

平安添裕债券型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
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	13
§ 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	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	55

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	55
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	55
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.11 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
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	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安添裕债券型证券投资基金		
基金简称	平安添裕债券		
基金主代码	008726		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 6 月 17 日		
基金管理人	平安基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,223,384,830.29 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	平安添裕债券 A	平安添裕债券 C	平安添裕债券 E
下属分级基金的交易代码	008726	008727	023578
报告期末下属分级基金的份额总额	1,214,346,127.78 份	9,037,725.66 份	976.85 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、资产配置策略；2、债券投资策略：(1) 组合久期配置策略；(2) 类属资产配置策略；(3) 息差策略；(4) 个券选择策略；3、股票投资策略；4、现金头寸管理；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、可转换债券及可交换债券投资策略；8、信用衍生品投资策略
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
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，但低于混合型基金、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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李海波	方圆
	联系电话	0755-88622632	95559
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-800-4800	95559
传真		0755-23997878	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号

邮政编码	518048	200336
法定代表人	罗春风	任德奇

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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(2025年1月1日-2025年6月30日)		2025年2月28日(基金合同生效日)-2025年6月30日
	平安添裕债券 A	平安添裕债券 C	
本期已实现收益	11,809,401.34	1,919.71	1.56
本期利润	29,871,632.37	27,014.22	18.59
加权平均基金份额本期利润	0.0561	0.0030	0.0190
本期加权平均净值利润率	5.44%	0.29%	1.85%
本期基金份额净值增长率	0.49%	0.30%	1.86%
3.1.2 期末	报告期末(2025年6月30日)		

末数据和指标			
期末可供分配利润	53,344,791.42	208,613.49	41.74
期末可供分配基金份额利润	0.0439	0.0231	0.0427
期末基金资产净值	1,267,690,919.20	9,246,339.15	1,018.59
期末基金份额净值	1.0439	1.0231	1.0427
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	4.39%	2.31%	1.86%

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

平安添裕债券 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	1.46%	0.24%	0.53%	0.05%	0.93%	0.19%
过去三个月	1.88%	0.27%	1.12%	0.08%	0.76%	0.19%
过去六个月	0.49%	0.22%	-0.06%	0.10%	0.55%	0.12%
过去一年	1.99%	0.25%	3.67%	0.13%	-1.68%	0.12%
过去三年	-2.04%	0.25%	5.45%	0.11%	-7.49%	0.14%
自基金合同	4.39%	0.28%	8.56%	0.12%	-4.17%	0.16%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

平安添裕债券 C

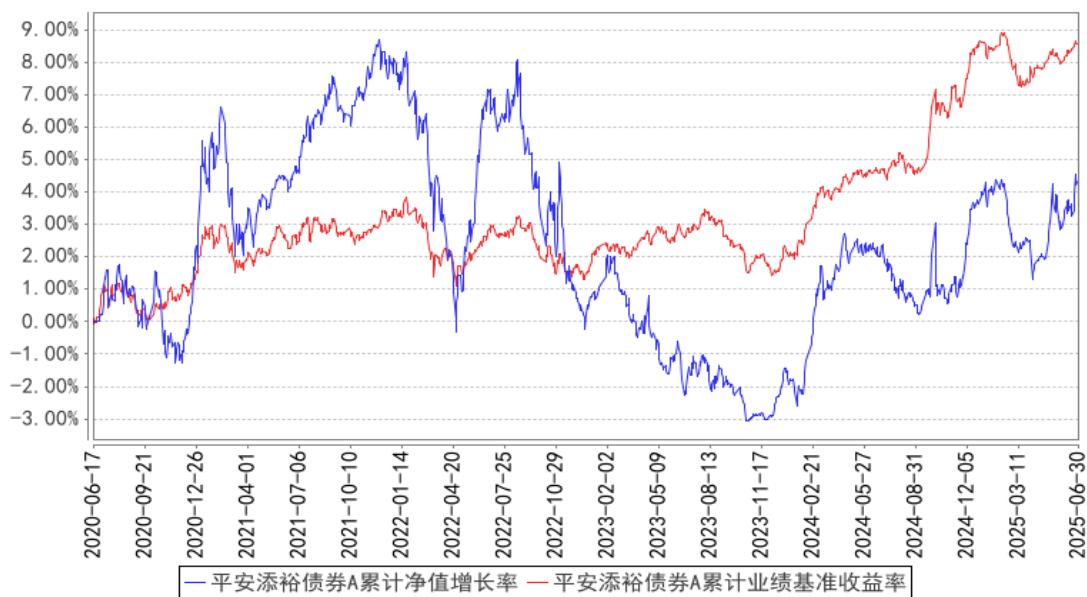
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.43%	0.24%	0.53%	0.05%	0.90%	0.19%
过去三个月	1.78%	0.26%	1.12%	0.08%	0.66%	0.18%
过去六个月	0.30%	0.22%	-0.06%	0.10%	0.36%	0.12%
过去一年	1.59%	0.25%	3.67%	0.13%	-2.08%	0.12%
过去三年	-3.20%	0.25%	5.45%	0.11%	-8.65%	0.14%
自基金合同 生效起至今	2.31%	0.28%	8.56%	0.12%	-6.25%	0.16%

平安添裕债券 E

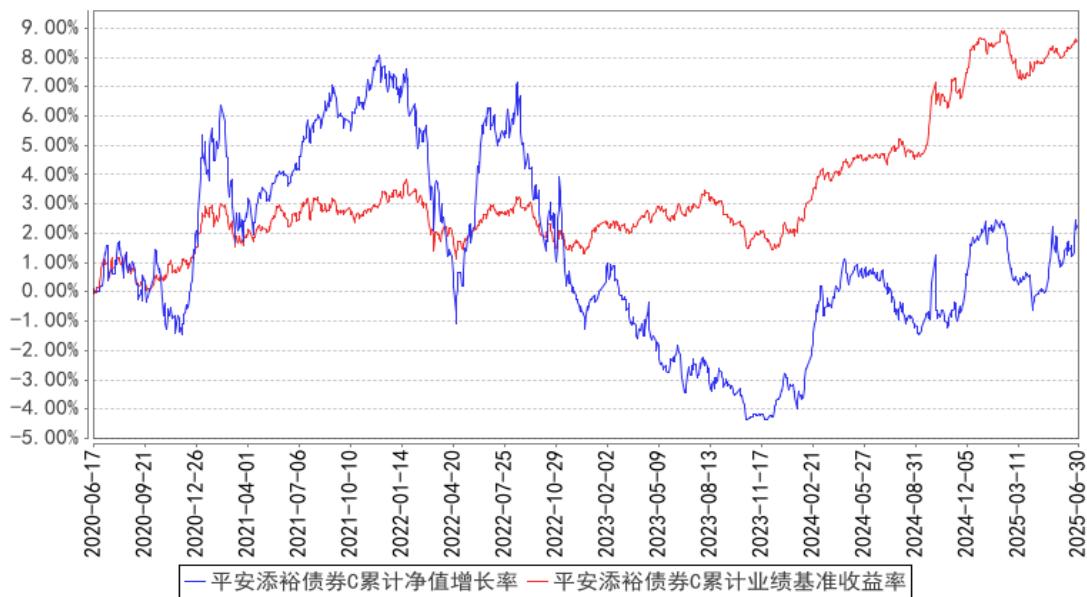
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.43%	0.24%	0.53%	0.05%	0.90%	0.19%
过去三个月	1.79%	0.26%	1.12%	0.08%	0.67%	0.18%
自基金合同 生效起至今	1.86%	0.23%	0.66%	0.10%	1.20%	0.13%

