

平安养老保险股份有限公司集合型企业年金计划管理情况

2024 年 1 季度

一、2024 年 1 季度集合计划基本情况表

序号	计划登记号	计划名称	期末企业数(个)	期末职工人数(人)	期末资产金额(万元)	设立组合数(个)	本期投资收益(万元)	本年累计投资收益(万元)
1	99JH20110003	平安相伴今生企业年金集合计划	2,014	297,634	1,936,370.09	8	19,348.17	19,348.17
2	99JH20110004	平安阳光人生企业年金集合计划	821	29,369	96,159.35	5	644.69	644.69
3	99JH20110005	平安美好人生企业年金集合计划	993	113,660	562,994.88	7	5,509.25	5,509.25
4	99JH20110006	平安养颐人生企业年金集合计划	1,311	118,626	553,193.13	7	3,572.20	3,572.20
5	99JH20110007	平安精致人生企业年金集合计划	1,546	134,497	665,544.49	6	-1,758.41	-1,758.41
6	99JH20110008	平安丰沃人生企业年金集合计划	901	74,055	405,047.23	6	2,468.18	2,468.18
7	99JH20120041	平安锦绣人生企业年金集合计划	154	12,817	74,200.73	6	-30.19	-30.19
8	99JH20120042	平安美满人生企业年金集合计划	464	54,933	365,394.73	6	532.73	532.73

9	99JH20130046	平安鹏程企业年金集合计划	864	44,500	408,635.57	9	3,372.93	3,372.93
	合计	——	9,068	880,091	5,067,540.20	60	33,659.55	33,659.55

注：1. 期末资产金额包含受托户资金余额。

2. 投资收益为所有组合投资收益合计数。投资收益=当期投资资产利息收入+投资处置收益+公允价值变动损益+其他收入-受托费-托管费-投资管理费-交易费用-利息支出-其他费用。本期投资收益以本季度为期间，本年累计投资收益以年初到本季度末为期间。

二、2024 年 1 季度集合计划组合明细表

序号	计划登记号	计划名称	组合序号	组合名称	组合类型	组合代码	投资管理人名称	组合期末资产净值 (万元)	本年以来投资收益率 (%)
1	99JH20110003	平安相伴今生企业年金集合计划	1	平安相伴今生企业年金集合计划省心收益投资组合	固定收益类	I44Q0103	平安养老保险股份有限公司	1,288,935.17	1.19
			2	平安相伴今生企业年金集合计划受托直投组合	固定收益类	T03Q0035	平安养老保险股份有限公司(受托)	168,036.08	0.77
			3	平安相伴今生企业年金集合计划安心回报投资组合	含权益类	I44Q0003	平安养老保险股份有限公司	285,043.49	0.92

			4	平安相伴今生企业年金集合计划信心进取 1 投资组合	含 权 益 类	I44Q0020	平安养老保险股份有限公司	31,351.27	0.64
			5	平安相伴今生企业年金集合计划舒心平衡投资组合	含 权 益 类	I44Q0100	平安养老保险股份有限公司	91,300.92	0.20
			6	平安相伴今生企业年金集合计划信心进取 4 投资组合	含 权 益 类	I52Q0466	中国人寿养老保险股份有限公司	32,502.35	0.45
			7	平安相伴今生企业年金集合计划信心进取 2 投资组合	含 权 益 类	I35Q0185	嘉实基金管理有限公司	7,167.26	-0.90
			8	平安相伴今生企业年金集合计划信心进取 3 投资组合	含 权 益 类	I41Q0283	中信证券股份有限公司	8,664.89	0.95
2	99JH20110004	平安阳光人生企业年金集合计划	1	平安阳光人生企业年金集合计划省心收益 1 投资组合	固 定 收 益类	I44Q0014	平安养老保险股份有限公司	63,339.62	0.75
			2	平安阳光人生企业年金集合计划省心收益 2 投资组合	固 定 收 益类	I43Q0048	华泰资产管理有限公司	7,529.98	1.45
			3	平安阳光人生企业	含 权 益	I44Q0015	平安养老保	23,259.92	0.31

