

平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发
起式基金中基金（FOF）
2025 年年度报告

2025 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 30 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。本年度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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03月27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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自2025年10月15日（基金合同生效日）起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况	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	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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合规守信情况的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47

8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3	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	49
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	50
8.6	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	50
8.7	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	50
8.8	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	50
8.9	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	50
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	50
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
8.12	本报告期投资基金情况	51
8.13	投资组合报告附注	57
§ 9	基金份额持有人信息	57
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.3	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	58
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	58
9.5	发起式基金发起资金持有份额情况	59
§ 10	开放式基金份额变动	59
§ 11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
11.2	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	60
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4	基金投资策略的改变	60
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	60
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
11.7	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.9	其他重大事件	62
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	62
12.1	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	62
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 13	备查文件目录	63
13.1	备查文件目录	63
13.2	存放地点	63
13.3	查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	
基金简称	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式(FOF)	
基金主代码	025247	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年10月15日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,807,675,431.70份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式(FOF)A	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式(FOF)C
下属分级基金的交易代码	025247	025248
报告期末下属分级基金的份额总额	1,494,915,895.39份	1,312,759,536.31份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过资产配置及优选基金，在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、基金投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 内部基金精选策略 (2) 外部基金精选策略 (3) 公募 REITs 投资策略 3、股票投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*75%+沪深300指数收益率*18%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率*2%+同期银行活期存款利率*5%
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金中基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。</p> <p>本基金若投资港股通标的证券，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。</p>

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	李海波	张姗
	联系电话	0755-88622632	400-61-95555

人	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-800-4800	400-61-95555
传真		0755-23997878	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		罗春风	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025年10月15日(基金合同生效日)-2025年12月31日	
	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C
本期已实现收益	-2,973,008.78	-3,438,576.35
本期利润	-5,206,793.62	-5,400,043.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0035	-0.0041
本期加权平均净值利润率	-0.35%	-0.41%
本期基金份额净值增长率	-0.35%	-0.41%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	
期末可供分配利润	-5,206,793.62	-5,400,043.43
期末可供分配基金份额利润	-0.0035	-0.0041
期末基金资产净值	1,489,709,101.77	1,307,359,492.88
期末基金份额净值	0.9965	0.9959
3.1.3 累计期末指标	2025年末	
基金份额累计净值增长率	-0.35%	-0.41%

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。
4. 本基金基金合同于2025年10月15日正式生效，截至报告期末未满一年；

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A

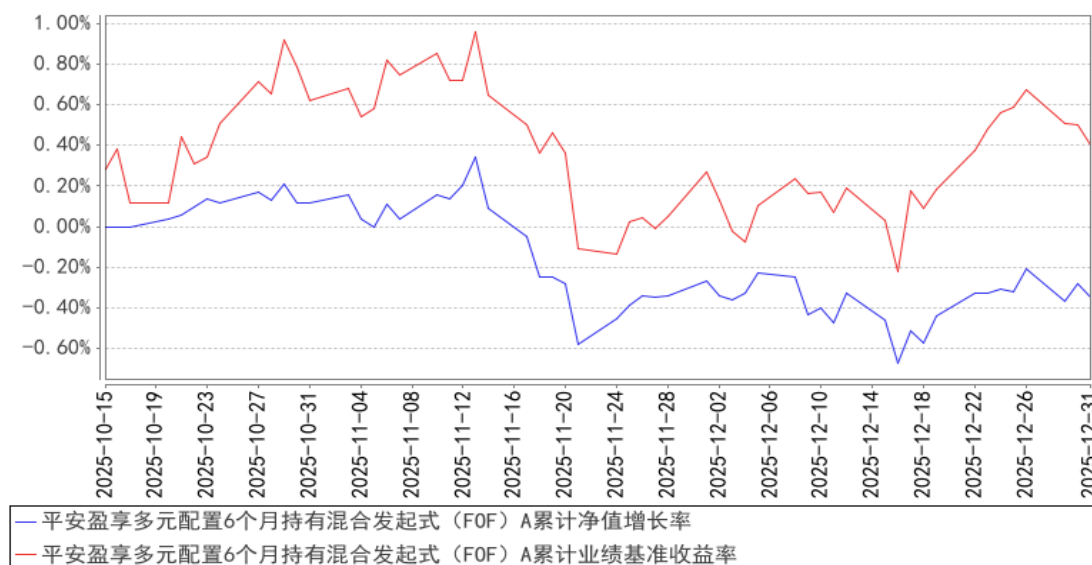
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-0.35%	0.10%	0.40%	0.17%	-0.75%	-0.07%

