<br>月加入平安基金管理有限公司，现任公<br>司总经理助理兼固定收益投资总监。同<br>时担任平安如意中短债债券型证券投资<br>基金、平安季享裕三个月定期开放债券<br>型证券投资基金、平安季开鑫三个月定<br>期开放债券型证券投资基金、平安惠铭<br>纯债债券型证券投资基金、平安惠澜纯<br>债债券型证券投资基金、平安鑫享混合<br>型证券投资基金、平安合颖定期开放纯<br>债债券型发起式证券投资基金、平安鼎<br>信债券型证券投资基金、平安惠泰纯债<br>债券型证券投资基金、平安瑞兴 1 年持<br>有期混合型证券投资基金、平安惠享纯<br>债债券型证券投资基金、平安合韵定期<br>开放纯债债券型发起式证券投资基金基<br>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。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度经济延续修复态势，但步伐有所分化。出口受全球需求波动影响，增长动力仍显不足；消费在促消费政策带动下温和回暖，成为稳定经济的重要支撑；投资方面，基建投资持续发力，制造业投资在产业升级驱动下保持一定韧性，房地产在政策刺激下出现一定程度的改善。整体经济增长内生动能逐步积聚，对完成全年 5% 的 GDP 增速目标信心有所提升。通胀方面，CPI 同比涨幅维持在相对低位，核心 CPI 走势平稳，反映出消费端物价上涨压力不大。PPI 受部分上游原材料价格波动及工业需求恢复节奏影响，虽有阶段性起伏，但整体水平仍然较低。货币政策方面，央行灵活运用多种货币政策工具，维持流动性合理充裕。公开市场操作精准调节资金面，MLF 等中长期资金投放适时适度，引导市场利率围绕政策利率窄幅波动。

整体来看，四季度债券市场延续了全年的牛市走势，但波动性也有所增加。四季度最重要的政策信号来自 12 月的中央政治局会议，明确提出“实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，加强超常规逆周期调节”，这一表述进一步打开了市场对货币政策的想象空间。在政策利好和机构配置“抢跑”情绪的推动下，10 年期国债收益率突破 2% 关键点位，并创下历史新高。四季度 A 股市场整体呈现震荡态势。“924 新政”及中共中央政治局会议释放积极信号，使 A 股在四季度初出现快速上涨。但随后因获利盘回吐等因素，沪指陷入震荡调整。板块方面，金融板块表现亮眼，银行、非银金融等涨幅居前；科技板块也较为活跃，电子、通信等在科技政策和内需政策预期推动下有较好表现。而与经济周期相关的消费、医药、房地产周期链条行业增长面临挑战。可转债市场方面，受益于股市回暖和债市走强的双重利好，四季度可转债市场估值水平有所修复，整体呈现震荡上行态势。

四季度本基金保持了投资组合的流动性，债券资产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；权益资产均衡配置于偏稳健的红利行业，季末加仓了部分估值相对较低的价值股，以及信用资质较好的可转债标的。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安瑞兴 1 年持有混合 A 的基金份额净值 1.3352 元, 本报告期基金份额净值增长率为 2.22%, 同期业绩比较基准收益率为 1.48%; 截至本报告期末平安瑞兴 1 年持有混合 C 的基金份额净值 1.3094 元, 本报告期基金份额净值增长率为 2.14%, 同期业绩比较基准收益率为 1.48%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                 | 金额 (元)           | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资               | 51,106,505.30    | 3.32          |
|    | 其中: 股票             | 51,106,505.30    | 3.32          |
| 2  | 基金投资               | 8,807,088.40     | 0.57          |
| 3  | 固定收益投资             | 1,265,852,660.88 | 82.20         |
|    | 其中: 债券             | 1,265,852,660.88 | 82.20         |
|    | 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       | 14,138,417.05    | 0.92          |
| 8  | 其他资产               | 200,095,569.14   | 12.99         |
| 9  | 合计                 | 1,540,000,240.77 | 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 18,030,715.56 元, 占净值比例 1.54%。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别           | 公允价值 (元)      | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业       | -             | -             |
| B  | 采矿业            | 16,821.00     | 0.00          |
| C  | 制造业            | 21,167,175.44 | 1.81          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供 | 932,499.00    | 0.08          |

|   |                 |               |      |
|---|-----------------|---------------|------|
|   | 应业              |               |      |
| E | 建筑业             | 293,919.16    | 0.03 |
| F | 批发和零售业          | 20,130.00     | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 2,629,781.14  | 0.22 |
| H | 住宿和餐饮业          | -             | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,477,242.00  | 0.30 |
| J | 金融业             | 4,529,362.00  | 0.39 |
| K | 房地产业            | 8,860.00      | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业        | -             | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      | -             | -    |
| 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              | 33,075,789.74 | 2.82 |

