

平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型  
发起式基金中基金（FOF）  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| 3.3 其他指标                                | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 7         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 8         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 9         |
| 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             | 9         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 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       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 11        |
| 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 | 11        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 13        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 14        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 38        |
| 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       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 42        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 42        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 42        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 42        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 42        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 42        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 43        |
| 7.12 本报告期投资基金情况 .....                       | 43        |
| 7.13 投资组合报告附注 .....                         | 45        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 46        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 46        |
| 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 .....      | 46        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 46        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>46</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>47</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 47        |
| 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 .....      | 47        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 47        |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....               | 47        |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 47        |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 47        |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 47        |
| 10.9 其他重大事件 .....                           | 51        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>52</b> |
| 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 .....    | 52        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 53        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 53        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 53        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 53        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                                     |
|------------|-------------------------------------|
| 基金名称       | 平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF） |
| 基金简称       | 平安养老 2045                           |
| 基金主代码      | 011684                              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                              |
| 基金合同生效日    | 2021 年 4 月 20 日                     |
| 基金管理人      | 平安基金管理有限公司                          |
| 基金托管人      | 平安银行股份有限公司                          |
| 报告期末基金份额总额 | 44,505,753.03 份                     |
| 基金合同存续期    | 不定期                                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下，通过基金资产配置和组合管理，在合理控制投资组合波动性的同时，力争实现与其承担的风险相对应的长期稳健回报，追求基金资产的长期稳健增值。在 2045 年 12 月 31 日以前，本基金侧重于资本增值，当期收益为辅；在 2045 年 12 月 31 日之后，本基金侧重于当期收益，资本增值为辅。 |
| 投资策略   | 本基金将采取主动的大类资产配置策略，注重风险与收益的平衡，即在股票型基金、混合型基金、债券类基金、货币市场基金和其他资产之间的配置比例；其次，本基金将精选具有较高投资价值的证券投资基金、股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。   |
| 业绩比较基准 | 中证平安 2045 退休宝指数收益率*95%+同期银行活期存款利率*5%  |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金中基金，是目标日期基金，风险与收益水平会随着投资者目标时间期限的接近而逐步降低。本基金相对股票型基金、股票型基金中基金和一般的混合型基金其预期风险较小，但高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。   |

### 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                      | 平安银行股份有限公司                    |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 陈特正                             | 李帅帅                           |
|             | 联系电话 | 0755-22626828                   | 0755-25878287                 |
|             | 电子邮箱 | fundservice@pingan.com.cn       | LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-800-4800                    | 95511-3                       |
| 传真          |      | 0755-23997878                   | 0755-82080387                 |
| 注册地址        |      | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 | 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号          |
| 办公地址        |      | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 | 广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 |
| 邮政编码        |      | 518048                          | 518001                        |
| 法定代表人       |      | 罗春风                             | 谢永林                           |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023年1月1日-2023年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 592,746.06                |
| 本期利润          | 1,466,182.64              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0518                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 5.41%                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 5.35%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | -3,009,563.06             |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0676                   |
| 期末基金资产净值      | 42,834,388.10             |
| 期末基金份额净值      | 0.9624                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2023年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率   | -3.76%                    |

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

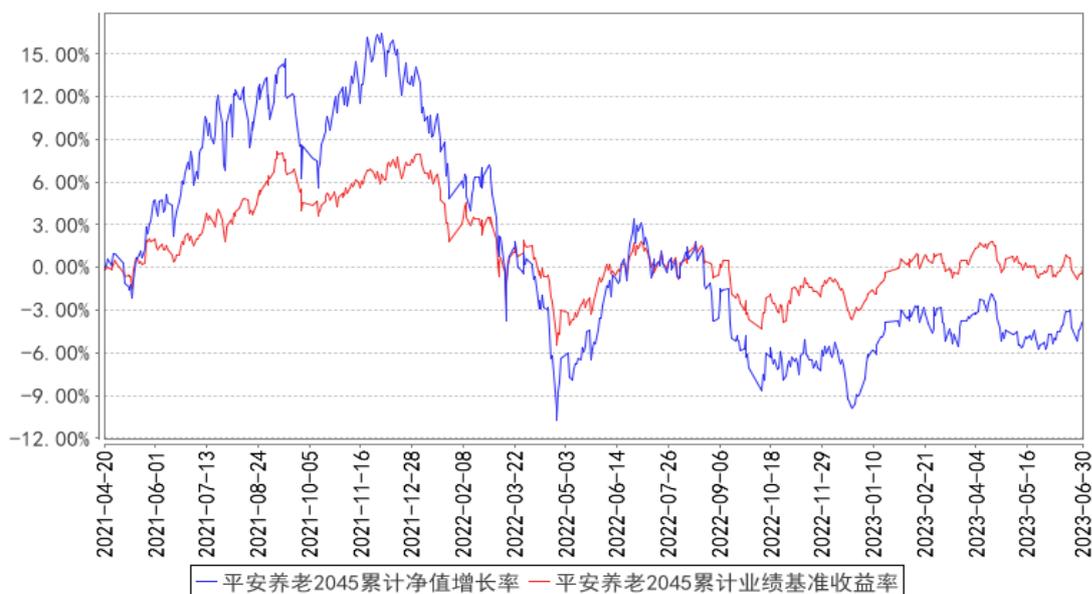
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 2.06%    | 0.53%       | 0.32%      | 0.38%         | 1.74% | 0.15% |
| 过去三个月 | -0.38%   | 0.50%       | -0.82%     | 0.34%         | 0.44% | 0.16% |

|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月      | 5.35%  | 0.54% | 2.96%  | 0.33% | 2.39%  | 0.21% |
| 过去一年       | -6.54% | 0.66% | -1.48% | 0.40% | -5.06% | 0.26% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.76% | 0.89% | -0.01% | 0.49% | -3.75% | 0.40% |

### 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

平安养老2045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 2021 年 04 月 20 日正式生效；

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

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、海外、专户七大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团