				年金集合计划舒心 平衡投资组合	类		险股份有限 公司		
			4	平安阳光人生企业 年金集合计划安心 回报投资组合	含 权 益 类	-	平安养老保 险股份有限 公司	-	-
			5	平安阳光人生企业 年金集合计划信心 进取 4 投资组合	含 权 益 类	I34Q0356	易方达基金 管理有限公 司	63.60	-
3	99JH20110005	平安美好 人生企业 年金集合 计划	1	平安美好人生企业 年金集合计划省心 收益 1 投资组合	固 定 收 益类	I44Q0076	平安养老保 险股份有限 公司	379,752.81	1.07
			2	平安美好人生企业 年金集合计划省心 收益 2 投资组合	固 定 收 益类	I31Q0121	海富通基金 管理有限公 司	99,726.42	0.78
			3	平安美好人生企业 年金集合计划信心 进取 1 投资组合	含 权 益 类	I44Q0088	平安养老保 险股份有限 公司	14,880.76	1.02
			4	平安美好人生企业 年金集合计划舒心 平衡投资组合	含 权 益 类	I44Q0070	平安养老保 险股份有限 公司	48,762.63	1.11
			5	平安美好人生企业 年金集合计划信心	含 权 益 类	I52Q0677	中国人寿养 老保险股份	10,102.36	0.62

				进取 3 投资组合			有限公司		
			6	平安美好人生企业年金集合计划安心回报投资组合	含 权 益 类	-	平安养老保险股份有限公司	-	-
			7	平安美好人生企业年金集合计划受托直投资组合	含 权 益 类	-	平安养老保险股份有限公司(受托)	-	-
4	99JH20110006	平安养颐人生企业年金集合计划	1	平安养颐人生企业年金集合计划省心收益投资组合	固 定 收 益类	I44Q0139	平安养老保险股份有限公司	398,981.21	0.61
			2	平安养颐人生企业年金集合计划信心进取 4 投资组合	固 定 收 益类	I47Q0270	工银瑞信基金管理有限公司	57,688.12	1.45
			3	平安养颐人生企业年金集合计划信心进取 1 投资组合	含 权 益 类	I44Q0138	平安养老保险股份有限公司	38,876.40	0.89
			4	平安养颐人生企业年金集合计划舒心平衡投资组合	含 权 益 类	I44Q0140	平安养老保险股份有限公司	44,515.85	-0.10
			5	平安养颐人生企业年金集合计划信心进取 2 投资组合	含 权 益 类	I32Q0250	华夏基金管理有限公司	4,658.38	0.26

			6	平安颐颐人生企业年金集合计划信心进取 3 投资组合	含 权 益 类	I46Q0050	国泰基金管理有限公司	133.88	0.75
			7	平安颐颐人生企业年金集合计划安心回报投资组合	含 权 益 类	-	平安养老保险股份有限公司	-	-
5	99JH20110007	平安精致人生企业年金集合计划	1	平安精致人生企业年金集合计划省心收益 1 投资组合	固 定 收 益 类	I44Q0073	平安养老保险股份有限公司	446,743.53	-0.36
			2	平安精致人生企业年金集合计划省心收益 2 投资组合	固 定 收 益 类	I38Q2009	博时基金管理有限公司	158,704.77	0.89
			3	平安精致人生企业年金集合计划信心进取 1 投资组合	含 权 益 类	I44Q0086	平安养老保险股份有限公司	26,044.47	1.02
			4	平安精致人生企业年金集合计划舒心平衡投资组合	含 权 益 类	I44Q0077	平安养老保险股份有限公司	18,897.08	-8.37
			5	平安精致人生企业年金集合计划信心进取 2 投资组合	含 权 益 类	I39Q0067	银华基金管理有限公司	5,233.25	0.73
			6	平安精致人生企业	含 权 益	-	平安养老保	-	-

