

平安安享灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 年 08 月 29 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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
§ 4 管理人报告	9
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	10
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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40

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	40
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	40
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	41
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	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 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	16,190,487.31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	9,058,355.06份	7,132,132.25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	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-800-4800	021-60637228
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	张金良
-------	-----	-----

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(2024 年 1 月 1 日-2024 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	702,653.06	438,906.68
本期利润	16,957.86	-211,126.65
加权平均基金份额 本期利润	0.0020	-0.0381
本期加权平均净 值利润率	0.16%	-3.12%
本期基金份额净 值增长率	0.79%	0.73%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	1,742,045.15	1,336,007.04
期末可供分配基 金份额利润	0.1923	0.1873
期末基金资产净 值	10,800,400.21	8,468,139.29
期末基金份额净 值	1.1923	1.1873
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

基金份额累计净值增长率	19.12%	17.12%
-------------	--------	--------

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. 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

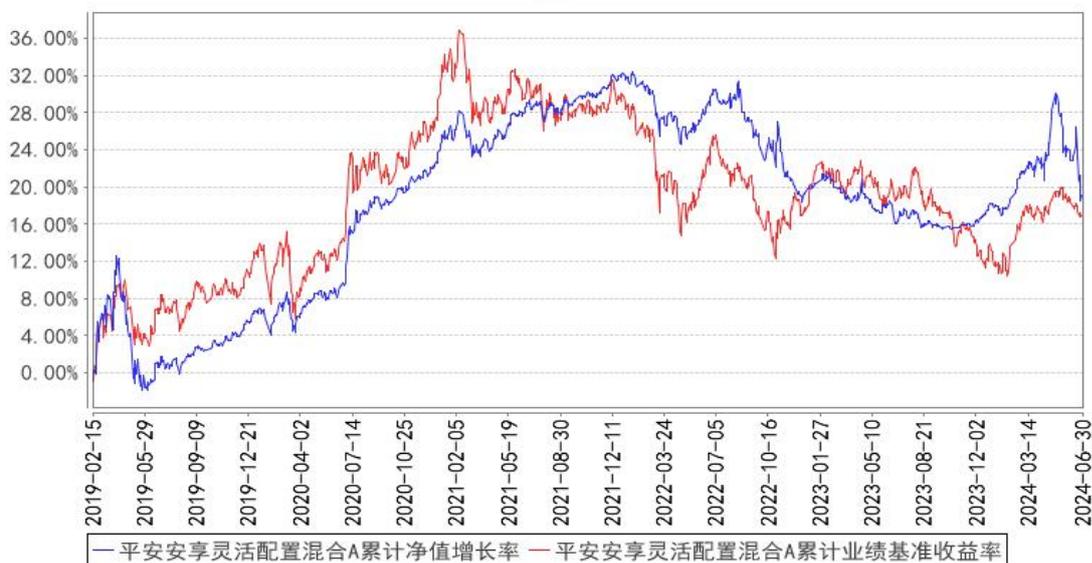
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.06%	1.00%	-1.17%	0.24%	-2.89%	0.76%
过去三个月	-2.50%	0.83%	-0.08%	0.36%	-2.42%	0.47%
过去六个月	0.79%	0.62%	2.71%	0.44%	-1.92%	0.18%
过去一年	2.35%	0.45%	-1.77%	0.43%	4.12%	0.02%
过去三年	-7.75%	0.38%	-10.93%	0.52%	3.18%	-0.14%
自基金合同生效起至今	19.12%	0.47%	16.96%	0.59%	2.16%	-0.12%

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	-4.07%	1.00%	-1.17%	0.24%	-2.90%	0.76%
过去三个月	-2.53%	0.83%	-0.08%	0.36%	-2.45%	0.47%
过去六个月	0.73%	0.62%	2.71%	0.44%	-1.98%	0.18%
过去一年	2.27%	0.45%	-1.77%	0.43%	4.04%	0.02%
过去三年	-8.02%	0.38%	-10.93%	0.52%	2.91%	-0.14%
自基金合同生效起至今	17.12%	0.36%	8.97%	0.57%	8.15%	-0.21%

