

# 平安安享灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 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                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 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             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 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 | 13        |
| 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      | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 43        |
| 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       | 44        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 50        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....    | 51        |
| 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 ..... | 52        |
| 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 ..... | 52        |
| 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 .....    | 52        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 52        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 52        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 53        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>53</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 53        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 54        |
| 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 .....      | 55        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>55</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>55</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 55        |
| 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 .....      | 55        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 55        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 56        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 56        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 56        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 56        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 57        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>58</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 .....    | 58        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 59        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>59</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 59        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 59        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 59        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                  |
|-----------------|-------------------|------------------|
| 基金名称            | 平安安享灵活配置混合型证券投资基金 |                  |
| 基金简称            | 平安安享灵活配置混合        |                  |
| 基金主代码           | 002282            |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                  |
| 基金合同生效日         | 2019 年 2 月 15 日   |                  |
| 基金管理人           | 平安基金管理有限公司        |                  |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司      |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 419,052,735.05 份  |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 平安安享灵活配置混合 A      | 平安安享灵活配置混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 002282            | 007663           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 286,137,863.92 份  | 132,914,871.13 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 通过对宏观经济和股票市场、债券市场发展趋势的分析，力求把握在不同行情中可行的投资机会，追求基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略   | 本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析，结合经济周期理论，形成对不同市场周期的预测和判断，进行积极、灵活的资产配置，确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票型基金。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人                           | 基金托管人                     |
|---------|---------------------------------|---------------------------|
| 名称      | 平安基金管理有限公司                      | 中国建设银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名                              | 陈特正                       |
|         | 联系电话                            | 0755-22626828             |
|         | 电子邮箱                            | fundservice@pingan.com.cn |
| 客户服务电话  | 400-800-4800                    | 021-60637111              |
| 传真      | 0755-23997878                   | 021-60635778              |
| 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 | 北京市西城区金融大街 25 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 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼     |
| 邮政编码    | 518048                          | 100033                    |

|       |     |     |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 罗春风 | 田国立 |
|-------|-----|-----|

## 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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |                |                |
|---------------|-------------------------------------|----------------|----------------|
|               | 平安安享灵活配置混合 A                        | 平安安享灵活配置混合 C   |                |
| 本期已实现收益       | 15,468,170.96                       | 4,490,465.67   |                |
| 本期利润          | 17,313,694.74                       | 6,063,044.88   |                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0534                              | 0.0634         |                |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.05%                               | 4.82%          |                |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.35%                               | 4.29%          |                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)               |                |                |
|               | 期末可供分配利润                            | 83,866,881.47  | 36,675,116.49  |
|               | 期末可供分配基金份额利润                        | 0.2931         | 0.2759         |
|               | 期末基金资产净值                            | 386,852,444.82 | 179,484,379.25 |
|               | 期末基金份额净值                            | 1.3520         | 1.3504         |

|              |                  |        |
|--------------|------------------|--------|
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) |        |
| 基金份额累计净值增长率  | 29.13%           | 27.34% |

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安安享灵活配置混合 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.98%    | 0.19%       | -0.91%     | 0.41%         | 1.89%  | -0.22% |
| 过去三个月      | 3.82%    | 0.25%       | 2.46%      | 0.49%         | 1.36%  | -0.24% |
| 过去六个月      | 4.35%    | 0.33%       | 1.53%      | 0.66%         | 2.82%  | -0.33% |
| 过去一年       | 17.72%   | 0.35%       | 14.21%     | 0.66%         | 3.51%  | -0.31% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.13%   | 0.56%       | 31.31%     | 0.67%         | -2.18% | -0.11% |

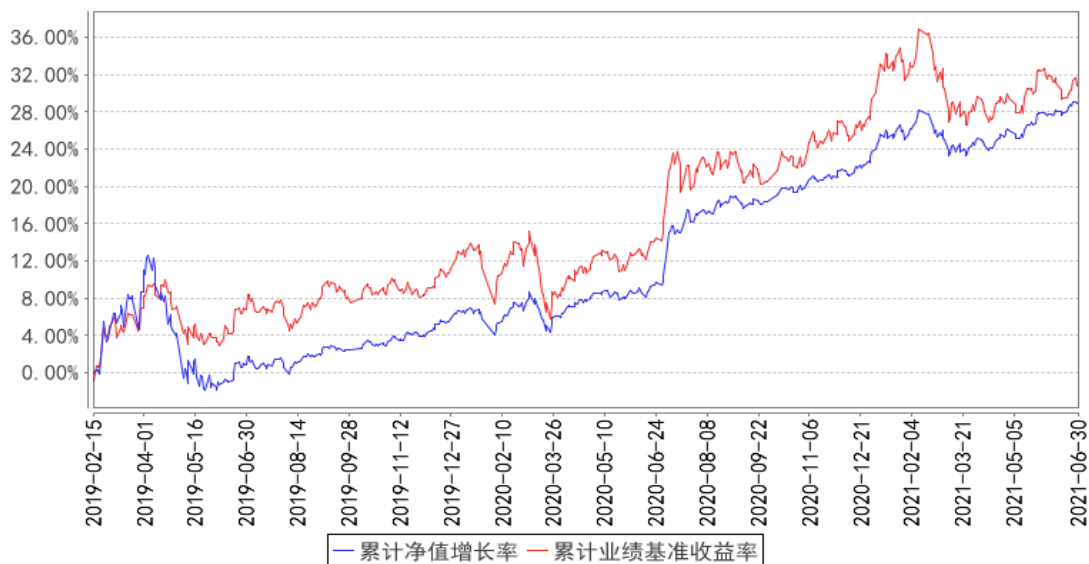
平安安享灵活配置混合 C

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 0.96%    | 0.19%       | -0.91%     | 0.41%         | 1.87% | -0.22% |

|            |        |       |        |       |       |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去三个月      | 3.80%  | 0.25% | 2.46%  | 0.49% | 1.34% | -0.24% |
| 过去六个月      | 4.29%  | 0.33% | 1.53%  | 0.66% | 2.76% | -0.33% |
| 过去一年       | 17.60% | 0.35% | 14.21% | 0.66% | 3.39% | -0.31% |
| 自基金合同生效起至今 | 27.34% | 0.33% | 22.34% | 0.64% | 5.00% | -0.31% |

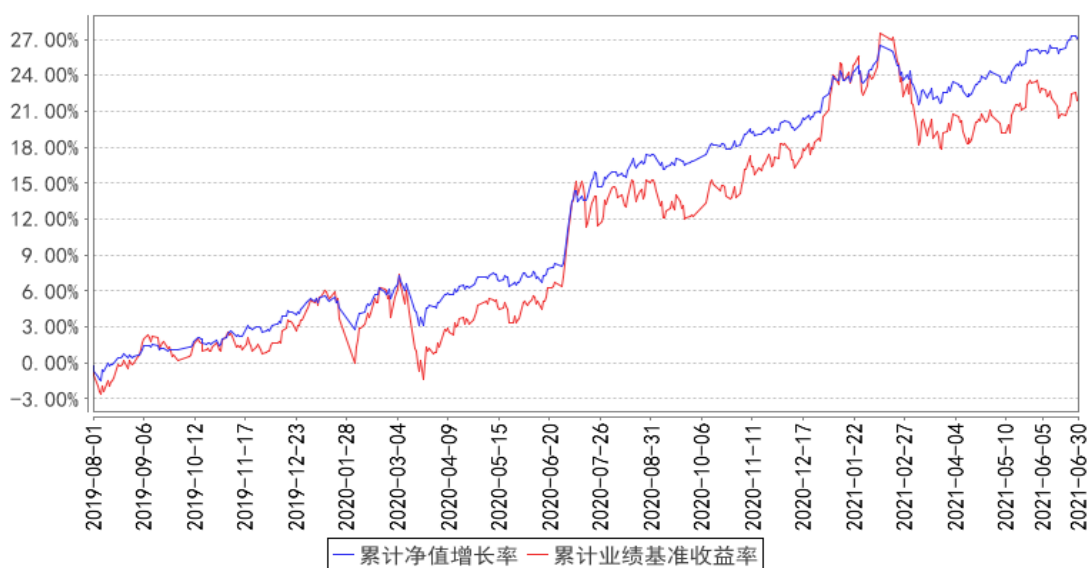
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

平安安享灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





平安安享灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 2 月 15 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合同约定；

3、本基金于 2019 年 07 月 15 日起增设 C 类份额，C 类份额从 2019 年 08 月 01 日开始有份额，所以以上 C 类份额走势图从 2019 年 08 月 01 日开始。

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

## § 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（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2021 年 6 月 30 日，平安基金共管理 138 只公募基金，公募资产管理总规模约为 3,831 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 |        |  |
| 毛时超 | 平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2020年5月9日       | -    | 4年     | 毛时超先生，中山大学硕士。2016年7月加入平安基金管理有限公司，曾任衍生品投资中心衍生品研究员、基金经理助理。现担任平安安享灵活配置混合型证券投资基金、平安深证300指数增强型证券投资基金、平安沪深300指数量化增强证券投资基金、平安中证500指数增强型发起式证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安量化精选混合型发起式证券投资基金、平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，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

报告期内，中国股市历经较大幅度的波动，不同行业出现显著的分化走势。以锂电池、新能源汽车、光伏等为代表的新经济成长型产业，由于政策支持、符合未来发展方向，并且产业景气度持续提升，具有很大的预期发展空间，在年初调整一段时间之后，大幅反弹领涨全市场。去年表现较好的大盘龙头股票，经过春节之前大幅上涨之后，估值处于历史相对高位，加上部分个股因为原材料成本上升或者消费需求下降，导致增速下滑业绩压力较大，在反弹行情中相比去年表现较差。