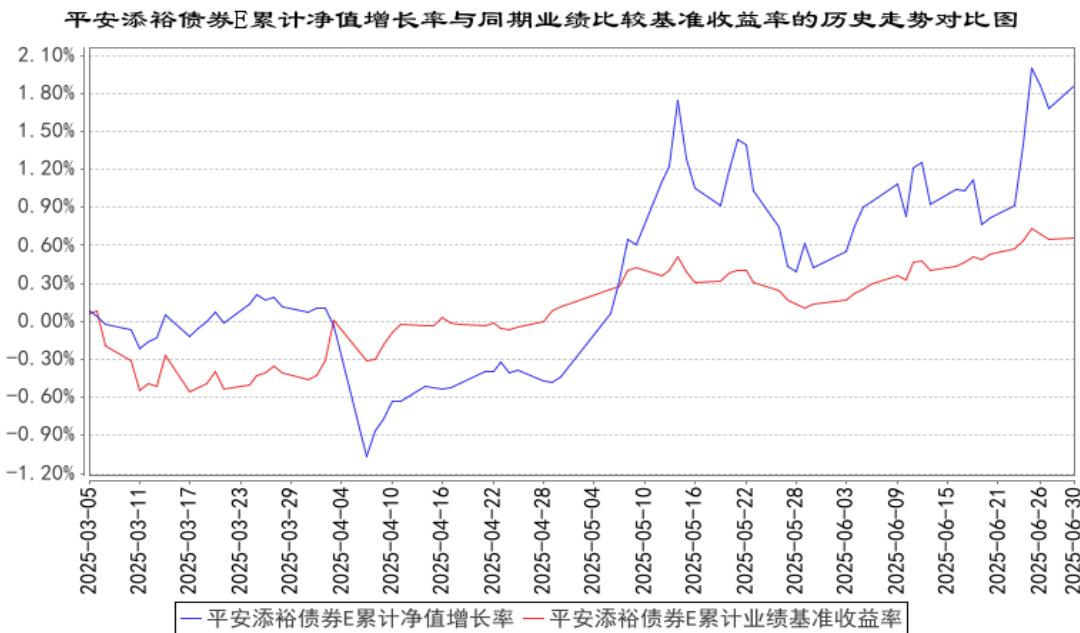
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

平安添裕债券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



平安添裕债券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、本基金合同于 2020 年 06 月 17 日生效；

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 2025 年 02 月 28 日增设 E 类份额，E 类份额从 2025 年 03 月 05 日开始有份额，所以上 E 类份额走势图从 2025 年 03 月 05 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，平安基金总部位于深圳，注册资本金为 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、海外、专户七大业务板块。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 2025 年 6 月 30 日，平安基金共管理 230 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6600 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	平安添裕 债券型证 券投资基金 基金经理	2025年3 月24日	-	13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、平安添裕债券型证券投资基金基金经理。
韩克	平安添裕 债券型证 券投资基金 基金经理	2020年6 月17日	2025年3 月24日	13年	韩克先生，浙江大学金融学硕士。曾先后担任南方基金管理有限公司债券交易员、研究员、投资经理助理。2019年6月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心投资经理。现担任平安恒鑫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 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执行公平执行，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

2025 年上半年，国内经济整体平稳，价格指数持续走低。生产端开年偏强，2 季度略有回落。需求端结构分化：政策支持的消费领域偏强运行，但其他消费领域偏弱。美国对等关税导致出口波动，但在抢出口的效应下出口整体较强。但在国内需求面临堵点以及高关税的环境下，货币政策维持稳健宽松，5 月降准降息，整体呈现流动性宽松的状态。

报告期内，债券整体呈现高波震荡形式。年初非银存款流失与信贷“开门红”影响下银行负债端压力仍大，央行稳汇率与防风险诉求上升，通过收紧资金的方式打断收益率下行趋势，叠加春节后科技主题带来权益强势上涨行情压制，债市出现大幅调整。4 月初美国对全球加征“对等关税”，国内经济预期下修，宽货币预期再起，收益率快速下行。5 月初双降落地，中旬中美经贸会谈取得积极进展，下旬存款利率调降落地，10 年国债收益率 1.6–1.7% 低位震荡。报告期内，本产品以信用债投资为主，结合市场情况灵活进行久期和杠杆调节，同时适当操作兼具安全性和收益性的转债品种，力争增强组合收益。

报告期内权益市场整体大幅震荡，但上半年主要股指收涨。4 月初特朗普对等关税落地，中国反制超预期，市场出现恐慌性下跌，万得全 A 单日下跌 9.26%，随后“国家队”强力稳市，市场快速修复缺口。5–6 月权益市场进一步走强，占优的板块从新消费、创新药等轮动到低位的周期板块，指数创年内新高。

权益部分整体以大盘价值和大盘成长配置为主，维持了较高的权益仓位，积极获取市场反弹的机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安添裕债券 A 的基金份额净值 1.0439 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.49%，同期业绩比较基准收益率为 -0.06%；截至本报告期末平安添裕债券 C 的基金份额净值 1.0231 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准收益率为 -0.06%；截至本

报告期末平安添裕债券 E 的基金份额净值 1.0427 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.86%，同期业绩比较基准收益率为 0.66%。

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，国内需求依然面临较多堵点，出口美国在对等关税压制下也面临回落压力，央行资金面预计将继续维持均衡偏宽松的环境。但风险偏好的持续回升对债券市场的压制仍在，权益市场预计保持震荡向上，结构性机会丰富。

本产品债券方面将继续以中高等级信用债为主，下半年依然以赚取稳定票息和骑乘收益为主，同时结合市场环境动态调整组合久期和杠杆。权益投资方面，继续保持均衡配置思路，以大盘价值及大盘成长为核心配置，优选估值合理、未来盈利现金流增速稳健的龙头公司。

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 人的情形。本基金本报告期内出现连续 20 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。

§ 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，基金托管人在平安添裕债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，平安基金管理有限公司在平安添裕债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由平安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关平安添裕债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：平安添裕债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	387,366.78	2,972,202.66
结算备付金		655,590.87	78,242.75
存出保证金		164,620.34	18,847.31
交易性金融资产	6.4.7.2	1,538,861,673.40	56,250,270.65
其中：股票投资		445,334,931.96	7,742,610.28
基金投资		-	-
债券投资		1,093,526,741.44	48,507,660.37
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	-	-

应收清算款		463,104.07	180,781.19
应收股利		-	-
应收申购款		10.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,540,532,365.46	59,500,344.56
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024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		262,064,679.36	8,000,555.54
应付清算款		14,932.86	61,732.94
应付赎回款		62,762.31	3,522.24
应付管理人报酬		729,018.55	30,324.36
应付托管费		208,291.02	8,664.10
应付销售服务费		3,032.90	3,073.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		28.34	754.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	511,343.18	150,040.72
负债合计		263,594,088.52	8,258,668.52
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,223,384,830.29	49,491,449.73
未分配利润	6.4.7.12	53,553,446.65	1,750,226.31
净资产合计		1,276,938,276.94	51,241,676.04
负债和净资产总计		1,540,532,365.46	59,500,344.56

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,223,384,830.29 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0439 元，A 类基金份额 1,214,346,127.78 份；下属 C 类基金份额净值 1.0231 元，C 类基金份额 9,037,725.66 份；下属 E 类基金份额净值 1.0427 元，E 类基金份额 976.85 份。

6.2 利润表

会计主体：平安添裕债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
一、营业总收入		33,657,922.46	2,339,061.51
1. 利息收入		10,215.05	3,076.76

其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	7, 159. 52	3, 076. 76
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		3, 055. 53	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		15, 560, 308. 79	2, 016, 008. 81
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	4, 038, 124. 52	463, 821. 40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	6, 427, 533. 60	1, 399, 098. 98
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	-	-
股利收益	6. 4. 7. 19	5, 094, 650. 67	153, 088. 43
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	18, 087, 342. 57	319, 623. 28
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	56. 05	352. 66
减：二、营业总支出		3, 759, 257. 28	436, 531. 73
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 916, 624. 06	187, 753. 37
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	547, 606. 91	53, 643. 79
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	18, 212. 23	18, 320. 81
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1, 200, 432. 15	115, 303. 44
其中：卖出回购金融资产支出		1, 200, 432. 15	115, 303. 44
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		301. 61	5. 28
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	76, 080. 32	61, 505. 04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29, 898, 665. 18	1, 902, 529. 78
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		29,898,665.18	1,902,529.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		29,898,665.18	1,902,529.78