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成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 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（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。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 2024 年 6 月 30 日，平安基金共管理 206 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6655 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		
莫芄	平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2024 年 3 月 1 日	-	5 年	莫芄先生，清华大学机械制造与自动化专业硕士，曾担任广发基金管理有限公司研究员。2021 年 4 月加入平安基金管理有限公司，现担任研究中心高级研究员，同时担任平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
韩克	平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2021 年 10 月 29 日	2024 年 3 月 1 日	12 年	韩克先生，浙江大学金融学硕士。曾先后担任南方基金管理有限公司债券交易员、研究员、投资经理助理。2019 年 6 月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心投资经理。现担任平安添裕债券型证券投资基金、平安惠复纯债债券型证券投资基金、平安恒鑫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 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

2024 年上半年，Wind 全 A 指数-8.01%，沪深 300 指数+0.89%，中证 2000 指数-23.28%。

报告期内，我们坚持着“基于深度研究和 DCF 思想计算预期收益率，并匹配以相应仓位”的投资策略。在这里，我们想详细地阐述“匹配以相应仓位”的具体做法，基金持有者可以藉此更好地理解我们持有资产的仓位变化。

“匹配以相应仓位”中最重要的理念是“下行风险越低、期望收益率越高的资产仓位越重”。在我们看来，深度研究的核心在于“研究可研究的问题，提升对远期内在价值判断的置信度”，但深度研究并不能使我们掌握一切，“历史一再让我们看到，许多以为必然会发生的事，常常因为

不可预见的阻碍而无法成真；而某些难以想象的情节，最后却成为事实”，所以不管我们思考多深，研究多么细致，事物发展的进程往往也不能完全如我们所愿。因此站在当下去研究远期公司的内在价值，天然就会得到一个呈现概率分布特点的合理区间，而不是一个准确的数值，这也是为什么一些投资者倾向于选择远期置信度更高的赛道和公司。在合理区间以外，由于市场短期的投票机属性，导致股价不时会突破合理区间的上限和下限，我们称之为“泡沫化”和“底部化”，当股价泡沫化时，我们会选择清仓，而当股价底部化时我们会选择满仓。某些赛道和公司的置信度没有那么高，可能导致合理区间的范围本身就不小，我们会在偏区间下限选择重仓，而在偏区间上限选择轻仓，并采取上涨减仓、下跌加仓的策略，最终构建一个最优收益率期望的资产组合。在我们的投资框架中，没有“买入”、“持有”、“卖出”，只有“满仓”、“清仓”、“x 个点仓位”，这两种理念其实有明显区别，后者的核心就是“对不同风险收益比的资产给予不同的仓位匹配”，如果持仓 5% 的标的上涨了 20~30%，而我们对长期内在价值的判断没有变化，那么预期收益率的下降就应当进行仓位调整，降低到 3% 的仓位也便在情理之中了。