本基金股票部分的投资策略，基于上证 50 和深证 100 指数的行业权重分布，从估值、ROE、波动率、股息率、波动率、陆股通持股等维度，精选基本面良好的沪深两市的大市值优质股票，除非个股基本面发生较大变化，不然将会长期持有不做短期调整，降低组合的交易换手率。本基金债券部分的投资策略，是买入到期时间一年以内、到期收益率在 3%左右、信用评级较高的债券，持有到期后获取稳定的票息收益。此外本基金积极参与沪深两市新股询价申购，增厚基金的投资收益表现。本基金的整体投资策略，是通过股票底仓、债券票息和新股收益，控制股票仓位和波动率处于较低水平，降低基金的业绩波动和回撤，获取长期较为稳健的投资收益表现。

报告期内，本基金持有的部分大盘股票，虽然在此轮反弹行情中，相比去年表现较差，而且短期来看具有一定的业绩压力，但是公司经营管理基本面没有出现大的变化，营收利润增长确定性依然很强，经历此轮大幅上涨、快速下跌与横盘震荡之后，估值回到较为合理的水平，长期来看随着业绩不断释放，依然具有较好的预期收益空间，所以报告期内继续持有，持仓股票没有进行大的调整。

本报告期内，本基金通过卖出沪深 300 股指期货合约，避免来回交易费用较高的股票，维持股票实际仓位在合理的水平，降低基金整体的净值波动。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安安享灵活配置混合 A 的基金份额净值 1.3520 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.35%，同期业绩比较基准收益率为 1.53%；截至本报告期末平安安享灵活配置混合 C 的基金份额净值 1.3504 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.29%，同期业绩比较基准收益率为

1.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，大盘股票在过去两年大幅上涨、今年出现一定的调整之后，估值水平已经具有一定的吸引力，加上公司经营基本面良好、长期来看业绩保持增长，所以继续看好未来的收益表现。本基金主要配置沪深两市较大市值、基本面优良的股票，整体呈现估值较低、波动较小的特征，随着中国经济稳步向前发展，依然具有较大的上涨空间，长期来看具有较好的投资价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。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、资本市场风险监控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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

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

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 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，中国建设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合规守信、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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人复核审查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。

## § 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：平安安享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 11,456,377.01                  | 3,031,211.69                     |
| 结算备付金           |            | 1,769,873.74                   | 1,152,880.46                     |
| 存出保证金           |            | 1,688,364.92                   | 31,112.71                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 558,033,863.41                 | 586,055,608.39                   |
| 其中：股票投资         |            | 133,739,317.81                 | 132,482,608.39                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 424,294,545.60                 | 453,573,000.00                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | 22,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | 82,795.93                      | 2,810,193.38                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 4,899,330.32                   | 10,329,655.59                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 132,689.07                     | 202,638.11                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 578,063,294.40                 | 625,613,300.33                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <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     |          | -              | -              |
| 应付证券清算款       |          | -              | 1,962,896.11   |
| 应付赎回款         |          | 6,933,303.83   | 721,210.47     |
| 应付管理人报酬       |          | 250,268.12     | 299,930.25     |
| 应付托管费         |          | 41,711.34      | 49,988.35      |
| 应付销售服务费       |          | 10,144.19      | 16,909.74      |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 27,623.33      | 32,120.90      |
| 应交税费          |          | 4,245,134.00   | 4,267,620.65   |
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 218,285.52     | 189,000.00     |
| 负债合计          |          | 11,726,470.33  | 7,539,676.47   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 419,052,735.05 | 477,132,827.63 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 147,284,089.02 | 140,940,796.23 |
| 所有者权益合计       |          | 566,336,824.07 | 618,073,623.86 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 578,063,294.40 | 625,613,300.33 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 419,052,735.05 份，其中平安安享灵活配置混合 A 基金份额总额 286,137,863.92 份，基金份额净值 1.3520 元。平安安享灵活配置混合 C 基金份额总额 132,914,871.13 份，基金份额净值 1.3504 元。

## 6.2 利润表

会计主体：平安安享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 附注号      | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|-----------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
|                 |          | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| 一、收入            |          | 25,685,761.08                   | 8,309,465.61                    |
| 1. 利息收入         |          | 8,583,089.00                    | 2,873,865.69                    |
| 其中：存款利息收入       | 6.4.7.11 | 62,557.18                       | 14,952.81                       |
| 债券利息收入          |          | 8,503,489.45                    | 2,637,407.40                    |
| 资产支持证券利息收入      |          | -                               | 192,578.64                      |
| 买入返售金融资产收入      |          | 17,042.37                       | 28,926.84                       |
| 证券出借利息收入        |          | -                               | -                               |
| 其他利息收入          |          | -                               | -                               |
| 2. 投资收益（损失以“-”填 |          | 13,616,692.37                   | 8,188,708.61                    |

|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 列)                         |            |               |               |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12   | 16,147,211.34 | 6,628,770.92  |
| 基金投资收益                     | -          | -             | -             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13   | -3,131,957.42 | 582,300.20    |
| 资产支持证券投资收<br>益             | 6.4.7.13.5 | -             | -             |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.14   | -             | -             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.15   | -417,731.43   | -             |
| 股利收益                       | 6.4.7.16   | 1,019,169.88  | 977,637.49    |
| 3. 公允价值变动收益（损失<br>以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 3,418,102.99  | -2,759,206.74 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号<br>填列）     |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号<br>填列）     | 6.4.7.18   | 67,876.72     | 6,098.05      |
| 减：二、费用                     |            | 2,309,021.46  | 1,057,553.20  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,647,128.44  | 749,540.79    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 274,521.38    | 124,923.47    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 62,673.68     | 570.60        |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 176,665.59    | 43,006.83     |
| 5. 利息支出                    |            | -             | 20,000.85     |
| 其中：卖出回购金融资产支<br>出          |            | -             | 20,000.85     |
| 6. 税金及附加                   |            | 29,439.41     | 6,305.72      |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 118,592.96    | 113,204.94    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”<br>号填列）    |            | 23,376,739.62 | 7,251,912.41  |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”<br>号填列）      |            | 23,376,739.62 | 7,251,912.41  |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安安享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                |                |
|-------------------------------|---------------------------------------|----------------|----------------|
|                               | 实收基金                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者<br>权益（基金净值）           | 477,132,827.63                        | 140,940,796.23 | 618,073,623.86 |
| 二、本期经营活<br>动产生的基金净<br>值变动数（本期 | -                                     | 23,376,739.62  | 23,376,739.62  |

|   |  |                |                 |
|---|--|----------------|-----------------|
| 利润)                                     |  |                |                 |
| 三、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)      | -58,080,092.58                             | -17,033,446.83 | -75,113,539.41  |
| 其中: 1. 基金申购款                            | 244,909,579.32                             | 78,623,586.35  | 323,533,165.67  |
| 2. 基金赎回款                                | -302,989,671.90                            | -95,657,033.18 | -398,646,705.08 |
| 四、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) | -  | -              | -               |
| 五、期末所有者权益 (基金净值)                        | 419,052,735.05                             | 147,284,089.02 | 566,336,824.07  |
| 项目                                      | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                 |
|   | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益 (基金净值)                        | 250,481,205.17                             | 28,562,668.60  | 279,043,873.77  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)               | -  | 7,251,912.41   | 7,251,912.41    |
| 三、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)      | -55,306,734.85                             | -6,836,368.98  | -62,143,103.83  |
| 其中: 1. 基金申购款                            | 16,659,561.67                              | 2,146,037.58   | 18,805,599.25   |
| 2. 基金赎回款                                | -71,966,296.52                             | -8,982,406.56  | -80,948,703.08  |
| 四、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) | -  | -              | -               |
| 五、期末所有者权益 (基金净值)                        | 195,174,470.32                             | 28,978,212.03  | 224,152,682.35  |



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：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>罗春风</u> | <u>林婉文</u> | <u>张南南</u> |
| 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

平安安享灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据原平安安享保本混合型证券投资基金(以下简称“平安安享保本混合”)《平安安享保本混合型证券投资基金合同》的约定,由原平安安享保本混合转型而来。原平安安享保本混合为契约型开放式基金,存续期限不定,原平安安享保本混合第一个保本期自 2016 年 2 月 3 日起至 2019 年 2 月 11 日到期,但基金管理人无法为本基金转入下一保本期确定保证人或保本义务人,原平安安享保本混合将不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件,因此基金管理人经与托管人协商一致,自 2019 年 2 月 15 日起,平安安享保本混合更名为平安安享灵活配置混合型证券投资基金,《平安安享灵活配置混合型证券投资基金》于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《平安安享灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行交易的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、央行票据、短期融资券、超级短期融资券、商业银行次级债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、定期存款等银行存款以及法律法规允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%,权证投资比例不高于基金资产净值的 3%,在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基

金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安安享灵活配置混合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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政

策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2021年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 11,456,377.01     |
| 定期存款         | -                 |
| 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         | -                 |
| 合计           | 11,456,377.01     |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021年6月30日 |                |                |
|---------------|-------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 106,425,259.98    | 133,739,317.81 | 27,314,057.83  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场             | 12,306,908.88  | 12,309,545.60  |
|               | 银行间市场             | 411,725,626.18 | 411,985,000.00 |
|               | 合计                | 424,032,535.06 | 424,294,545.60 |
| 资产支持证券        | -                 | -              | -              |
| 基金            | -                 | -              | -              |
| 其他            | -                 | -              | -              |
| 合计            | 530,457,795.04    | 558,033,863.41 | 27,576,068.37  |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2021年6月30日 |      |    | 备注 |
|-----------|-------------------|------|----|----|
|           | 合同/名义<br>金额       | 公允价值 |    |    |
|           |                   | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具    | -                 | -    | -  |    |
| 货币衍生工具    | -                 | -    | -  |    |
| 权益衍生工具    | -13,882,403.08    | -    | -  |    |
| 其中：股指期货投资 | -13,882,403.08    | -    | -  |    |
| 其他衍生工具    | -                 | -    | -  |    |
| 合计        | -13,882,403.08    | -    | -  |    |