四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2023 年 6 月 30 日，平安基金共管理 186 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5,721.58 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 |        |  |
| 李正一 | 平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理 | 2022 年 7 月 13 日 | -    | 9 年    | 李正一先生，伊利诺伊理工学院硕士。历任上海长量基金销售投资顾问有限公司基金研究岗、大泰金石投资管理有限公司基金研究岗、上海苍石资产管理有限公司投资研究岗。2017 年 5 月加入平安基金管理有限公司，现任平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、平安养老目标日期 2025 一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。 |
| 尚琼  | 平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理 | 2023 年 4 月 19 日 | -    | 12 年   | 尚琼女士，北京大学金融学专业硕士研究生。曾先后担任中银基金管理有限公司产品经理、大成基金管理有限公司高级数量分析师、投资经理、基金经理。2022 年 9 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、平安养老目标日期 2045 五年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控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，市场对经济的预期经历了由强转弱的过程。具体来看，一季度，国内疫情对经济的影响阶段性消退，市场预期向好，经济运行也呈现企稳回升态势。从结构上看，工业生产逐步恢复，服务业明显回升，市场销售较快恢复，固定资产投资平稳增长。二季度，国内经济在去年同期低基数效应下，同比数据保持了较好的增长；不过，部分数据也出现了边际走弱、环比下滑的情况。具体来看，工业生产仍旧稳步恢复，服务业和市场销售虽增速较高，但同比增速在 4 月份的高点后出现了不同程度的边际放缓迹象，基础设施和制造业投资仍保持一定的增长水平，但房地产开发投资仍处于探底过程中，对固定资产总体投资造成拖累，出口数据也在 6 月边际走弱。最后，价格指数方面，受石油、煤炭等大宗商品价格回落、市场需求不足以及上年同期基数较高等因素影响，PPI 同比降幅逐月扩大；另一方面，春节后消费需求回落，消费市场供应充足，国际能源价格有所回落，CPI 同比涨势逐步回落。

上半年，各大类资产表现与投资者对经济的预期有较大关联。原油价格方面，一季度，在全球经济增长放缓预期与中国经济恢复预期的对冲下，价格呈现震荡走平态势；来到二季度，原油的市场需求不及预期，价格震荡下行。汇率方面，一季度人民币兑美元走势以震荡为主，但二季度随着经济边际走弱，人民币兑美元单边贬值。国内市场方面，一季度 A 股市场整体价格中枢震荡上移；但二季度 A 股快速走弱，除与人工智能相关的行业股价有所表现外，其他多数行业，股

价都出现了不同程度的调整；债市也走出了两段行情，第一段是复苏交易后期的反弹行情，信用利差持续收敛，不断压缩博弈空间；第二段是在经济增速边际放缓、货币政策维持宽松的情况下，市场利率迅速回落，债券市场在二季度获得较好表现。此外，在经济边际走弱的情况下，投资者对稳增长政策的预期有所加强，并反映到了市场中。

报告期内，本基金整体保持中枢附近的权益仓位，采取多资产配置和多元化策略，分散投资，稳健操作。整体而言，报告期内，权益市场投资机会相对有限，呈宽幅震荡磨底状态，市场波动较大，行业分化严重，同一行业内部分股分化也较大，获取绝对收益的难度较大。本基金合理控制权益仓位，适时波段操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9624 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.35%，业绩比较基准收益率为 2.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，我国经济运行仍面临诸多困难与挑战，从内部看，主要表现为需求不足与重点领域风险隐患较多；从外部看，环境更加复杂严峻。在 7 月召开的中共中央政治局会议中，强调了在下半年经济工作中，要加大宏观政策调控力度，不断推动经济内生动力持续增强、社会预期持续改善以及风险隐患持续化解。

在具体工作部署上，政治局会议提到要保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定；要活跃资本市场，提振投资者信心；要发挥消费拉动经济增长的基础性作用，通过增加居民收入扩大消费；要制定出台促进民间投资的政策措施；要稳住外贸外资基本盘；要加快培育壮大战略性新兴产业、打造更多支柱产业；要适应我国房地产市场供求关系发生重大变化的新形势，促进房地产市场平稳健康发展；要有效防范化解地方债务风险，制定实施一揽子化债方案等方面。

政治局会议对于经济问题直指要害，也明确了政策调整方向，使此前市场较纷乱的预期有序起来。相信，随着后续相关政策的出台与落实，能够推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。另一方面，经过了几个月弱势震荡的 A 股市场对于偏弱复苏的经济预期已有所消化，市场整体估值水平也相对合理，政策也会进一步稳定投资环境。基于此，我们对下一阶段的 A 股市场并不悲观。

市场风格与行业方面，我们认为价值和成长均有机会，节奏有可能并不完全一致。内需不足的问题已在市场有所体现，随着政策的聚焦与逐步落地，新的市场预期或迅速构建，与之相关的消费类板块或有相应的机会；新兴产业、特别是与数字经济相关的领域，是重要的战略性转型方向，上半年表现强势，下阶段或与消费类板块形成一定互补；对于复苏趋势较弱的房地产产业链，

如果在政策的促进之下数据能够企稳，同样存在值得重视的机会。

债市方面，在积极的财政政策和稳健的货币政策之下，我们的观点中性偏乐观。市场利率水平或保持区间震荡，震荡的强势或弱势程度，或将取决于后续政策对经济预期的影响力度；不过，由于经济运行的目标是“质的有效提升和量的合理增长”，短期内进行较强政策刺激的概率有限，在较温和复苏的情境下，中长期利率偏弱震荡的可能性或更高一些。同时，随着对地方债务风险的化解方案逐步出台，债市或形成更多结构性的机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的