平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C

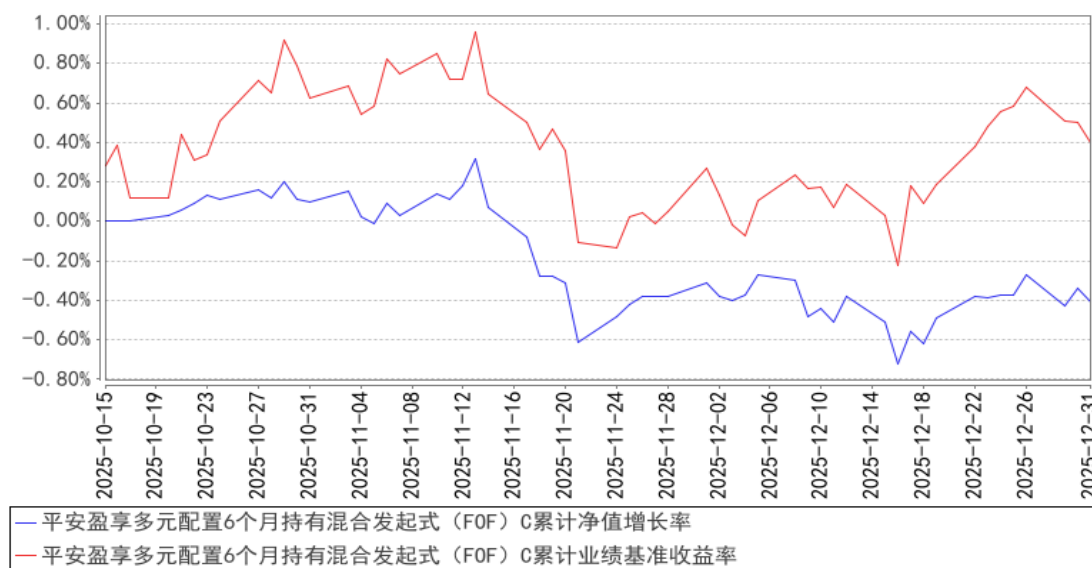
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-0.41%	0.10%	0.40%	0.17%	-0.81%	-0.07%

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

平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）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



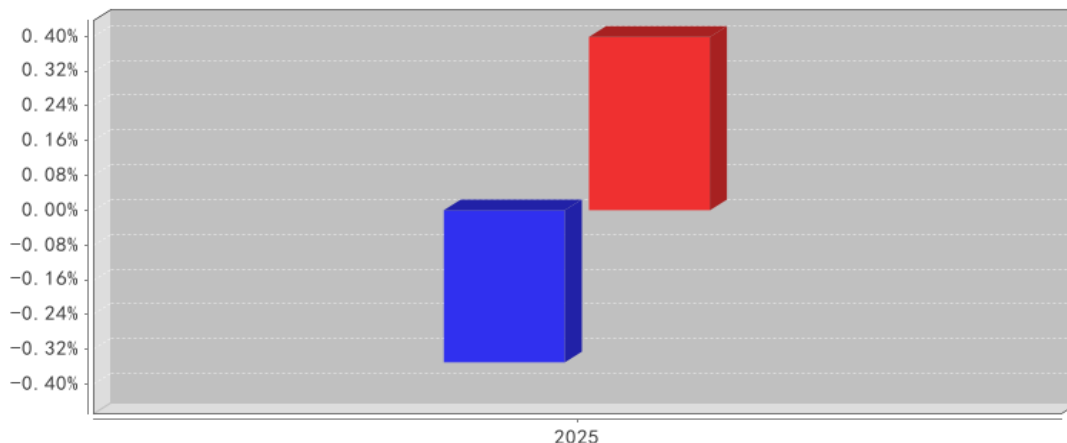
平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2025年10月15日正式生效，截至报告期末未满半年；
 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。

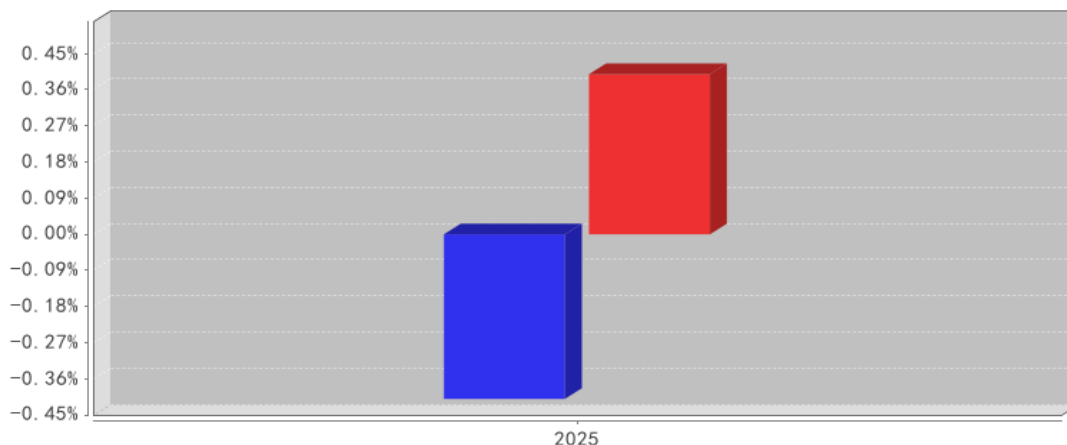
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



