

鹏安安泰利率债债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:鹏安基金管理有限公司

基金托管人:苏州银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 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。

基金托管人苏州银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年8月20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。

本报告期自2026年02月10日（基金合同生效日）起至06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
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	8
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	10
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
§ 5 托管人报告	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	38
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	38
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	38
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	38
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 投资组合报告附注	38

§ 8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	40
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	41
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	42
10.8 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏安安泰利率债债券型证券投资基金	
基金简称	鹏安安泰利率债	
基金主代码	026403	
基金运作方式	开放式	
基金合同生效日	2026 年 02 月 10 日	
基金管理人	鹏安基金管理有限公司	
基金托管人	苏州银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,660,673,602.75 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏安安泰利率债 A	鹏安安泰利率债 C
下属分级基金的交易代码	026403	026404
报告期末下属分级基金的份 额总额	6,324,199,652.62 份	336,473,950.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	1、利率策略 2、久期配置策略 3、收益率曲线策略 4、期限结构配置策略 5、息差策略 6、参与国债期货交易策略	
业绩比较基准	中债-国债及政策性银行债全价(总值)指数收益率*80%+同期银行活期存款利率(税后)*20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。	
	鹏安安泰利率债 A	鹏安安泰利率债 C
下属分级基金的风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。	本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

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		鹏安基金管理有限公司	苏州银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	汪兀	董平

人	联系电话	0898-6611-6803	0512-69868888-91017
	电子邮箱	wangp@penganfunds.com	custodyacc@suzhoubank.com
客户服务电话		400-814-2888	96067
传真		0898-66116876	0512-65135118
注册地址		海南省海口市江东新区兴洋大道 181 号 205 室-11108	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路 728 号
办公地址		海南省海口市美兰区国兴大道 15A 号全球贸易之窗 16F	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路 728 号
邮政编码		570203	215100
法定代表人		杨彬	崔庆军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.penganfunds.com
基金中期报告置备地点	海南省海口市美兰区国兴大道 15A 号全球贸易之窗 16F

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏安基金管理有限公司	海南省海口市美兰区国兴大道 15A 号全球贸易之窗 16F

§ 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（2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）-2026 年 06 月 30 日）	
	鹏安安泰利率债 A	鹏安安泰利率债 C
本期已实现收益	22,451,674.32	506,354.50
本期利润	30,743,540.78	626,910.47
加权平均基金份额本期利润	0.0079	0.0064
本期加权平均净值利润率	0.79%	0.64%
本期基金份额净值增长率	0.82%	0.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	36,588,537.31	2,057,519.45
期末可供分配基金份额利润	0.0058	0.0061
期末基金资产净值	6,375,958,497.01	339,339,131.37

期末基金份额净值	1.0082	1.0085
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	0.82%	0.85%

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

鹏安安泰利率债 A 净值表现

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
过去三个月	0.65%	0.02%	0.51%	0.05%	0.14%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.82%	0.02%	0.49%	0.05%	0.33%	-0.03%

鹏安安泰利率债 C 净值表现

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
过去三个月	0.66%	0.02%	0.51%	0.05%	0.15%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.85%	0.02%	0.49%	0.05%	0.36%	-0.03%

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

鹏安安泰利率债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2026年02月10日-2026年06月30日)



鹏安安泰利率债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2026年02月10日-2026年06月30日)



§ 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

鹏安基金管理有限公司成立于 2024 年 1 月，注册资本 2.1 亿元，总部位于海南海口，由开源证券股份有限公司全资设立，隶属于陕西煤业化工集团有限责任公司，经营范围包括公开募集证券投资基金管理、私募资产管理。

鹏安基金管理有限公司将深刻把握金融工作的政治性、人民性，以投资者最佳利益为核心，秉持开源证券“服务陕西、服务陕煤”的发展使命，依托海南自贸港的区位优势和政策支持，借助其开放格局和国际合作框架，成为持续创新、特色鲜明的专业资产管理机构。