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

### 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无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 953.14                 |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 1,176.62               |
| 应收债券利息     | 4,897,191.29           |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 应收出借证券利息   | -                      |
| 其他         | 9.27                   |
| 合计         | 4,899,330.32           |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 24,623.33              |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,000.00               |
| 合计          | 27,623.33              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 25.37                  |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 218,260.15             |
| 合计          | 218,285.52             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安安享灵活配置混合 A

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|                | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |
|----------------|---------------------------------|-----------------|
|                | 基金份额 (份)                        | 账面金额            |
| 上年度末           | 308,631,290.52                  | 308,631,290.52  |
| 本期申购           | 84,156,342.95                   | 84,156,342.95   |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -106,649,769.55                 | -106,649,769.55 |
| -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            | 286,137,863.92                  | 286,137,863.92  |

平安安享灵活配置混合 C

| 项目             | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |
|----------------|---------------------------------------|-----------------|
|                | 基金份额 (份)                              | 账面金额            |
| 上年度末           | 168,501,537.11                        | 168,501,537.11  |
| 本期申购           | 160,753,236.37                        | 160,753,236.37  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -196,339,902.35                       | -196,339,902.35 |
| -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            | 132,914,871.13                        | 132,914,871.13  |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安安享灵活配置混合 A

| 项目                     | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末                   | 75,601,794.96  | 15,661,247.36 | 91,263,042.32  |
| 本期利润                   | 15,468,170.96  | 1,845,523.78  | 17,313,694.74  |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | -7,203,084.45  | -659,071.71   | -7,862,156.16  |
| 其中：基金申<br>购款           | 20,974,138.32  | 5,387,929.70  | 26,362,068.02  |
| 基金赎<br>回款              | -28,177,222.77 | -6,047,001.41 | -34,224,224.18 |
| 本期已分配利<br>润            | -              | -             | -              |
| 本期末                    | 83,866,881.47  | 16,847,699.43 | 100,714,580.90 |

平安安享灵活配置混合 C

| 项目   | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 38,503,329.38 | 11,174,424.53 | 49,677,753.91 |

|                |                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期利润           | 4,490,465.67   | 1,572,579.21   | 6,063,044.88   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,318,678.56  | -2,852,612.11  | -9,171,290.67  |
| 其中：基金申购款       | 40,967,736.97  | 11,293,781.36  | 52,261,518.33  |
| 基金赎回款          | -47,286,415.53 | -14,146,393.47 | -61,432,809.00 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 36,675,116.49  | 9,894,391.63   | 46,569,508.12  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |           |
|-----------|----------------------|-----------|
|           | 2021年1月1日至2021年6月30日 |           |
| 活期存款利息收入  |                      | 42,383.22 |
| 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 |                      | 19,980.02 |
| 其他        |                      | 193.94    |
| 合计        |                      | 62,557.18 |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                   |               |
|------------------|----------------------|---------------|
|                  | 2021年1月1日至2021年6月30日 |               |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 |                      | 16,147,211.34 |
| 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               |                      | 16,147,211.34 |

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |               |
|------------|----------------------|---------------|
|            | 2021年1月1日至2021年6月30日 |               |
| 卖出股票成交总额   |                      | 61,884,001.16 |
| 减：卖出股票成本总额 |                      | 45,736,789.82 |
| 买卖股票差价收入   |                      | 16,147,211.34 |

### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于股票投资产生的证券出借差价收入。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -3,131,957.42              |
| 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                            | -3,131,957.42              |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 536,652,367.69             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 524,405,832.77             |
| 减：应收利息总额                | 15,378,492.34              |
| 买卖债券差价收入                | -3,131,957.42              |

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。



#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 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。

##### 6.4.7.14.2 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。

##### 6.4.7.14.3 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。

##### 6.4.7.14.4 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。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 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。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目       | 本期收益金额<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------|--------------------------------|
| 股指期货投资收益 | -417,731.43                    |

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,019,169.88               |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                          |
| 基金投资产生的股利收益   | -                          |
| 合计            | 1,019,169.88               |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------|----------------------------|
|------|----------------------------|

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| 1. 交易性金融资产             | 3,414,239.91 |
| 股票投资                   | 2,299,342.95 |
| 债券投资                   | 1,114,896.96 |
| 资产支持证券投资               | -            |
| 基金投资                   | -            |
| 贵金属投资                  | -            |
| 其他                     | -            |
| 2. 衍生工具                | 3,863.08     |
| 权证投资                   | -            |
| 期货投资                   | 3,863.08     |
| 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                     | 3,418,102.99 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 67,863.29                  |
| 基金转换费收入 | 13.43                      |
| 合计      | 67,876.72                  |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 170,990.59                 |
| 银行间市场交易费用 | 5,675.00                   |
| 合计        | 176,665.59                 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 29,752.78                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行费用    | 10,732.81                  |
| 账户维护费   | 18,000.00                  |
| 其他      | 600.00                     |
| 合计      | 118,592.96                 |

#### 6.4.7.21 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

截至本财务报表批准报出日，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         |
| 建设银行                     | 基金托管人、基金销售机构                |
| 平安信托有限责任公司               | 基金管理人的股东                    |
| 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                    |
| 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                   |
| 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               |
| 平安证券股份有限公司(“平安证券”)       | 基金管理人的股东的子公司、基金销售机构         |
| 平安银行股份有限公司(“平安银行”)       | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构 |
| 上海陆金所基金销售有限公司(“陆金所”)     | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构 |
| 中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)   | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构 |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                     |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|---------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例(%) |
| 平安证券  | 11,736,679.06              | 12.44                   | -                               | -                   |

### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                           | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                           |
|-------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 平安证券  | 20,000,000.00              | 36.04                     | -                               | -                         |

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日      |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 平安证券  | 10,930.17                       | 15.69              | -            | -                    |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 平安证券  | -                               | -                  | -            | -                    |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 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               | 上年度可比期间         |
|----|------------------|-----------------|
|    | 2021年1月1日至2021年6 | 2020年1月1日至2020年 |

|                 | 月 30 日       | 6 月 30 日   |
|-----------------|--------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,647,128.44 | 749,540.79 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 149,281.94   | 122,511.84 |

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 274,521.38                      | 124,923.47                      |

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |                 |           |
|----------------|---------------------------------|-----------------|-----------|
|                | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                 |           |
|                | 平安安享灵活配置混合<br>A                 | 平安安享灵活配置混合<br>C | 合计        |
| 陆金所            | -                               | 4,475.07        | 4,475.07  |
| 平安基金           | -                               | 16,466.80       | 16,466.80 |
| 平安人寿           | -                               | 5,819.52        | 5,819.52  |
| 平安证券           | -                               | 33.19           | 33.19     |
| 合计             | -                               | 26,794.58       | 26,794.58 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |                 |           |
|                | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                 |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                 |           |
|                | 平安安享灵活配置混合<br>A                 | 平安安享灵活配置混合<br>C | 合计        |
| 平安基金           | -                               | 438.61          | 438.61    |

|      |   |        |        |
|------|---|--------|--------|
| 平安证券 | - | 92.99  | 92.99  |
| 合计   | - | 531.60 | 531.60 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：无。

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

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>2021年1月1日至2021年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020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    |
| 建设银行-活期 | 11,456,377.01              | 42,383.22 | 2,100,057.14                    | 11,409.65 |

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |        |      |      |              |          |
|--|--------|------|------|--------------|----------|
| 关联方名称                                      | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入    |          |
|  |        |      |      | 数量（单位：<br>张） | 总金额      |
| 平安证券股份有<br>限公司                             | 605011 | 杭州热电 | 公开发行 | 525          | 3,239.25 |
| 平安证券股份有<br>限公司                             | 605162 | 新中港  | 公开发行 | 1,377        | 8,358.39 |
| 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |        |      |      |              |          |
| 关联方名称                                      | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入    |          |
|  |        |      |      | 数量（单位：<br>张） | 总金额      |
| -  | -      | -    | -    | -            | -        |

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2021 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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                  |                  |        |       |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|------------------|------------------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日            | 可流通日             | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 300614               | 百川畅银 | 2021 年 5 月 18 日  | 2021 年 11 月 25 日 | 新股锁定   | 9.19  | 40.38  | 329      | 3,023.51  | 13,285.02 | -  |
| 300919               | 中伟股份 | 2020 年 12 月 15 日 | 2021 年 07 月 02 日 | 新股锁定   | 24.60 | 163.00 | 610      | 15,006.00 | 99,430.00 | -  |
| 300926               | 博俊科技 | 2020 年 12 月 29 日 | 2021 年 07 月 12 日 | 新股锁定   | 10.76 | 22.20  | 359      | 3,862.84  | 7,969.80  | -  |
| 300931               | 通用电梯 | 2021 年 1 月 13 日  | 2021 年 7 月 21 日  | 新股锁定   | 4.31  | 13.11  | 672      | 2,896.32  | 8,809.92  | -  |