“匹配以相应仓位”中另一个重要理念是“要给资产的下行风险预留加仓空间，以尽可能实现对回撤的控制，同时尽量提升投资回报”。假设我们用 100 万在 A 公司 10 元股价的位置买入了 10 万股，预期 1 年时间收益率 20%（目标价 12 元），但是我们的运气不太好，某种原材料由于短期事件的原因导致异常上涨，达到了显著偏离正常水平的高位，致使市场下修了公司的业绩。尽管我们认为在短期事件后，原材料价格将恢复到正常水平，公司的长期逻辑不会发生任何改变，短期的业绩下修对未来数年 DCF 折现的影响也是微乎其微，但市场总是会对短期基本面的边际变化反应迅速，最终 A 公司的股价迅速下跌了 20%，我们的持仓资产变成了 8 元 10 万股，价值 80 万元。由于我们此时坚持自己的长期判断，1 年后的目标价也仍然是 12 元，故而我们会选择加仓，我们在 8 元位置买入同样金额 100 万元，获得了 12.5 万股。至此，我们总计花费了 200 万元，持有 22.5 万股，平均持仓成本为 8.89 元——也就是说股价只需要再次上涨到 8.89 元，我们将不再亏损。如果 A 公司的股价上涨回到第一次的买入价格 10 元，我们的持仓收益率将变为 12.5%。此时根据我们的仓位策略，我们应当在 10 元卖出底部加仓的 12.5 万股，这 12.5 万股每股挣了 2 元，即盈利 25 万元。如果 A 公司最终并未在 10 元股价停下，而是如一开始我们所判断的那样，最终在 1 年后涨到了 12 元，此时剩下的 10 万股（成本 10 元），也会让我们继续再获得 20 万元的盈利。试想一下，如果 A 公司只是从 10 元上涨到了 12 元，我们只挣了 20 万元，但是短期利空因素导致了 A 公司股价下跌，结果因为这次下跌，我们反而从 A 公司身上总计挣到了 45 万元。所以任何时候，只要 A 公司内在价值不发生变化，买入后的下跌反而都是更好的机会，因为我们可以继续加仓直至满仓，最终获得更好的收益表现。诚然，上述加仓策略存在一个极大的风险，就是

如果短期事件反映了我们对 A 公司长期逻辑和内在价值的判断是有偏差的，但由于我们固执己见“灯下黑”，不断地加仓最终导致了更严重的亏损。要避免这一风险，也只能要求我们对长期可研究的问题尽可能的研究清楚，同时坚持客观的态度审视自己的观点，并且对反面观点保持着学习和敬畏之心。如果真的出现对内在价值的判断失误，应当及时止损。

值得一提的是，该投资策略实际执行下来并不会导致较高的换手率，我们预计未来的全年换手率在全市场的主动权益基金中仍然会处于偏低水平。此外，基金的股票占比是标的仓位累计的结果，并非我们的主动选择，如果基金整体的股票仓位在某个时刻较低，仅仅只代表我们当时没有找到足够的满足收益率要求的资产。宏观和市场风格的判断不会影响我们的股票仓位，我们认为宏观和市场风格的变化是有逻辑但却极难预测的，我们也自认为没有这样的能力对宏观和市场风格做出前瞻性的判断，就好像每一次天气的变化，都是合乎逻辑的（比如洋流、气旋等原因），但因为影响天气的变量太多，要准确判断未来几个月后的天气实在太难。

投资的实践充满艰难，我们将不断完善投资框架，以在一以贯之的方法之下追求长期最好的正期望收益，在这一投资框架下，我们会孜孜寻觅股价低于其内在价值并且有着持久护城河的优秀公司，努力为持有人实现基金资产的稳健增值。

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 1.1923 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.79%，同期业绩比较基准收益率为 2.71%；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 1.1873 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.73%，同期业绩比较基准收益率为 2.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于内部经济活动表现疲软，外部又面临着贸易保护主义的兴起，整个市场笼罩在相对悲观的氛围之中。人性总是使得我们在悲观的时候过度悲观，在乐观的时候又过度乐观，而后物极必反，周而复始。站在当下，我们对未来并不悲观，因为目前市场许多资产的估值都已经极具吸引力，抱着“私有化心态”去持有这些公司或许可以使得我们的心态更加平和。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理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。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

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中国证监会或相关派出机构报告并提出了解决方案。

§ 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,211,917.05	1,114,623.41
结算备付金		703,751.51	36,718.32
存出保证金		7,360.34	31,243.96
交易性金融资产	6.4.7.2	16,634,492.87	20,165,800.03
其中：股票投资		16,634,492.87	2,446,975.35
基金投资		-	-
债券投资		-	17,718,824.68
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,007,000.00	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		759.64	27,209.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		23,565,281.41	21,375,595.01
负债和净资产			
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	1,045,325.83
应付清算款		11,951.26	322,776.53
应付赎回款		29,269.45	18,944.27
应付管理人报酬		9,839.77	7,935.26
应付托管费		1,639.97	1,322.53
应付销售服务费		731.60	482.32
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,209,096.01	4,209,101.64