6.3 净资产变动表

会计主体：平安添裕债券型证券投资基金

本报告期：2025年1月1日至2025年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	49,491,449.73	1,750,226.31	51,241,676.04
二、本期期初净资产	49,491,449.73	1,750,226.31	51,241,676.04
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	1,173,893,380.56	51,803,220.34	1,225,696,600.90
(一)、综合收益总额	-	29,898,665.18	29,898,665.18
(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)	1,173,893,380.56	21,904,555.16	1,195,797,935.72
其中：1. 基金申购款	1,179,206,370.57	22,065,507.57	1,201,271,878.14
2. 基金赎回款	-5,312,990.01	-160,952.41	-5,473,942.42
(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	1,223,384,830.29	53,553,446.65	1,276,938,276.94
项目	上年度可比期间		
	2024年1月1日至2024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	52,018,306.38	-867,557.79	51,150,748.59
二、本期期初净资产	52,018,306.38	-867,557.79	51,150,748.59
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填	2,010,819.06	1,985,612.35	3,996,431.41

列)			
(一)、综合收益总额	-	1,902,529.78	1,902,529.78
(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)	2,010,819.06	83,082.57	2,093,901.63
其中:1. 基金申购款	10,619,988.62	127,268.51	10,747,257.13
2. 基金赎回款	-8,609,169.56	-44,185.94	-8,653,355.50
(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	54,029,125.44	1,118,054.56	55,147,180.00

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

林婉文

张南南

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

平安添裕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[2019]2775 号《关于准予平安添裕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《平安添裕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 2,373,192,216.15 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(2020)第 0449 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安添裕债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,374,578,315.25 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,386,099.10 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《平安添裕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/申购费用的基金份额，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 类基金份额。本基金 A 类、C 类、E 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类、E 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《平安添裕债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、次级债)、资产支持证券、信用衍生品、债券回购、国债期货、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等)、同业存单、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%，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的 5%的现金或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。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《平安添裕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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 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[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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 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。

(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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	387,366.78
等于：本金	387,359.60
加：应计利息	7.18
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	387,366.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	427,276,847.07	-	445,334,931.96	18,058,084.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所	5,379,856.68	33,160.33	5,564,801.13	151,784.12

券 市场					
银行间 市场	1,073,225,905.36	14,264,290.31	1,087,961,940.31	471,744.64	
合计	1,078,605,762.04	14,297,450.64	1,093,526,741.44	623,528.76	
资产支持证券	—	—	—	—	—
基金	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	1,505,882,609.11	14,297,450.64	1,538,861,673.40	18,681,613.65	

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

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

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 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.13
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	452,453.48
其中：交易所市场	406,327.32
银行间市场	46,126.16
应付利息	-
预提费用	58,888.57
合计	511,343.18

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安添裕债券 A

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,532,228.78	40,532,228.78
本期申购	1,178,833,454.44	1,178,833,454.44
本期赎回（以“-”号填列）	-5,019,555.44	-5,019,555.44
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	1,214,346,127.78	1,214,346,127.78

平安添裕债券 C

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,959,220.95	8,959,220.95
本期申购	371,939.28	371,939.28

本期赎回(以“-”号填列)	-293,434.57	-293,434.57
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	9,037,725.66	9,037,725.66

平安添裕债券 E

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	976.85	976.85
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
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	976.85	976.85

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

平安添裕债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,287,417.50	-1,716,643.15	1,570,774.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,287,417.50	-1,716,643.15	1,570,774.35
本期利润	11,809,401.34	18,062,231.03	29,871,632.37
本期基金份额交易产生的变动数	86,282,837.37	-64,380,452.67	21,902,384.70
其中：基金申购款	86,681,183.01	-64,621,858.27	22,059,324.74
基金赎回款	-398,345.64	241,405.60	-156,940.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	101,379,656.21	-48,034,864.79	53,344,791.42

平安添裕债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	558,712.93	-379,260.97	179,451.96
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	558,712.93	-379,260.97	179,451.96
本期利润	1,919.71	25,094.51	27,014.22
本期基金份额交易产生的变动数	5,896.34	-3,749.03	2,147.31
其中：基金申购款	23,678.76	-17,519.08	6,159.68
基金赎回款	-17,782.42	13,770.05	-4,012.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	566,528.98	-357,915.49	208,613.49

平安添裕债券 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1.56	17.03	18.59
本期基金份额交易产生的变动数	78.82	-55.67	23.15
其中：基金申购款	78.82	-55.67	23.15
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80.38	-38.64	41.74

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
活期存款利息收入		5,680.59
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		1,377.58
其他		101.35
合计		7,159.52

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 2025年1月1日至2025年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		4,038,124.52
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	4,038,124.52

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	270,880,468.03
减：卖出股票成本总额	266,228,890.48
减：交易费用	613,453.03
买卖股票差价收入	4,038,124.52

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	6,068,410.45
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	359,123.15
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	6,427,533.60

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	813,581,096.58
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	809,456,702.27
减：应计利息总额	3,733,468.97
减：交易费用	31,802.19
买卖债券差价收入	359,123.15

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,094,650.67
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	5,094,650.67

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	18,087,342.57
股票投资	18,025,808.47
债券投资	61,534.10
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	18,087,342.57

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	49.86
基金转换费收入	6.19
合计	56.05

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《平安添裕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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	7,891.75

账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	76,080.32

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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
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
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

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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,916,624.06	187,753.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	317,079.11	70,020.83
应支付基金管理人的净管理费	1,599,544.95	117,732.54

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 0.70%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}.$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	547,606.91	53,643.79

注：支付基金托管行的托管费按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。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}.$$

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 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			
	平安添裕债券 A	平安添裕债券 C	平安添裕债券 E	合计
交通银行	-	14.82	-	14.82

陆基金	-	361.28	-	361.28
平安基金	-	15,539.64	-	15,539.64
平安人寿	-	585.55	-	585.55
平安银行	-	1,349.16	-	1,349.16
合计	-	17,850.45	-	17,850.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	平安添裕债券A	平安添裕债券C	平安添裕债券E	合计
交通银行	-	34.04	-	34.04
陆基金	-	189.53	-	189.53
平安基金	-	15,290.47	-	15,290.47
平安人寿	-	660.92	-	660.92
平安银行	-	1,458.97	-	1,458.97
合计	-	17,633.93	-	17,633.93

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 0.40%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×0.40%/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 0.30%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×0.30%/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：本基金本报告期内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

注：无。

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

平安添裕债券 C

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024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	7,743,295.05	85.6775	7,743,295.05	86.4282

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 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
交通银行-活期	387,366.78	5,680.59	2,132,786.40	1,868.42

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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

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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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

交通银行股份有限公司、平安银行股份有限公司	198434 IB	24 江苏债 02	公开发行	40,000	4,000,000.00
-----------------------	-----------	-----------	------	--------	--------------

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（2025 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 2025 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 262,064,679.36 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
232380089	23 中信银行二级资本债 01A	2025 年 7 月 1 日	106.00	344,000	36,462,763.49
092280080	22 光大银行二级资本债 01A	2025 年 7 月 2 日	105.28	418,000	44,006,673.53
312400001	24 工行 TLAC 非资本债 01A	2025 年 7 月 2 日	101.13	500,000	50,565,958.90
312410003	24 建行 TLAC 非资本债 01A	2025 年 7 月 2 日	102.17	135,000	13,792,395.20
092280080	22 光大银行二级资本债 01A	2025 年 7 月 4 日	105.28	444,000	46,743,930.74
092280083	22 建行永续债 01	2025 年 7 月 4 日	105.54	453,000	47,810,600.47
232380089	23 中信银	2025 年 7 月	106.00	72,000	7,631,741.19

	行二级资本债 01A	4 日			
232480052	24 浦发银行二级资本债 01A	2025 年 7 月 4 日	102.83	400,000	41,130,886.58
合计				2,766,000	288,144,950.10

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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、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 78.65%（上年度末：48.05%）。

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 2025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	387,366.78	-	-	-	387,366.78
结算备付金	655,590.87	-	-	-	655,590.87
存出保证金	164,620.34	-	-	-	164,620.34
交易性金融资产	72,483,791.62	499,725,153.96	521,317,795.86	445,334,931.96	1,538,861,673.40
应收申购款	-	-	-	10.00	10.00
应收清算款	-	-	-	463,104.07	463,104.07
资产总计	73,691,369.61	499,725,153.96	521,317,795.86	445,798,046.03	1,540,532,365.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	62,762.31	62,762.31
应付管理人报酬	-	-	-	729,018.55	729,018.55