|        |      |            |             |      |       |        |       |           |            |   |
|--------|------|------------|-------------|------|-------|--------|-------|-----------|------------|---|
| 300933 | 中辰股份 | 2021年1月15日 | 2021年7月22日  | 新股锁定 | 3.37  | 10.44  | 1,112 | 3,747.44  | 11,609.28  | - |
| 300937 | 药易购  | 2021年1月20日 | 2021年7月27日  | 新股锁定 | 12.25 | 53.71  | 244   | 2,989.00  | 13,105.24  | - |
| 300940 | 南极光  | 2021年1月27日 | 2021年8月3日   | 新股锁定 | 12.76 | 43.38  | 307   | 3,917.32  | 13,317.66  | - |
| 300945 | 曼卡龙  | 2021年2月3日  | 2021年8月10日  | 新股锁定 | 4.56  | 18.88  | 474   | 2,161.44  | 8,949.12   | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021年2月18日 | 2021年8月25日  | 新股锁定 | 13.00 | 27.42  | 324   | 2,808.00  | 8,884.08   | - |
| 300950 | 德固特  | 2021年2月24日 | 2021年9月3日   | 新股锁定 | 8.41  | 39.13  | 219   | 1,841.79  | 8,569.47   | - |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021年3月16日 | 2021年9月24日  | 新股锁定 | 16.53 | 46.07  | 232   | 3,834.96  | 10,688.24  | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021年3月16日 | 2021年9月27日  | 新股锁定 | 12.85 | 25.80  | 371   | 4,767.35  | 9,571.80   | - |
| 300957 | 贝泰妮  | 2021年3月18日 | 2021年9月27日  | 新股锁定 | 47.33 | 251.96 | 450   | 21,298.50 | 113,382.00 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021年3月22日 | 2021年9月29日  | 新股锁定 | 12.08 | 23.06  | 234   | 2,826.72  | 5,396.04   | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021年3月23日 | 2021年9月30日  | 新股锁定 | 8.48  | 22.07  | 394   | 3,341.12  | 8,695.58   | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021年3月29日 | 2021年10月11日 | 新股锁定 | 3.40  | 16.37  | 576   | 1,958.40  | 9,429.12   | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021年3月31日 | 2021年10月11日 | 新股锁定 | 8.24  | 31.54  | 286   | 2,356.64  | 9,020.44   | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021年4月2日  | 2021年10月13日 | 新股锁定 | 4.54  | 11.54  | 507   | 2,301.78  | 5,850.78   | - |



|        |      |            |             |      |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|------------|-------------|------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      |            | 日           |      |       |        |       |           |           |   |
| 300968 | 格林精密 | 2021年4月6日  | 2021年10月15日 | 新股锁定 | 6.87  | 12.07  | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021年4月7日  | 2021年10月15日 | 新股锁定 | 18.24 | 28.29  | 245   | 4,468.80  | 6,931.05  | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021年4月8日  | 2021年10月15日 | 新股锁定 | 28.28 | 115.71 | 360   | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021年4月14日 | 2021年10月21日 | 新股锁定 | 5.48  | 13.03  | 492   | 2,696.16  | 6,410.76  | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股锁定 | 8.42  | 13.60  | 593   | 4,993.06  | 8,064.80  | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股锁定 | 33.22 | 87.50  | 726   | 24,117.72 | 63,525.00 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 新股锁定 | 48.59 | 90.39  | 459   | 22,302.81 | 41,489.01 | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 新股锁定 | 15.83 | 45.29  | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021年4月21日 | 2021年11月1日  | 新股锁定 | 14.79 | 30.57  | 264   | 3,904.56  | 8,070.48  | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021年4月28日 | 2021年11月11日 | 新股锁定 | 6.79  | 26.81  | 301   | 2,043.79  | 8,069.81  | - |
| 300991 | 创益通  | 2021年5月12日 | 2021年11月22日 | 新股锁定 | 13.06 | 26.51  | 254   | 3,317.24  | 6,733.54  | - |

|        |      |            |             |      |       |       |     |           |           |   |
|--------|------|------------|-------------|------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021年5月17日 | 2021年11月24日 | 新股锁定 | 12.10 | 19.29 | 410 | 4,961.00  | 7,908.90  | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年5月17日 | 2021年11月26日 | 新股锁定 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52  | 4,454.12  | - |
| 300997 | 欢乐家  | 2021年5月26日 | 2021年12月2日  | 新股锁定 | 4.94  | 13.05 | 928 | 4,584.32  | 12,110.40 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021年5月25日 | 2021年12月2日  | 新股锁定 | 6.02  | 21.32 | 201 | 1,210.02  | 4,285.32  | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021年5月27日 | 2021年12月7日  | 新股锁定 | 18.71 | 57.62 | 201 | 3,760.71  | 11,581.62 | - |
| 301007 | 德迈仕  | 2021年6月4日  | 2021年12月16日 | 新股锁定 | 5.29  | 14.44 | 303 | 1,602.87  | 4,375.32  | - |
| 301009 | 可靠股份 | 2021年6月8日  | 2021年12月17日 | 新股锁定 | 12.54 | 27.89 | 801 | 10,044.54 | 22,339.89 | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021年6月9日  | 2021年12月20日 | 新股锁定 | 7.83  | 17.61 | 218 | 1,706.94  | 3,838.98  | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021年6月9日  | 2021年12月17日 | 新股锁定 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00  | 5,922.00  | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021年6月15日 | 2021年12月22日 | 新股锁定 | 8.05  | 24.26 | 170 | 1,368.50  | 4,124.20  | - |
| 301013 | 利和兴  | 2021年6月21日 | 2021年12月29日 | 新股锁定 | 8.72  | 27.11 | 471 | 4,107.12  | 12,768.81 | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021年6月22日 | 2021年12月30日 | 新股锁定 | 7.64  | 38.83 | 462 | 3,529.68  | 17,939.46 | - |

|        |      |            |             |       |       |        |         |              |              |   |
|--------|------|------------|-------------|-------|-------|--------|---------|--------------|--------------|---|
|        |      |            | 日           |       |       |        |         |              |              |   |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021年6月23日 | 2021年12月30日 | 新股锁定  | 13.75 | 32.98  | 275     | 3,781.25     | 9,069.50     | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021年6月28日 | 2021年7月7日   | 新股未上市 | 8.29  | 8.29   | 7,029   | 58,270.41    | 58,270.41    | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021年6月28日 | 2022年1月7日   | 新股锁定  | 8.29  | 8.29   | 782     | 6,482.78     | 6,482.78     | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日   | 新股未上市 | 10.64 | 10.64  | 3,789   | 40,314.96    | 40,314.96    | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年6月28日 | 2022年1月6日   | 新股锁定  | 10.64 | 10.64  | 421     | 4,479.44     | 4,479.44     | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日   | 新股未上市 | 9.46  | 9.46   | 2,609   | 24,681.14    | 24,681.14    | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年6月28日 | 2022年1月6日   | 新股锁定  | 9.46  | 9.46   | 290     | 2,743.40     | 2,743.40     | - |
| 600905 | 三峡能源 | 2021年6月2日  | 2021年12月10日 | 新股锁定  | 2.65  | 5.67   | 907,763 | 2,405,571.95 | 5,147,016.21 | - |
| 605162 | 新中港  | 2021年6月29日 | 2021年7月7日   | 新股未上市 | 6.07  | 6.07   | 1,377   | 8,358.39     | 8,358.39     | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日   | 新股未上市 | 31.56 | 31.56  | 349     | 11,014.44    | 11,014.44    | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021年6月30日 | 2021年7月9日   | 新股未上市 | 21.96 | 21.96  | 2,469   | 54,219.24    | 54,219.24    | - |
| 688117 | 圣诺生物 | 2021年5月26日 | 2021年12月3日  | 新股锁定  | 17.90 | 35.97  | 1,672   | 29,928.80    | 60,141.84    | - |
| 688131 | 皓元医药 | 2021年6月1日  | 2021年12月8日  | 新股锁定  | 64.99 | 247.10 | 1,955   | 127,055.45   | 483,080.50   | - |
| 688217 | 睿昂基因 | 2021年5月    | 2021年11     | 新股锁定  | 18.42 | 58.40  | 1,040   | 19,156.80    | 60,736.00    | - |

|        |      |            |             |       |       |        |       |           |            |   |
|--------|------|------------|-------------|-------|-------|--------|-------|-----------|------------|---|
|        |      | 7日         | 月17日        |       |       |        |       |           |            |   |
| 688226 | 威腾电气 | 2021年6月28日 | 2021年7月7日   | 新股未上市 | 6.42  | 6.42   | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06  | - |
| 688239 | 航宇科技 | 2021年6月25日 | 2021年7月5日   | 新股未上市 | 11.48 | 11.48  | 4,926 | 56,550.48 | 56,550.48  | - |
| 688315 | 诺禾致源 | 2021年4月2日  | 2021年10月13日 | 新股锁定  | 12.76 | 39.20  | 3,711 | 47,352.36 | 145,471.20 | - |
| 688319 | 欧林生物 | 2021年5月31日 | 2021年12月8日  | 新股锁定  | 9.88  | 27.34  | 3,412 | 33,710.56 | 93,284.08  | - |
| 688323 | 瑞华泰  | 2021年4月21日 | 2021年10月28日 | 新股锁定  | 5.97  | 22.78  | 4,513 | 26,942.61 | 102,806.14 | - |
| 688350 | 富淼科技 | 2021年1月21日 | 2021年7月28日  | 新股锁定  | 13.58 | 22.44  | 2,552 | 34,656.16 | 57,266.88  | - |
| 688499 | 利元亨  | 2021年6月23日 | 2021年7月1日   | 新股未上市 | 38.85 | 38.85  | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65  | - |
| 688601 | 力芯微  | 2021年6月18日 | 2021年12月28日 | 新股锁定  | 36.48 | 133.69 | 1,174 | 42,827.52 | 156,952.06 | - |
| 688616 | 西力科技 | 2021年3月10日 | 2021年9月22日  | 新股锁定  | 7.35  | 13.78  | 3,918 | 28,797.30 | 53,990.04  | - |
| 688677 | 海泰新光 | 2021年2月18日 | 2021年8月26日  | 新股锁定  | 35.76 | 103.23 | 1,768 | 63,223.68 | 182,510.64 | - |

