

平安盈诚积极配置 6 个月持有期混合型基
金中基金（FOF）
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安盈诚积极配置 6 个月持有混合（FOF）	
基金主代码	016621	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 22 日	
报告期末基金份额总额	83,205,371.97 份	
投资目标	本基金通过主动精选基金品种及大类资产配置，并根据市场变化动态调整控制基金下行风险，力争追求基金长期增值。	
投资策略	1、资产配置策略 2、基金投资策略 3、股票投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、存托凭证投资策略	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*70%+中证债券型基金指数收益率*20%+恒生综合指数收益率（使用估值汇率折算）*5%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金是混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安盈诚积极配置 6 个月持	平安盈诚积极配置 6 个月持

	有混合 (FOF) A	有混合 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	016621	016622
报告期末下属分级基金的份额总额	65,378,737.56 份	17,826,634.41 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)	
	平安盈诚积极配置 6 个月持有混合 (FOF) A	平安盈诚积极配置 6 个月持有混合 (FOF) C
1. 本期已实现收益	-1,474,012.21	-414,461.37
2. 本期利润	4,530,711.90	1,205,817.02
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0676	0.0658
4. 期末基金资产净值	57,075,964.64	15,448,501.80
5. 期末基金份额净值	0.8730	0.8666

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所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

平安盈诚积极配置 6 个月持有混合 (FOF) A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.85%	1.32%	12.14%	1.16%	-3.29%	0.16%
过去六个月	6.62%	1.09%	11.15%	0.92%	-4.53%	0.17%
过去一年	-6.38%	1.11%	7.90%	0.82%	-14.28%	0.29%
自基金合同生效起至今	-12.70%	0.93%	7.11%	0.75%	-19.81%	0.18%

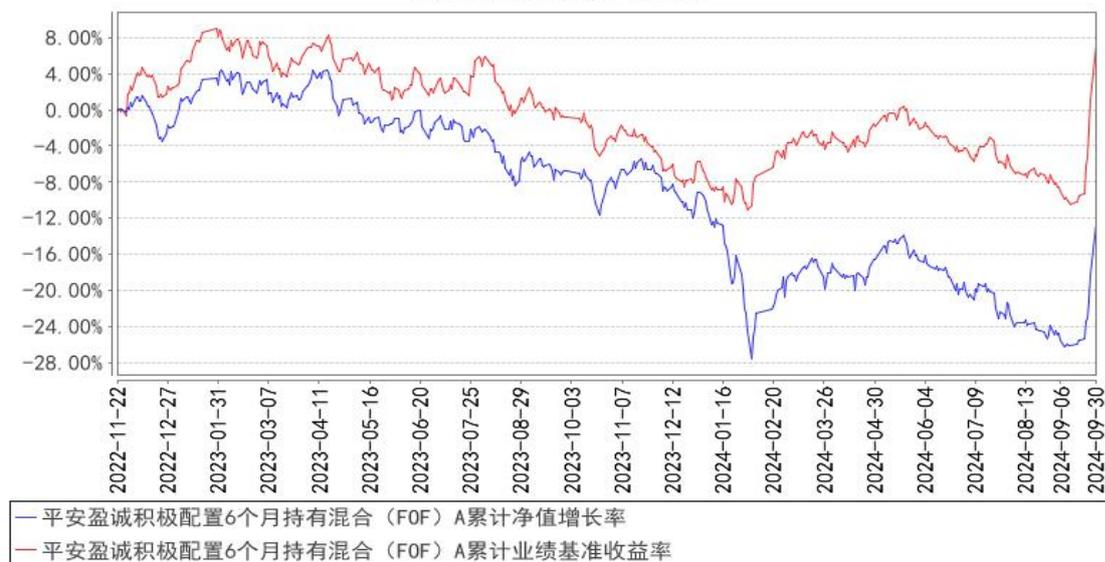
平安盈诚积极配置 6 个月持有混合 (FOF) C

阶段	净值增长率①	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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	8.75%	1.32%	12.14%	1.16%	-3.39%	0.16%
过去六个月	6.41%	1.09%	11.15%	0.92%	-4.74%	0.17%
过去一年	-6.75%	1.11%	7.90%	0.82%	-14.65%	0.29%
自基金合同 生效起至今	-13.34%	0.93%	7.11%	0.75%	-20.45%	0.18%

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

平安盈诚积极配置6个月持有混合（FOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安盈诚积极配置6个月持有混合 (FOF) C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2022 年 11 月 22 日正式生效；