应付托管费	-	-	-	208,291.02	208,291.02
应付清算款	-	-	-	14,932.86	14,932.86
卖出回购金融资产款	262,064,679.36	-	-	-	262,064,679.36
应付销售服务费	-	-	-	3,032.90	3,032.90
应交税费	-	-	-	28.34	28.34
其他负债	-	-	-	511,343.18	511,343.18
负债总计	262,064,679.36	-	-	1,529,409.16	263,594,088.52
利率敏感度缺口	- 188,373,309.75	499,725,153.96 521,317,795.86	444,268,636.87	1,276,938,276.94	
上年度末 2024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	2,972,202.66	-	-	-	2,972,202.66
结算备付金	78,242.75	-	-	-	78,242.75
存出保证金	18,847.31	-	-	-	18,847.31
交易性金融资产	21,481,661.78	9,997,608.42	17,028,390.17	7,742,610.28	56,250,270.65
应收清算款	-	-	-	180,781.19	180,781.19
资产总计	24,550,954.50	9,997,608.42	17,028,390.17	7,923,391.47	59,500,344.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,522.24	3,522.24
应付管理人报酬	-	-	-	30,324.36	30,324.36
应付托管费	-	-	-	8,664.10	8,664.10
应付清算款	-	-	-	61,732.94	61,732.94
卖出回购金融资产款	8,000,555.54	-	-	-	8,000,555.54
应付销售服务费	-	-	-	3,073.95	3,073.95
应交税费	-	-	-	754.67	754.67
其他负债	-	-	-	150,040.72	150,040.72
负债总计	8,000,555.54	-	-	258,112.98	8,258,668.52
利率敏感度缺口	16,550,398.96	9,997,608.42	17,028,390.17	7,665,278.49	51,241,676.04

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-7,182,179.20	-740,025.65

	市场利率下降 25 个基点	7,316,579.03	772,741.09
--	------------------	--------------	------------

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 2025年6月30日		上年度末 2024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	445,334,931.96	34.88	7,742,610.28	15.11
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	445,334,931.96	34.88	7,742,610.28	15.11

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	
		对资产负债表日基金资产净值的

	相关风险变量的变动	影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2025 年 6 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	9,527,668.46	271,556.34
	沪深 300 指数下降 5%	-9,527,668.46	-271,556.34

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	448,300,589.20	9,067,467.25
第二层次	1,090,561,084.20	47,182,803.40
第三层次	-	-
合计	1,538,861,673.40	56,250,270.65

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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	445,334,931.96	28.91
	其中：股票	445,334,931.96	28.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,093,526,741.44	70.98
	其中：债券	1,093,526,741.44	70.98
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,042,957.65	0.07
8	其他各项资产	627,734.41	0.04
9	合计	1,540,532,365.46	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

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	6,383,107.00	0.50
B	采矿业	20,956,288.00	1.64
C	制造业	223,031,566.51	17.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,653,954.00	1.46
E	建筑业	7,814,221.00	0.61

F	批发和零售业	1,356,856.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	15,165,335.00	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,322,692.45	1.36
J	金融业	123,509,726.00	9.67
K	房地产业	3,381,642.00	0.26
L	租赁和商务服务业	3,427,941.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	3,148,499.00	0.25
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	1,183,104.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	445,334,931.96	34.88

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

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	300750	宁德时代	62,000	15,637,640.00	1.22
2	600519	贵州茅台	10,000	14,095,200.00	1.10
3	600036	招商银行	277,300	12,741,935.00	1.00
4	601601	中国太保	292,400	10,967,924.00	0.86
5	601899	紫金矿业	453,300	8,839,350.00	0.69
6	600030	中信证券	316,200	8,733,444.00	0.68
7	601166	兴业银行	363,000	8,472,420.00	0.66
8	000333	美的集团	114,400	8,259,680.00	0.65
9	600900	长江电力	271,500	8,183,010.00	0.64
10	601398	工商银行	1,003,700	7,618,083.00	0.60
11	002594	比亚迪	19,300	6,405,863.00	0.50
12	300059	东方财富	269,700	6,238,161.00	0.49
13	601336	新华保险	96,700	5,656,950.00	0.44
14	600000	浦发银行	395,600	5,490,928.00	0.43
15	000651	格力电器	116,300	5,224,196.00	0.41
16	601628	中国人寿	114,300	4,708,017.00	0.37
17	000858	五粮液	38,900	4,625,210.00	0.36
18	688981	中芯国际	51,797	4,566,941.49	0.36
19	601211	国泰海通	234,200	4,487,272.00	0.35

20	600887	伊利股份	150,400	4,193,152.00	0.33
21	600893	航发动力	106,900	4,119,926.00	0.32
22	600919	江苏银行	334,900	3,998,706.00	0.31
23	600926	杭州银行	234,600	3,945,972.00	0.31
24	600276	恒瑞医药	75,600	3,923,640.00	0.31
25	601702	华峰铝业	239,300	3,802,477.00	0.30
26	002714	牧原股份	89,900	3,776,699.00	0.30
27	600760	中航沈飞	64,000	3,751,680.00	0.29
28	601288	农业银行	611,800	3,597,384.00	0.28
29	002475	立讯精密	103,300	3,583,477.00	0.28
30	002371	北方华创	8,100	3,581,901.00	0.28
31	601816	京沪高铁	616,900	3,547,175.00	0.28
32	601100	恒立液压	48,100	3,463,200.00	0.27
33	601229	上海银行	306,900	3,256,209.00	0.26
34	601988	中国银行	567,300	3,188,226.00	0.25
35	601799	星宇股份	25,100	3,137,500.00	0.25
36	000725	京东方 A	777,900	3,103,821.00	0.24
37	603596	伯特利	58,100	3,061,289.00	0.24
38	300274	阳光电源	44,540	3,018,475.80	0.24
39	688041	海光信息	20,915	2,955,080.35	0.23
40	600660	福耀玻璃	47,200	2,690,872.00	0.21
41	300760	迈瑞医疗	11,800	2,652,050.00	0.21
42	603501	豪威集团	20,700	2,642,355.00	0.21
43	002352	顺丰控股	53,900	2,628,164.00	0.21
44	300498	温氏股份	152,600	2,606,408.00	0.20
45	601728	中国电信	325,100	2,519,525.00	0.20
46	300124	汇川技术	38,900	2,511,773.00	0.20
47	601939	建设银行	257,900	2,434,576.00	0.19
48	601668	中国建筑	418,400	2,414,168.00	0.19
49	000063	中兴通讯	74,100	2,407,509.00	0.19
50	600690	海尔智家	91,700	2,272,326.00	0.18
51	601127	赛力斯	16,800	2,256,576.00	0.18
52	600309	万华化学	40,600	2,202,956.00	0.17
53	603986	兆易创新	17,300	2,188,969.00	0.17
54	601688	华泰证券	122,500	2,181,725.00	0.17
55	002415	海康威视	78,200	2,168,486.00	0.17
56	603259	药明康德	31,100	2,163,005.00	0.17
57	603019	中科曙光	29,900	2,104,960.00	0.16
58	601919	中远海控	133,100	2,001,824.00	0.16
59	600031	三一重工	110,500	1,983,475.00	0.16
60	600933	爱柯迪	120,300	1,926,003.00	0.15
61	600674	川投能源	118,500	1,900,740.00	0.15
62	000680	山推股份	211,100	1,893,567.00	0.15