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 证券代码   | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日      | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量<br>(单位:张) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
|--------|------|------------|-----------|--------|--------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 113050 | 南银转债 | 2021年6月17日 | 2021年7月1日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 1,340        | 133,998.24 | 133,998.24 | -  |
| 123117 | 健帆转债 | 2021年6月    | 2021年7月   | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 47           | 4,700.00   | 4,700.00   | -  |

|        |      |                 |                 |       |        |        |    |          |          |   |
|--------|------|-----------------|-----------------|-------|--------|--------|----|----------|----------|---|
|        |      | 23 日            | 12 日            |       |        |        |    |          |          |   |
| 127038 | 国微转债 | 2021 年 6 月 10 日 | 2021 年 7 月 14 日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 30 | 3,000.00 | 3,000.00 | - |

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 71.00%（上年末：66.91%）。

#### 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发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过由风险管理人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>2021年6月30日   | 1年以内                  | 1-5年                 | 5年以上          | 不计息                    | 合计                    |
|---------------------|-----------------------|----------------------|---------------|------------------------|-----------------------|
| <b>资产</b>           |                       |                      |               |                        |                       |
| 银行存款                | 11,456,377.01         | -                    | -             | -                      | 11,456,377.01         |
| 结算备付金               | 1,769,873.74          | -                    | -             | -                      | 1,769,873.74          |
| 存出保证金               | 22,940.12             | -                    | -             | 1,665,424.80           | 1,688,364.92          |
| 交易性金融资产             | 404,062,545.60        | 20,232,000.00        | -             | 133,739,317.81         | 558,033,863.41        |
| 应收利息                | -                     | -                    | -             | 4,899,330.32           | 4,899,330.32          |
| 应收申购款               | -                     | -                    | -             | 132,689.07             | 132,689.07            |
| 应收证券清算款             | -                     | -                    | -             | 82,795.93              | 82,795.93             |
| <b>资产总计</b>         | <b>417,311,736.47</b> | <b>20,232,000.00</b> | <b>-</b>      | <b>140,519,557.93</b>  | <b>578,063,294.40</b> |
| <b>负债</b>           |                       |                      |               |                        |                       |
| 应付赎回款               | -                     | -                    | -             | 6,933,303.83           | 6,933,303.83          |
| 应付管理人报酬             | -                     | -                    | -             | 250,268.12             | 250,268.12            |
| 应付托管费               | -                     | -                    | -             | 41,711.34              | 41,711.34             |
| 应付销售服务费             | -                     | -                    | -             | 10,144.19              | 10,144.19             |
| 应付交易费用              | -                     | -                    | -             | 27,623.33              | 27,623.33             |
| 应交税费                | -                     | -                    | -             | 4,245,134.00           | 4,245,134.00          |
| 其他负债                | -                     | -                    | -             | 218,285.52             | 218,285.52            |
| <b>负债总计</b>         | <b>-</b>              | <b>-</b>             | <b>-</b>      | <b>11,726,470.33</b>   | <b>11,726,470.33</b>  |
| <b>利率敏感度缺口</b>      | <b>417,311,736.47</b> | <b>20,232,000.00</b> | <b>-</b>      | <b>-128,793,087.60</b> | <b>566,336,824.07</b> |
| 上年度末<br>2020年12月31日 | 1年以内                  | 1-5年                 | 5年以上          | 不计息                    | 合计                    |
| <b>资产</b>           |                       |                      |               |                        |                       |
| 银行存款                | 3,031,211.69          | -                    | -             | -                      | 3,031,211.69          |
| 结算备付金               | 1,152,880.46          | -                    | -             | -                      | 1,152,880.46          |
| 存出保证金               | 31,112.71             | -                    | -             | -                      | 31,112.71             |
| 交易性金融资产             | 393,325,000.00        | 40,156,000.00        | 20,092,000.00 | 132,482,608.39         | 586,055,608.39        |
| 买入返售金融资产            | 22,000,000.00         | -                    | -             | -                      | 22,000,000.00         |
| 应收利息                | -                     | -                    | -             | 10,329,655.59          | 10,329,655.59         |
| 应收申购款               | -                     | -                    | -             | 202,638.11             | 202,638.11            |
| 应收证券清算款             | -                     | -                    | -             | 2,810,193.38           | 2,810,193.38          |



|         |                |               |               |                |                |
|---------|----------------|---------------|---------------|----------------|----------------|
| 资产总计    | 419,540,204.86 | 40,156,000.00 | 20,092,000.00 | 145,825,095.47 | 625,613,300.33 |
| 负债      |                |               |               |                |                |
| 应付赎回款   | -              | -             | -             | 721,210.47     | 721,210.47     |
| 应付管理人报酬 | -              | -             | -             | 299,930.25     | 299,930.25     |
| 应付托管费   | -              | -             | -             | 49,988.35      | 49,988.35      |
| 应付证券清算款 | -              | -             | -             | 1,962,896.11   | 1,962,896.11   |
| 应付销售服务费 | -              | -             | -             | 16,909.74      | 16,909.74      |
| 应付交易费用  | -              | -             | -             | 32,120.90      | 32,120.90      |
| 应交税费    | -              | -             | -             | 4,267,620.65   | 4,267,620.65   |
| 其他负债    | -              | -             | -             | 189,000.00     | 189,000.00     |
| 负债总计    | -              | -             | -             | 7,539,676.47   | 7,539,676.47   |
| 利率敏感度缺口 | 419,540,204.86 | 40,156,000.00 | 20,092,000.00 | 138,285,419.00 | 618,073,623.86 |

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 |                             |                   |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
|    | 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（2021年6月30日）             | 上年度末（2020年12月31日） |
| 分析 | 市场利率下降 25 个基点      | 327,436.35                  | 504,344.41        |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -325,241.24                 | -501,295.84       |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 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>2021年6月30日 |               | 上年度末<br>2020年12月31日 |               |
|---------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 133,739,317.81    | 23.61         | 132,482,608.39      | 21.43         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                 | -             | -                   | -             |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                 | -             | -                   | -             |
| 其他            | -                 | -             | -                   | -             |
| 合计            | 133,739,317.81    | 23.61         | 132,482,608.39      | 21.43         |

#### 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（2021年6月30日）             | 上年度末（2020年12月31日） |
| 分析 | 沪深 300 指数上升 5%            | 7,006,913.61                | 7,372,028.02      |
|    | 沪深 300 指数下降 5%            | -7,006,913.61               | -7,372,028.02     |

### 6.4.14 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              | 133,739,317.81 | 23.14         |
|    | 其中：股票             | 133,739,317.81 | 23.14         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 424,294,545.60 | 73.40         |
|    | 其中：债券             | 424,294,545.60 | 73.40         |
|    | 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      | 13,226,250.75  | 2.29          |
| 8  | 其他各项资产            | 6,803,180.24   | 1.18          |
| 9  | 合计                | 578,063,294.40 | 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         | 891,389.98    | 0.16          |
| B  | 采矿业              | 1,433,356.00  | 0.25          |
| C  | 制造业              | 76,043,160.77 | 13.43         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,160,036.60  | 0.91          |
| E  | 建筑业              | 1,583,796.37  | 0.28          |
| F  | 批发和零售业           | 563,186.00    | 0.10          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,496,378.00  | 0.26          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,688,575.21  | 0.47          |
| J  | 金融业              | 29,459,214.19 | 5.20          |
| K  | 房地产业             | 3,320,436.00  | 0.59          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,240,830.00  | 0.57          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 3,816,602.67  | 0.67          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 30,864.68     | 0.01          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -             |
| P  | 教育               | 169,209.00    | 0.03          |

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作   | 3,554,162.34   | 0.63  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 288,120.00     | 0.05  |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 133,739,317.81 | 23.61 |