- 平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A净值增长率
- 平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A业绩基准收益率

平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



- 平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C净值增长率
- 平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C业绩基准收益率

注：本基金基金合同于2025年10月15日正式生效，合同生效当年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于2025年10月15日成立，自合同生效日以来未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于2011年1月7日，总部位于深圳，是中国平安集团投资板块的重要成员。公司业务范围涵盖公募基金管理业务、资本市场专户管理业务，具有受托管理保险资金资产管理人资格、合格境内机构投资者(QDII)资格。截至2025年末，公司综合管理规模近9000亿元，公募管理规模7176亿元，累计服务客户数超1.7亿人，产品线涵盖货币、债券、混合、股票、指数、FOF、MOM、REITs等各类产品。公司以“为持有人创造价值”为使命，打造了一支人才梯队完善、长期业绩优异的超160人投研团队，构建起“业绩可归因、策略可复制、人才可持续”的专业投研平台，为投资者创造长期稳健的投资回报，致力成为受投资者信赖、行业领先的综合型资产管理公司。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高莺	FOF 投资部投资执行总经理，平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理	2025年10月15日	-	17年	高莺女士，CFA，浙江大学经济学本硕，美国爱荷华州立大学经济学博士，曾先后担任联邦家庭贷款银行资本市场分析师、美国太平洋投资管理公司(PIMCO)养老金投资部投资研究岗。2019年1月加入平安基金管理有限公司，现任FOF投资部投资执行总经理。同时担任平安养老目标日期2035三年持有期混合型基金中基金（FOF）、平安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、平安盈禧均衡配置1年持有期混合型基金中基金（FOF）、平安养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、平安盈瑞六个月持有期债券型基金中基金（FOF）、平安养老目标日期2050三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、平安盈弘6个月持有期债券型基金中基金（FOF）、平安元享90天持有期债券型基金中基金（FOF）、平安盈泽1年持有期债券型基金中基金（FOF）、平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决

定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、风控负责人、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 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。

4.3.3 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年国民经济顶住多重压力保持稳中有进发展态势。但外部环境变化影响加深，国内供需矛盾突出，经济发展中老问题、新挑战仍然不少。全年，GDP比上年增长5%；工业增加值比上年增长5.9%；服务业增加值比上年增长5.4%；社会消费品零售总额比上年增长3.7%；全国固定资产投资比上年下降3.8%。货物进出口总额比上年增长3.8%，其中，出口增长6.1%；进口增长0.5%；CPI与上年持平；PPI比上年下降2.6%。金融数据方面，2025年社会融资规模增量比上年多3.34万亿元，其中，政府债券净融资同比多2.54万亿元。12月末，M2余额同比增长8.5%；M1余额同比增长3.8%。政策方面，12月的中央经济工作会议指出，明年经济工作在政策取向上，要继续实施更加积极的财政政策。要继续实施适度宽松的货币政策。要增强宏观政策取向一致性和有效性。海外方面，纷扰不断，尤其美国引发的关税问题造成全球范围内不确定性的大幅上升。另一方面，美联储如预期中一样，开启新一轮降息周期。日央行12月加息25bp，发达经济体货币政策有所分化。

全年的股市行情，表现出流动性主导与风格轮动加剧的趋势。年初，受到技术突破等因素带动的TMT行业与机器人等板块相对强势。二季度，受贸易战影响，股市探底回升，行业上，金融相关行业回升势头相对较强。三、四季度，市场受风险偏好提升带动，股市整体上行，但成长风格强势时，价值风格往往有所回落。债市方面，年初以来，央行对固收市场施加了一定影响，对去年底的抢跑行情进行了一定的修正，一定程度上引发了债市的调整。二季度，贸易战引发的担忧情绪使市场利率水平再次下探。但当下半年市场风险偏好整体提升后，债市整体相对低迷。国际方面，上半年，美国新一届政府上台以及发起贸易战等因素，造成美股出现较大幅度的调整，但随后出现V型反转，不少科技巨头再次创出新高，下半年，受到科技巨头技术突破与高额投资计划的推动，美股连续创出新高，并持续高位震荡。另一方面，随着国际政治、经济环境不确定

性的上升与弱美元预期的增强，全年黄金价格屡创新高。

本基金于 2025 年 10 月 15 号成立，4 季度根据市场情况，择机逢低建仓。目前组合债基部分维持短债搭配一级、二级以及海外债基的配置策略；组合权益部分在 A 股、港股和海外均有配置，思路上持续寻找具备绝对收益的品种，并注重地域分散的多资产配置理念。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安盈享多元配置 6 个月持有混合发起式 (FOF) A 的基金份额净值 0.9965 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.35%，同期业绩比较基准收益率为 0.40%；截至本报告期末平安盈享多元配置 6 个月持有混合发起式 (FOF) C 的基金份额净值 0.9959 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.41%，同期业绩比较基准收益率为 0.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，国内经济仍会全面贯彻落实中央经济工作会议部署要求，在外部环境变化影响加深的背景下，着力解决国内供强需弱矛盾突出、重点领域风险隐患较多等发展中、转型中的问题，推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。我们认为，在传统经济领域尚未恢复活力、前沿科技领域仍需加快对国外先进技术的追赶步伐的局面下，平衡经济总量增长需求和经济转型需求的挑战仍然很大。我们将继续对房地产市场的变化、政策的延续性以及技术创新带来的生产力提升保持关注。海外方面，地缘政治矛盾有加剧的趋势，美国仍依靠宽松的财政和货币政策来维持其经济活力。