				年金集合计划受托 直投组合	类		险股份有限 公司(受托)		
6	99JH20110008	平安丰沃 人生企业 年金集合 计划	1	平安丰沃人生企业 年金集合计划省心 收益 1 投资组合	固 定 收 益类	I44Q0001	平安养老保 险股份有限 公司	250,188.81	0.99
			2	平安丰沃人生企业 年金集合计划省心 收益 2 投资组合	固 定 收 益类	I54Q0145	中国人民养 老保险有限 责任公司	13,323.14	0.82
			3	平安丰沃人生企业 年金集合计划舒心 平衡投资组合	含 权 益 类	I44Q0002	平安养老保 险股份有限 公司	87,847.46	-0.30
			4	平安丰沃人生企业 年金集合计划信心 进取 1 投资组合	含 权 益 类	I44Q0018	平安养老保 险股份有限 公司	7,506.65	-0.38
			5	平安丰沃人生企业 年金集合计划安心 回报投资组合	含 权 益 类	I44Q0304	平安养老保 险股份有限 公司	24,060.44	0.55
			6	平安丰沃人生企业 年金集合计划信心 进取 2 投资组合	含 权 益 类	I34Q0238	易方达基金 管理有限公 司	13,946.94	0.93
7	99JH20120041	平安锦绣 人生企业	1	平安锦绣人生债券 增强型投资组合	含 权 益 类	I41Q0024	中信证券股 份有限公司	8,285.39	1.21

		年金集合计划	2	平安锦绣人生稳健保值配置型投资组合	含权益类	I41Q0023	中信证券股份有限公司	9,382.83	1.16
			3	平安锦绣人生安心回报基金组合	含权益类	I44Q0348	平安养老保险股份有限公司	39,602.07	0.04
			4	平安锦绣人生受托直投组合 1-平安	含权益类	T03Q0005	平安养老保险股份有限公司(受托)	5,078.14	2.85
			5	平安锦绣人生稳健成长基金组合	含权益类	I43Q0047	华泰资产管理有限公司	563.52	-
			6	平安锦绣人生信心进取基金组合	含权益类	I44Q4424	平安养老保险股份有限公司	9,742.99	-
8	99JH20120042	平安美满人生企业年金集合计划	1	省心收益 1 基金组合	固定收益类	I44Q0012	平安养老保险股份有限公司	211,403.84	0.23
			2	省心收益 2 基金组合	固定收益类	I54Q0146	中国人民养老保险有限责任公司	33,876.70	0.90
			3	信心进取 1 基金组合	含权益类	I44Q0013	平安养老保险股份有限公司	13,903.93	0.24

							公司		
			4	舒心平衡基金组合	含 权 益 类	I44Q0011	平安养老保险股份有限公司	52,943.56	-1.22
			5	安心回报基金组合	含 权 益 类	I44Q9005	平安养老保险股份有限公司	19,076.92	0.98
			6	信心进取 3 基金组合	含 权 益 类	I46Q0049	国泰基金管理有限公司	29,873.94	0.61
9	99JH20130046	平安鹏程企业年金集合计划	1	省心收益-平安鹏程企业年金集合计划投资组合	固 定 收 益类	I44Q0513	平安养老保险股份有限公司	9,602.50	1.65
			2	平安鹏程企业年金集合计划信心进取 6 投资组合	含 权 益 类	I44Q0419	平安养老保险股份有限公司	304,375.31	0.85
			3	平安鹏程企业年金集合计划信心进取 1 投资组合	含 权 益 类	I33Q0238	南方基金管理有限公司	15,507.29	0.81
			4	平安鹏程企业年金集合计划信心进取 2 投资组合	含 权 益 类	I34Q0235	易方达基金管理有限公司	17,769.75	1.01

			5	平安鹏程企业年金集合计划信心进取3投资组合	含权益类	I35Q0184	嘉实基金管理有限公司	18,554.87	0.04
			6	平安鹏程企业年金集合计划信心进取4投资组合	含权益类	I36Q0081	招商基金管理有限公司	13,011.57	-0.67
			7	平安鹏程企业年金集合计划信心进取5投资组合	含权益类	I38Q2010	博时基金管理有限公司	14,325.75	1.83
			8	平安鹏程企业年金集合计划信心进取7投资组合	含权益类	I47Q0267	工银瑞信基金管理有限公司	13,818.39	1.47
			9	平安鹏程企业年金集合计划受托直投组合	含权益类	-	平安养老保险股份有限公司(受托)	-	-