基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                        |                          |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 2,819,325.36           | 1,622,133.15             |
| 结算备付金         |            | 290,794.46             | 237,766.22               |
| 存出保证金         |            | 35,156.45              | 17,024.61                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 39,601,519.61          | 19,307,345.68            |
| 其中：股票投资       |            | 3,503,900.00           | 1,395,473.90             |
| 基金投资          |            | 36,097,619.61          | 17,911,871.78            |
| 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        | 6.4.7.3    | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                      | -                        |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                      | -                        |
| 其中：债券投资       |            | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资      |            | -                      | -                        |
| 其他投资          |            | -                      | -                        |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                      | -                        |
| 应收清算款         |            | -                      | -                        |
| 应收股利          |            | 0.02                   | -                        |
| 应收申购款         |            | 182,453.66             | 7,210.06                 |
| 递延所得税资产       |            | -                      | -                        |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                      | 107.76                   |
| 资产总计          |            | 42,929,249.56          | 21,191,587.48            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b>             | <b>上年度末</b>              |

|               |          | 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------|-----------------|------------------|
| <b>负 债:</b>   |          |                 |                  |
| 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     |          | -               | -                |
| 应付清算款         |          | -               | -                |
| 应付赎回款         |          | -               | -                |
| 应付管理人报酬       |          | 20,844.67       | 10,585.47        |
| 应付托管费         |          | 4,168.90        | 2,149.67         |
| 应付销售服务费       |          | -               | -                |
| 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          | 6.4.7.9  | 69,847.89       | 94,740.88        |
| 负债合计          |          | 94,861.46       | 107,476.02       |
| <b>净 资 产:</b> |          |                 |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.10 | 44,505,753.03   | 23,080,203.55    |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11 | -               | -                |
| 未分配利润         | 6.4.7.12 | -1,671,364.93   | -1,996,092.09    |
| 净资产合计         |          | 42,834,388.10   | 21,084,111.46    |
| 负债和净资产总计      |          | 42,929,249.56   | 21,191,587.48    |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9624 元，基金份额总额 44,505,753.03 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目            | 附注号      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b> |          | 1,580,143.30                             | -2,170,430.62                                 |
| 1. 利息收入        |          | 6,650.05                                 | 3,722.97                                      |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.13 | 6,650.05                                 | 3,722.97                                      |
| 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     |          | -  | -   |
| 证券出借利息收入       |          | -  | -   |

|                                 |            |              |               |
|---------------------------------|------------|--------------|---------------|
| 其他利息收入                          |            | -            | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）               |            | 700,056.67   | -2,104,633.11 |
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.14   | 613,157.16   | -341,665.99   |
| 基金投资收益                          | 6.4.7.15   | -75,860.52   | -1,863,349.77 |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.16   | -            | -             |
| 资产支持证券投资<br>收益                  | 6.4.7.17   | -            | -             |
| 贵金属投资收益                         | 6.4.7.18   | -            | -             |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.19   | -            | -             |
| 股利收益                            | 6.4.7.20   | 162,760.03   | 100,382.65    |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产生的<br>收益   |            | -            | -             |
| 其他投资收益                          |            | -            | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）      | 6.4.7.21   | 873,436.58   | -74,455.23    |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）          |            | -            | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）          | 6.4.7.22   | -            | 4,934.75      |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 113,960.66   | 88,616.23     |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 79,842.68    | 58,276.87     |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 16,007.62    | 12,983.27     |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.3 | -            | -             |
| 4. 投资顾问费                        |            | -            | -             |
| 5. 利息支出                         |            | -            | -             |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |            | -            | -             |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.24   | -            | -             |
| 7. 税金及附加                        |            | 754.27       | -             |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.25   | 17,356.09    | 17,356.09     |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>以“-”号填列）</b> |            | 1,466,182.64 | -2,259,046.85 |
| 减：所得税费用                         |            | -            | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |            | 1,466,182.64 | -2,259,046.85 |
| <b>五、其他综合收益的税后<br/>净额</b>       |            | -            | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | 1,466,182.64 | -2,259,046.85 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |        |               |               |
|-------------------------------------|----------------------------|--------|---------------|---------------|
|                                     | 实收基金                       | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                     | 23,080,203.55              | -      | -1,996,092.09 | 21,084,111.46 |
| 加：会计政策变更                            | -                          | -      | -             | -             |
| 前期差错更正                              | -                          | -      | -             | -             |
| 其他                                  | -                          | -      | -             | -             |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                     | 23,080,203.55              | -      | -1,996,092.09 | 21,084,111.46 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | 21,425,549.48              | -      | 324,727.16    | 21,750,276.64 |
| (一)、综合收益总额                          | -                          | -      | 1,466,182.64  | 1,466,182.64  |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 21,425,549.48              | -      | -1,141,455.48 | 20,284,094.00 |
| 其中：1. 基金申购款                         | 21,425,549.48              | -      | -1,141,455.48 | 20,284,094.00 |
| 2. 基金赎回款                            | -                          | -      | -             | -             |

|  |                                 |        |               |               |
|--|---------------------------------|--------|---------------|---------------|
| (三)、<br>本期向<br>基金份额<br>持有人分<br>配利润产<br>生的基金<br>净值变动<br>(净值减少<br>以“-”<br>号填列) | -                               | -      | -             | -             |
| (四)、<br>其他综合<br>收益结转<br>留存收益   | -                               | -      | -             | -             |
| 四、本期<br>期末净资<br>产(基金<br>净值)  | 44,505,753.03                   | -      | -1,671,364.93 | 42,834,388.10 |
| 项目   | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |        |               |               |
|  | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计         |
| 一、上期<br>期末净资<br>产(基金<br>净值)  | 20,110,915.46                   | -      | 2,842,120.39  | 22,953,035.85 |
| 加:会计<br>政策变更   | -                               | -      | -             | -             |
| 前期差<br>错更正   | -                               | -      | -             | -             |
| 其他   | -                               | -      | -             | -             |
| 二、本期<br>期初净资<br>产(基金<br>净值)  | 20,110,915.46                   | -      | 2,842,120.39  | 22,953,035.85 |
| 三、本期<br>增减变动<br>额(减少<br>以“-”<br>号填列)   | 2,311,836.80                    | -      | -2,174,795.37 | 137,041.43    |

|  |               |   |               |               |
|--|---------------|---|---------------|---------------|
| (一)、综合收益总额                               | -             | - | -2,259,046.85 | -2,259,046.85 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 2,311,836.80  | - | 84,251.48     | 2,396,088.28  |
| 其中:1.基金申购款                               | 2,311,836.80  | - | 84,251.48     | 2,396,088.28  |
| 2.基金赎回款                                  | -             | - | -             | -             |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -             | - | -             | -             |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -             | - | -             | -             |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 22,422,752.26 | - | 667,325.02    | 23,090,077.28 |