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 理（助理）期限		证 券 从 业 年 限	说明
		任职日期	离任日期		
孙晨歌	本基金的基金经理、研究部负责人	2026-02-10	-	9 年	孙晨歌先生，中国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任联合资信评估工商部分析师，世纪证券自营固收部信用债研究员、投资经理，世纪证券资产管理部投资经理，开源

					证券资产管理总部投资经理、信用研究部负责人。2024 年 6 月加入鹏安基金管理有限公司，现任鹏安安泰利率债债券型证券投资基金基金经理。
蔡宇飞	本基金的基金经理	2026-02-10	-	11 年	蔡宇飞先生，中国籍，经济学博士，具有基金从业资格。历任前海开源基金管理有限公司投资经理，博远基金管理有限公司基金经理，金信基金管理有限公司基金经理。2025 年 6 月加入鹏安基金管理有限公司，现任鹏安安泰利率债债券型证券投资基金基金经理。

注：1. “任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规规定及基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效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。本基金运作管理符合有关法律法规规定和基金合同约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理规定》，通过组织结构的科学设置、完善的工作制度、标准化的业务流程和技术管控手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常实时监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的全流程监督，切实防范不同投资组合之间的利益输送风险，保护投资者合法权益。

在研究分析方面，本公司建立了客观、规范的研究分析体系，要求所有投资分析和建议均以充分的事实和数据为支撑，严禁利用内幕信息作为投资依据，规范了研究成果的应用流程。公司搭建了全公司与分投资组合双层的投资对象备选库和交易对手备选库，先制定全公司统一适用的备选库，再结合不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围等特征建立专属备选库，使各投资组合经理在获取研究支持、选取投资标的等方面得到公平对待，保障研究成果在各投资组合间的公平共享。

在投资决策方面，首先，公司建立健全投资授权管理制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限；其次，公司建立严格的投资组合投资信息管理及保密制度，除

业务管理所需外，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实现相互隔离，确保投资决策信息的公平获取。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能严格隔离，所有投资指令均经投资交易系统统一下达至交易部审核执行，并制定了公平的交易分配制度和差异化交易规则，通过强制公平委托等一系列措施，保证各投资组合获得公平的交易执行机会。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部牵头开展交易过程的实时监控和交易结果的定期分析评估工作，对公平交易执行情况作整体把控。其中日常监控包括交易部负责人对投资指令执行过程的实时监控，及时发现并通报可能导致不公平交易的异常行为，风险管理部与合规稽核部根据市场公认的第三方信息，对投资组合与交易对手之间议价交易的价格公允性进行审查，要求相关人员对价格异常情况作出合理性解释；事后分析评估上，风险管理部在每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体及分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度内不同时间窗下各投资组合同向交易的交易价差开展专项分析，包括同向交易持续占优比率及合计溢价贡献率等维度，形成分析报告并经相关负责人签署后留存备查。若发现交易价差出现异常情况，合规稽核部将重新核查投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，按规定向监管部门报送专项说明。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且未发现其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

报告期内，在资金宽松、内需弱于预期、通胀叙事转向的多重背景下，市场主要利率普遍下行，但各阶段交易节奏分化明显：4 月初债市博弈供给放量与通胀扰动；4 月中下旬交易主线切换至宽松资金面与地缘波动；5 月初短暂博弈央行净回笼操作、市场风险偏好抬升；5 月中下旬重回弱基本面、平稳流动性逻辑；6 月初低位利率区间多空博弈均衡；6 月中旬后行情再度由资金面主导。因此，本阶段核心看点并非收益率绝对下行幅度，而是短端利率大幅下行后曲线与利差的重定价：10 年-1 年利差走阔，收益率曲线持续陡峭；10 年期国开债与 10 年期国债利差收窄，政金债修复行情更强，为本阶段核心行情主线。30 年-10 年利差季内虽阶段性收窄，但季末仍维持高位，超长端供需压力尚未充分出清。

分期限维度看，3—5 年期利率债表现亮眼，核心支撑来自三重利好共振：资金面宽松、银行及理财配置需求旺盛、期限利差收窄。从配置视角来看，二季度银行计息负债成本持续下行、存单利率低位运行，3—5 年期资产收益具备配置价值，对应配置需求最为稳定。