63	002244	滨江集团	193,500	1,886,625.00	0.15
64	601138	工业富联	87,800	1,877,164.00	0.15
65	688800	瑞可达	37,947	1,866,992.40	0.15
66	002230	科大讯飞	38,400	1,838,592.00	0.14
67	601012	隆基绿能	122,300	1,836,946.00	0.14
68	688256	寒武纪	3,049	1,833,973.50	0.14
69	600050	中国联通	328,800	1,755,792.00	0.14
70	000338	潍柴动力	112,200	1,725,636.00	0.14
71	688008	澜起科技	21,024	1,723,968.00	0.14
72	600941	中国移动	15,300	1,722,015.00	0.13
73	601766	中国中车	239,706	1,687,530.24	0.13
74	601658	邮储银行	306,700	1,677,649.00	0.13
75	002142	宁波银行	60,700	1,660,752.00	0.13
76	600016	民生银行	345,900	1,643,025.00	0.13
77	600406	国电南瑞	71,800	1,609,038.00	0.13
78	300308	中际旭创	11,000	1,604,460.00	0.13
79	601088	中国神华	39,400	1,597,276.00	0.13
80	601881	中国银河	93,000	1,594,950.00	0.12
81	002027	分众传媒	214,100	1,562,930.00	0.12
82	601009	南京银行	134,200	1,559,404.00	0.12
83	000568	泸州老窖	13,700	1,553,580.00	0.12
84	002463	沪电股份	36,300	1,545,654.00	0.12
85	000100	TCL 科技	352,400	1,525,892.00	0.12
86	688012	中微公司	8,314	1,515,642.20	0.12
87	601006	大秦铁路	228,900	1,510,740.00	0.12
88	600104	上汽集团	93,800	1,505,490.00	0.12
89	300033	同花顺	5,500	1,501,555.00	0.12
90	600999	招商证券	85,100	1,496,909.00	0.12
91	601818	光大银行	355,600	1,475,740.00	0.12
92	600150	中国船舶	44,900	1,461,046.00	0.11
93	601985	中国核电	156,000	1,453,920.00	0.11
94	601963	重庆银行	133,600	1,450,896.00	0.11
95	600011	华能国际	198,300	1,415,862.00	0.11
96	603288	海天味业	35,100	1,365,741.00	0.11
97	601857	中国石油	157,300	1,344,915.00	0.11
98	688111	金山办公	4,719	1,321,555.95	0.10
99	600547	山东黄金	40,600	1,296,358.00	0.10
100	600111	北方稀土	51,700	1,287,330.00	0.10
101	002850	科达利	11,200	1,267,504.00	0.10
102	000977	浪潮信息	24,900	1,266,912.00	0.10
103	000938	紫光股份	52,500	1,259,475.00	0.10
104	600905	三峡能源	294,000	1,252,440.00	0.10
105	600019	宝钢股份	189,900	1,251,441.00	0.10

106	601600	中国铝业	173,800	1,223,552.00	0.10
107	600089	特变电工	101,200	1,207,316.00	0.09
108	600028	中国石化	213,800	1,205,832.00	0.09
109	603993	洛阳钼业	141,400	1,190,588.00	0.09
110	000625	长安汽车	93,300	1,190,508.00	0.09
111	002241	歌尔股份	50,800	1,184,656.00	0.09
112	300015	爱尔眼科	94,800	1,183,104.00	0.09
113	601077	渝农商行	163,800	1,169,532.00	0.09
114	600600	青岛啤酒	16,800	1,166,928.00	0.09
115	601390	中国中铁	207,200	1,162,392.00	0.09
116	600415	小商品城	55,100	1,139,468.00	0.09
117	300442	润泽科技	23,000	1,139,190.00	0.09
118	600585	海螺水泥	52,100	1,118,587.00	0.09
119	601169	北京银行	162,300	1,108,509.00	0.09
120	002050	三花智控	41,900	1,105,322.00	0.09
121	300014	亿纬锂能	24,000	1,099,440.00	0.09
122	002179	中航光电	27,100	1,093,756.00	0.09
123	603799	华友钴业	29,300	1,084,686.00	0.08
124	600809	山西汾酒	6,000	1,058,340.00	0.08
125	600584	长电科技	31,300	1,054,497.00	0.08
126	601989	中国重工	226,000	1,048,640.00	0.08
127	300408	三环集团	30,400	1,015,360.00	0.08
128	601607	上海医药	56,700	1,013,796.00	0.08
129	688271	联影医疗	7,900	1,009,146.00	0.08
130	600588	用友网络	74,700	998,739.00	0.08
131	000975	山金国际	51,600	977,304.00	0.08
132	002049	紫光国微	14,800	974,728.00	0.08
133	600570	恒生电子	28,400	952,536.00	0.07
134	600958	东方证券	97,300	941,864.00	0.07
135	000776	广发证券	55,800	937,998.00	0.07
136	002600	领益智造	108,800	934,592.00	0.07
137	600938	中国海油	35,500	926,905.00	0.07
138	000921	海信家电	35,500	912,350.00	0.07
139	600436	片仔癀	4,500	900,045.00	0.07
140	002422	科伦药业	25,000	898,000.00	0.07
141	000538	云南白药	16,000	892,640.00	0.07
142	002028	思源电气	12,200	889,502.00	0.07
143	000807	云铝股份	55,600	888,488.00	0.07
144	600795	国电电力	182,300	882,332.00	0.07
145	600066	宇通客车	35,200	875,072.00	0.07
146	600009	上海机场	26,800	851,436.00	0.07
147	601669	中国电建	173,900	846,893.00	0.07
148	600438	通威股份	50,400	844,200.00	0.07

149	300433	蓝思科技	37,600	838,480.00	0.07
150	601872	招商轮船	127,900	800,654.00	0.06
151	601838	成都银行	39,800	799,980.00	0.06
152	000166	申万宏源	157,900	792,658.00	0.06
153	601825	沪农商行	81,000	785,700.00	0.06
154	600489	中金黄金	53,600	784,168.00	0.06
155	001979	招商蛇口	89,100	781,407.00	0.06
156	002460	赣锋锂业	22,800	769,956.00	0.06
157	600426	华鲁恒升	35,400	767,118.00	0.06
158	688169	石头科技	4,872	762,711.60	0.06
159	600886	国投电力	50,600	745,844.00	0.06
160	601377	兴业证券	119,900	742,181.00	0.06
161	000157	中联重科	102,500	741,075.00	0.06
162	600989	宝丰能源	45,500	734,370.00	0.06
163	601186	中国铁建	91,500	732,915.00	0.06
164	601225	陕西煤业	38,000	731,120.00	0.06
165	601888	中国中免	11,900	725,543.00	0.06
166	600048	保利发展	88,100	713,610.00	0.06
167	002920	德赛西威	6,776	692,032.88	0.05
168	605499	东鹏饮料	2,200	690,910.00	0.05
169	300502	新易盛	5,380	683,367.60	0.05
170	601898	中煤能源	61,900	677,186.00	0.05
171	301269	华大九天	5,400	668,952.00	0.05
172	601058	赛轮轮胎	50,900	667,808.00	0.05
173	601001	晋控煤业	54,100	661,102.00	0.05
174	000768	中航西飞	24,000	656,160.00	0.05
175	002466	天齐锂业	20,200	647,208.00	0.05
176	002001	新和成	30,100	640,227.00	0.05
177	601800	中国交建	71,900	639,191.00	0.05
178	600029	南方航空	107,900	636,610.00	0.05
179	600115	中国东航	157,500	634,725.00	0.05
180	302132	中航成飞	7,100	624,374.00	0.05
181	600176	中国巨石	54,500	621,300.00	0.05
182	002736	国信证券	53,100	611,712.00	0.05
183	603198	迎驾贡酒	15,500	611,165.00	0.05
184	601066	中信建投	25,400	610,870.00	0.05
185	600027	华电国际	110,300	603,341.00	0.05
186	000543	皖能电力	85,000	595,000.00	0.05
187	300122	智飞生物	30,300	593,577.00	0.05
188	601868	中国能建	265,200	591,396.00	0.05
189	000661	长春高新	5,900	585,162.00	0.05
190	600346	恒力石化	40,800	581,808.00	0.05
191	600988	赤峰黄金	23,300	579,704.00	0.05