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

平安养老目标日期 2045 五年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[2020]2174 号《关于准予平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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《平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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 12,903,762.85 元，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（2021）第 0407 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》于 2021 年 4 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 12,905,475.78 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,712.93 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,400.04 份基金份额，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《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（以下简称“证券投资基金”，包含封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金（LOF）和交易型开放式指数基金（ETF）、QDII 基金、香港互认基金等中国证监会允许投资的基金）、股票、债券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。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金、股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款以及其他银行存款）、同业存单、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的相关规定）。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：投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）占基金资产的比例合计原则上不超过 80%，其中对商品基金投资占基金资产的比例不超过 10%。本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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：中证平安 2045 退休宝指数收益率\*95%+同期银行活期存款利率\*5%。

#### 6.4.2 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、应用指南、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 3 号《半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。

#### 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 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

#### (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%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### (2) 增值税

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。

### (3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### (4) 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

### (5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,819,325.36           |
| 等于：本金          | 2,819,037.17           |
| 加：应计利息         | 288.19                 |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 2,819,325.36           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |      |               |            |
|---------------|------------------------|------|---------------|------------|
|               | 成本                     | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动     |
| 股票            | 3,566,720.15           | -    | 3,503,900.00  | -62,820.15 |
| 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            | 35,862,725.64          | -    | 36,097,619.61 | 234,893.97 |
| 其他            | -                      | -    | -             | -          |
| 合计            | 39,429,445.79          | -    | 39,601,519.61 | 172,073.82 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 52,491.80         |
| 其中：交易所市场    | 52,491.80         |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 17,356.09         |
| 合计          | 69,847.89         |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |               |
|---------------|----------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额          |
| 上年度末          | 23,080,203.55              | 23,080,203.55 |
| 本期申购          | 21,425,549.48              | 21,425,549.48 |
| 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           | 44,505,753.03              | 44,505,753.03 |

#### 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

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末           | -2,171,258.02 | 175,165.93   | -1,996,092.09 |
| 本期利润           | 592,746.06    | 873,436.58   | 1,466,182.64  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,431,051.10 | 289,595.62   | -1,141,455.48 |
| 其中：基金申购款       | -1,431,051.10 | 289,595.62   | -1,141,455.48 |
| 基金赎回款          | -             | -            | -             |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | -3,009,563.06 | 1,338,198.13 | -1,671,364.93 |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 活期存款利息收入  | 4,665.33             |
| 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 | 1,748.99             |
| 其他        | 235.73               |
| 合计        | 6,650.05             |

## 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                   |
|------------------|----------------------|
|                  | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 613,157.16           |
| 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               | 613,157.16           |

## 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                   |
|------------|----------------------|
|            | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 74,046,244.47        |
| 减：卖出股票成本总额 | 73,239,541.41        |
| 减：交易费用     | 193,545.90           |
| 买卖股票差价收入   | 613,157.16           |

## 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 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期                   |
|-------------------|----------------------|
|                   | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出/赎回基金成交总额       | 117,229,907.15       |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 117,249,874.35       |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 6,285.60             |
| 减：交易费用            | 49,607.72            |
| 基金投资收益            | -75,860.52           |

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 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。

##### 6.4.7.16.2 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。

##### 6.4.7.16.3 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。

##### 6.4.7.16.4 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。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 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。

##### 6.4.7.17.2 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资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.17.3 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。

##### 6.4.7.17.4 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。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 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。

##### 6.4.7.18.2 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。

##### 6.4.7.18.3 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。

##### 6.4.7.18.4 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。

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 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。

**6.4.7.19.2 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。

**6.4.7.20 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | -                          |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                          |
| 基金投资产生的股利收益   | 162,760.03                 |
| 合计            | 162,760.03                 |

**6.4.7.21 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 873,436.58                 |
| 股票投资                   | 22,151.20                  |
| 债券投资                   | -                          |
| 资产支持证券投资               | -                          |
| 基金投资                   | 851,285.38                 |
| 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                     | 873,436.58                 |

**6.4.7.22 其他收入**

注：本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.23 持有基金产生的费用**

| 项目                   | 本期费用<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------------|------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 19,435.00                    |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 78,958.57                    |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 16,513.82                    |

**6.4.7.24 信用减值损失**

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 审计费用    | 17,356.09                       |
| 信息披露费   | -                               |
| 证券出借违约金 | -                               |
| 合计      | 17,356.09                       |

#### 6.4.7.26 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无须作披露的分部报告。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                    | 与本基金的关系                     |
|--------------------------|-----------------------------|
| 平安基金管理有限公司（“平安基金”）       | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构         |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”）       | 基金托管人、基金销售机构                |
| 大华资产管理有限公司               | 基金管理人的股东                    |
| 三亚盈湾旅业有限公司               | 基金管理人的股东                    |
| 平安信托有限责任公司               | 基金管理人的股东                    |
| 深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）   | 基金管理人的子公司                   |
| 平安证券股份有限公司（“平安证券”）       | 基金管理人的股东的子公司、基金销售机构         |
| 上海陆金所基金销售有限公司（“陆基金”）     | 基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”）   | 基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 中国平安保险（集团）股份有限公司（“平安集团”） | 基金管理人的最终控股母公司               |

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 基金交易

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基金交易。

#### 6.4.10.1.5 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。

#### 6.4.10.1.6 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<br>2023年1月1日至2023年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 79,842.68                      | 58,276.87                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 19,503.45                      | 15,230.76                           |

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年1月1日至2023年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 16,007.62                      | 12,983.27                           |