2026 年 A 股市场有望在政策支持与全球流动性宽松的双重驱动下实现稳步增长，结构性机会集中于“十五五”规划重点产业（如 AI、新能源、高端制造）及受益于海外需求复苏的出口链。国内经济呈现“弱复苏+结构分化”特征，工业韧性与政策发力将提供托底支撑；在美联储降息周期下，全球资金再配置或利好 A 股风险资产。债市可能继续维持窄幅震荡，短端性价比或高于长端。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通

过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.9 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

不适用。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明 (2026) 审字第 70039114_H152 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的财务报表, 包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表, 2025 年 10 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为, 后附的平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 10 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF), 并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不

	<p>对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 不能持续经营。</p>

	(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	黄拥璇
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室	
审计报告日期	2026年3月24日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	207,547,010.11
结算备付金		1,185,190.49
存出保证金		181,108.30
交易性金融资产	7.4.7.2	2,580,340,599.32
其中：股票投资		86,509,147.64
基金投资		2,493,831,451.68
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		12,204,713.94
应收股利		1,161.75
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		2,801,459,783.91
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-

衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		2,299,970.61
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,294,995.54
应付托管费		319,099.47
应付销售服务费		333,133.80
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	143,989.84
负债合计		4,391,189.26
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	2,807,675,431.70
未分配利润	7.4.7.12	-10,606,837.05
净资产合计		2,797,068,594.65
负债和净资产总计		2,801,459,783.91

注：（1）报告截止日2025年12月31日，基金份额总额2,807,675,431.70份，其中下属A类基金份额净值0.9965元，基金份额总额1,494,915,895.39份；下属C类基金份额净值0.9959元，基金份额总额1,312,759,536.31份。

（2）本基金合同于2025年10月15日生效，本报实际编制期间为2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日
一、营业总收入		-5,636,248.24
1. 利息收入		258,495.62
其中：存款利息收入	7.4.7.13	258,495.62
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		-
其他利息收入		-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,699,491.94
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-336,430.06
基金投资收益	7.4.7.15	-6,538,329.19
债券投资收益	7.4.7.16	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.17	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-
股利收益	7.4.7.20	5,175,267.31
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）	7.4.7.21	-4,195,251.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	-
减：二、营业总支出		4,970,588.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,241,170.91
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	798,234.43
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	829,202.45
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.24	-
7. 税金及附加		3,880.31
8. 其他费用	7.4.7.25	98,100.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,606,837.05
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,606,837.05
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-10,606,837.05

7.3 净资产变动表

会计主体：平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	2,807,675,431.70	-	2,807,675,431.70
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-10,606,837.05	-10,606,837.05
(一)、综合收益总额	-	-10,606,837.05	-10,606,837.05
(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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	2,807,675,431.70	-10,606,837.05	2,797,068,594.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) (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[2025]1677 号文《关于准予平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 注册的批复》准予注册, 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《平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》作为发起人向社会公开募集, 经向中国证监会备案, 《平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》于 2025 年 10 月 15 日正式生效。本基金为契约型开放式基金, 存续期限不定。本基金的募集期间为 2025 年 10 月 10 日至

2025 年 10 月 13 日, 设立时募集的扣除认购费后的实收基金 (本金) 为人民币 2,807,621,865.13 元, 在募集期间产生的活期存款利息为人民币 53,566.57 元, 以上实收基金 (本息) 合计为人民币 2,807,675,431.70 元, 折合 2,807,675,431.70 份基金份额, 业经安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙) 安永华明 (2025) 验字第 70039114_H25 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司, 基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金, 发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币 1,000 万元, 且发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书》的规定, 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, 但不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额类别, 称为 A 类基金份额; 从本类别基金资产净值中计提销售服务费, 且不收取认购/申购费用的基金份额, 称为 C 类基金份额。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 A 类基金份额和 C 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《平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 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, 包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金 (包括 QDII 基金、商品基金 (含商品期货基金和黄金 ETF)、公开募集基础设施证券投资基金 (以下简称“公募 REITs”)、香港互认基金)、国内依法发行上市的股票 (包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票、港股通标的 ETF、债券 (包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券 (含分离交易可转换债券)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券等中国证监会允许基金投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款 (包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为: 投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的比例不低于本基金资产的 80%, 其中投资于股票、股票型基金、计入权益类资产的混合型基金的比例合计占基金资产的 5%-30%, 投资于 QDII 基金、香港互认基金的比例合计不超过本基金资产的 20%, 投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%, 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%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票（含存托凭证）资产投资比例不低于基金资产60%的混合型基金；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票（含存托凭证）资产占基金资产比例均不低于60%的混合型基金。如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*75%+沪深300指数收益率*18%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率*2%+同期银行活期存款利率*5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2025年12月31日的财务状况以及自2025年10月15日（基金合同生效日）起至2025年12月31日止的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2025年10月15日（基金合同生效日）起至2025年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权