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	34,213.85	66,758.99
负债合计		4,296,741.91	5,672,647.37
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	16,190,487.31	13,291,332.99
未分配利润	6.4.7.12	3,078,052.19	2,411,614.65
净资产合计		19,268,539.50	15,702,947.64
负债和净资产总计		23,565,281.41	21,375,595.01

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 16,190,487.31 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1923 元，基金份额 9,058,355.06 份；C 类基金份额净值 1.1873 元，基金份额 7,132,132.25 份。

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-88,672.28	-2,045,422.18
1. 利息收入		45,403.54	20,277.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,244.91	20,277.80
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		35,158.63	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,196,564.26	-2,849,153.96
其中：股票投资收益	6.4.7.14	717,349.12	-4,738,034.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	331,386.72	1,718,743.84
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	147,828.42	170,136.88
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,335,728.53	783,271.46

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	5, 088. 45	182. 52
减：二、营业总支出		105, 496. 51	792, 680. 83
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	51, 766. 11	370, 569. 07
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	8, 627. 67	61, 761. 55
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	3, 351. 01	47, 715. 36
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4, 959. 91	190, 495. 25
其中：卖出回购金融资产支出		4, 959. 91	190, 495. 25
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		1. 33	4, 671. 51
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	36, 790. 48	117, 468. 09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-194, 168. 79	-2, 838, 103. 01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-194, 168. 79	-2, 838, 103. 01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-194, 168. 79	-2, 838, 103. 01

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	13, 291, 332. 99	-	2, 411, 614. 65	15, 702, 947. 64
二、本期期初净资产	13, 291, 332. 99	-	2, 411, 614. 65	15, 702, 947. 64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2, 899, 154. 32	-	666, 437. 54	3, 565, 591. 86
（一）、综合收益总额	-	-	-194, 168. 79	-194, 168. 79
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	2, 899, 154. 32	-	860, 606. 33	3, 759, 760. 65

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	5,492,437.37	-	1,457,827.17	6,950,264.54
2. 基金赎回款	-2,593,283.05	-	-597,220.84	-3,190,503.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	16,190,487.31	-	3,078,052.19	19,268,539.50
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	132,953,570.67	-	25,869,460.89	158,823,031.56
二、本期期初净资产	132,953,570.67	-	25,869,460.89	158,823,031.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-39,656,633.40	-	-10,795,982.63	-50,452,616.03
(一)、综合收益总额	-	-	-2,838,103.01	-2,838,103.01
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-39,656,633.40	-	-7,957,879.62	-47,614,513.02
其中：1. 基金申购款	776,718.44	-	143,786.52	920,504.96
2. 基金赎回款	-40,433,351.84	-	-8,101,666.14	-48,535,017.98
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	93,296,937.27	-	15,073,478.26	108,370,415.53

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。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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。

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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,211,917.05
等于：本金	1,211,789.09
加：应计利息	127.96
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,211,917.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	17,888,770.97	-	16,634,492.87	-1,254,278.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	17,888,770.97	-	16,634,492.87	-1,254,278.10

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,007,000.00	-
银行间市场	-	-

合计	5,007,000.00	-
----	--------------	---

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.18
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	13,800.41
其中：交易所市场	13,800.41
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	20,412.26
合计	34,213.85

6.4.7.10 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,446,026.28	8,446,026.28
本期申购	1,660,364.10	1,660,364.10
本期赎回（以“-”号填列）	-1,048,035.32	-1,048,035.32
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	9,058,355.06	9,058,355.06

平安安享灵活配置混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,845,306.71	4,845,306.71
本期申购	3,832,073.27	3,832,073.27
本期赎回（以“-”号填列）	-1,545,247.73	-1,545,247.73
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	7,132,132.25	7,132,132.25