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。支付基金托管人平安银行的

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 0.12% 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 × 0.12% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                         | 本期<br>2023年1月1日至2023年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年6月30日 |
|----------------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 基金合同生效日(2021年4月20日)持有的基金份额 | -                              | -                                   |
| 报告期初持有的基金份额                | 10,000,400.04                  | 10,000,400.04                       |
| 报告期内申购/买入总份额               | 0.00                           | 0.00                                |
| 报告期内因拆分变动份额                | 0.00                           | 0.00                                |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额             | 0.00                           | 0.00                                |
| 报告期末持有的基金份额                | 10,000,400.04                  | 10,000,400.04                       |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | 22.4699%                       | 44.5993%                            |

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

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

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：无。

**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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |          |
|---------|----------------------------|----------|---------------------------------|----------|
|         | 期末余额                       | 当期利息收入   | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 平安银行-活期 | 2,819,325.36               | 4,665.33 | 2,151,166.30                    | 3,511.93 |

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业存款利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明****6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

于本期末，本基金未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。（于2022-06-30，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 2,952,763.77 元，占本基金资产净值的比例为 12.79%。）

**6.4.10.8.2 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                   | 本期费用<br>2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30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） | -                            | 4,934.75                        |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 163.14                       | 12,227.37                       |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 32.62                        | 2,304.03                        |
| 当期交易基金产生的交易费（元）      | 25.20                        | -                               |

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费和当期交易基金产生的赎回费为零。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际

持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

#### 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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

###### 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市场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、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

##### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本期末，本基金未持有债券投资（上年末：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|-------|-------|-------|-----|----|
|                        |       |       |       |     |    |

|                          |              |       |       |               |               |
|--------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产                       |              |       |       |               |               |
| 银行存款                     | 2,819,325.36 | -     | -     | -             | 2,819,325.36  |
| 结算备付金                    | 290,794.46   | -     | -     | -             | 290,794.46    |
| 存出保证金                    | 35,156.45    | -     | -     | -             | 35,156.45     |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 39,601,519.61 | 39,601,519.61 |
| 应收股利                     | -            | -     | -     | 0.02          | 0.02          |
| 应收申购款                    | -            | -     | -     | 182,453.66    | 182,453.66    |
| 资产总计                     | 3,145,276.27 | -     | -     | 39,783,973.29 | 42,929,249.56 |
| 负债                       |              |       |       |               |               |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -     | 20,844.67     | 20,844.67     |
| 应付托管费                    | -            | -     | -     | 4,168.90      | 4,168.90      |
| 其他负债                     | -            | -     | -     | 69,847.89     | 69,847.89     |
| 负债总计                     | -            | -     | -     | 94,861.46     | 94,861.46     |
| 利率敏感度缺口                  | 3,145,276.27 | -     | -     | 39,689,111.83 | 42,834,388.10 |
| 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                       |              |       |       |               |               |
| 银行存款                     | 1,622,133.15 | -     | -     | -             | 1,622,133.15  |
| 结算备付金                    | 237,766.22   | -     | -     | -             | 237,766.22    |
| 存出保证金                    | 17,024.61    | -     | -     | -             | 17,024.61     |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 19,307,345.68 | 19,307,345.68 |
| 应收申购款                    | -            | -     | -     | 7,210.06      | 7,210.06      |
| 其他资产                     | -            | -     | -     | 107.76        | 107.76        |
| 资产总计                     | 1,876,923.98 | -     | -     | 19,314,663.50 | 21,191,587.48 |
| 负债                       |              |       |       |               |               |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -     | 10,585.47     | 10,585.47     |
| 应付托管费                    | -            | -     | -     | 2,149.67      | 2,149.67      |
| 其他负债                     | -            | -     | -     | 94,740.88     | 94,740.88     |
| 负债总计                     | -            | -     | -     | 107,476.02    | 107,476.02    |
| 利率敏感度缺口                  | 1,876,923.98 | -     | -     | 19,207,187.48 | 21,084,111.46 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金未持有债券资产（上年末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年6月30日 |                  | 上年度末<br>2022年12月31日 |                  |
|---------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 3,503,900.00      | 8.18             | 1,395,473.90        | 6.62             |
| 交易性金融资产—基金投资  | 36,097,619.61     | 84.27            | 17,911,871.78       | 84.95            |
| 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            | 39,601,519.61     | 92.45            | 19,307,345.68       | 91.57            |

##### 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 |                             |                   |
|----|-------------------------|-----------------------------|-------------------|
|    | 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（2023年6月30日）             | 上年度末（2022年12月31日） |
| 分析 | 沪深300指数上升               | 1,087,519.00                | 669,825.49        |

|  |             |               |             |
|--|-------------|---------------|-------------|
|  | 5%          |               |             |
|  | 沪深 300 指数下降 | -1,087,519.00 | -669,825.49 |
|  | 5%          |               |             |

#### 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<br>2023年6月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 39,601,519.61     | 19,307,345.68       |
| 第二层次          | -                 | -                   |
| 第三层次          | -                 | -                   |
| 合计            | 39,601,519.61     | 19,307,345.68       |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 3,503,900.00  | 8.16          |
|    | 其中：股票             | 3,503,900.00  | 8.16          |
| 2  | 基金投资              | 36,097,619.61 | 84.09         |
| 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      | 3,110,119.82  | 7.24          |
| 8  | 其他各项资产            | 217,610.13    | 0.51          |
| 9  | 合计                | 42,929,249.56 | 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         | -            | -             |
| B  | 采矿业              | -            | -             |
| C  | 制造业              | 1,118,900.00 | 2.61          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -             |
| 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  | 1,315,800.00 | 3.07          |
| 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     | 1,069,200.00 | 2.50 |
| S | 综合            | -            | -    |
|   | 合计            | 3,503,900.00 | 8.18 |

### 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  | 000917 | 电广传媒 | 180,000 | 1,315,800.00 | 3.07         |
| 2  | 300364 | 中文在线 | 60,000  | 1,069,200.00 | 2.50         |
| 3  | 002920 | 德赛西威 | 5,000   | 779,050.00   | 1.82         |
| 4  | 300502 | 新易盛  | 5,000   | 339,850.00   | 0.79         |

