

平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 08 月 28 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 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	8
§ 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	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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
§ 5 托管人报告	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
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	16
§ 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	37
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	41

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	41
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	41
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	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	42
§ 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	43
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	43
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	平安鑫利混合	
基金主代码	003626	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 7 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,434,147.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C
下属分级基金的交易代码	003626	006433
报告期末下属分级基金的份额总额	369,122.10 份	11,065,025.04 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，本基金通过灵活的资产配置，力求在有效分散风险的同时实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金转型为开放式基金后，将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码		518048	518001
法定代表人		罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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(2020年1月1日-2020年6月30日)	
	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C
本期已实现收益	7,893.99	-12,649,365.20
本期利润	16,256.40	-12,475,298.09
加权平均基金份额本期利润	0.0762	-0.1034
本期加权平均净值利润率	7.14%	-9.70%
本期基金份额净值增长率	2.88%	2.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	32,751.88	941,096.81
期末可供分配基金份额利润	0.0887	0.0851
期末基金资产净值	413,678.71	12,358,731.59
期末基金份额净值	1.1207	1.1169
3.1.3 累计期末	报告期末(2020年6月30日)	

指标		
基金份额累计净值增长率	15.39%	7.58%

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

平安鑫利混合 A

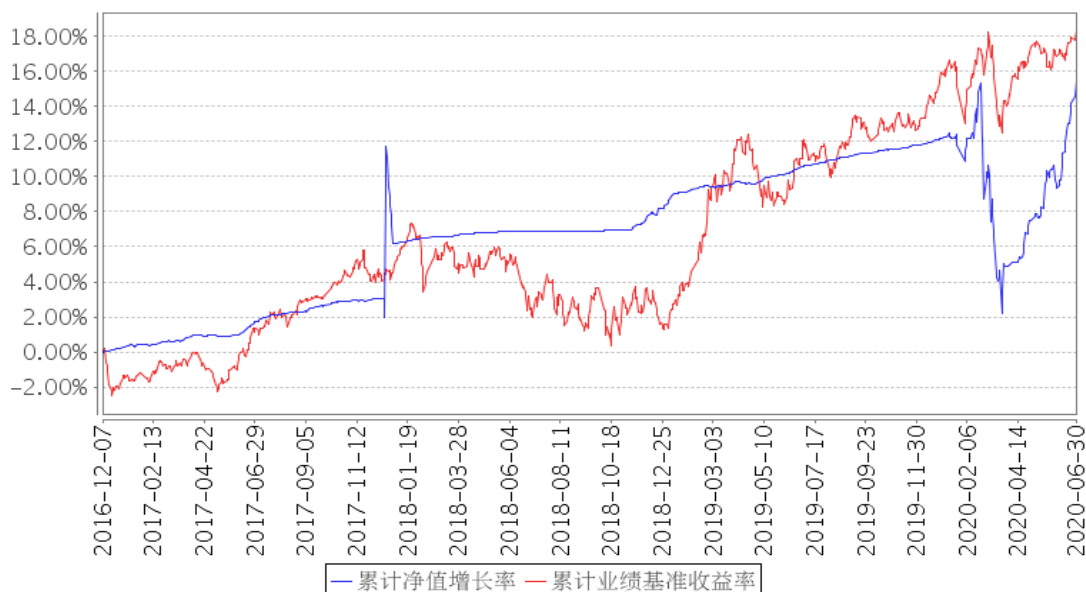
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.47%	0.36%	1.74%	0.27%	2.73%	0.09%
过去三个月	9.97%	0.29%	3.59%	0.28%	6.38%	0.01%
过去六个月	2.88%	0.68%	2.43%	0.44%	0.45%	0.24%
过去一年	4.38%	0.47%	6.56%	0.35%	-2.18%	0.12%
过去三年	13.45%	0.39%	16.70%	0.37%	-3.25%	0.02%
自基金合同生效起至今	15.39%	0.36%	18.29%	0.35%	-2.90%	0.01%