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

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王家萌	平安盈诚积极配置6个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理	2024 年 1 月 17 日	-	11 年	王家萌女士，上海交通大学工学学士，新加坡国立大学理学硕士，曾先后担任中国银行上海市分行金融培训生、国投安信期货有限公司量化研究员、平安道远投资管理（上海）有限公司交易员、浙江慧度资产管理有限公司量化研究员。2020 年 6 月加入平安基金管理有限公司，曾担任 MOM 投资中心投资经理，现担任平安盈诚积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、平安盈泽 1 年持有期债券型基金中基金 (FOF) 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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，国内经济运行总体平稳，但当前外部环境变化带来的不利影响增多，国内有效需求依然不足，经济持续回升向好仍面临诸多困难挑战。从具体数据上看，7、8 月份，工业增加值、服务业生产指数和社会消费品零售总额同比增速基本保持在合理范围之内，但增速有边际回落迹象；8 月 PPI 同比降幅较 7 月有所扩大，CPI 同比增速仍在低位徘徊。9 月制造业 PMI 均为 49.8%，较上月有所好转，但仍在 50% 下方，从该指标内部结构上看，生产端强于需求端的特征仍未改变。海外方面，9 月的美联储议息会议，决定将联邦基金目标利率降低 50bp，开启降息周期以继续支持经济运行。鉴于此，9 月底的我国政治局会议也表达了对经济现状态度上的变化。

当季的大类资产表现中，A 股市场在连续震荡下跌后迎来政策红利，9 月底上演反转行情，行业方面，券商等行业涨幅居前，前期跌幅较大的消费类行业也有亮眼表现；另一方面，受到同样

因素的影响，债市几乎与股市呈现出了相反的趋势，形成了冲高回落行情。国际方面，由于主要经济体的需求放缓，原油价格在三季度下跌较多；金价则创出了历史高点；海外权益市场表现偏强，但风格方面前期较强势的科技板块势头有所减弱。

组合操作上，平安盈诚是追求相对收益的偏股混合型 FOF，投资上参考公募基金指数，报告期内组合保持中高权益仓位。结构上，三季度组合在风格及行业板块上较为均衡，更聚焦于对底层基金的挖掘上。

当前一系列宏观政策正在加码推出过程，市场的政策预期及风偏大幅修正，成交额显著放量，市场波动率快速提升，结合市场整体仍处于赔率较高区域，组合将持续保持中高权益仓位运作。结构上，组合仍将以均衡价值型基金作为底仓，随着市场风险偏好提升，组合也将重点关注景气度边际向上的科技、军工等方向。组合将围绕以上方向积极挖掘具备相关选股能力的基金进行配置。此外，组合将密切跟踪国内财政政策等方向的进一步发力及落地情况，关注经济企稳改善信号以及顺周期方向的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安盈诚积极配置 6 个月持有混合（FOF）A 的基金份额净值 0.8730 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.85%，同期业绩比较基准收益率为 12.14%；截至本报告期末平安盈诚积极配置 6 个月持有混合（FOF）C 的基金份额净值 0.8666 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.75%，同期业绩比较基准收益率为 12.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	68,286,910.72	93.86
3	固定收益投资	304,551.29	0.42
	其中：债券	304,551.29	0.42
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,860,626.89	5.31
8	其他资产	304,759.01	0.42
9	合计	72,756,847.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	304,551.29	0.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	304,551.29	0.42

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019733	24 国债 02	3,000	304,551.29	0.42

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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：本基金报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	4,709.07
2	应收证券清算款	300,000.00

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	49.94
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	304,759.01

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有股票。

5.11.6 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。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	013860	宝盈品质甄选混合 C	契约型开放式	6,239,433.83	8,348,362.46	11.51	否
2	014061	浦银安盛新兴产业混合 C	契约型开放式	2,199,549.80	7,252,795.51	10.00	否
3	011066	大成高新技术产业股票 C	契约型开放式	1,492,388.70	6,600,685.98	9.10	否
4	008187	淳厚信睿 C	契约型开放式	3,108,136.14	6,216,583.09	8.57	否
5	014597	华泰柏瑞富利混合 C	契约型开放式	2,710,727.48	6,154,435.67	8.49	否
6	018998	景顺长城研究精选股票 C	契约型开放式	4,281,605.25	6,071,316.24	8.37	否
7	002170	东吴移动互联网混合 C	契约型开放式	1,500,757.10	4,700,371.24	6.48	否
8	004605	富国新活	契约型开放	1,837,521.02	4,268,745.08	5.89	否

		力灵活配置混合 C	式				
9	000893	工银创新动力股票	契约型开放式	3,084,968.03	3,658,772.08	5.04	否
10	002291	诺安安鑫混合	契约型开放式	1,433,233.26	3,485,623.29	4.81	否

6.1.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名公开募集基础设施证券投资基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	748.88	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	32,256.52	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	67,049.03	-
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	169,522.37	-
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	28,376.70	-
当期交易基金产生的交易费(元)	846.30	-
当期交易基金产生的转换费(元)	3,160.75	-

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安盈诚积极配置 6 个月持有混合 (FOF) A	平安盈诚积极配置 6 个月持有混合 (FOF) C
报告期期初基金份额总额	68,667,928.27	19,008,716.39
报告期期间基金总申购份额	2,019.12	1,030.31
减：报告期期间基金总赎回份额	3,291,209.83	1,183,112.29

报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)		
报告期期末基金份额总额	65,378,737.56	17,826,634.41

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安盈诚积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 募集注册的文件
- (2) 平安盈诚积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同
- (3) 平安盈诚积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

10.2 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

10.3 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

2024 年 10 月 24 日