### 5.2.2 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     | -             | -            |
| 周期性消费品  | -             | -            |
| 非周期性消费品 | 6,098,214.17  | 0.52         |
| 能源      | 2,047,492.96  | 0.17         |
| 金融      | 1,058,819.32  | 0.09         |
| 医疗      | -             | -            |
| 工业      | 3,285,349.15  | 0.28         |
| 地产业     | 313,233.03    | 0.03         |
| 信息科技    | 670,360.36    | 0.06         |
| 电信服务    | 4,557,246.57  | 0.39         |
| 公用事业    | -             | -            |
| 合计      | 18,030,715.56 | 1.54         |

注：以上分类采用全球行业分类标准。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 00700  | 腾讯控股   | 11,100  | 4,286,361.35 | 0.37         |
| 2  | 600285 | 羚锐制药   | 190,000 | 4,210,400.00 | 0.36         |
| 3  | 300750 | 宁德时代   | 13,000  | 3,458,000.00 | 0.30         |
| 4  | 01800  | 中国交通建设 | 641,000 | 3,258,818.10 | 0.28         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 4  | 601800 | 中国交建 | 1,000   | 10,450.00    | 0.00 |
| 5  | 09896  | 名创优品 | 66,400  | 2,893,060.08 | 0.25 |
| 6  | 000651 | 格力电器 | 54,600  | 2,481,570.00 | 0.21 |
| 7  | 06181  | 老铺黄金 | 10,600  | 2,367,624.99 | 0.20 |
| 8  | 600160 | 巨化股份 | 97,900  | 2,361,348.00 | 0.20 |
| 9  | 601598 | 中国外运 | 433,700 | 2,320,295.00 | 0.20 |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 55,800  | 2,274,408.00 | 0.19 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 224,770,300.78   | 19.19        |
| 2  | 央行票据      | —                | —            |
| 3  | 金融债券      | 50,586,104.05    | 4.32         |
|    | 其中：政策性金融债 | 50,586,104.05    | 4.32         |
| 4  | 企业债券      | 232,811,775.61   | 19.88        |
| 5  | 企业短期融资券   | —                | —            |
| 6  | 中期票据      | 428,441,156.46   | 36.59        |
| 7  | 可转债(可交换债) | 69,476,889.46    | 5.93         |
| 8  | 同业存单      | 49,214,632.60    | 4.20         |
| 9  | 其他        | 210,551,801.92   | 17.98        |
| 10 | 合计        | 1,265,852,660.88 | 108.09       |

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

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 数量(张)     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 242115    | 24 兴业 C1       | 1,000,000 | 100,556,202.74 | 8.59         |
| 2  | 240558    | 24 厦贸 Y1       | 900,000   | 93,068,778.08  | 7.95         |
| 3  | 019756    | 24 特国 06       | 611,000   | 65,296,348.00  | 5.58         |
| 4  | 102485318 | 24 扬子国资 MTN004 | 600,000   | 60,546,690.41  | 5.17         |
| 5  | 148973    | 24 长城 C1       | 500,000   | 50,898,290.41  | 4.35         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险说明        |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-------------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -           |
| 公允价值变动总额合计(元)     |    |          |         |           | -           |
| 股指期货投资本期收益(元)     |    |          |         |           | 745,586.27  |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |    |          |         |           | -301,708.00 |

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为偏债混合型基金，以套期保值为目的开展股指期货投资，选择流动性好、交易活跃的期货合约进行交易。本基金投资基础资产为上证 50、沪深 300 和中证 500 的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理和套期保值为投资目标。

本基金参与股指期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。本基金投资基础资产为国债的国债期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理和套期保值为投资目标。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险指标说明        |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|---------------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -             |
| 公允价值变动总额合计(元)     |    |          |         |           | -             |
| 国债期货投资本期收益(元)     |    |          |         |           | -1,296,151.33 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) |    |          |         |           | -             |