益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变

化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重

新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利

得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分

配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要说明的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》,自 2025 年 8 月 8 日起,对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

(3) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运

用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《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[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
活期存款	207,547,010.11
等于：本金	207,523,534.61
加：应计利息	23,475.50
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	207,547,010.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	84,002,203.47	-	86,509,147.64	2,506,944.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	2,500,533,647.77	-	2,493,831,451.68	-6,702,196.09
其他	-	-	-	-
合计	2,584,535,851.24	-	2,580,340,599.32	-4,195,251.92

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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。

7.4.7.3.2 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。

7.4.7.3.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

7.4.7.5.2 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。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

7.4.7.6.2 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。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 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。

7.4.7.7.2 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。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	48,989.84
其中：交易所市场	48,989.84
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,000.00
合计	143,989.84

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安盈享多元配置6个月持有混合发起式(FOF)A

项目	本期 2025年10月15日(基金合同生效日)至2025年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,494,915,895.39	1,494,915,895.39
本期申购	-	-
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	1,494,915,895.39	1,494,915,895.39

平安盈享多元配置6个月持有混合发起式(FOF)C

项目	本期 2025年10月15日(基金合同生效日)至2025年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,312,759,536.31	1,312,759,536.31
本期申购	-	-
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	1,312,759,536.31	1,312,759,536.31

注：(1) 本基金合同于2025年10月15日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币2,807,621,865.13元，折合2,807,621,865.13份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币53,566.57元，折合53,566.57份基金份额。其中A类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币1,494,886,154.72元，折合1,494,886,154.72份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币29,740.67元，折合29,740.67份基金份额。C类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币1,312,735,710.41元，折合1,312,735,710.41份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币23,825.90元，折合23,825.90份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币2,807,675,431.70元，折合2,807,675,431.70份基金份额。

(2) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-2,973,008.78	-2,233,784.84	-5,206,793.62
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,973,008.78	-2,233,784.84	-5,206,793.62

平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-3,438,576.35	-1,961,467.08	-5,400,043.43
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,438,576.35	-1,961,467.08	-5,400,043.43

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日
活期存款利息收入	255,891.12
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	2,512.58
其他	91.92
合计	258,495.62

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-336,430.06
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	-336,430.06

7.4.7.14.2 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10月15日（基金合同生效日）至2025 年12月31日
卖出股票成交总额	14,253,737.00
减：卖出股票成本总额	14,521,796.05
减：交易费用	68,371.01
买卖股票差价收入	-336,430.06

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31 日
卖出/赎回基金成交总额	990,022,280.36
减：卖出/赎回基金成本总额	996,456,484.16
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	32,335.88
减：交易费用	71,789.51
基金投资收益	-6,538,329.19

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

7.4.7.16.3 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。

7.4.7.16.4 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。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 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。

7.4.7.17.2 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买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.17.3 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——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 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——申购差价收入。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 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。

7.4.7.18.2 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。

7.4.7.18.3 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。

7.4.7.18.4 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。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 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。

7.4.7.19.2 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。

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	249,521.60
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	4,925,745.71
合计	5,175,267.31

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日

1. 交易性金融资产	-4,195,251.92
股票投资	2,506,944.17
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-6,702,196.09
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,195,251.92

7.4.7.22 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

7.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	30.15
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,725,514.94
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	429,819.27

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

7.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期内未计提信用减值损失。

7.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	65,000.00
信息披露费	30,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	3,055.00
其他	45.71
合计	98,100.71

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司(“平安汇通”)	基金管理人的子公司
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
当期发生的基金应支付的管理费	3,241,170.91	
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,759,380.16	
应支付基金管理人的净管理费	1,481,790.75	

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的0.60%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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×0.60%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	798,234.43	

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的0.15%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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×0.15%/当年天数。

7.4.10.2.3 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10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C	合计
招商银行	-	829,202.45	829,202.45

合计	-	829,202.45	829,202.45
----	---	------------	------------

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0.3%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×0.3%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

7.4.10.4.2 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：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C
基金合同生效日（2025年10月15日）持有的基金份额	10,000,666.73	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	10,000,666.73	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.6690%	-

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。

7.4.10.5.2 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

注：无。

7.4.10.6 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10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期	207,547,010.11	255,891.12

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有基金管理人平安基金所管理的公开募集证券投资基金合计256,077,870.98元，占本基金资产净值的比例为9.16%。