### 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  | 688076 | 诺泰生物 | 3,702,279.82 | 17.56          |
| 2  | 605089 | 味知香  | 2,563,126.00 | 12.16          |
| 3  | 000917 | 电广传媒 | 2,349,046.00 | 11.14          |
| 4  | 300573 | 兴齐眼药 | 2,209,459.00 | 10.48          |
| 5  | 300755 | 华致酒行 | 1,982,819.00 | 9.40           |
| 6  | 300496 | 中科创达 | 1,704,577.08 | 8.08           |
| 7  | 002043 | 兔宝宝  | 1,431,519.00 | 6.79           |
| 8  | 002050 | 三花智控 | 1,431,372.00 | 6.79           |
| 9  | 688017 | 绿的谐波 | 1,417,026.77 | 6.72           |
| 10 | 688331 | 荣昌生物 | 1,399,206.09 | 6.64           |
| 11 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 1,391,439.00 | 6.60           |
| 12 | 002466 | 天齐锂业 | 1,374,699.00 | 6.52           |
| 13 | 002668 | 奥马电器 | 1,323,703.00 | 6.28           |
| 14 | 002965 | 祥鑫科技 | 1,286,360.00 | 6.10           |
| 15 | 002487 | 大金重工 | 1,232,566.00 | 5.85           |
| 16 | 603255 | 鼎际得  | 1,211,009.00 | 5.74           |
| 17 | 300364 | 中文在线 | 1,148,429.00 | 5.45           |
| 18 | 002920 | 德赛西威 | 1,146,471.40 | 5.44           |
| 19 | 300033 | 同花顺  | 1,126,482.05 | 5.34           |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 20 | 000651 | 格力电器  | 1,082,570.00 | 5.13 |
| 21 | 688305 | 科德数控  | 1,078,959.66 | 5.12 |
| 22 | 603076 | 乐惠国际  | 1,067,291.00 | 5.06 |
| 23 | 688110 | 东芯股份  | 1,010,502.24 | 4.79 |
| 24 | 688301 | 奕瑞科技  | 999,039.02   | 4.74 |
| 25 | 688037 | 芯源微   | 998,903.43   | 4.74 |
| 26 | 300115 | 长盈精密  | 998,296.00   | 4.73 |
| 27 | 000069 | 华侨城 A | 997,615.00   | 4.73 |
| 28 | 300634 | 彩讯股份  | 992,877.00   | 4.71 |
| 29 | 600938 | 中国海油  | 937,464.00   | 4.45 |
| 30 | 688608 | 恒玄科技  | 852,381.89   | 4.04 |
| 31 | 300260 | 新莱应材  | 819,193.00   | 3.89 |
| 32 | 300232 | 洲明科技  | 796,903.00   | 3.78 |
| 33 | 002142 | 宁波银行  | 795,446.00   | 3.77 |
| 34 | 002156 | 通富微电  | 792,779.00   | 3.76 |
| 35 | 301071 | 力量钻石  | 759,168.00   | 3.60 |
| 36 | 000725 | 京东方 A | 702,745.00   | 3.33 |
| 37 | 300633 | 开立医疗  | 701,235.00   | 3.33 |
| 38 | 002517 | 恺英网络  | 699,179.00   | 3.32 |
| 39 | 001236 | 弘业期货  | 696,872.00   | 3.31 |
| 40 | 002612 | 朗姿股份  | 693,872.00   | 3.29 |
| 41 | 002705 | 新宝股份  | 654,254.00   | 3.10 |
| 42 | 001287 | 中电港   | 644,000.00   | 3.05 |
| 43 | 688337 | 普源精电  | 614,347.96   | 2.91 |
| 44 | 000729 | 燕京啤酒  | 598,502.00   | 2.84 |
| 45 | 688262 | 国芯科技  | 589,523.77   | 2.80 |
| 46 | 300693 | 盛弘股份  | 583,697.00   | 2.77 |
| 47 | 301191 | 菲菱科思  | 578,713.00   | 2.74 |
| 48 | 300217 | 东方电热  | 575,000.00   | 2.73 |
| 49 | 688139 | 海尔生物  | 499,873.51   | 2.37 |
| 50 | 688062 | 迈威生物  | 499,782.84   | 2.37 |
| 51 | 301015 | 百洋医药  | 499,581.00   | 2.37 |
| 52 | 002984 | 森麒麟   | 496,558.00   | 2.36 |
| 53 | 000858 | 五粮液   | 489,240.00   | 2.32 |
| 54 | 300729 | 乐歌股份  | 474,464.00   | 2.25 |
| 55 | 600132 | 重庆啤酒  | 472,894.00   | 2.24 |
| 56 | 300592 | 华凯易佰  | 457,084.00   | 2.17 |
| 57 | 605168 | 三人行   | 428,380.00   | 2.03 |