债市运行走势与当期宏观环境高度匹配。经济层面，一季度 GDP 同比增长 5.0%，实现“开门红”；但多家机构一致预判二季度实际 GDP 同比回落至 4.5%—4.9% 区间，经济动能较一季度边际走弱。增

长结构分化特征显著：出口保持高韧性，4、5 月人民币计价出口同比分别达 9.7%、13.8%；社零表现偏弱，两个月同比增速仅 0.2%、-0.6%；信贷端内生需求不足，4 月新增人民币贷款-100 亿元、5 月 5200 亿元；社融增量 4 月 6238 亿元、5 月 20264 亿元，增长主要依靠财政发力，私人部门信用扩张偏弱。

本基金为债券型基金，专注债券品类投资。产品严格遵循基金合同及监管法律法规运作，目标持续跑赢业绩比较基准，优于同类市场平均收益。报告期内，产品完成银行间账户开立后，按既定策略运作：以捕捉期限结构高性价比凸点为核心思路，叠加骑乘收益、精选个券、波段交易增厚收益，力求为持有人创造稳健回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末鹏安安泰利率债 A 基金份额净值为 1.0082 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.82%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%；截至报告期末鹏安安泰利率债 C 基金份额净值为 1.0085 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.85%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，中国经济呈现前高态势，政策持续靠前发力，上半年 GDP 同比增长 4.7%，增量为五年同期最高；但经济结构延续 K 型分化，整体稳定性偏弱。进入二季度后，受内外部多重因素扰动，经济修复边际走弱。其中出口表现亮眼，消费与固定资产投资均出现一定回落。结合当前稳增长政策储备与流动性环境来看，下半年政策落地空间充足，各类宏观政策工具有望持续托底经济，全年经济修复节奏仍存在较强不确定性，后续需持续跟踪各类经济指标变化。

展望下半年债市，适度宽松的货币政策是年内影响债市的核心逻辑，流动性仍是债市定价的核心锚。上半年，尤其 6 月之后，央行对资金面的调节更为精准，创设隔夜逆回购等工具，7 天期 OMO 利率维持在 1.4%。预计下半年央行将延续适度宽松政策基调，灵活开展流动性操作以平抑资金波动。长短端国债利率将同时受经济基本面、财政供给、期限利差、外部环境等多重因素约束，各期限利率均存在双向波动可能；利率债市场后续走势由多重宏观变量博弈决定，市场波动风险仍需持续关注。

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。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定

分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——鹏安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏安基金管理有限公司编制和披露的本基金半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：鹏安安泰利率债债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
-----	-----	-------------------------

资 产：		
货币资金	6.4.7.1	757,110,892.00
结算备付金		1,645,426.35
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,052,394,482.21
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		3,052,394,482.21
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	1,880,296,203.09
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		1,024,974,000.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		6,716,421,003.65
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		850,471.09
应付托管费		141,745.20
应付销售服务费		4,489.34
应付投资顾问费		-
应交税费		34,167.53
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	92,502.11
负债合计		1,123,375.27
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	6,660,673,602.75
未分配利润	6.4.7.8	54,624,025.63
净资产合计		6,715,297,628.38
负债和净资产总计		6,716,421,003.65

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 6,660,673,602.75 份。其中鹏安安泰利率债

A 基金份额净值 1.0082 元，基金份额总额 6,324,199,652.62 份；鹏安安泰利率债 C 基金份额净值 1.0085 元，基金份额总额 336,473,950.13 份。

2、本基金于 2026 年 02 月 10 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止。

6.2 利润表

会计主体：鹏安安泰利率债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同 生效日）至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		36,996,712.91
1. 利息收入		16,488,635.90
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,095,912.54
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		6,392,723.36
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,095,654.58
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	12,095,654.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	8,412,422.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、营业总支出		5,626,261.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,710,689.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	785,115.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	45,366.78
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	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		12,742.98
8. 其他费用	6.4.7.18	72,347.15