7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期 2025年10月15日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	151,862.04
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	50,620.74

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的

基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购、赎回自身管理的其他基金（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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（不含本基金所投资的基金份额）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（不含本基金所投资的基金份额），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，本基金未持有债券和资产支持证券投资。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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期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（不含本基金所投资的基金份额）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(不含本基金所投资的基金份额)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7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约

规定的重新定价日或到期日进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	207,547,010.11	-	-	-	207,547,010.11
结算备付金	1,185,190.49	-	-	-	1,185,190.49
存出保证金	181,108.30	-	-	-	181,108.30
交易性金融资产	-	-	-	2,580,340,599.32	2,580,340,599.32
应收股利	-	-	-	1,161.75	1,161.75
应收清算款	-	-	-	12,204,713.94	12,204,713.94
资产总计	208,913,308.90	-	-	2,592,546,475.01	2,801,459,783.91
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,294,995.54	1,294,995.54
应付托管费	-	-	-	319,099.47	319,099.47
应付清算款	-	-	-	2,299,970.61	2,299,970.61
应付销售服务费	-	-	-	333,133.80	333,133.80
其他负债	-	-	-	143,989.84	143,989.84
负债总计	-	-	-	4,391,189.26	4,391,189.26
利率敏感度缺口	208,913,308.90	-	-	2,588,155,285.75	2,797,068,594.65

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本报告期末，本基金未持有债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,420,909.64	-	4,420,909.64
资产合计	-	4,420,909.64	-	4,420,909.64
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	-	4,420,909.64	-	4,420,909.64

7.4.13.4.2.2 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	
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12月31日）
	所有外币相对于人民币升值5%	221,045.48
	所有外币相对于人民币贬值5%	-221,045.48

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	86,509,147.64	3.09
交易性金融资产—基金投资	2,493,831,451.68	89.16

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	2,580,340,599.32	92.25

7.4.13.4.3.2 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	
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 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	5,908,711.52
	沪深 300 指数下降 5%	-5,908,711.52

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注: 无

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	2,442,283,016.32
第二层次	138,057,583.00
第三层次	-

合计	2,580,340,599.32
----	------------------

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：于本报告期末，本基金无属于第三层次的金融资产。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：于本报告期末，本基金未使用不可观察输入值。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	86,509,147.64	3.09
	其中：股票	86,509,147.64	3.09
2	基金投资	2,493,831,451.68	89.02
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	208,732,200.60	7.45
8	其他各项资产	12,386,983.99	0.44
9	合计	2,801,459,783.91	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4,420,909.64元，占净值比例0.16%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	24,732,225.00	0.88
C	制造业	52,276,921.00	1.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,079,092.00	0.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	82,088,238.00	2.93

8.2.2 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	1,370,031.19	0.05
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	399,837.43	0.01

能源	-	-
金融	-	-
医疗	-	-
工业	-	-
地产业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	2,651,041.02	0.09
公用事业	-	-
合计	4,420,909.64	0.16

注：以上分类采用全球行业分类标准。

8.3 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	601899	紫金矿业	717,500	24,732,225.00	0.88
2	000333	美的集团	231,700	18,107,355.00	0.65
3	300750	宁德时代	36,600	13,441,716.00	0.48
4	600519	贵州茅台	8,800	12,119,184.00	0.43
5	600595	中孚实业	946,800	7,432,380.00	0.27
6	600900	长江电力	186,800	5,079,092.00	0.18
7	00700	腾讯控股	4,900	2,651,041.02	0.09
8	01378	中国宏桥	46,500	1,370,031.19	0.05
9	002532	天山铝业	72,700	1,176,286.00	0.04
10	09988	阿里巴巴-W	3,100	399,837.43	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	22,660,270.00	0.81
2	000333	美的集团	18,420,675.28	0.66
3	600900	长江电力	14,474,070.00	0.52
4	300750	宁德时代	13,622,343.00	0.49
5	600519	贵州茅台	12,650,419.00	0.45
6	600595	中孚实业	6,694,531.00	0.24
7	00700	腾讯控股	2,895,488.27	0.10
8	600031	三一重工	2,495,493.00	0.09
9	01378	中国宏桥	1,358,831.08	0.05
10	300115	长盈精密	1,298,374.00	0.05
11	002532	天山铝业	998,617.00	0.04
12	000425	徐工机械	499,686.00	0.02

13	09988	阿里巴巴-W	455,201.89	0.02
----	-------	--------	------------	------

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	8,995,280.00	0.32
2	600031	三一重工	2,357,618.00	0.08
3	300115	长盈精密	1,418,308.00	0.05
4	601899	紫金矿业	997,559.00	0.04
5	000425	徐工机械	484,972.00	0.02

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。

8.4.3 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	98,523,999.52
卖出股票收入（成交）总额	14,253,737.00

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金通过资产配置及优选基金，在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。