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

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

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

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 239,642.09     |
| 2  | 应收证券清算款 | 175,036,956.80 |
| 3  | 应收股利    | 8,153.28       |
| 4  | 应收利息    | —              |
| 5  | 应收申购款   | 24,810,816.97  |
| 6  | 其他应收款   | —              |
| 7  | 其他      | —              |
| 8  | 合计      | 200,095,569.14 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称  | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------------|--------------|
| 1  | 113021 | 中信转债  | 10,833,157.02 | 0.93         |
| 2  | 113062 | 常银转债  | 7,260,964.07  | 0.62         |
| 3  | 118031 | 天23转债 | 6,682,525.36  | 0.57         |
| 4  | 113065 | 齐鲁转债  | 5,592,794.83  | 0.48         |
| 5  | 113050 | 南银转债  | 5,520,556.90  | 0.47         |
| 6  | 113669 | 景23转债 | 3,298,028.11  | 0.28         |
| 7  | 110081 | 闻泰转债  | 2,412,188.32  | 0.21         |
| 8  | 123131 | 奥飞转债  | 2,153,620.71  | 0.18         |
| 9  | 113055 | 成银转债  | 1,401,564.11  | 0.12         |
| 10 | 127091 | 科数转债  | 1,132,232.05  | 0.10         |
| 11 | 113636 | 甬金转债  | 1,130,253.78  | 0.10         |
| 12 | 123121 | 帝尔转债  | 1,117,489.12  | 0.10         |
| 13 | 110059 | 浦发转债  | 1,089,998.63  | 0.09         |
| 14 | 113640 | 苏利转债  | 1,082,991.78  | 0.09         |
| 15 | 123168 | 惠云转债  | 1,041,714.24  | 0.09         |
| 16 | 123224 | 宇邦转债  | 1,023,763.03  | 0.09         |
| 17 | 123198 | 金埔转债  | 998,284.95    | 0.09         |
| 18 | 123207 | 冠中转债  | 770,039.70    | 0.07         |
| 19 | 113677 | 华懋转债  | 490,037.81    | 0.04         |