平安鑫利混合 C

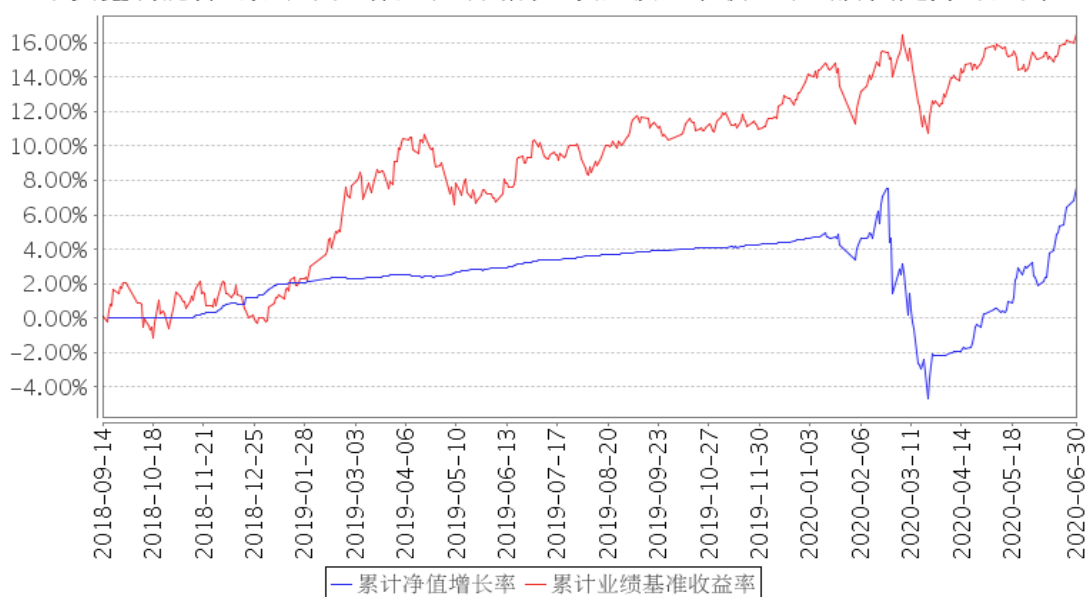
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.47%	0.36%	1.74%	0.27%	2.73%	0.09%
过去三个月	9.95%	0.29%	3.59%	0.28%	6.36%	0.01%
过去六个月	2.85%	0.68%	2.43%	0.44%	0.42%	0.24%
过去一年	4.18%	0.47%	6.56%	0.35%	-2.38%	0.12%
自基金合同生效起至今	7.58%	0.35%	16.50%	0.40%	-8.92%	-0.05%

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

平安鑫利混合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



平安鑫利混合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、本基金成立日为 2016 年 12 月 7 日；

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，建仓结束时各项资产比例已符合合同约定；

3、自 2018 年 9 月 14 日起在现有基金份额的基础上增设 C 类份额。

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。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股权 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2020 年 06 月 30 日，平安基金共管理 115 只公募基金，资产管理总规模约为 3,784 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		
段玮婧	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018 年 9 月 26 日	2020 年 2 月 11 日	13 年	段玮婧女士，中山大学硕士。曾担任中国中投证券有限责任公司投资经理。2016 年 9 月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资研究部固定收益组投资经理。现担任平安金管家货币市场基金、平安短债债券型证券投资基金、平安乐享一年定期开放债券型证券投资基金、平安乐顺 39 个月定期开放债券型证券投资基金、平安合聚 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合庆 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合兴 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
田元强	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2018 年 11 月 26 日	2020 年 1 月 17 日	7 年	田元强先生，西安交通大学工商管理硕士，曾先后担任鹏元资信评估有限公司信用评级部分析师、生命保险资产管理有限公司信用评估部分析师、中国中投证券有限责任公司研究总部分析员。2016 年 11 月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心固定收益高级研究员。现担任平安交易型货币市场基金、平安 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安如意中短债债券型证券投资基金、平安合信 3 个月定