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,370,451.25
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,370,451.25
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		31,370,451.25

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏安安泰利率债债券型证券投资基金
本报告期：2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	6,000,116,284.18	-	6,000,116,284.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	660,557,318.57	54,624,025.63	715,181,344.20
（一）、综合收益总额	-	31,370,451.25	31,370,451.25
（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）	660,557,318.57	23,253,574.38	683,810,892.95
其中：1. 基金申购款	3,610,535,650.67	28,709,985.21	3,639,245,635.88
2. 基金赎回款	-2,949,978,332.10	-5,456,410.83	-2,955,434,742.93
（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	6,660,673,602.75	54,624,025.63	6,715,297,628.38

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：

魏峻	周辉明	任建伟
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

鹏安安泰利率债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]2784 号《关于准予鹏安安泰利率债债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由鹏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《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，

首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,999,974,331.22 元，业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2026]200Z0001 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金基金合同》于 2026 年 02 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,000,116,284.18 份基金份额，其中认购资金利息折合 141,952.96 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏安基金管理有限公司，基金托管人为苏州银行股份有限公司。

根据《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金基金合同》和《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金招募说明书》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。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。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并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括：具有良好流动性的金融工具，包括债券(含国债、政策性金融债、地方政府债、央行票据)、债券回购、银行存款、国债期货、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）。

本基金不投资于股票、可转换债券和可交换债券，也不投资信用债券。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。

本基金投资组合资产配置比例：对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于利率债资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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、存出保证金及应收申购款等。

本基金所指利率债是指国债、政策性金融债、地方政府债和央行票据。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏安基金管理有限公司于 2026 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净

资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金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；或者(3)该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、

已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；
(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，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由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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。

6.4.4.11 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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、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》、国务院令第826号《中华人民共和国

国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部·税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	157,056,640.27
等于：本金	157,053,416.60
加：应计利息	3,223.67
减：坏账准备	-
定期存款	600,053,888.88
等于：本金	600,000,000.00
加：应计利息	53,888.88
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	400,034,444.44
存款期限 1-3 个月	200,019,444.44

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	362.85
等于：本金	362.61
加：应计利息	0.24
减：坏账准备	-
合计	757,110,892.00

注：其他存款为存放在开立于证券经纪机构的证券资金账户内的交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	3,016,517,167.57	27,464,892.21	3,052,394,482.21
	合计	3,016,517,167.57	27,464,892.21	3,052,394,482.21
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,016,517,167.57	27,464,892.21	3,052,394,482.21	8,412,422.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	350,026,082.20	-
银行间市场	1,530,270,120.89	-
合计	1,880,296,203.09	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 其他资产

注：无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 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	20,954.96
其中：交易所市场	-
银行间市场	20,954.96
应付利息	-
预提费用	71,547.15
合计	92,502.11

注：预提费用为该基金 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间的审计费及信息披露费用。

6.4.7.7 实收基金

鹏安安泰利率债 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,400,190,603.75	5,400,190,603.75
本期申购	3,274,036,790.82	3,274,036,790.82
本期赎回（以“-”号填列）	-2,350,027,741.95	-2,350,027,741.95
本期末	6,324,199,652.62	6,324,199,652.62

鹏安安泰利率债 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	599,925,680.43	599,925,680.43
本期申购	336,498,859.85	336,498,859.85
本期赎回（以“-”号填列）	-599,950,590.15	-599,950,590.15
本期末	336,473,950.13	336,473,950.13

注：1、申购含红利再投。
2、本基金自 2026 年 01 月 06 日至 2026 年 02 月 06 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 5,999,974,331.22 元，折合为 5,999,974,331.22 份基金份额（其中 A 类基金份额 5,400,071,980.60 份，C 类基金份额 599,902,350.62 份）。根据《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 141,952.96 元，在

本基金成立后，折合为 141,952.96 份基金份额(其中 A 类基金份额 118,623.15 份，C 类基金份额 23,329.81 份)，划入基金份额持有人账户。