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

|    |        |       |              |       |
|----|--------|-------|--------------|-------|
| 1  | 688076 | 诺泰生物  | 3,791,890.56 | 17.98 |
| 2  | 605089 | 味知香   | 2,585,694.00 | 12.26 |
| 3  | 300573 | 兴齐眼药  | 2,281,267.00 | 10.82 |
| 4  | 300755 | 华致酒行  | 1,999,683.95 | 9.48  |
| 5  | 300496 | 中科创达  | 1,766,917.76 | 8.38  |
| 6  | 002050 | 三花智控  | 1,487,769.00 | 7.06  |
| 7  | 002043 | 兔宝宝   | 1,448,739.00 | 6.87  |
| 8  | 688017 | 绿的谐波  | 1,439,215.28 | 6.83  |
| 9  | 002918 | 蒙娜丽莎  | 1,437,229.00 | 6.82  |
| 10 | 688331 | 荣昌生物  | 1,421,761.16 | 6.74  |
| 11 | 002466 | 天齐锂业  | 1,395,002.00 | 6.62  |
| 12 | 002965 | 祥鑫科技  | 1,306,827.00 | 6.20  |
| 13 | 002668 | 奥马电器  | 1,287,312.00 | 6.11  |
| 14 | 002487 | 大金重工  | 1,219,942.00 | 5.79  |
| 15 | 603255 | 鼎际得   | 1,213,208.00 | 5.75  |
| 16 | 300033 | 同花顺   | 1,107,138.00 | 5.25  |
| 17 | 000651 | 格力电器  | 1,102,657.00 | 5.23  |
| 18 | 603076 | 乐惠国际  | 1,085,262.00 | 5.15  |
| 19 | 688305 | 科德数控  | 1,067,770.92 | 5.06  |
| 20 | 688110 | 东芯股份  | 1,053,709.93 | 5.00  |
| 21 | 300634 | 彩讯股份  | 1,034,436.00 | 4.91  |
| 22 | 688301 | 奕瑞科技  | 1,031,826.35 | 4.89  |
| 23 | 688037 | 芯源微   | 1,011,491.74 | 4.80  |
| 24 | 300115 | 长盈精密  | 986,425.00   | 4.68  |
| 25 | 000069 | 华侨城 A | 981,137.00   | 4.65  |
| 26 | 600938 | 中国海油  | 960,055.00   | 4.55  |
| 27 | 688082 | 盛美上海  | 892,996.17   | 4.24  |
| 28 | 000917 | 电广传媒  | 889,800.00   | 4.22  |
| 29 | 688608 | 恒玄科技  | 886,000.00   | 4.20  |
| 30 | 300232 | 洲明科技  | 811,878.00   | 3.85  |
| 31 | 002156 | 通富微电  | 798,780.00   | 3.79  |
| 32 | 301071 | 力量钻石  | 795,336.00   | 3.77  |
| 33 | 605266 | 健之佳   | 782,620.00   | 3.71  |
| 34 | 300260 | 新莱应材  | 767,381.00   | 3.64  |
| 35 | 002142 | 宁波银行  | 763,477.00   | 3.62  |
| 36 | 000725 | 京东方 A | 729,494.00   | 3.46  |
| 37 | 002517 | 恺英网络  | 721,484.00   | 3.42  |
| 38 | 002612 | 朗姿股份  | 719,175.00   | 3.41  |
| 39 | 300633 | 开立医疗  | 717,611.00   | 3.40  |
| 40 | 001287 | 中电港   | 676,000.00   | 3.21  |
| 41 | 001236 | 弘业期货  | 675,597.00   | 3.20  |
| 42 | 688262 | 国芯科技  | 619,026.28   | 2.94  |
| 43 | 002705 | 新宝股份  | 614,089.00   | 2.91  |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 44 | 688337 | 普源精电 | 608,994.08 | 2.89 |
| 45 | 300693 | 盛弘股份 | 595,264.00 | 2.82 |
| 46 | 301191 | 菲菱科思 | 591,541.00 | 2.81 |
| 47 | 000729 | 燕京啤酒 | 591,429.00 | 2.81 |
| 48 | 300217 | 东方电热 | 558,706.00 | 2.65 |
| 49 | 301015 | 百洋医药 | 524,210.00 | 2.49 |
| 50 | 688062 | 迈威生物 | 517,813.70 | 2.46 |
| 51 | 002984 | 森麒麟  | 506,484.00 | 2.40 |
| 52 | 000858 | 五粮液  | 493,295.00 | 2.34 |
| 53 | 688139 | 海尔生物 | 482,271.95 | 2.29 |
| 54 | 300729 | 乐歌股份 | 477,600.00 | 2.27 |
| 55 | 300592 | 华凯易佰 | 472,900.00 | 2.24 |
| 56 | 600132 | 重庆啤酒 | 471,361.00 | 2.24 |
| 57 | 605168 | 三人行  | 441,510.00 | 2.09 |
| 58 | 002920 | 德赛西威 | 429,000.00 | 2.03 |

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 75,325,816.31 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 74,046,244.47 |

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

基金的投资组合比例要求：投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种占基金资产的比例合计原则上不超过 80%，其中对商品基金投资占基金资产的比例不超过 10%。本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。建仓期满后，按照基金合同要求，2023 年初至 2023 年底，权益资产范围 41%—66%。

在选择养老目标基金子基金（含香港互认基金）时，重点考察子基金风格特征稳定性、风险控制 and 合规运作情况，并对照业绩比较基准评价中长期收益、业绩波动和回撤的情况，且被投资子基金的主要筛选条件如下：

（1）子基金运作期限应当不少于 2 年，最近 2 年平均季末基金净资产应当不低于 2 亿元；子基金为指数基金、ETF 和商品基金等品种的，运作期限应当不少于 1 年，最近定期报告披露的季末基金净资产应当不低于 1 亿元；

（2）子基金运作合规，风格清晰，中长期收益良好，业绩波动较低；

（3）子基金基金管理人及子基金基金经理最近 2 年没有重大违法违规行为；

（4）中国证监会规定的其他条件。

### 7.12.2 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  | 511360 | 海富通中证短融 ETF                | 交易型开放式 (ETF) | 54,600.00    | 5,869,336.20 | 13.70 | 否 |
| 2  | 005015 | 泰康景泰回报混合 C                 | 契约型开放式       | 3,367,168.82 | 5,412,050.44 | 12.63 | 否 |
| 3  | 006663 | 易方达安悦超短债债券 C               | 契约型开放式       | 4,308,192.07 | 4,382,723.79 | 10.23 | 否 |
| 4  | 513180 | 华夏恒生科技 ETF (QDII)          | 交易型开放式 (ETF) | 5,888,200.00 | 3,150,187.00 | 7.35  | 否 |
| 5  | 512100 | 南方中证 1000ETF               | 交易型开放式 (ETF) | 1,012,000.00 | 2,690,908.00 | 6.28  | 否 |
| 6  | 010995 | 博时创新经济混合 C                 | 契约型开放式       | 2,360,999.87 | 2,658,958.05 | 6.21  | 否 |
| 7  | 511990 | 华宝添益货币 A                   | 契约型开放式       | 24,074.00    | 2,407,303.70 | 5.62  | 否 |
| 8  | 516110 | 国泰中证 800 汽车与零部件 ETF        | 交易型开放式 (ETF) | 2,000,000.00 | 2,092,000.00 | 4.88  | 否 |
| 9  | 513050 | 易方达中证海外中国互联网 50 (QDII-ETF) | 交易型开放式 (ETF) | 1,950,800.00 | 1,948,849.20 | 4.55  | 否 |
| 10 | 513100 | 国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)      | 交易型开放式 (ETF) | 1,700,000.00 | 1,870,000.00 | 4.37  | 否 |