192	002252	上海莱士	83,800	575,706.00	0.05
193	601319	中国人保	65,600	571,376.00	0.04
194	601111	中国国航	72,400	571,236.00	0.04
195	600460	士兰微	22,900	568,378.00	0.04
196	002648	卫星化学	32,200	558,026.00	0.04
197	601878	浙商证券	50,600	552,046.00	0.04
198	003816	中国广核	151,500	551,460.00	0.04
199	600219	南山铝业	143,300	548,839.00	0.04
200	002074	国轩高科	16,700	542,082.00	0.04
201	601998	中信银行	63,000	535,500.00	0.04
202	002601	龙佰集团	32,900	533,309.00	0.04
203	688126	沪硅产业	28,079	525,638.88	0.04
204	601117	中国化学	68,400	524,628.00	0.04
205	000630	铜陵有色	155,300	518,702.00	0.04
206	002129	TCL 中环	66,900	513,792.00	0.04
207	300347	泰格医药	9,600	511,872.00	0.04
208	002709	天赐材料	27,300	494,676.00	0.04
209	600482	中国动力	21,100	486,777.00	0.04
210	001965	招商公路	40,100	481,200.00	0.04
211	688396	华润微	10,088	475,750.08	0.04
212	300759	康龙化成	19,300	473,622.00	0.04
213	600039	四川路桥	47,800	473,220.00	0.04
214	601633	长城汽车	21,900	470,412.00	0.04
215	601021	春秋航空	8,400	467,460.00	0.04
216	002493	荣盛石化	56,100	464,508.00	0.04
217	600085	同仁堂	12,700	457,962.00	0.04
218	000786	北新建材	17,200	455,456.00	0.04
219	300782	卓胜微	6,300	449,631.00	0.04
220	600845	宝信软件	19,000	448,780.00	0.04
221	002180	纳思达	19,300	442,742.00	0.03
222	601618	中国中冶	144,100	429,418.00	0.03
223	600183	生益科技	13,900	419,085.00	0.03
224	002916	深南电路	3,850	415,068.50	0.03
225	002459	晶澳科技	41,100	410,178.00	0.03
226	600161	天坛生物	21,000	402,990.00	0.03
227	000301	东方盛虹	48,200	401,506.00	0.03
228	000876	新 希 望	42,800	401,464.00	0.03
229	002938	鹏鼎控股	12,300	393,969.00	0.03
230	688506	百利天恒	1,328	393,247.36	0.03
231	600061	国投资本	51,600	388,032.00	0.03
232	600023	浙能电力	73,000	386,900.00	0.03
233	002311	海大集团	6,500	380,835.00	0.03
234	600026	中远海能	36,300	374,979.00	0.03

235	300661	圣邦股份	5,120	372,582.40	0.03
236	603296	华勤技术	4,600	371,128.00	0.03
237	601059	信达证券	21,600	369,360.00	0.03
238	000895	双汇发展	14,600	356,386.00	0.03
239	600025	华能水电	36,500	348,575.00	0.03
240	000963	华东医药	8,500	343,060.00	0.03
241	600875	东方电气	20,300	339,822.00	0.03
242	000617	中油资本	46,200	337,260.00	0.03
243	601877	正泰电器	14,800	335,516.00	0.03
244	600803	新奥股份	17,700	334,530.00	0.03
245	600018	上港集团	56,900	324,899.00	0.03
246	600332	白云山	12,300	324,228.00	0.03
247	688599	天合光能	21,631	314,298.43	0.02
248	300413	芒果超媒	13,800	301,116.00	0.02
249	600015	华夏银行	37,600	297,416.00	0.02
250	300999	金龙鱼	9,900	292,347.00	0.02
251	605117	德业股份	5,480	288,576.80	0.02
252	603260	合盛硅业	5,800	274,920.00	0.02
253	688009	中国通号	53,258	273,746.12	0.02
254	603806	福斯特	20,800	269,568.00	0.02
255	688303	大全能源	12,363	263,579.16	0.02
256	688036	传音控股	3,208	255,677.60	0.02
257	601865	福莱特	15,000	228,150.00	0.02
258	603195	公牛集团	4,580	220,985.00	0.02
259	601698	中国卫通	10,400	212,888.00	0.02
260	300394	天孚通信	2,660	212,374.40	0.02
261	000708	中信特钢	17,100	201,096.00	0.02
262	688187	时代电气	4,566	194,739.90	0.02
263	600233	圆通速递	15,100	194,639.00	0.02
264	603369	今世缘	4,800	186,864.00	0.01
265	601136	首创证券	9,000	178,920.00	0.01
266	601808	中海油服	10,500	144,480.00	0.01
267	603833	欧派家居	2,500	141,125.00	0.01
268	600377	宁沪高速	9,100	139,594.00	0.01
269	000999	华润三九	3,070	96,029.60	0.01
270	688047	龙芯中科	694	92,572.66	0.01
271	600160	巨化股份	2,400	68,832.00	0.01
272	300979	华利集团	1,300	68,341.00	0.01
273	688082	盛美上海	468	53,323.92	0.00
274	300628	亿联网络	1,500	52,140.00	0.00
275	688472	阿特斯	3,646	33,360.90	0.00
276	688235	百济神州	66	15,420.24	0.00
277	000596	古井贡酒	100	13,315.00	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	600519	贵州茅台	28,045,693.00	54.73
2	300750	宁德时代	22,351,997.80	43.62
3	600036	招商银行	17,107,111.00	33.39
4	000333	美的集团	11,097,055.00	21.66
5	601601	中国太保	10,715,663.00	20.91
6	601166	兴业银行	10,013,196.00	19.54
7	601899	紫金矿业	9,465,640.00	18.47
8	601702	华峰铝业	8,923,200.00	17.41
9	600030	中信证券	8,891,626.29	17.35
10	002594	比亚迪	8,779,040.00	17.13
11	600900	长江电力	7,989,725.50	15.59
12	300059	东方财富	7,857,375.00	15.33
13	600276	恒瑞医药	7,670,638.20	14.97
14	601398	工商银行	7,168,063.00	13.99
15	000858	五粮液	7,044,437.00	13.75
16	002475	立讯精密	6,895,221.00	13.46
17	688981	中芯国际	6,693,906.86	13.06
18	600887	伊利股份	6,215,628.00	12.13
19	601088	中国神华	6,144,723.00	11.99
20	600919	江苏银行	5,988,037.00	11.69
21	000651	格力电器	5,983,868.00	11.68
22	601100	恒立液压	5,962,107.00	11.64
23	002371	北方华创	5,798,469.00	11.32
24	601336	新华保险	5,739,868.00	11.20
25	600933	爱柯迪	5,548,229.00	10.83
26	600031	三一重工	5,407,513.05	10.55
27	600690	海尔智家	5,305,691.00	10.35
28	601799	星宇股份	5,145,898.00	10.04
29	601211	国泰海通	5,119,839.00	9.99
30	600000	浦发银行	5,114,619.00	9.98
31	300274	阳光电源	4,908,579.45	9.58
32	601229	上海银行	4,809,179.00	9.39
33	601689	拓普集团	4,767,319.00	9.30
34	601288	农业银行	4,757,815.00	9.29
35	601628	中国人寿	4,686,324.00	9.15
36	688041	海光信息	4,557,600.81	8.89
37	300124	汇川技术	4,230,626.00	8.26
38	601988	中国银行	4,185,845.00	8.17

39	600926	杭州银行	4,120,044.00	8.04
40	688256	寒武纪	4,119,228.08	8.04
41	603259	药明康德	4,022,009.00	7.85
42	000725	京东方A	4,006,975.00	7.82
43	300308	中际旭创	3,963,266.00	7.73
44	600893	航发动力	3,947,643.00	7.70
45	002714	牧原股份	3,939,142.00	7.69
46	000807	云铝股份	3,906,767.00	7.62
47	300502	新易盛	3,805,207.20	7.43
48	300760	迈瑞医疗	3,677,307.00	7.18
49	601816	京沪高铁	3,658,129.00	7.14
50	601728	中国电信	3,578,225.00	6.98
51	000425	徐工机械	3,489,376.00	6.81
52	600660	福耀玻璃	3,438,369.00	6.71
53	600809	山西汾酒	3,392,224.00	6.62
54	600760	中航沈飞	3,345,120.00	6.53
55	603501	豪威集团	3,332,116.00	6.50
56	688111	金山办公	3,297,268.51	6.43
57	603596	伯特利	3,217,619.00	6.28
58	000568	泸州老窖	3,167,195.00	6.18
59	300442	润泽科技	3,164,438.00	6.18
60	601668	中国建筑	3,143,982.00	6.14
61	605499	东鹏饮料	3,093,143.00	6.04
62	300498	温氏股份	3,076,901.00	6.00
63	600309	万华化学	3,018,006.00	5.89
64	002415	海康威视	3,000,856.00	5.86
65	002850	科达利	2,997,414.00	5.85
66	601127	赛力斯	2,992,227.00	5.84
67	000063	中兴通讯	2,923,701.00	5.71
68	002352	顺丰控股	2,876,028.00	5.61
69	001979	招商蛇口	2,809,656.00	5.48
70	600600	青岛啤酒	2,802,809.00	5.47
71	600016	民生银行	2,797,446.00	5.46
72	600406	国电南瑞	2,710,463.00	5.29
73	600674	川投能源	2,703,204.00	5.28
74	601919	中远海控	2,700,439.00	5.27
75	603019	中科曙光	2,651,780.00	5.18
76	600941	中国移动	2,640,908.00	5.15
77	002230	科大讯飞	2,531,811.00	4.94
78	600988	赤峰黄金	2,531,318.00	4.94
79	600050	中国联通	2,510,981.00	4.90
80	601012	隆基绿能	2,497,824.00	4.87
81	600060	海信视像	2,488,034.00	4.86