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 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	1,620,270.89	-74,378.11	1,545,892.78
本期期初	1,620,270.89	-74,378.11	1,545,892.78
本期利润	702,653.06	-685,695.20	16,957.86
本期基金份额交易产生的变动数	152,220.83	26,973.68	179,194.51
其中：基金申购款	421,303.54	5,835.59	427,139.13
基金赎回款	-269,082.71	21,138.09	-247,944.62
本期已分配利润	-	-	-

本期末	2,475,144.78	-733,099.63	1,742,045.15
-----	--------------	-------------	--------------

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	832,451.95	33,269.92	865,721.87
本期期初	832,451.95	33,269.92	865,721.87
本期利润	438,906.68	-650,033.33	-211,126.65
本期基金份额交易产生的变动数	527,931.02	153,480.80	681,411.82
其中：基金申购款	866,385.65	164,302.39	1,030,688.04
基金赎回款	-338,454.63	-10,821.59	-349,276.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,799,289.65	-463,282.61	1,336,007.04

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	8,131.27
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	2,039.05
其他	74.59
合计	10,244.91

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	717,349.12
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	717,349.12

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	11,000,346.66
减：卖出股票成本总额	10,248,077.83
减：交易费用	34,919.71
买卖股票差价收入	717,349.12

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	82,427.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	248,959.48
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	331,386.72

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	94,863,316.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	93,619,326.77
减：应计利息总额	984,760.24
减：交易费用	10,269.68
买卖债券差价收入	248,959.48

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	147,828.42
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	147,828.42

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,335,728.53
股票投资	-1,337,485.38
债券投资	1,756.85
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,335,728.53

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	4,975.86
基金转换费收入	112.59
合计	5,088.45

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	15,912.26
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	2,278.22
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	36,790.48

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银	基金托管人、基金销售机构

行”)	
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
平安信托有限责任公司	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
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”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
上海陆金所基金销售有限公司(“陆基金”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
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

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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
平安证券	-	-	6,000,000.00	13.02

6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	51,766.11	370,569.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	18,905.44	32,173.31
应支付基金管理人的净管理费	32,860.67	338,395.76

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,627.67	61,761.55

注：支付基金托管行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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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 A	平安安享灵活配置混合 C	合计
陆基金	-	93.00	93.00
平安基金	-	527.28	527.28
平安人寿	-	1,646.15	1,646.15
平安银行	-	19.80	19.80
平安证券	-	23.10	23.10
合计	-	2,309.33	2,309.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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 A	平安安享灵活配置混合 C	合计
陆基金	-	146.60	146.60
平安基金	-	44,074.49	44,074.49
平安人寿	-	1,922.93	1,922.93
平安银行	-	72.55	72.55
平安证券	-	22.17	22.17
合计	-	46,238.74	46,238.74

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,211,917.05	8,131.27	8,284,871.00	14,055.88

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

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（2024 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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：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 41.53%）。

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公司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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,211,917.05	-	-	-	1,211,917.05
结算备付金	703,751.51	-	-	-	703,751.51
存出保证金	7,360.34	-	-	-	7,360.34
交易性金融资产	-	-	-	16,634,492.87	16,634,492.87
买入返售金融资产	5,007,000.00	-	-	-	5,007,000.00
应收申购款	-	-	-	759.64	759.64
资产总计	6,930,028.90	-	-	16,635,252.51	23,565,281.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,269.45	29,269.45
应付管理人报酬	-	-	-	9,839.77	9,839.77
应付托管费	-	-	-	1,639.97	1,639.97
应付清算款	-	-	-	11,951.26	11,951.26
应付销售服务费	-	-	-	731.60	731.60
应交税费	-	-	-	4,209,096.01	4,209,096.01
其他负债	-	-	-	34,213.85	34,213.85
负债总计	-	-	-	4,296,741.91	4,296,741.91
利率敏感度缺口	6,930,028.90	-	-	12,338,510.60	19,268,539.50
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,114,623.41	-	-	-	1,114,623.41
结算备付金	36,718.32	-	-	-	36,718.32
存出保证金	31,243.96	-	-	-	31,243.96
交易性金融资产	9,149,938.39	-	8,568,886.29	2,446,975.35	20,165,800.03
应收申购款	-	-	-	27,209.29	27,209.29
资产总计	10,332,524.08	-	8,568,886.29	2,474,184.64	21,375,595.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	18,944.27	18,944.27
应付管理人报酬	-	-	-	7,935.26	7,935.26
应付托管费	-	-	-	1,322.53	1,322.53
应付清算款	-	-	-	322,776.53	322,776.53
卖出回购金融资产款	1,045,325.83	-	-	-	1,045,325.83
应付销售服务费	-	-	-	482.32	482.32
应交税费	-	-	-	4,209,101.64	4,209,101.64
其他负债	-	-	-	66,758.99	66,758.99
负债总计	1,045,325.83	-	-	4,627,321.54	5,672,647.37
利率敏感度缺口	9,287,198.25	-	8,568,886.29	-2,153,136.90	15,702,947.64