|    |        |              |              |              |              |      |   |
|----|--------|--------------|--------------|--------------|--------------|------|---|
| 11 | 007509 | 华商润丰混合 C     | 契约型开放式       | 874,287.13   | 1,866,603.02 | 4.36 | 否 |
| 12 | 516010 | 国泰中证动漫游戏 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 1,200,000.00 | 1,748,400.00 | 4.08 | 否 |
| 13 | 004545 | 永赢天天利货币 A    | 契约型开放式       | 300.21       | 300.21       | 0.00 | 否 |

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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。

#### 7.13.2 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。

#### 7.13.3 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 | 35,156.45  |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | 0.02       |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 182,453.66 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 217,610.13 |

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

#### 7.13.6 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。

## § 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>(%) | 持有份额          | 占总份额比例<br>(%) |
| 2,987        | 14,899.82     | 12,968,774.68 | 29.14         | 31,536,978.35 | 70.86         |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数(份)     | 占基金总份额比例(%) |
|------------------|---------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 14,712,079.22 | 33.0566     |

### 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                             | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 10~50             |

### 8.4 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<br>占基金总<br>份额比例<br>(%) | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------------------|---------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,400.04 | 22.47                       | 10,000,000.00 | 22.47                   | 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          | 10,000,400.04 | 22.47                       | 10,000,000.00 | 22.47                   | 3年             |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 基金合同生效日(2021年4月20日)基金份额总额 | 12,905,475.78 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 23,080,203.55 |

|               |               |
|---------------|---------------|
| 本报告期基金总申购份额   | 21,425,549.48 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | -             |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -             |
| 本报告期期末基金份额总额  | 44,505,753.03 |

## § 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

本基金管理人公司董事杨玉萍女士因工作安排不再出任公司第四届董事会董事，公司股东平安信托有限责任公司根据《公司章程》推荐郭晓涛先生接替杨玉萍女士出任公司董事。经公司 2023 年第二次股东会审议，同意郭晓涛先生出任公司董事，杨玉萍女士不再担任公司董事。上述变更自 2023 年 3 月 17 日公司 2023 年第二次股东会做出决议之日起生效。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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 (%) |    |
| 广发证券   | 2      | 88,970,855.24 | 59.56            | 64,174.42 | 59.56          | -  |
| 开源证券   | 2      | 44,425,561.24 | 29.74            | 32,043.95 | 29.74          | -  |
| 国信证券   | 2      | 15,975,644.30 | 10.70            | 11,523.30 | 10.70          | -  |
| 安信证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 渤海证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 财通证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 长江证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 川财证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | 退租 |
| 大通证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 东北证券   | 3      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 东方财富证券 | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 东方证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 东吴证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 东兴证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 方正证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 光大证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 国盛证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 国泰君安证券 | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 海通证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 恒泰证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 华创证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 华林证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | 退租 |
| 华泰证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 民生证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 平安证券   | 4      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 申万宏源证券 | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 世纪证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 太平洋证券  | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 天风证券   | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 万联证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 西部证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 西南证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 兴业证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |

|                      |   |   |   |   |   |   |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 银河证券                 | 2 | - | - | - | - | - |
| 英大证券                 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际<br>金融股份<br>有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券                 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>证券           | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券                 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中银国际<br>证券           | 1 | - | - | - | - | - |

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

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

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

### 10.8.2 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 (%) |
| 广发证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | 11,829,864.10  | 5.98             |
| 开源证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | 149,437,061.62 | 75.54            |
| 国信证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | 36,569,785.77  | 18.48            |
| 安信证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | -              | -                |
| 渤海证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | -              | -                |
| 财通证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | -              | -                |

|                |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
|----------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 长江<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 川财<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 大通<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东北<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方<br>财富<br>证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东兴<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 方正<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国盛<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰<br>君安<br>证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华创<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华林<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 民生<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安<br>证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万<br>宏源<br>证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 世纪             | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

|              |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券           |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| 太平洋证券        | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券         | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券         | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券         | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券         | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券         | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券         | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券         | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券         | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券         | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

### 10.9 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 | 2023年01月05日 |
| 2  | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告                     | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023年01月14日 |
| 3  | 平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023年01月19日 |

|    |   |              |                  |
|----|---|--------------|------------------|
|    | 的公告   |              |                  |
| 4  | 平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2022 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 01 月 20 日 |
| 5  | 平安基金管理有限公司关于暂停上海爱建基金销售有限公司办理相关销售业务的公告               | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 02 月 09 日 |
| 6  | 关于暂停浦领基金销售有限公司办理相关销售业务的公告                           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 02 月 13 日 |
| 7  | 平安基金管理有限公司关于新增平安证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告                | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 03 月 20 日 |
| 8  | 平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2022 年年度报告     | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 03 月 31 日 |
| 9  | 平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新     | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 04 月 21 日 |
| 10 | 平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新)     | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 04 月 21 日 |
| 11 | 平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理变更公告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 04 月 21 日 |
| 12 | 平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 04 月 22 日 |
| 13 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构的公告            | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 05 月 12 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              | 2023/01/01--2023/06/30  | 10,000,400.04 | 0.00 | 0.00 | 10,000,400.04 | 22.47    |
| 个人  | -              | -                       | -             | -    | -    | -             | -        |
| 产品特有风险  |                |                         |               |      |      |               |          |
| 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）募集注册的文件

(2) 平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同

(3) 平安养老目标日期 2045 五年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

### 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

2023 年 8 月 31 日