

平安盈诚积极配置 6 个月持有期混合型基
金中基金（FOF）
2026 年第 2 季度报告

2026 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 07 月 20 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约定，于 2026 年 07 月 17 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 2026 年 04 月 01 日起至 06 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	11,754,760.57 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	10,206,776.02 份	1,547,984.55 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（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 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	1,138,857.39	146,758.75
2. 本期利润	4,970,478.56	669,444.98
3. 加权平均基金份额本期利润	0.4271	0.4310
4. 期末基金资产净值	16,115,279.68	2,409,200.20
5. 期末基金份额净值	1.5789	1.5563

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	38.03%	1.92%	8.00%	0.93%	30.03%	0.99%
过去六个月	35.27%	1.75%	4.86%	0.85%	30.41%	0.90%
过去一年	71.83%	1.52%	18.24%	0.76%	53.59%	0.76%
过去三年	60.16%	1.34%	24.03%	0.83%	36.13%	0.51%
自基金合同生效起至今	57.89%	1.25%	26.85%	0.80%	31.04%	0.45%

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
过去三个月	37.88%	1.92%	8.00%	0.93%	29.88%	0.99%
过去六个月	35.00%	1.75%	4.86%	0.85%	30.14%	0.90%
过去一年	71.13%	1.52%	18.24%	0.76%	52.89%	0.76%
过去三年	58.24%	1.34%	24.03%	0.83%	34.21%	0.51%
自基金合同生效起至今	55.63%	1.25%	26.85%	0.80%	28.78%	0.45%

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）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	—	13 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)、平安养老目标日期 2050 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决

定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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《基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，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的规定及基金合同的约定。

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

二季度，外部形势更加复杂多变，国内主要的经济指标同比、环比边际走平或略有下降，供需矛盾突出，部分企业经营压力较大，经济稳中向好的基础还需巩固。规模以上工业增加值 4、5 月同比增长 4.1%和 4.5%；服务业生产指数 4、5 月同比增长 4.3%和 4.4%；货物进出口总额 4、5 月同比增长 14.9%和 16.9%；生产端总体平稳。社会消费品零售总额 4、5 月同比增长 0.2%和下降 0.6%；固定资产投资增速 4、5 月累计同比下降 1.6%和下降 4.1%；房地产行业对经济的影响仍在持续。CPI 的 4、5 月同比上涨均为 1.2%；PPI 的 4、5 月同比上涨为 2.8%和 3.9%；由原油价格波动造成的成本端压力并未传导到下游价格层面。

海外方面，美国企业正在大量投资人工智能、数据中心和新技术，帮助保持经济增长，而消费者则减少支出。美联储委员会决定将联邦基金利率目标区间维持在 3.5%至 3.75%，但由于美国

短期通胀明显上行，加之新任美联储主席的管理方式或有较大变化，加息预期有所升温。

2026 年二季度权益市场经历了美伊冲突缓和后的反弹上行，万得全 A 二季度上涨 12.8%。具体节奏上，4 月初美伊冲突缓和大幅提振市场风险偏好，4 月指数开启反弹普涨，5-6 月指数整体维持震荡，AI 科技演绎结构性行情。当前位置指数下行风险有限，但内部结构分化极致，主要风险可能来自科技成长方向交易高拥挤引发阶段性大幅波动。

组合操作上，平安盈诚作为相对收益定位的产品，报告期内维持高权益仓位运作，结构上组合在 4 月初美伊缓和时适度增配了科技成长方向。后续组合在重视成长主线的时候，将关注波动控制，适度增配价值底仓来对冲组合波动。

展望后市，从外部看，AI 主线回归，短期最大的不确定性也随之回到了 AI 资本开支的持续性和美联储货币政策预期之上；而这两点大概率也是今后一个阶段市场博弈的焦点。国内经济方面，供强需弱的格局仍在持续，得到资源倾斜的新质生产力和受到地产拖累的消费能力成为“跷跷板”的两端。对于债市而言，虽然由于通胀向下游传导较难，货币政策可能不会因为上游行业成本的阶段性抬升而调整，但利率的绝对水平较低，市场也较难出现显著的趋势行情。

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 1.5789 元，本报告期基金份额净值增长率为 38.03%，同期业绩比较基准收益率为 8.00%；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 1.5563 元，本报告期基金份额净值增长率为 37.88%，同期业绩比较基准收益率为 8.00%。

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 人的情形。本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末，以上情况未消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

§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	17,468,727.71	93.26
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,084,115.91	5.79
8	其他资产	178,070.40	0.95
9	合计	18,730,914.02	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境内股票。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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：本基金本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约定的备选股票库

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	1,968.04
2	应收证券清算款	151,490.40
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	24,611.96
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	178,070.40

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：本基金本报告期末未持有股票。

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	025542	华夏行业景气混合 C	契约型开放式	263,028.31	1,856,059.27	10.02	否
2	008187	淳厚信睿 C	契约型开放式	324,336.58	1,778,110.43	9.60	否
3	513310	华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体 ETF(QDII)	交易型开放式(ETF)	210,700.00	1,408,950.90	7.61	否
4	018326	国泰海通创新成长混合发起 C	契约型开放式	474,750.71	1,286,954.22	6.95	否
5	009989	华宝研究精选混合	契约型开放式	922,905.69	1,256,812.97	6.78	否
6	017484	财通资管数字经济混合发起式 C	契约型开放式	394,325.69	1,245,911.45	6.73	否
7	011120	富国创新科技混合 C	契约型开放式	203,677.38	1,217,787.06	6.57	否
8	001184	易方达新常态混合	契约型开放式	466,012.30	1,207,437.87	6.52	否
9	011370	华商均衡成长混合 C	契约型开放式	229,771.47	1,125,765.32	6.08	否
10	013507	华安制造先锋混合 C	契约型开放式	133,449.56	857,920.53	4.63	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不动产

投资信托基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 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)	176.74	—
当期交易基金产生的赎回费(元)	1,059.34	314.78
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	16,096.25	—
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	46,820.62	1,189.19
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	7,686.49	198.16
当期交易基金产生的交易费(元)	96.44	—
当期交易基金产生的转换费(元)	3,402.94	—

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	13,240,479.93	1,664,800.28
报告期期间基金总申购份额	237,998.33	237,424.31
减：报告期期间基金总赎回份额	3,271,702.24	354,240.04
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	10,206,776.02	1,547,984.55

§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

平安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，权益登记日为 2026 年 5 月 19 日，大会投票表决时间为自 2026 年 5 月 19 日起，至 2026 年 6 月 16 日 17:00 止（以基金管理人收到表决票的时间为准）。2026 年 6 月 17 日，在本基金基金托管人授权代表的监督下，基金管理人授权的监督员对本次基金份额持有人大会表决进行了计票，上海源泰律师事务所对计票过程进行了见证，深圳市深圳公证处对计票过程及结果进行了公证。根据计票结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的本基金基金份额总数小于在权益登记日本基金基金份额总数的二分之一，未达到法定的基金份额持有人大会召开条件。详细内容请阅读本基金管理人于 2026 年 6 月 18 日发布的《关于平安盈诚积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会会议情况的公告》。

§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

2026 年 07 月 20 日