基金的投资组合比例为：投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的比例不低于本基金资产的 80%，其中投资于股票、股票型基金、计入权益类资产的混合型基金的比例合计占基金资产的 5%-30%，投资于 QDII 基金、香港互认基金的比例合计不超过本基金资产的 20%，投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%，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%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金为混合型基金中基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

本基金若投资港股通标的证券，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。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	005754	平安短债 A	契约型开放式	161,427,021.39	200,766,786.50	7.18	是
2	110051	易方达安和中短债债券 A	契约型开放式	190,437,425.97	200,702,003.23	7.18	否

3	007823	天弘弘择短债A	契约型开放式	170,370,560.91	200,543,187.25	7.17	否
4	006829	鹏扬利沣短债A	契约型开放式	185,063,386.42	200,479,166.51	7.17	否
5	511360	海富通中证短融ETF	交易型开放式(ETF)	1,363,700.00	153,873,089.50	5.50	否
6	002351	易方达裕祥回报债券A	契约型开放式	75,877,524.19	121,859,303.85	4.36	否
7	006319	易方达安瑞短债债券A	契约型开放式	99,878,313.13	100,287,814.21	3.59	否
8	014000	中欧丰利债券A	契约型开放式	68,047,404.32	77,846,230.54	2.78	否
9	968130	东亚联丰亚洲策略债券A类别人民币(累积)	契约型开放式	713,461.25	73,457,970.30	2.63	否
10	000385	景顺长城景颐双利债券A类	契约型开放式	37,621,729.98	69,637,822.19	2.49	否
11	968132	东亚联丰亚洲策略债券A类别人民币(对冲)(累积)	契约型开放式	662,220.53	64,599,612.70	2.31	否
12	513180	华夏恒生科技ETF(QDII)	交易型开放式(ETF)	84,107,100.00	61,566,397.20	2.20	否
13	002065	景顺长城景盛双息收益债券	契约型开	49,012,081.74	61,216,090.09	2.19	否

		A类	放式				
14	002920	中欧短债债券A	契约型开放式	53,702,211.39	57,515,068.40	2.06	否
15	159650	博时中债0-3年国开行ETF	交易型开放式(ETF)	488,100.00	52,404,368.40	1.87	否
16	003949	兴全稳泰债券A	契约型开放式	41,879,135.60	50,388,975.95	1.80	否
17	004827	平安中短债债券A	契约型开放式	42,804,554.40	50,299,631.88	1.80	是
18	519137	海富通瑞福债券A	契约型开放式	42,246,725.81	50,265,154.37	1.80	否
19	007754	上银慧永利中短期债券A	契约型开放式	47,423,883.15	50,212,407.48	1.80	否
20	005992	光大保德信超短债债券A	契约型开放式	44,626,026.42	50,137,340.68	1.79	否
21	003612	南方卓元债券A	契约型开放式	44,001,194.16	50,130,560.51	1.79	否
22	014846	博时恒乐债券A	契约型开放式	33,151,827.67	39,871,703.14	1.43	否
23	008448	德邦短债A	契约型开放式	25,962,725.66	30,103,780.40	1.08	否
24	016850	中欧颐利债券A	契约型开放式	27,034,068.67	30,088,918.43	1.08	否

25	009271	博时信用优选债券 A	契约型开放式	25,930,503.93	30,071,605.41	1.08	否
26	017592	汇添富添添乐双盈债券 A	契约型开放式	25,202,622.09	30,036,485.01	1.07	否
27	004904	人保货币 B	契约型开放式	30,003,753.38	30,003,753.38	1.07	否
28	513690	博时恒生高股息 ETF	交易型开放式 (ETF)	27,217,300.00	29,040,859.10	1.04	否
29	006662	易方达安悦超短债债券 A	契约型开放式	28,346,314.85	28,745,997.89	1.03	否
30	563360	华泰柏瑞中证 A500ETF	交易型开放式 (ETF)	21,001,200.00	26,503,514.40	0.95	否
31	159780	南方中证科创创业 50ETF	交易型开放式 (ETF)	24,919,100.00	22,900,652.90	0.82	否
32	968154	中银香港亚洲债 C3	契约型开放式	2,487,562.18	19,950,248.68	0.71	否
33	968155	中银香港亚洲债 C4	契约型开放式	2,362,670.64	19,633,793.02	0.70	否
34	513730	华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技 ETF(QDII)	交易型开放式 (ETF)	10,411,500.00	14,440,750.50	0.52	否
35	518880	华安黄金 ETF	交易型开	1,342,800.00	12,489,382.80	0.45	否