82	601857	中国石油	2,464,618.00	4.81
83	002463	沪电股份	2,464,292.00	4.81
84	603986	兆易创新	2,462,394.00	4.81
85	002050	三花智控	2,374,232.30	4.63
86	000338	潍柴动力	2,371,642.00	4.63
87	601939	建设银行	2,368,273.00	4.62
88	601963	重庆银行	2,361,497.00	4.61
89	601985	中国核电	2,360,568.00	4.61
90	601766	中国中车	2,330,409.88	4.55
91	600028	中国石化	2,241,565.00	4.37
92	601688	华泰证券	2,217,835.00	4.33
93	688008	澜起科技	2,215,639.65	4.32
94	601225	陕西煤业	2,212,870.00	4.32
95	601658	邮储银行	2,203,999.00	4.30
96	688012	中微公司	2,173,253.00	4.24
97	603993	洛阳钼业	2,159,393.00	4.21
98	601006	大秦铁路	2,157,830.00	4.21
99	000680	山推股份	2,137,444.00	4.17
100	603306	华懋科技	2,121,142.00	4.14
101	002142	宁波银行	2,095,318.00	4.09
102	002027	分众传媒	2,080,780.00	4.06
103	601138	工业富联	2,007,546.00	3.92
104	000100	TCL 科技	1,999,657.00	3.90
105	000963	华东医药	1,998,034.02	3.90
106	600104	上汽集团	1,991,125.00	3.89
107	603288	海天味业	1,975,788.00	3.86
108	601818	光大银行	1,940,885.00	3.79
109	002244	滨江集团	1,884,025.00	3.68
110	688596	正帆科技	1,872,858.83	3.65
111	601009	南京银行	1,856,737.00	3.62
112	600150	中国船舶	1,846,177.00	3.60
113	601888	中国中免	1,838,550.98	3.59
114	600585	海螺水泥	1,823,033.00	3.56
115	600938	中国海油	1,797,294.00	3.51
116	300033	同花顺	1,795,288.00	3.50
117	601881	中国银河	1,788,062.00	3.49
118	600999	招商证券	1,775,491.00	3.46
119	688800	瑞可达	1,774,884.03	3.46
120	600547	山东黄金	1,768,961.00	3.45
121	600019	宝钢股份	1,721,921.00	3.36
122	600905	三峡能源	1,719,577.00	3.36
123	000661	长春高新	1,707,962.00	3.33
124	600048	保利发展	1,698,194.00	3.31

125	600111	北方稀土	1,693,106.00	3.30
126	000938	紫光股份	1,690,207.00	3.30
127	688235	百济神州	1,686,550.24	3.29
128	002600	领益智造	1,676,829.00	3.27
129	600011	华能国际	1,676,046.00	3.27
130	300015	爱尔眼科	1,668,067.00	3.26
131	002028	思源电气	1,665,163.00	3.25
132	000625	长安汽车	1,630,633.00	3.18
133	601390	中国中铁	1,628,676.00	3.18
134	605333	沪光股份	1,620,035.00	3.16
135	600089	特变电工	1,613,832.00	3.15
136	688120	华海清科	1,607,001.84	3.14
137	600426	华鲁恒升	1,597,468.00	3.12
138	000977	浪潮信息	1,577,237.00	3.08
139	300433	蓝思科技	1,525,718.00	2.98
140	601077	渝农商行	1,520,170.00	2.97
141	688271	联影医疗	1,515,008.67	2.96
142	000975	山金国际	1,510,178.00	2.95
143	002601	龙佰集团	1,507,368.00	2.94
144	601600	中国铝业	1,471,740.00	2.87
145	600436	片仔癀	1,470,352.00	2.87
146	300408	三环集团	1,442,314.00	2.81
147	002179	中航光电	1,412,205.00	2.76
148	002241	歌尔股份	1,405,821.00	2.74
149	600584	长电科技	1,384,265.00	2.70
150	603369	今世缘	1,359,249.00	2.65
151	601989	中国重工	1,347,257.00	2.63
152	002049	紫光国微	1,339,652.00	2.61
153	600015	华夏银行	1,313,653.00	2.56
154	000538	云南白药	1,309,461.00	2.56
155	300014	亿纬锂能	1,274,315.00	2.49
156	601001	晋控煤业	1,268,782.00	2.48
157	601825	沪农商行	1,267,942.00	2.47
158	000921	海信家电	1,259,485.00	2.46
159	600958	东方证券	1,250,327.00	2.44
160	600588	用友网络	1,244,231.00	2.43
161	600066	宇通客车	1,231,505.00	2.40
162	605117	德业股份	1,227,377.96	2.40
163	002422	科伦药业	1,224,995.00	2.39
164	600886	国投电力	1,223,029.00	2.39
165	600438	通威股份	1,221,567.03	2.38
166	000776	广发证券	1,192,221.00	2.33
167	600415	小商品城	1,191,399.00	2.33

168	600009	上海机场	1,190,995.00	2.32
169	002311	海大集团	1,183,784.76	2.31
170	601607	上海医药	1,168,881.00	2.28
171	601872	招商轮船	1,167,512.00	2.28
172	601838	成都银行	1,152,909.00	2.25
173	300818	耐普矿机	1,150,998.43	2.25
174	603799	华友钴业	1,147,953.00	2.24
175	600795	国电电力	1,144,756.00	2.23
176	601669	中国电建	1,140,447.00	2.23
177	600489	中金黄金	1,115,923.00	2.18
178	601877	正泰电器	1,099,358.00	2.15
179	002304	洋河股份	1,088,894.07	2.13
180	300122	智飞生物	1,088,243.00	2.12
181	600570	恒生电子	1,076,992.00	2.10
182	688036	传音控股	1,071,315.49	2.09
183	601377	兴业证券	1,053,004.00	2.05
184	601058	赛轮轮胎	1,039,834.00	2.03
185	000157	中联重科	1,034,212.88	2.02

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	600519	贵州茅台	11,510,426.00	22.46
2	300750	宁德时代	8,790,003.00	17.15
3	600036	招商银行	5,707,790.00	11.14
4	601702	华峰铝业	5,436,826.33	10.61
5	601088	中国神华	4,824,566.00	9.42
6	601689	拓普集团	4,474,337.00	8.73
7	300502	新易盛	4,400,351.00	8.59
8	300308	中际旭创	4,379,842.20	8.55
9	002475	立讯精密	4,076,242.00	7.95
10	600276	恒瑞医药	4,076,172.17	7.95
11	600933	爱柯迪	3,783,292.00	7.38
12	000333	美的集团	3,583,510.00	6.99
13	600690	海尔智家	3,443,793.00	6.72
14	600031	三一重工	3,256,818.30	6.36
15	000425	徐工机械	3,199,921.00	6.24
16	600919	江苏银行	3,051,964.00	5.96
17	000807	云铝股份	3,034,183.00	5.92
18	603259	药明康德	2,804,264.00	5.47
19	600060	海信视像	2,565,479.00	5.01
20	605499	东鹏饮料	2,556,471.00	4.99