3、根据《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金基金合同》、《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金招募说明书》及《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金开放日常申购(赎回、定期定额投资)业务公告》的相关规定，本基金于 2026 年 02 月 10 日(基金合同生效日)至 2026 年 02 月 23 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、定期定额投资业务自 2026 年 02 月 24 日起开始办理。

6.4.7.8 未分配利润

鹏安安泰利率债 A

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	22,451,674.32	8,291,866.46	30,743,540.78
本期基金份额交易产生的变动数	14,136,862.99	6,878,440.62	21,015,303.61
其中：基金申购款	18,290,971.63	7,739,384.82	26,030,356.45
基金赎回款	-4,154,108.64	-860,944.20	-5,015,052.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,588,537.31	15,170,307.08	51,758,844.39

鹏安安泰利率债 C

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	506,354.50	120,555.97	626,910.47
本期基金份额交易产生的变动数	1,551,164.95	687,105.82	2,238,270.77
其中：基金申购款	1,989,920.46	689,708.30	2,679,628.76
基金赎回款	-438,755.51	-2,602.48	-441,357.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,057,519.45	807,661.79	2,865,181.24

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	352,787.39
定期存款利息收入	2,784,999.99
其他存款利息收入	179,114.41
结算备付金利息收入	6,524,575.58
其他	254,435.17
合计	10,095,912.54

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金产生的利息收入以及协议活期存款利息收入，其他为应收申购款利息。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	10,932,613.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,163,040.85
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,095,654.58

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	864,113,847.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	859,104,166.43
减：应计利息总额	3,783,947.58
减：交易费用	62,692.20
买卖债券差价收入	1,163,040.85

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.15 股利收益

注：无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	8,412,422.43
——股票投资	—
——债券投资	8,412,422.43
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	8,412,422.43

6.4.7.17 信用减值损失

注：本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	20,824.29
信息披露费	47,722.86
证券出借违约金	—
证券账户开户费	800.00
账户维护费	3,000.00
合计	72,347.15

6.4.7.19 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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、关联关系

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

本基金本报告期内不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。

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
鹏安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
苏州银行股份有限公司	基金托管人
开源证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

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：无。

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
开源证券股份有限公司	1,533,244,178.48	100%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
开源证券股份有限公司	20,096,389,000.00	97.86%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣金总额的 比例
开源证券股份 有限公司	46,129.70	100%	-	-

注：上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

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 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,710,689.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	668,752.78
应支付基金管理人的净管理费	4,041,936.95

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.30\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	785,115.02

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	本期
--------------	----

名称	2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏安安泰利率债 A	鹏安安泰利率债 C	合计
鹏安基金管理有限公司	-	40,999.37	40,999.37
开源证券股份有限公司	-	1.26	1.26
合计	-	41,000.63	41,000.63

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：无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.4.2 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

鹏安安泰利率债 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
苏州银行股份有限公司	1,797,646,584.09	26.99%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5 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 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
苏州银行股份有限公司	157,056,640.27	352,787.39
开源证券股份有限公司	2.33	15,781.08

注：1、本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息；
2、本基金管理人股东受托作为本基金的证券经纪商之一。上述款项为本基金存放于基金专用证券资金账户中的证券交易结算资金，按证券经纪服务协议约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

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（2026 年 06 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：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金目前面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应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。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了顺序递进、权责统一、严密有效的四道内控防线。该体系分为四个层级，由上至下分别是董事会（含下设的合规与风险控制委员会、审计委员会）、经营层（含下设的风险管理委员会）、相关内部控制部门（风险管理部、合规稽核部）与各风险管理单元（公司各部门）。

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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存

放在具有托管资格的银行；本基金存放其他存款银行前，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。本基金存在存放于期货公司的期货备付金，期货公司的选择参考证券期货经营机构的主体评级或行业分类结果选择交易对手，违约风险可能性很小。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据、地方政府债和政策性金融债以外的债券和资产支持证券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日
A-1	—
A-1 以下	—
未评级	600,733,913.90
合计	600,733,913.90

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日
AAA	189,819,366.95
AAA 以下	—
未评级	2,261,841,201.36
合计	2,451,660,568.31