### 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  | 600519 | 贵州茅台 | 4,600   | 9,460,820.00 | 1.67         |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 114,000 | 6,177,660.00 | 1.09         |
| 3  | 600905 | 三峡能源 | 907,763 | 5,147,016.21 | 0.91         |
| 4  | 000858 | 五粮液  | 16,500  | 4,915,185.00 | 0.87         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 175,600 | 3,608,580.00 | 0.64         |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 48,759  | 3,479,929.83 | 0.61         |
| 7  | 002142 | 宁波银行 | 82,200  | 3,203,334.00 | 0.57         |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药 | 43,440  | 2,952,616.80 | 0.52         |
| 9  | 002475 | 立讯精密 | 63,800  | 2,934,800.00 | 0.52         |
| 10 | 601888 | 中国中免 | 9,200   | 2,760,920.00 | 0.49         |
| 11 | 601601 | 中国太保 | 82,837  | 2,399,787.89 | 0.42         |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 95,300  | 2,376,782.00 | 0.42         |
| 13 | 601012 | 隆基股份 | 26,740  | 2,375,581.60 | 0.42         |
| 14 | 000651 | 格力电器 | 45,400  | 2,365,340.00 | 0.42         |
| 15 | 300015 | 爱尔眼科 | 32,933  | 2,337,584.34 | 0.41         |
| 16 | 002415 | 海康威视 | 35,000  | 2,257,500.00 | 0.40         |
| 17 | 000568 | 泸州老窖 | 8,910   | 2,102,225.40 | 0.37         |
| 18 | 300760 | 迈瑞医疗 | 4,300   | 2,064,215.00 | 0.36         |
| 19 | 603259 | 药明康德 | 12,883  | 2,017,348.97 | 0.36         |
| 20 | 000002 | 万科A  | 83,100  | 1,978,611.00 | 0.35         |
| 21 | 600887 | 伊利股份 | 45,683  | 1,682,504.89 | 0.30         |
| 22 | 002594 | 比亚迪  | 6,500   | 1,631,500.00 | 0.29         |
| 23 | 601336 | 新华保险 | 34,800  | 1,597,668.00 | 0.28         |
| 24 | 300124 | 汇川技术 | 21,150  | 1,570,599.00 | 0.28         |
| 25 | 600031 | 三一重工 | 52,400  | 1,523,268.00 | 0.27         |
| 26 | 600309 | 万华化学 | 13,700  | 1,490,834.00 | 0.26         |
| 27 | 300750 | 宁德时代 | 2,700   | 1,443,960.00 | 0.25         |
| 28 | 300014 | 亿纬锂能 | 12,400  | 1,288,732.00 | 0.23         |
| 29 | 000776 | 广发证券 | 81,600  | 1,235,424.00 | 0.22         |
| 30 | 601688 | 华泰证券 | 74,400  | 1,175,520.00 | 0.21         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 31 | 002352 | 顺丰控股 | 16,700  | 1,130,590.00 | 0.20 |
| 32 | 000661 | 长春高新 | 2,900   | 1,122,300.00 | 0.20 |
| 33 | 601668 | 中国建筑 | 238,900 | 1,110,885.00 | 0.20 |
| 34 | 601818 | 光大银行 | 289,200 | 1,093,176.00 | 0.19 |
| 35 | 600926 | 杭州银行 | 73,100  | 1,078,225.00 | 0.19 |
| 36 | 601628 | 中国人寿 | 31,000  | 1,050,590.00 | 0.19 |
| 37 | 601009 | 南京银行 | 97,800  | 1,028,856.00 | 0.18 |
| 38 | 300347 | 泰格医药 | 4,900   | 947,170.00   | 0.17 |
| 39 | 600585 | 海螺水泥 | 22,678  | 930,931.90   | 0.16 |
| 40 | 600048 | 保利地产 | 74,200  | 893,368.00   | 0.16 |
| 41 | 002714 | 牧原股份 | 14,560  | 885,539.20   | 0.16 |
| 42 | 600690 | 海尔智家 | 31,200  | 808,392.00   | 0.14 |
| 43 | 000338 | 潍柴动力 | 43,600  | 779,132.00   | 0.14 |
| 44 | 000625 | 长安汽车 | 29,500  | 775,260.00   | 0.14 |
| 45 | 603288 | 海天味业 | 5,818   | 750,231.10   | 0.13 |
| 46 | 600837 | 海通证券 | 64,200  | 738,300.00   | 0.13 |
| 47 | 300408 | 三环集团 | 17,400  | 738,108.00   | 0.13 |
| 48 | 300059 | 东方财富 | 22,080  | 724,003.20   | 0.13 |
| 49 | 300122 | 智飞生物 | 3,800   | 709,574.00   | 0.13 |
| 50 | 002271 | 东方雨虹 | 12,800  | 708,096.00   | 0.13 |
| 51 | 601088 | 中国神华 | 34,800  | 679,296.00   | 0.12 |
| 52 | 002311 | 海大集团 | 8,300   | 677,280.00   | 0.12 |
| 53 | 601211 | 国泰君安 | 35,600  | 610,184.00   | 0.11 |
| 54 | 002007 | 华兰生物 | 15,600  | 572,208.00   | 0.10 |
| 55 | 688608 | 恒玄科技 | 1,741   | 551,740.31   | 0.10 |
| 56 | 600104 | 上汽集团 | 24,700  | 542,659.00   | 0.10 |
| 57 | 002410 | 广联达  | 7,300   | 497,860.00   | 0.09 |
| 58 | 600436 | 片仔癀  | 1,100   | 493,130.00   | 0.09 |
| 59 | 688131 | 皓元医药 | 1,955   | 483,080.50   | 0.09 |
| 60 | 002027 | 分众传媒 | 51,000  | 479,910.00   | 0.08 |
| 61 | 600570 | 恒生电子 | 5,100   | 475,575.00   | 0.08 |
| 62 | 000157 | 中联重科 | 47,500  | 438,900.00   | 0.08 |
| 63 | 002304 | 洋河股份 | 2,100   | 435,120.00   | 0.08 |
| 64 | 300759 | 康龙化成 | 2,000   | 433,980.00   | 0.08 |
| 65 | 002557 | 洽洽食品 | 10,000  | 431,000.00   | 0.08 |
| 66 | 000932 | 华菱钢铁 | 65,100  | 429,660.00   | 0.08 |
| 67 | 600745 | 闻泰科技 | 4,200   | 406,980.00   | 0.07 |
| 68 | 300628 | 亿联网络 | 4,800   | 402,240.00   | 0.07 |
| 69 | 603986 | 兆易创新 | 2,100   | 394,590.00   | 0.07 |
| 70 | 000708 | 中信特钢 | 18,200  | 379,288.00   | 0.07 |
| 71 | 000166 | 申万宏源 | 79,500  | 372,060.00   | 0.07 |
| 72 | 002353 | 杰瑞股份 | 8,300   | 371,010.00   | 0.07 |