|    |        |        |            |      |
|----|--------|--------|------------|------|
| 20 | 123109 | 昌红转债   | 475,891.64 | 0.04 |
| 21 | 113530 | 大丰转债   | 232,742.19 | 0.02 |
| 22 | 113043 | 财通转债   | 232,412.88 | 0.02 |
| 23 | 128125 | 华阳转债   | 228,378.90 | 0.02 |
| 24 | 113577 | 春秋转债   | 132,025.62 | 0.01 |
| 25 | 123187 | 超达转债   | 131,997.70 | 0.01 |
| 26 | 110079 | 杭银转债   | 129,091.18 | 0.01 |
| 27 | 127051 | 博杰转债   | 128,997.81 | 0.01 |
| 28 | 111008 | 沿浦转债   | 128,847.81 | 0.01 |
| 29 | 127053 | 豪美转债   | 128,839.59 | 0.01 |
| 30 | 127035 | 濮耐转债   | 127,526.58 | 0.01 |
| 31 | 123022 | 长信转债   | 126,996.85 | 0.01 |
| 32 | 113598 | 法兰转债   | 125,843.84 | 0.01 |
| 33 | 123088 | 威唐转债   | 125,789.42 | 0.01 |
| 34 | 118041 | 星球转债   | 125,515.01 | 0.01 |
| 35 | 118003 | 华兴转债   | 124,118.49 | 0.01 |
| 36 | 113039 | 嘉泽转债   | 123,352.88 | 0.01 |
| 37 | 113668 | 鹿山转债   | 123,028.22 | 0.01 |
| 38 | 123232 | 金现转债   | 122,898.36 | 0.01 |
| 39 | 123190 | 道氏转 02 | 122,334.79 | 0.01 |
| 40 | 113597 | 佳力转债   | 121,959.32 | 0.01 |
| 41 | 123138 | 丝路转债   | 121,472.19 | 0.01 |
| 42 | 123182 | 广联转债   | 120,912.33 | 0.01 |
| 43 | 123129 | 锦鸡转债   | 120,600.68 | 0.01 |
| 44 | 118004 | 博瑞转债   | 120,423.42 | 0.01 |
| 45 | 123201 | 纽泰转债   | 120,408.44 | 0.01 |
| 46 | 123076 | 强力转债   | 120,098.49 | 0.01 |
| 47 | 113047 | 旗滨转债   | 119,395.21 | 0.01 |
| 48 | 123126 | 瑞丰转债   | 119,023.01 | 0.01 |
| 49 | 123039 | 开润转债   | 118,946.82 | 0.01 |
| 50 | 113625 | 江山转债   | 117,980.68 | 0.01 |
| 51 | 113056 | 重银转债   | 117,962.47 | 0.01 |
| 52 | 123218 | 宏昌转债   | 117,597.81 | 0.01 |
| 53 | 123235 | 亿田转债   | 117,332.05 | 0.01 |
| 54 | 128144 | 利民转债   | 116,900.68 | 0.01 |
| 55 | 113565 | 宏辉转债   | 116,193.15 | 0.01 |
| 56 | 111018 | 华康转债   | 115,826.14 | 0.01 |
| 57 | 123199 | 山河转债   | 115,762.47 | 0.01 |
| 58 | 118039 | 煜邦转债   | 115,733.15 | 0.01 |
| 59 | 111000 | 起帆转债   | 115,449.86 | 0.01 |
| 60 | 123186 | 志特转债   | 115,052.47 | 0.01 |
| 61 | 113033 | 利群转债   | 114,464.93 | 0.01 |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 62 | 127019 | 国城转债    | 113,850.68 | 0.01 |
| 63 | 127088 | 赫达转债    | 113,809.45 | 0.01 |
| 64 | 110076 | 华海转债    | 113,116.71 | 0.01 |
| 65 | 127102 | 浙建转债    | 112,746.14 | 0.01 |
| 66 | 123162 | 东杰转债    | 111,423.15 | 0.01 |
| 67 | 113654 | 永 02 转债 | 111,078.77 | 0.01 |
| 68 | 127070 | 大中转债    | 110,910.27 | 0.01 |
| 69 | 113024 | 核建转债    | 109,784.79 | 0.01 |
| 70 | 128129 | 青农转债    | 109,452.38 | 0.01 |
| 71 | 118029 | 富森转债    | 107,032.36 | 0.01 |
| 72 | 118005 | 天奈转债    | 106,793.01 | 0.01 |
| 73 | 113053 | 隆 22 转债 | 106,102.99 | 0.01 |
| 74 | 127049 | 希望转 2   | 104,597.81 | 0.01 |
| 75 | 127103 | 东南转债    | 102,838.68 | 0.01 |
| 76 | 123171 | 共同转债    | 102,471.97 | 0.01 |
| 77 | 118023 | 广大转债    | 101,955.34 | 0.01 |
| 78 | 118034 | 晶能转债    | 101,414.44 | 0.01 |
| 79 | 110095 | 双良转债    | 101,290.00 | 0.01 |
| 80 | 127061 | 美锦转债    | 99,098.88  | 0.01 |
| 81 | 123161 | 强联转债    | 89,704.79  | 0.01 |
| 82 | 110067 | 华安转债    | 12,699.99  | 0.00 |
| 83 | 110073 | 国投转债    | 11,552.93  | 0.00 |
| 84 | 113641 | 华友转债    | 11,393.90  | 0.00 |
| 85 | 111010 | 立昂转债    | 11,262.52  | 0.00 |
| 86 | 110085 | 通 22 转债 | 11,057.90  | 0.00 |
| 87 | 123200 | 海泰转债    | 11,026.84  | 0.00 |
| 88 | 123210 | 信服转债    | 10,809.85  | 0.00 |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 平安瑞兴 1 年持有混合 A | 平安瑞兴 1 年持有混合 C |
|----------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额    | 159,980,955.13 | 41,942,783.36  |
| 报告期期间基金总申购份额   | 601,634,384.19 | 87,862,704.59  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 11,344,378.06  | 507,078.14     |

|                           |                |                |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） |                |                |
| 报告期期末基金份额总额               | 750,270,961.26 | 129,298,409.81 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                       | 平安瑞兴 1 年持有混合 A | 平安瑞兴 1 年持有混合 C |
|--------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 5,188,067.44   | -              |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -              | -              |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -              | -              |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 5,188,067.44   | -              |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.69           | -              |

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

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

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安瑞兴 1 年持有期混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安瑞兴 1 年持有期混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安瑞兴 1 年持有期混合型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

## 9.2 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

## 9.3 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

2025 年 1 月 21 日