					期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
高勇标	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020年2月11日	-	9年	高勇标先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017年4月加入平安基金管理有限公司，曾任投资研究部固定收益组投资经理，现任平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安惠鸿纯债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金、平安惠澜纯债债券型证券投资基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安增利六个月定期开放债券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。

4.2 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

上半年宏观经济开局相对平稳，市场主要矛盾是经济弱复苏，风险资产上涨，而无风险利率因流动性整体宽松并未明显调整；1 月中下旬之后，随着新型冠状病毒在中国爆发并快速蔓延，经济弱复苏的预期受到挑战；3 月份疫情在海外扩散，叠加沙俄石油价格战爆发，全球股市、商品等风险资产持续大跌，并引发海外发生流动性危机，美联储紧急救市但效果有限。在内外交困情况下，中国一季度 GDP 增速下行至-6.8%。进入二季度，随着新冠病毒继续在全球蔓延，海外主要发达国家和我国央行均采取了偏宽松的货币政策，以应对经济仍然面临的巨大不确定性。不过由于新冠病毒在我国率先得到逐步控制，国内陆续开启了复工复产，生产订单与部分需求得到集中释放，经济增速出现了逐步修复，二季度国内 GDP 增速回升至 3.2%；受上述因素影响，上半年债市收益率和股票市场基本呈先下后上的震荡走势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期平安鑫利混合 A 基金份额净值 1.1207 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.88%，同期业绩比较基准收益率为 2.43%；截至本报告期平安鑫利混合 C 基金份额净值 1.1169 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.85%，同期业绩比较基准收益率为 2.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金认为债市和股市将继续呈震荡格局。国内经济在政策催化和复工复产加速下逐步回归正常，经济和企业盈利增速逐季提升；国外，特别是欧美国家疫情拐点逐步出现，逐步着手恢复经济，但整体需求较弱，恢复还需一定时间。总体来看，经济基本面处于内需向上，外需向下的交错期，流动性维持宽松但不“泛滥”，风险偏好反复冲击、折腾。综上，本基金认为债券市场中短端品种仍有较高配置价值，长端品种有阶段性交易机会；股票市场则存在结构性行情，中长期盈利模式好的价值成长公司依然具有巨大投资机会。本基金将通过债券和股票资产的均衡配置、动态调整，获取稳健的投资收益，降低组合波动和回撤。

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工作组，由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组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。估值工作组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

本基金本报告期内出现连续 20 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。

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。

§ 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，平安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。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 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：平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,864,705.72	29,695,836.95
结算备付金		44,774.73	-
存出保证金		154,243.25	1,228.28
交易性金融资产	6.4.7.2	12,123,610.50	275,462,500.00
其中：股票投资		3,399,775.00	-
基金投资		-	-
债券投资		8,723,835.50	270,462,500.00
资产支持证券投资		-	5,000,000.00
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	40,116.95	4,139,320.31
应收股利		-	-
应收申购款		89,871.31	200.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	3,000.00	3,000.00
资产总计		14,320,322.46	309,302,085.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
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		400,000.00	-
应付证券清算款		63.34	20,138,732.68
应付赎回款		1,059,357.74	-
应付管理人报酬		5,540.32	159,635.33
应付托管费		923.38	26,605.91
应付销售服务费		882.87	26,594.75
应付交易费用	6.4.7.7	12,162.00	21,971.62
应交税费		3.71	6,313.33
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	68,978.80	181,000.00
负债合计		1,547,912.16	20,560,853.62
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	11,434,147.14	265,867,210.84
未分配利润	6.4.7.10	1,338,263.16	22,874,021.08
所有者权益合计		12,772,410.30	288,741,231.92
负债和所有者权益总计		14,320,322.46	309,302,085.54

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 11,434,147.14 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1207 元，A 类基金份额 369,122.10 份；下属 C 类基金份额净值 1.1169 元，C 类基金份额 11,065,025.04 份。