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-	-161,438.29
市场利率下降25个基点	-	163,990.47	

注：于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：本基金持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为：112.84%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：敏感性见上表数据）。

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，所面临的最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。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

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 2024年6月30日	上年度末 2023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	16,634,492.87	86.33	2,446,975.35	15.58
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	16,634,492.87	86.33	2,446,975.35	15.58

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	329,350.40	104,181.77
	沪深 300 指数下降 5%	-329,350.40	-104,181.77

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日

第一层次	16,634,492.87	2,911,250.30
第二层次	-	17,254,549.73
第三层次	-	-
合计	16,634,492.87	20,165,800.03

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	16,634,492.87	70.59
	其中：股票	16,634,492.87	70.59
2	基金投资	-	-
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	5,007,000.00	21.25
	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	1,915,668.56	8.13
8	其他各项资产	8,119.98	0.03

9	合计	23,565,281.41	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,313,578.87	84.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	320,914.00	1.67
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	16,634,492.87	86.33

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	603596	伯特利	42,620	1,657,918.00	8.60
2	601058	赛轮轮胎	109,000	1,526,000.00	7.92
3	603997	继峰股份	144,000	1,473,120.00	7.65
4	600933	爱柯迪	95,900	1,418,361.00	7.36
5	601799	星宇股份	12,500	1,400,500.00	7.27
6	000333	美的集团	18,700	1,206,150.00	6.26
7	001380	华纬科技	41,564	808,004.16	4.19

8	301160	翔楼新材	21,300	793,425.00	4.12
9	603279	景津装备	36,200	785,178.00	4.07
10	603129	春风动力	5,500	782,870.00	4.06
11	688612	威迈斯	25,838	686,515.66	3.56
12	605333	沪光股份	23,300	648,905.00	3.37
13	688533	上声电子	24,215	626,442.05	3.25
14	603529	爱玛科技	20,900	571,197.00	2.96
15	000338	潍柴动力	25,400	412,496.00	2.14
16	603278	大业股份	63,900	396,819.00	2.06
17	300750	宁德时代	2,100	378,063.00	1.96
18	300012	华测检测	31,900	320,914.00	1.67
19	002472	双环传动	14,200	312,684.00	1.62
20	002050	三花智控	12,500	238,500.00	1.24
21	603100	川仪股份	8,100	190,431.00	0.99