|     |        |        |        |            |      |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 73  | 600009 | 上海机场   | 7,600  | 365,788.00 | 0.06 |
| 74  | 002736 | 国信证券   | 33,800 | 363,350.00 | 0.06 |
| 75  | 000703 | 恒逸石化   | 30,100 | 359,695.00 | 0.06 |
| 76  | 000783 | 长江证券   | 49,000 | 358,680.00 | 0.06 |
| 77  | 000786 | 北新建材   | 8,900  | 349,325.00 | 0.06 |
| 78  | 603899 | 晨光文具   | 4,000  | 338,240.00 | 0.06 |
| 79  | 002690 | 美亚光电   | 6,000  | 334,560.00 | 0.06 |
| 80  | 002241 | 歌尔股份   | 7,800  | 333,372.00 | 0.06 |
| 81  | 600588 | 用友网络   | 10,000 | 332,600.00 | 0.06 |
| 82  | 300529 | 健帆生物   | 3,800  | 328,168.00 | 0.06 |
| 83  | 688161 | 威高骨科   | 3,069  | 325,467.45 | 0.06 |
| 84  | 002128 | 露天煤业   | 30,400 | 316,464.00 | 0.06 |
| 85  | 000596 | 古井贡酒   | 1,300  | 311,350.00 | 0.05 |
| 86  | 002511 | 中顺洁柔   | 11,300 | 311,315.00 | 0.05 |
| 87  | 002459 | 晶澳科技   | 6,300  | 308,700.00 | 0.05 |
| 88  | 600050 | 中国联通   | 71,000 | 306,720.00 | 0.05 |
| 89  | 000725 | 京东方 A  | 48,800 | 304,512.00 | 0.05 |
| 90  | 002812 | 恩捷股份   | 1,300  | 304,330.00 | 0.05 |
| 91  | 002677 | 浙江美大   | 16,300 | 297,964.00 | 0.05 |
| 92  | 300012 | 华测检测   | 9,300  | 296,484.00 | 0.05 |
| 93  | 000528 | 柳工     | 36,060 | 295,692.00 | 0.05 |
| 94  | 300207 | 欣旺达    | 9,000  | 293,040.00 | 0.05 |
| 95  | 000100 | TCL 科技 | 38,200 | 292,230.00 | 0.05 |
| 96  | 300413 | 芒果超媒   | 4,200  | 288,120.00 | 0.05 |
| 97  | 300454 | 深信服    | 1,100  | 285,428.00 | 0.05 |
| 98  | 002078 | 太阳纸业   | 21,200 | 283,020.00 | 0.05 |
| 99  | 600660 | 福耀玻璃   | 5,000  | 279,250.00 | 0.05 |
| 100 | 002001 | 新和成    | 9,420  | 270,165.60 | 0.05 |
| 101 | 600741 | 华域汽车   | 10,200 | 267,954.00 | 0.05 |
| 102 | 300433 | 蓝思科技   | 9,100  | 267,631.00 | 0.05 |
| 103 | 300558 | 贝达药业   | 2,400  | 259,776.00 | 0.05 |
| 104 | 002601 | 龙佰集团   | 7,500  | 259,350.00 | 0.05 |
| 105 | 601225 | 陕西煤业   | 21,600 | 255,960.00 | 0.05 |
| 106 | 601117 | 中国化学   | 29,000 | 254,040.00 | 0.04 |
| 107 | 688169 | 石头科技   | 200    | 252,200.00 | 0.04 |
| 108 | 301015 | 百洋医药   | 4,614  | 251,115.78 | 0.04 |
| 109 | 002050 | 三花智控   | 10,000 | 239,800.00 | 0.04 |
| 110 | 002949 | 华阳国际   | 14,100 | 238,290.00 | 0.04 |
| 111 | 002648 | 卫星石化   | 6,020  | 235,923.80 | 0.04 |
| 112 | 001979 | 招商蛇口   | 21,500 | 235,425.00 | 0.04 |
| 113 | 688036 | 传音控股   | 1,100  | 230,450.00 | 0.04 |
| 114 | 002032 | 苏泊尔    | 3,600  | 229,644.00 | 0.04 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 115 | 000895 | 双汇发展 | 7,000  | 222,600.00 | 0.04 |
| 116 | 300450 | 先导智能 | 3,680  | 221,315.20 | 0.04 |
| 117 | 600885 | 宏发股份 | 3,500  | 219,450.00 | 0.04 |
| 118 | 002508 | 老板电器 | 4,700  | 218,550.00 | 0.04 |
| 119 | 300136 | 信维通信 | 6,900  | 213,072.00 | 0.04 |
| 120 | 001914 | 招商积余 | 12,400 | 213,032.00 | 0.04 |
| 121 | 000876 | 新希望  | 14,500 | 212,715.00 | 0.04 |
| 122 | 000063 | 中兴通讯 | 6,400  | 212,672.00 | 0.04 |
| 123 | 002938 | 鹏鼎控股 | 5,800  | 208,104.00 | 0.04 |
| 124 | 600763 | 通策医疗 | 500    | 205,500.00 | 0.04 |
| 125 | 601799 | 星宇股份 | 900    | 203,148.00 | 0.04 |
| 126 | 300285 | 国瓷材料 | 4,000  | 195,000.00 | 0.03 |
| 127 | 002371 | 北方华创 | 700    | 194,166.00 | 0.03 |
| 128 | 601669 | 中国电建 | 50,000 | 193,500.00 | 0.03 |
| 129 | 603501 | 韦尔股份 | 600    | 193,200.00 | 0.03 |
| 130 | 300502 | 新易盛  | 6,161  | 192,531.25 | 0.03 |
| 131 | 688396 | 华润微  | 2,100  | 191,142.00 | 0.03 |
| 132 | 002555 | 三七互娱 | 7,800  | 187,356.00 | 0.03 |
| 133 | 002049 | 紫光国微 | 1,200  | 185,028.00 | 0.03 |
| 134 | 688677 | 海泰新光 | 1,768  | 182,510.64 | 0.03 |
| 135 | 600406 | 国电南瑞 | 7,800  | 181,272.00 | 0.03 |
| 136 | 002709 | 天赐材料 | 1,670  | 177,988.60 | 0.03 |
| 137 | 002439 | 启明星辰 | 6,100  | 176,961.00 | 0.03 |
| 138 | 600563 | 法拉电子 | 1,100  | 174,196.00 | 0.03 |
| 139 | 002372 | 伟星新材 | 8,300  | 171,561.00 | 0.03 |
| 140 | 688345 | 博力威  | 2,332  | 171,518.60 | 0.03 |
| 141 | 002607 | 中公教育 | 8,100  | 169,209.00 | 0.03 |
| 142 | 603939 | 益丰药房 | 2,990  | 167,709.10 | 0.03 |
| 143 | 688667 | 菱电电控 | 1,500  | 165,015.00 | 0.03 |
| 144 | 300115 | 长盈精密 | 7,920  | 163,152.00 | 0.03 |
| 145 | 688601 | 力芯微  | 1,174  | 156,952.06 | 0.03 |
| 146 | 002138 | 顺络电子 | 4,000  | 155,080.00 | 0.03 |
| 147 | 002821 | 凯莱英  | 400    | 149,040.00 | 0.03 |
| 148 | 688315 | 诺禾致源 | 3,711  | 145,471.20 | 0.03 |
| 149 | 300496 | 中科创达 | 900    | 141,354.00 | 0.02 |
| 150 | 688002 | 睿创微纳 | 1,300  | 129,779.00 | 0.02 |
| 151 | 600183 | 生益科技 | 5,400  | 126,414.00 | 0.02 |
| 152 | 603129 | 春风动力 | 1,000  | 124,080.00 | 0.02 |
| 153 | 601808 | 中海油服 | 8,600  | 123,496.00 | 0.02 |
| 154 | 600019 | 宝钢股份 | 16,100 | 123,004.00 | 0.02 |
| 155 | 600298 | 安琪酵母 | 2,200  | 119,636.00 | 0.02 |
| 156 | 002507 | 涪陵榨菜 | 3,100  | 116,746.00 | 0.02 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 157 | 601066 | 中信建投 | 3,700  | 116,291.00 | 0.02 |
| 158 | 600999 | 招商证券 | 6,100  | 116,022.00 | 0.02 |
| 159 | 603883 | 老百姓  | 2,200  | 115,896.00 | 0.02 |
| 160 | 603018 | 华设集团 | 14,400 | 114,480.00 | 0.02 |
| 161 | 300957 | 贝泰妮  | 450    | 113,382.00 | 0.02 |
| 162 | 600346 | 恒力石化 | 4,300  | 112,832.00 | 0.02 |
| 163 | 603338 | 浙江鼎力 | 1,900  | 111,511.00 | 0.02 |
| 164 | 002242 | 九阳股份 | 3,400  | 110,466.00 | 0.02 |
| 165 | 600201 | 生物股份 | 6,100  | 106,445.00 | 0.02 |
| 166 | 688323 | 瑞华泰  | 4,513  | 102,806.14 | 0.02 |
| 167 | 300919 | 中伟股份 | 610    | 99,430.00  | 0.02 |
| 168 | 601100 | 恒立液压 | 1,100  | 94,512.00  | 0.02 |
| 169 | 688319 | 欧林生物 | 3,412  | 93,284.08  | 0.02 |
| 170 | 002493 | 荣盛石化 | 5,400  | 93,258.00  | 0.02 |
| 171 | 600507 | 方大特钢 | 13,700 | 92,886.00  | 0.02 |
| 172 | 688621 | 阳光诺和 | 985    | 87,468.00  | 0.02 |
| 173 | 688499 | 利元亨  | 2,149  | 83,488.65  | 0.01 |
| 174 | 300037 | 新宙邦  | 800    | 80,080.00  | 0.01 |
| 175 | 002876 | 三利谱  | 1,200  | 77,640.00  | 0.01 |
| 176 | 601636 | 旗滨集团 | 3,900  | 72,384.00  | 0.01 |
| 177 | 603416 | 信捷电气 | 1,100  | 69,817.00  | 0.01 |
| 178 | 300271 | 华宇软件 | 3,500  | 67,375.00  | 0.01 |
| 179 | 688390 | 固德威  | 200    | 66,800.00  | 0.01 |
| 180 | 002563 | 森马服饰 | 5,500  | 65,725.00  | 0.01 |
| 181 | 301018 | 申菱环境 | 7,811  | 64,753.19  | 0.01 |
| 182 | 603882 | 金域医学 | 400    | 63,908.00  | 0.01 |
| 183 | 300979 | 华利集团 | 726    | 63,525.00  | 0.01 |
| 184 | 600176 | 中国巨石 | 4,000  | 62,040.00  | 0.01 |
| 185 | 300888 | 稳健医疗 | 500    | 61,810.00  | 0.01 |
| 186 | 002318 | 久立特材 | 5,100  | 61,302.00  | 0.01 |
| 187 | 688217 | 睿昂基因 | 1,040  | 60,736.00  | 0.01 |
| 188 | 688117 | 圣诺生物 | 1,672  | 60,141.84  | 0.01 |
| 189 | 603529 | 爱玛科技 | 1,019  | 59,224.28  | 0.01 |
| 190 | 601899 | 紫金矿业 | 6,000  | 58,140.00  | 0.01 |
| 191 | 688350 | 富淼科技 | 2,552  | 57,266.88  | 0.01 |
| 192 | 603833 | 欧派家居 | 400    | 56,784.00  | 0.01 |
| 193 | 688239 | 航宇科技 | 4,926  | 56,550.48  | 0.01 |
| 194 | 688087 | 英科再生 | 2,469  | 54,219.24  | 0.01 |
| 195 | 688616 | 西力科技 | 3,918  | 53,990.04  | 0.01 |
| 196 | 600809 | 山西汾酒 | 100    | 44,800.00  | 0.01 |
| 197 | 301020 | 密封科技 | 4,210  | 44,794.40  | 0.01 |
| 198 | 300894 | 火星人  | 628    | 42,704.00  | 0.01 |



|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 199 | 300973 | 立高食品 | 360   | 41,655.60 | 0.01 |
| 200 | 300981 | 中红医疗 | 459   | 41,489.01 | 0.01 |
| 201 | 603185 | 上机数控 | 200   | 35,790.00 | 0.01 |
| 202 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.01 |
| 203 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 204 | 001207 | 联科科技 | 682   | 22,581.02 | 0.00 |
| 205 | 301009 | 可靠股份 | 801   | 22,339.89 | 0.00 |
| 206 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 207 | 300925 | 法本信息 | 600   | 15,774.00 | 0.00 |
| 208 | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 209 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 210 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 211 | 300940 | 南极光  | 307   | 13,317.66 | 0.00 |
| 212 | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 213 | 300937 | 药易购  | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 214 | 301013 | 利和兴  | 471   | 12,768.81 | 0.00 |
| 215 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 216 | 300997 | 欢乐家  | 928   | 12,110.40 | 0.00 |
| 217 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 218 | 301002 | 崧盛股份 | 201   | 11,581.62 | 0.00 |
| 219 | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 11,065.83 | 0.00 |
| 220 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 221 | 300955 | 嘉亨家化 | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 222 | 300956 | 英力股份 | 371   | 9,571.80  | 0.00 |
| 223 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 224 | 301016 | 雷尔伟  | 275   | 9,069.50  | 0.00 |
| 225 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 226 | 300945 | 曼卡龙  | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 227 | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 228 | 300931 | 通用电梯 | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 229 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 230 | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 231 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 232 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 233 | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81  | 0.00 |
| 234 | 300978 | 东箭科技 | 593   | 8,064.80  | 0.00 |
| 235 | 300926 | 博俊科技 | 359   | 7,969.80  | 0.00 |
| 236 | 300993 | 玉马遮阳 | 410   | 7,908.90  | 0.00 |
| 237 | 300971 | 博亚精工 | 245   | 6,931.05  | 0.00 |
| 238 | 300991 | 创益通  | 254   | 6,733.54  | 0.00 |
| 239 | 300975 | 商络电子 | 492   | 6,410.76  | 0.00 |
| 240 | 301011 | 华立科技 | 175   | 5,922.00  | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 241 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 242 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 243 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 244 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 245 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 246 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 247 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 248 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 600905 | 三峡能源 | 3,436,527.95 | 0.56           |
| 2  | 002142 | 宁波银行 | 1,649,871.00 | 0.27           |
| 3  | 002839 | 张家港行 | 1,132,000.00 | 0.18           |
| 4  | 000776 | 广发证券 | 1,012,179.00 | 0.16           |
| 5  | 300124 | 汇川技术 | 888,814.00   | 0.14           |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 621,652.00   | 0.10           |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 620,035.00   | 0.10           |
| 8  | 601012 | 隆基股份 | 594,021.00   | 0.10           |
| 9  | 601336 | 新华保险 | 581,279.00   | 0.09           |
| 10 | 002557 | 洽洽食品 | 544,086.00   | 0.09           |
| 11 | 002949 | 华阳国际 | 541,637.00   | 0.09           |
| 12 | 000002 | 万科A  | 535,744.00   | 0.09           |
| 13 | 603288 | 海天味业 | 477,954.00   | 0.08           |
| 14 | 000166 | 申万宏源 | 472,000.00   | 0.08           |
| 15 | 300759 | 康龙化成 | 418,567.00   | 0.07           |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 415,660.00   | 0.07           |
| 17 | 002812 | 恩捷股份 | 410,659.00   | 0.07           |
| 18 | 688819 | 天能股份 | 403,273.50   | 0.07           |
| 19 | 002736 | 国信证券 | 395,620.00   | 0.06           |
| 20 | 002714 | 牧原股份 | 386,103.00   | 0.06           |