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在

基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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》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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金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%，本基金与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上述比例限制)。

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%。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 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。于 2026 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的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。

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受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 6 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产					
货 币 资 金	757,110,892.00	-	-	-	757,110,892.00
结 算 备 付 金	1,645,426.35	-	-	-	1,645,426.35
交 易 性 金 融 资 产	816,888,160.75	1,582,292,084.37	653,214,237.09	-	3,052,394,482.21
买 入 返 售 金 融 资	1,880,296,203.09	-	-	-	1,880,296,203.09

产					
应收申购款	-	-	-	1,024,974,000.00	1,024,974,000.00
资产总计	3,455,940,682.19	1,582,292,084.37	653,214,237.09	1,024,974,000.00	6,716,421,003.65
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	850,471.09	850,471.09
应付托管费	-	-	-	141,745.20	141,745.20
应付销售服务费	-	-	-	4,489.34	4,489.34
应交税费	-	-	-	34,167.53	34,167.53
其他负债	-	-	-	92,502.11	92,502.11
负债总计	-	-	-	1,123,375.27	1,123,375.27
利	3,455,940,682.	1,582,292,084.	653,214,237.	1,023,850,624.	6,715,297,628.

率 敏 感 度 缺 口	19	37	09	73	38
----------------------------	----	----	----	----	----

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
		本期末 2026 年 06 月 30 日
	利率下降 25 个基点	27,721,735.08
	利率上升 25 个基点	-27,201,684.72

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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于利率债资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金(不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未进行交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2026 年 06 月 30 日
第一层次	-
第二层次	3,052,394,482.21
第三层次	-
合计	3,052,394,482.21

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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

截至资产负债表日本基金无需说明的其他重要事项。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,052,394,482.21	45.45

	其中：债券	3,052,394,482.21	45.45
	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	1,880,296,203.09	28.00
	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	758,756,318.35	11.30
8	其他各项资产	1,024,974,000.00	15.26
9	合计	6,716,421,003.65	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	99,896,573.63	1.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,762,678,541.63	41.14
	其中：政策性金融债	2,762,678,541.63	41.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	189,819,366.95	2.83
10	合计	3,052,394,482.21	45.45

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	09260401	26 农发清发 01	4,700,000	470,647,537.67	7.01
2	190215	19 国开 15	4,100,000	446,640,402.60	6.65
3	240410	24 农发 10	3,500,000	371,156,943.84	5.53
4	260203	26 国开 03	3,500,000	354,292,663.70	5.28
5	250203	25 国开 03	3,000,000	299,725,150.68	4.46

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。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

1、26 农发清发 01（证券代码：09260401）、24 农发 10（证券代码：240410）

上述债券发行主体均为中国农业发展银行。2025 年 8 月 1 日，国家金融监督管理总局对中国农业发展银行处以 1020 万元行政处罚，违规事由包括信贷资金投向不合规、贷后管理不到位等。

2、19 国开 15（证券代码：190215）、26 国开 03（证券代码：260203）、25 国开 03（证券代码：250203）、23 国开 03（证券代码：230203）、17 国开 10（证券代码：170210）、25 国开 20（证券代

码：250220）、24 国开清发 03（证券代码：09240203）

上述债券发行主体均为国家开发银行。2025 年 7 月 25 日，国家外汇管理局对国家开发银行予以警告、没收违法所得并罚款 1394.42 万元的行政处罚，违规事由为违规办理内保外贷业务，违规办理结汇、售汇业务，未按规定开展国际收支统计申报。2025 年 9 月 22 日，中国人民银行对国家开发银行予以警告并罚款 123 万元的行政处罚，违规事由为违反金融统计相关管理规定。

上述证券的投资决策程序的说明：本基金为利率债型证券投资基金，主要以国债、政策性金融债等利率债作为核心投资标的，依托宏观经济与利率走势研究，实施久期配置、收益率曲线策略等主动投资运作。上述债券发行主体均为国家政策性银行，拥有主权信用背书，债券本息兑付保障性较强；前述监管处罚属于发行人日常经营层面的合规问题，不会影响标的债券信用资质与到期兑付能力，该部分债券投资决策流程符合法律法规及公司内部制度要求。