			放式 (ETF)				
36	513500	博时标普 500ETF	交易 型开 放式 (ETF)	4,713,800.00	11,463,961.60	0.41	否
37	513050	易方达中证海 外中国互联网 50(QDII-ETF)	交易 型开 放式 (ETF)	7,531,400.00	11,048,563.80	0.40	否
38	513010	易方达恒生科 技ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	14,573,900.00	10,915,851.10	0.39	否
39	004451	汇添富双鑫添 利债券A	契约 型开 放式	8,021,017.17	9,992,583.19	0.36	否
40	968112	海通亚洲总收 益债券H人民 币对冲	契约 型开 放式	180,858.97	9,929,971.32	0.36	否
41	008367	富国亚洲收益 债券(QDII)人 民币A	契约 型开 放式	9,197,019.87	9,886,796.36	0.35	否
42	159516	国泰中证半导 体材料设备主 题ETF	交易 型开 放式 (ETF)	5,848,600.00	9,024,389.80	0.32	否
43	513650	南方标普 500ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	4,560,000.00	8,244,480.00	0.29	否
44	513400	道琼斯ETF	交易 型开 放式 (ETF)	6,322,800.00	7,808,658.00	0.28	否
45	512880	国泰中证全指	交易	6,048,900.00	7,325,217.90	0.26	否

		证券公司ETF	型开放式(ETF)				
46	560860	万家中证工业有色金属主题ETF	交易型开放式(ETF)	3,972,000.00	6,311,508.00	0.23	否
47	513000	易方达奥明日经225ETF(QDII)	交易型开放式(ETF)	3,236,600.00	5,825,880.00	0.21	否
48	516510	易方达中证云计算与大数据主题ETF	交易型开放式(ETF)	3,107,900.00	5,255,458.90	0.19	否
49	023512	景顺长城景颐丰利债券F类	契约型开放式	3,330,003.33	5,013,986.01	0.18	否
50	511030	平安中高等级公司债利因子ETF	交易型开放式(ETF)	46,900.00	5,011,452.60	0.18	是
51	513290	汇添富纳斯达克生物科技ETF	交易型开放式(ETF)	1,984,200.00	3,021,936.60	0.11	否
52	159649	华安中债1-5年国开行债券ETF	交易型开放式(ETF)	27,700.00	3,010,131.30	0.11	否
53	563220	富国中证A500ETF	交易型开放式(ETF)	1,658,300.00	2,056,292.00	0.07	否
54	512670	国防ETF	交易型开放式	679,100.00	613,906.40	0.02	否

			(ETF)				
--	--	--	-------	--	--	--	--

8.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产证券投资基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集不动产证券投资基金。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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

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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	181,108.30
2	应收清算款	12,204,713.94
3	应收股利	1,161.75
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,386,983.99

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末投资前十名股票中无流通受限的股票。

8.13.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A	5,231	285,780.14	30,368,045.11	2.03	1,464,547,850.28	97.97
平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C	5,686	230,875.75	13,060,413.33	0.99	1,299,699,122.98	99.01
合计	10,864	258,438.46	43,428,458.44	1.55	2,764,246,973.26	98.45

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A	0
	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A	0
	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品的情况

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,666.73	0.36	10,000,000.00	0.36	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,666.73	0.36	10,000,000.00	0.36	3年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）A	平安盈享多元配置6个月持有混合发起式（FOF）C
基金合同生效日（2025年10月15日）基金份额总额	1,494,915,895.39	1,312,759,536.31
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,494,915,895.39	1,312,759,536.31

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

管理人：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。公司根据《中华人民共和国公司法》以及中国证监会《关于新〈公司法〉配套制度规则实施相关过渡期安排》等有关法律法规、监管规定完成了监事会改革工作，取消了监事会。

托管人：本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 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、基金管理业务的诉讼或仲裁。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金初次聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）服务，报告期内应支付给该事务所的报酬为65,000.00元。

11.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.7.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受稽查或处罚等情况。

11.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

11.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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 (%)	
东吴证券	1	48,361,801.00	42.88	21,080.55	43.03	
信达证券	1	36,250,269.28	32.14	15,801.42	32.25	
国投证券	1	21,191,499.24	18.79	9,067.76	18.51	
中信证券	2	6,974,167.00	6.18	3,040.11	6.21	
银河证券	3	-	-	-	-	

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、本基金本报告期合同生效，上述租用交易单元均为本期新增所用。

4、报告期内退租交易单元的情况：无。

11.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东吴证券	-	-	-	-	-	-	563,079,866.50	31.77
信达证券	-	-	-	-	-	-	103,736,097.14	5.85
国投证券	-	-	-	-	-	-	192,871,250.13	10.88
中信证券	-	-	-	-	-	-	912,835,847.38	51.50
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.9 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	平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金产品资料概要	中国证监会规定报刊及网站	2025年09月23日
2	平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金份额发售公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年09月23日
3	平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2025年09月23日
4	平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2025年09月23日
5	平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书	中国证监会规定报刊及网站	2025年09月23日
6	平安基金管理有限公司关于新增平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年09月26日
7	关于平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）提前结束募集的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年10月11日
8	平安基金管理有限公司关于平安盈享多元配置6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年10月16日
9	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10月25日
10	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12月26日
11	平安基金管理有限公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年12月27日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 募集注册的文件

(2) 平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同

(3) 平安盈享多元配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 托管协议

(4) 法律意见书

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.2 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

13.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2026 年 03 月 30 日