注：1. 组合类型按是否含权益类投资标的分为固定收益类和含权益类，以期初合同或备忘录为准，明确约定不能投资权益类的组合为固定收益类；没有明确约定或期间发生类别变动的，都为含权益类。

2. 本年以来投资收益率为该组合单位净值增长率。

对因分红、净值归一等非正常业务影响组合单位净值的，收益率分阶段计算。

(1) 分红情况

期间多段分红收益率公式： $R = (\text{期内第1次分红前一天单位净值} / \text{期初单位净值}) * (\text{期内第2次分红前一天单位净值} /$

$$((\text{期内第1次分红前一天单位净值} - \text{第一次单位份额分红金额})) * \dots * (\text{期末单位净值} / (\text{期内第 } n \text{ 次分红前一天单位净值} - \text{第 } n \text{ 次单位份额分红金额})) - 1$$

其中，单位份额分红金额 = 分红当天分红金额 / 分红前总份额

(2) 净值归一情况

期间多段净值归一收益率公式：
$$R = ((\text{期内第1次归一当天单位净值} * \text{第1次净值归一系数}) / \text{期初单位净值}) * ((\text{期内第2次归一当天单位净值} * \text{第2次净值归一系数}) / \text{期内第1次归一当天单位净值}) * \dots * (\text{期末单位净值} / \text{期内第 } n \text{ 次归一当天单位净值}) - 1$$

其中，净值归一系数 = 净值归一当天总份额 / 净值归一前一天总份额

(3) 期内混合发生分红、净值归一时，按上述公式进行混合分段并计算期间收益率。

3. 本年以来投资收益空缺的为 2024 年 1 月 1 日及以后正式运作的组合。

三、2024 年 1 季度集合计划分组组合类型收益情况表

序号	计划登记号	计划名称	组合类型	样本组合数（个）	样本组合期末资产净值（万元）	本年以来加权平均收益率（%）
1	99JH20110003	平安相伴今生企业年金集合计划	固定收益类	2	1,456,971.25	1.14
			含权益类	6	456,030.18	0.68
			综合	8	1,913,001.43	1.03
2	99JH20110004	平安阳光人生企业年金集合计划	固定收益类	2	70,869.60	0.82
			含权益类	1	23,259.92	0.31
			综合	3	94,129.52	0.70
3	99JH20110005	平安美好人生企业年金集合计划	固定收益类	2	479,479.23	1.01
			含权益类	3	73,745.75	1.02
			综合	5	553,224.98	1.01
4	99JH20110006	平安养颐人生企业年金集合计划	固定收益类	2	456,669.33	0.71
			含权益类	4	88,184.51	0.32
			综合	6	544,853.84	0.65
5	99JH20110007	平安精致人生企业年金集合计划	固定收益类	2	605,448.30	-0.05
			含权益类	3	50,174.80	-3.07
			综合	5	655,623.10	-0.29
6	99JH20110008	平安丰沃人生企业年金集合计划	固定收益类	2	263,511.95	0.98
			含权益类	4	133,361.49	-0.03
			综合	6	396,873.44	0.63
7	99JH20120041	平安锦绣人生企业年金集合计划	固定收益类	0	0.00	0.00
			含权益类	4	62,348.43	0.68
			综合	4	62,348.43	0.68

8	99JH20120042	平安美满人生企业年金集合计划	固定收益类	2	245,280.54	0.32
			含权益类	4	115,798.35	-0.26
			综合	6	361,078.89	0.13
9	99JH20130046	平安鹏程企业年金集合计划	固定收益类	1	9,602.50	1.65
			含权益类	7	397,362.93	0.82
			综合	8	406,965.43	0.84
	合计	——	固定收益类	15	3,587,832.70	0.79
			含权益类	36	1,400,266.36	0.43

注：1. 样本为 2024 年 1 月 1 日以前正式运作的投资组合。

2. 本年以来加权平均收益率计算方法为符合条件样本组合收益率的规模加权，以上年末和本年各季度末平均资产规模为权重；各组合收益率为单位净值增长率。