除上述证券外，本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内相关主体受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本产品不投资于股票。

7.12.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,024,974,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,024,974,000.00

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
鹏安安泰利率债 A	155	40,801,288.08	6,324,090,548.82	100%	109,103.80	0.00%
鹏安安泰利率债 C	138	2,438,217.03	336,440,503.68	99.99%	33,446.45	0.01%
合计	286	23,289,068.54	6,660,531,052.50	100%	142,550.25	0.00%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏安安泰利率债 A	26,777.08	0.0004%
	鹏安安泰利率债 C	190.28	0.0001%
	合计	26,967.36	0.0004%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鹏安安泰利率债 A	0~10
	鹏安安泰利率债 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏安安泰利率债 A	0~10
	鹏安安泰利率债 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	鹏安安泰利率债 A	鹏安安泰利率债 C
基金合同生效日（2026 年 02 月 10 日）基金份额总额	5,400,190,603.75	599,925,680.43

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,274,036,790.82	336,498,859.85
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,350,027,741.95	599,950,590.15
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	6,324,199,652.62	336,473,950.13

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

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

1、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2026 年 4 月 22 日发布公告，杨彬先生自 2026 年 4 月 21 日起代为履行公司总经理职务；洪正华先生因退休离任，不再担任公司董事及总经理职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

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

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：管理人的高级管理人员、相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
开源证券股份有限公司	4	-	-	46,129.70	100%	-
华安证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用或者通过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
开源证券股份有限公司	1,533,244,178.48	100.00%	20,096,389,000.00	97.86%	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	440,004,000.00	2.14%	-	-	-	-

注：1、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）的有关规定，基金管理人管理的采用券商交易模式的基金，不适用单一证券公司交易佣金比例限制。

2、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。本基金管理人与选择的证券经

纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

3、本基金管理人将根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3 号）及证券业协会测算结果完成佣金动态调整工作。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司官网披露的本公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)的报告期为 2025 年 10 月 28 日至 2025 年 12 月 31 日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏安基金管理有限公司关于旗下基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-02-04
2	鹏安基金管理有限公司关于鹏安安泰利率债债券型证券投资基金增加兴业银行股份有限公司银银平台为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2026-02-06
3	鹏安安泰利率债债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2026-02-11
4	鹏安安泰利率债债券型证券投资基金开放日常申购（赎回、定期定额投资）业务公告	中国证监会规定媒介	2026-02-13
5	关于鹏安安泰利率债债券型证券投资基金开通同一基金不同类别份额转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-04
6	关于鹏安安泰利率债债券型证券投资基金向符合《海南自由贸易港跨境资产管理试点业务实施细则》的境外投资者销售并修订招募说明书的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-12
7	鹏安安泰利率债债券型证券投资基金基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2026-03-12
8	鹏安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-31
9	鹏安基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
10	鹏安基金管理有限公司 2026 年行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
11	2025 年度鹏安基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-24
12	鹏安基金管理有限公司关于旗下基金增加广发证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-18

13	鹏安基金管理有限公司关于旗下基金增加华福证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-18
14	鹏安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-03
15	鹏安基金管理有限公司关于鹏安安泰利率债债券型证券投资基金增加京东肯特瑞基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-25

§ 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	20260210-20260630	1,500,057,333.33	-	-	1,500,057,333.33	22.52%
	2	20260210-20260630	1,799,999,000.00	297,647,584.09	300,000,000.00	1,797,646,584.09	26.99%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；
2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资或者买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出或者卖出等业务减少的份额。

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. 中国证监会准予鹏安安泰利率债债券型证券投资基金注册的文件

2. 《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金基金合同》
3. 《鹏安安泰利率债债券型证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

12.3 查阅方式

上述文件可在鹏安基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到鹏安基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏安基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-814-2888

网址:<http://www.penganfunds.com>

鹏安基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日