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	603596	伯特利	2,339,691.80	14.90
2	603997	继峰股份	1,903,460.00	12.12
3	600933	爱柯迪	1,736,411.00	11.06
4	601799	星宇股份	1,692,573.00	10.78
5	601058	赛轮轮胎	1,587,981.00	10.11
6	001380	华纬科技	1,401,946.74	8.93
7	603129	春风动力	1,307,521.00	8.33
8	605333	沪光股份	1,254,307.00	7.99
9	000333	美的集团	1,218,590.00	7.76
10	688612	威迈斯	912,782.00	5.81
11	603529	爱玛科技	880,230.00	5.61
12	688533	上声电子	865,652.22	5.51
13	301160	翔楼新材	796,265.00	5.07
14	603279	景津装备	786,359.00	5.01
15	000338	潍柴动力	726,687.00	4.63
16	603278	大业股份	619,763.00	3.95
17	002472	双环传动	513,818.00	3.27
18	300750	宁德时代	447,792.00	2.85
19	300012	华测检测	405,838.00	2.58
20	002050	三花智控	380,060.00	2.42
21	002475	立讯精密	321,984.00	2.05

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	605333	沪光股份	771,942.00	4.92
2	603596	伯特利	677,050.60	4.31
3	001380	华纬科技	669,694.00	4.26
4	603129	春风动力	641,495.00	4.09
5	002475	立讯精密	425,100.00	2.71
6	000338	潍柴动力	350,284.00	2.23
7	601225	陕西煤业	305,006.00	1.94
8	601699	潞安环能	304,230.00	1.94
9	601088	中国神华	291,321.00	1.86
10	000568	泸州老窖	283,922.00	1.81
11	600660	福耀玻璃	275,251.00	1.75
12	600026	中远海能	265,710.00	1.69
13	688533	上声电子	264,644.40	1.69
14	601702	华峰铝业	249,189.00	1.59
15	603529	爱玛科技	247,176.00	1.57
16	300856	科思股份	216,258.00	1.38
17	002318	久立特材	210,827.00	1.34
18	002472	双环传动	207,780.00	1.32
19	002014	永新股份	207,496.00	1.32
20	603997	继峰股份	201,641.00	1.28

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	25,773,080.73
卖出股票收入（成交）总额	11,000,346.66

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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 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。

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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

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库以外的股票。

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	7,360.34
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	759.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,119.98

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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	364	24,885.59	76.57	-	9,058,278.49	100.00
平安安享灵活配置混合 C	2,444	2,918.22	2,440,974.58	34.23	4,691,157.67	65.77
合计	2,779	5,826.01	2,441,051.15	15.08	13,749,436.16	84.92

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	56,480.65	0.6235
	平安安享灵活配置混合 C	273,039.09	3.8283
	合计	329,519.74	2.0353

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 (2019 年 2 月 15 日)	101,298,190.57	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	8,446,026.28	4,845,306.71
本报告期基金总申购份额	1,660,364.10	3,832,073.27
减：本报告期基金总赎回份额	1,048,035.32	1,545,247.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	9,058,355.06	7,132,132.25

§ 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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本基金本报告期内，无涉及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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
华创证券	2	29,807,955.67	81.06	21,936.04	81.06	-
国盛证券	2	3,699,134.48	10.06	2,722.16	10.06	-
中信建投证券	1	2,609,487.74	7.10	1,920.25	7.10	-
国信证券	1	656,849.50	1.79	483.39	1.79	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
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	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 (%)				的比例 (%)
华创证 券	34,144,806. 47	91.35	328,165,000. 00	77.40	-	-
国盛证 券	1,100,590.3 6	2.94	95,801,000.0 0	22.60	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	2,133,375.1 4	5.71	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券	-	-	-	-	-	-

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关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月15日
2	平安安享灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月22日
3	平安基金管理有限公司关于终止与北京微动利基金销售有限公司和北京增财基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月24日
4	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	2024年03月02日
5	平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年03月02日
6	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	2024年03月02日
7	平安基金管理有限公司关于平安安享灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年03月09日
8	平安基金管理有限公司关于旗下基金参与中国平安人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年03月15日
9	平安安享灵活配置混合型证券投资基	中国证监会规定报刊及	2024年03月29日

	金 2023 年年度报告	网站	
10	平安安享灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 22 日
11	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	2024 年 05 月 31 日
12	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	2024 年 05 月 31 日
13	平安基金管理有限公司关于暂停海银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	2024 年 06 月 01 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

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予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

2024 年 8 月 30 日