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  | 600905 | 三峡能源 | 1,782,563.69 | 0.29           |
| 2  | 002839 | 张家港行 | 1,140,819.00 | 0.18           |
| 3  | 601658 | 邮储银行 | 1,064,867.84 | 0.17           |
| 4  | 002110 | 三钢闽光 | 988,564.00   | 0.16           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 5  | 000651 | 格力电器 | 868,198.00 | 0.14 |
| 6  | 600036 | 招商银行 | 833,383.00 | 0.13 |
| 7  | 002916 | 深南电路 | 821,227.00 | 0.13 |
| 8  | 600000 | 浦发银行 | 804,564.00 | 0.13 |
| 9  | 600887 | 伊利股份 | 755,359.00 | 0.12 |
| 10 | 002850 | 科达利  | 732,626.00 | 0.12 |
| 11 | 002202 | 金风科技 | 684,856.00 | 0.11 |
| 12 | 300957 | 贝泰妮  | 679,406.61 | 0.11 |
| 13 | 002100 | 天康生物 | 674,996.00 | 0.11 |
| 14 | 688696 | 极米科技 | 665,504.00 | 0.11 |
| 15 | 688083 | 中望软件 | 661,630.00 | 0.11 |
| 16 | 601328 | 交通银行 | 644,358.00 | 0.10 |
| 17 | 600519 | 贵州茅台 | 631,331.00 | 0.10 |
| 18 | 688680 | 海优新材 | 619,333.42 | 0.10 |
| 19 | 000166 | 申万宏源 | 604,923.00 | 0.10 |
| 20 | 300979 | 华利集团 | 599,039.36 | 0.10 |

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 | 44,694,156.29 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 61,884,001.16 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 22,188,844.20  | 3.92         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 30,298,000.00  | 5.35         |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 190,154,000.00 | 33.58        |
| 6  | 中期票据      | 181,501,000.00 | 32.05        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 152,701.40     | 0.03         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 424,294,545.60 | 74.92        |

#### 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  | 042000318 | 20 国电 CP002    | 300,000 | 30,099,000.00 | 5.31         |
| 2  | 012100044 | 21 福州城投 SCP001 | 300,000 | 30,087,000.00 | 5.31         |
| 3  | 012102179 | 21 中电投 SCP022  | 300,000 | 29,991,000.00 | 5.30         |
| 4  | 012102109 | 21 南航股 SCP015  | 300,000 | 29,979,000.00 | 5.29         |
| 5  | 012102095 | 21 苏交通 SCP012  | 300,000 | 29,964,000.00 | 5.29         |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称     | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元）        | 公允价值变动（元） | 风险说明        |
|-------------------|--------|----------|----------------|-----------|-------------|
| IF2112            | IF2112 | -9       | -13,878,540.00 | 3,863.08  | -           |
| 公允价值变动总额合计（元）     |        |          |                |           | 3,863.08    |
| 股指期货投资本期收益（元）     |        |          |                |           | -417,731.43 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |        |          |                |           | 3,863.08    |

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金通过卖出沪深 300 股指期货合约，避免来回交易费用较高的股票，维持股票实际仓位在合理的水平，降低基金整体的净值波动。

### 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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。

#### 7.12.2 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股票库之外的股票。

#### 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   | 1,688,364.92 |
| 2  | 应收证券清算款 | 82,795.93    |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 4,899,330.32 |
| 5  | 应收申购款   | 132,689.07   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 6,803,180.24 |

#### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1  | 600905 | 三峡能源 | 5,147,016.21 | 0.91          | 新股锁定     |

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别         | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额  | 持有人结构          |            |               |            |
|--------------|-----------|------------|----------------|------------|---------------|------------|
|              |           |            | 机构投资者          |            | 个人投资者         |            |
|              |           |            | 持有份额           | 占总份额比例 (%) | 持有份额          | 占总份额比例 (%) |
| 平安安享灵活配置混合 A | 444       | 644,454.65 | 274,363,471.67 | 95.89      | 11,774,392.25 | 4.11       |
| 平安安享灵活配置混合 C | 6,190     | 21,472.52  | 118,250,853.00 | 88.97      | 14,664,018.13 | 11.03      |
| 合计           | 6,603     | 63,463.99  | 392,614,324.67 | 93.69      | 26,438,410.38 | 6.31       |

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别         | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|--------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 平安安享灵活配置混合 A | -          | -            |
|                  | 平安安享灵活配置混合 C | 128,826.67 | 0.0969       |
|                  | 合计           | 128,826.67 | 0.0307       |

注：上述从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别         | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|--------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 平安安享灵活配置混合 A | 0                 |
|                                | 平安安享灵活配置混合 C | 0                 |
|                                | 合计           | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 平安安享灵活配置混合 A | 0                 |
|                                | 平安安享灵活配置混合 C | 10~50             |
|                                | 合计           | 10~50             |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 平安安享灵活配置混合 A   | 平安安享灵活配置混合 C   |
|--|----------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>(2019 年 2 月 15 日)<br>基金份额总额 | 101,298,190.57 | -              |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 308,631,290.52 | 168,501,537.11 |
| 本报告期基金总申购份额                            | 84,156,342.95  | 160,753,236.37 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | 106,649,769.55 | 196,339,902.35 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）               | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 286,137,863.92 | 132,914,871.13 |

## § 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

2021 年 3 月 2 日，王金涛担任平安基金管理有限公司总经理助理。

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

报告期内，本基金无涉及基金管理人、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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称     | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|----------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|          |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国盛证券     | 2      | 43,234,237.70 | 45.83%       | 30,751.44 | 44.13%     | -  |
| 中信建投证券   | 1      | 23,289,244.16 | 24.69%       | 16,566.09 | 23.78%     | -  |
| 平安证券     | 1      | 11,736,679.06 | 12.44%       | 10,930.17 | 15.69%     | -  |
| 国信证券     | 1      | 7,817,673.31  | 8.29%        | 5,560.91  | 7.98%      | -  |
| 华创证券     | 2      | 6,184,007.43  | 6.56%        | 4,398.49  | 6.31%      | -  |
| 天风证券     | 1      | 2,068,394.95  | 2.19%        | 1,471.23  | 2.11%      | -  |
| 长城证券     | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 恒泰证券     | 2      | -             | -            | -         | -          | 新增 |
| 信达证券     | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中国中金财富证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |

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。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称     | 债券交易          |              | 债券回购交易        |                | 权证交易 |              |
|----------|---------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
|          | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国盛证券     | 91,215,734.28 | 60.06%       | 35,500,000.00 | 63.96%         | -    | -            |
| 中信建投证券   | 94,614.64     | 0.06%        | -             | -              | -    | -            |
| 平安证券     | -             | -            | 20,000,000.00 | 36.04%         | -    | -            |
| 国信证券     | 21,007,600.90 | 13.83%       | -             | -              | -    | -            |
| 华创证券     | 19,514,819.00 | 12.85%       | -             | -              | -    | -            |
| 天风证券     | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 长城证券     | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 恒泰证券     | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 信达证券     | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 中国中金财富证券 | 20,042,200.00 | 13.20%       | -             | -              | -    | -            |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                       | 法定披露方式       | 法定披露日期           |
|----|--|--------------|------------------|
| 1  | 平安基金管理有限公司 2020 年 12 月 31 日基金净值公告          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 01 月 01 日 |
| 2  | 平安安享灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 01 月 21 日 |
| 3  | 平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告            | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 01 月 22 日 |
| 4  | 平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告            | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 05 日 |
| 5  | 平安安享灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告               | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 30 日 |
| 6  | 平安基金管理有限公司关于新增中国中金财富证券有限公司为旗下部分基金销售机构的公告   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 04 月 06 日 |
| 7  | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财富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 | 2021 年 04 月 09 日 |

|    |   |              |                  |
|----|---|--------------|------------------|
| 8  | 平安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、定期定额投资起点及账户最低持有份额下限的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 04 月 15 日 |
| 9  | 平安安享灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告                    | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 04 月 22 日 |
| 10 | 平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新                         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 05 月 31 日 |
| 11 | 平安安享灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）                          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 05 月 31 日 |
| 12 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告              | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 06 月 02 日 |
| 13 | 平安基金管理有限公司关于暂停北京加和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 | 2021 年 06 月 21 日 |
| 14 | 平安基金管理有限公司关于旗下基金所持恩捷股份（股票代码：002812）估值调整的公告          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 06 月 23 日 |
| 15 | 平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                    | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 06 月 24 日 |
| 16 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富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 | 2021 年 06 月 25 日 |
| 17 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建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 | 2021 年 06 月 25 日 |
| 18 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司为销售机构的公告              | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 06 月 30 日 |
| 19 | 平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告                    | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 06 月 30 日 |
| 20 | 平安安享灵活配置混合型证券投资基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 06 月 30 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|------|----------------|------------|
|------|----------------|------------|

| 别  | 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  | 2021/04/21--<br>2021/05/24;<br>2021/05/26--<br>2021/06/17 | 76,944,310.86 | -    | -    | 76,944,310.86 | 18.36    |
| 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

注：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安享灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安安享灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电

话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日