21	300059	东方财富	2,549,250.00	4.97
22	300274	阳光电源	2,536,115.00	4.95
23	601166	兴业银行	2,484,451.00	4.85
24	601100	恒立液压	2,451,218.25	4.78
25	603306	华懋科技	2,330,887.00	4.55
26	002594	比亚迪	2,081,276.70	4.06
27	002371	北方华创	2,032,391.00	3.97
28	601799	星宇股份	1,991,045.00	3.89
29	688981	中芯国际	1,939,776.09	3.79
30	300442	润泽科技	1,934,981.00	3.78
31	600988	赤峰黄金	1,921,572.00	3.75
32	688256	寒武纪	1,837,503.76	3.59
33	688596	正帆科技	1,830,192.96	3.57
34	600809	山西汾酒	1,796,982.00	3.51
35	300124	汇川技术	1,769,940.00	3.45
36	001979	招商蛇口	1,756,199.00	3.43
37	688111	金山办公	1,749,154.99	3.41
38	000858	五粮液	1,744,583.00	3.40
39	601899	紫金矿业	1,744,410.00	3.40
40	600887	伊利股份	1,717,055.00	3.35
41	000963	华东医药	1,715,581.00	3.35
42	601601	中国太保	1,660,709.00	3.24
43	601225	陕西煤业	1,659,339.68	3.24
44	688235	百济神州	1,638,398.58	3.20
45	601288	农业银行	1,597,707.00	3.12
46	601229	上海银行	1,597,551.00	3.12
47	002850	科达利	1,570,898.00	3.07
48	600016	民生银行	1,546,187.00	3.02
49	002463	沪电股份	1,501,963.00	2.93
50	688120	华海清科	1,500,031.54	2.93
51	605333	沪光股份	1,457,261.00	2.84
52	002050	三花智控	1,431,333.00	2.79
53	300818	耐普矿机	1,403,488.55	2.74
54	000651	格力电器	1,363,766.94	2.66
55	600600	青岛啤酒	1,354,976.00	2.64
56	601857	中国石油	1,340,404.00	2.62
57	601211	国泰海通	1,312,638.00	2.56
58	603993	洛阳钼业	1,285,138.00	2.51
59	688041	海光信息	1,268,269.66	2.48
60	000568	泸州老窖	1,256,218.00	2.45
61	000661	长春高新	1,231,422.00	2.40
62	600660	福耀玻璃	1,218,025.00	2.38
63	002028	思源电气	1,178,042.00	2.30

64	600938	中国海油	1,145,405.00	2.24
65	300760	迈瑞医疗	1,136,960.00	2.22
66	600000	浦发银行	1,085,176.00	2.12
67	601985	中国核电	1,078,958.00	2.11
68	000725	京东方A	1,067,073.00	2.08
69	601336	新华保险	1,066,085.00	2.08
70	002304	洋河股份	1,026,662.00	2.00

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	685,795,403.69
卖出股票收入（成交）总额	270,880,468.03

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	22,753,974.49	1.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	569,243,288.34	44.58
	其中：政策性金融债	66,455,266.30	5.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,965,657.24	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	498,563,821.37	39.04
10	合计	1,093,526,741.44	85.64

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	092280080	22 光大银行 二级资本债 01A	900,000	94,751,210.96	7.42
2	232380089	23 中信银行 二级资本债 01A	700,000	74,197,483.84	5.81
3	092280083	22 建行永续 债 01	700,000	73,879,515.07	5.79

4	2228001	22 邮储银行 永续债 01	600,000	62,462,222.47	4.89
5	242480002	24 兴业银行 永续债 01	600,000	61,239,724.93	4.80

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，兴业银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中国建设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	164,620.34
2	应收清算款	463,104.07
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	627,734.41
---	----	------------

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	127090	兴瑞转债	1,407,164.54	0.11
2	132026	G三峡EB2	578,546.30	0.05
3	113052	兴业转债	512,905.01	0.04
4	113042	上银转债	259,219.60	0.02
5	113056	重银转债	207,821.79	0.02

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 (%)
平安添裕债券 A	527	2,304,262.10	1,186,913,609.23	97.74	27,432,518.55	2.26
平安添裕债券 C	111	81,420.95	7,743,295.05	85.68	1,294,430.61	14.32
平安添裕债券 E	1	976.85	0.00	0.00	976.85	100.00
合计	623	1,963,699.57	1,194,656,904.28	97.65	28,727,926.01	2.35

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	平安添裕债券 A	100,080.59	0.0082
	平安添裕债券 C	9.38	0.0001

有从业人员持有本基金	平安添裕债券 E	-	-
	合计	100,089.97	0.0082

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	平安添裕债券 A	0
	平安添裕债券 C	0
	平安添裕债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安添裕债券 A	10~50
	平安添裕债券 C	0
	平安添裕债券 E	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安添裕债券 A	平安添裕债券 C	平安添裕债券 E
基金合同生效日（2020 年 6 月 17 日）基金份额总额	2,330,476,223.12	44,102,092.13	-
本报告期期初基金份额总额	40,532,228.78	8,959,220.95	-
本报告期基金总申购份额	1,178,833,454.44	371,939.28	976.85
减：本报告期基金总赎回份额	5,019,555.44	293,434.57	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,214,346,127.78	9,037,725.66	976.85

§ 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

一、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，李海波先生新任公司督察长，原督察长陈特正先生转任风控负责人；游自强先生新任公司信息技术负责人，副总经理林婉文女士不再兼任信息技术负责人。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

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，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

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，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 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
信达证券	1	384,827,130 .33	40.25	167,749.96	40.25	
中信证券	1	225,208,496 .71	23.56	98,168.46	23.56	

国盛证券	1	144,889,266 .96	15.16	63,160.21	15.16	
华泰证券	2	102,468,372 .10	10.72	44,666.02	10.72	
天风证券	1	76,982,589. 12	8.05	33,556.30	8.05	
广发证券	1	21,649,233. 48	2.26	9,437.22	2.26	
川财证券	2	-	-	-	-	
方正证券	3	-	-	-	-	
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(%)
信达证券	31,406,198 .85	55.04	17,472,000.0 0	91.61	-	-
中信证券	6,139,455. 98	10.76	-	-	-	-
国盛证券	2,301,118. 67	4.03	-	-	-	-
华泰证券	6,937,378. 03	12.16	1,600,000.00	8.39	-	-
天风证券	3,777,000. 15	6.62	-	-	-	-
广发证券	6,495,645. 58	11.38	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
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	2025年01月15日
2	平安添裕债券型证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025年01月21日
3	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	2025年02月08日
4	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增国泰君安证券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	2025年02月20日
5	平安添裕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	2025年02月28日
6	平安添裕债券型证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2025年02月28日
7	平安添裕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	2025年02月28日
8	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年02月28日
9	平安基金管理有限公司关于平安添裕债券型证券投资基金增设E类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年02月28日
10	平安添裕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	2025年02月28日
11	平安基金管理有限公司关于新增平安添裕债券型证券投资基金E类份额销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月03日
12	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月11日
13	平安添裕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	2025年03月25日
14	平安添裕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	2025年03月26日
15	平安添裕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	2025年03月26日
16	平安添裕债券型证券投资基金2024年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月28日
17	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	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月31日

	况		
18	平安添裕债券型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 21 日
19	平安基金管理有限公司关于新增大连网金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	2025 年 04 月 22 日
20	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	2025 年 05 月 21 日
21	平安基金管理有限公司关于新增上海攀赢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	2025 年 05 月 23 日
22	平安基金管理有限公司关于终止与民商基金销售(上海)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	2025 年 05 月 30 日
23	平安添裕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	2025 年 05 月 30 日
24	平安添裕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	2025 年 05 月 30 日
25	平安基金管理有限公司关于新增上海华夏财富投资管理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	2025 年 06 月 18 日
26	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	2025 年 06 月 30 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	2025 年 04 月 16 日-2025 年 06 月 30 日	0.00	588,984,980.86	0.00	588,984,980.86	48.14
	2	2025 年 04 月 16 日-2025 年 06 月 30 日	0.00	588,984,980.86	0.00	588,984,980.86	48.14
个人	1	2025 年 01 月 01 日-2025	12,465,582.82	0.00	0.00	12,465,582.82	1.02

		年 04 月 15 日					
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

为更好地满足投资者的投资理财需求，根据《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》及《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等法律法规的规定及平安添裕债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同的约定，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与本基金基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，决定自 2025 年 2 月 28 日起在现有基金份额的基础上增设 E 类基金份额。详细内容可阅读本公司于 2025 年 2 月 28 日发布的《平安基金管理有限公司关于平安添裕债券型证券投资基金增设 E 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》。

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

2025 年 8 月 29 日