6.2 利润表

会计主体：平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 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
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-11,171,187.45	21,125,141.80
1. 利息收入		1,707,927.61	23,389,829.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	46,396.90	723,394.27
债券利息收入		1,515,797.51	21,628,740.93
资产支持证券利息收入		40,026.52	-
买入返售金融资产收入		105,706.68	1,037,693.83
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-13,075,686.73	-2,492,993.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-7,383,668.99	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-5,751,284.91	-2,492,993.56
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	52,123.29	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	7,143.88	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	182,429.52	-497,062.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	14,142.15	725,368.81
减：二、费用		1,287,854.24	7,717,162.70

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	391,114.34	2,828,220.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	65,185.74	471,370.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	65,074.90	471,246.31
4. 交易费用	6.4.7.19	528,063.13	41,653.00
5. 利息支出		155,965.43	3,767,679.14
其中：卖出回购金融资产支出		155,965.43	3,767,679.14
6. 税金及附加		3,893.66	31,572.74
7. 其他费用	6.4.7.20	78,557.04	105,420.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,459,041.69	13,407,979.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,459,041.69	13,407,979.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	265,867,210.84	22,874,021.08	288,741,231.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,459,041.69	-12,459,041.69
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）	-254,433,063.70	-9,076,716.23	-263,509,779.93
其中：1. 基金申购款	13,450,019.78	1,013,810.85	14,463,830.63
2. 基金赎回款	-267,883,083.48	-10,090,527.08	-277,973,610.56
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)	11,434,147.14	1,338,263.16	12,772,410.30
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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)	289,752,612.63	15,246,158.05	304,998,770.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,407,979.10	13,407,979.10
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)	350,993,536.29	17,566,232.32	368,559,768.61
其中：1. 基金申购款	1,787,805,115.34	109,267,971.99	1,897,073,087.33
2. 基金赎回款	-1,436,811,579.05	-91,701,739.67	-1,528,513,318.72
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)	640,746,148.92	46,220,369.47	686,966,518.39

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：

罗春风

林婉文

张南南

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

平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金(原名为平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)是根据原平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“平安大华鑫利定期开放基金”)《平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,由平安大华鑫利定期开放基

金转型而来。原平安大华华鑫利定期开放基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，原平安大华鑫利定期开放基金的第二次开放期自 2017 年 12 月 14 日起至 2017 年 12 月 20 日止，因在第二次开放期最后一日终触发本基金的转型条件，本基金自 2018 年 1 月 19 日起正式转型为平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金。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(原平安大华基金管理有限公司，已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记)，基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》，平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金。

根据《平安鑫利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《平安鑫利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，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

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》、《平安鑫利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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	1,864,705.72
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	1,864,705.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,173,196.00	3,399,775.00	226,579.00

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	785,436.24	791,035.50
	银行间市场	7,931,368.00	7,932,800.00
	合计	8,716,804.24	8,723,835.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	11,890,000.24	12,123,610.50	233,610.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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 2020年6月30日
应收活期存款利息	306.36
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	18.18
应收债券利息	39,729.86
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	62.55
合计	40,116.95

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
其他应收款	3,000.00

待摊费用	-
合计	3,000.00

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,820.62
银行间市场应付交易费用	8,341.38
合计	12,162.00

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21.76
应付证券出借违约金	-
预提费用	68,957.04
合计	68,978.80

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安鑫利混合 A

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	119,973.72	119,973.72
本期申购	710,472.54	710,472.54
本期赎回(以“-”号填列)	-461,324.16	-461,324.16
-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	369,122.10	369,122.10

平安鑫利混合 C

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	265,747,237.12	265,747,237.12
本期申购	12,739,547.24	12,739,547.24
本期赎回(以“-”号填列)	-267,421,759.32	-267,421,759.32
-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	11,065,025.04	11,065,025.04

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安鑫利混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,724.82	984.15	10,708.97
本期利润	7,893.99	8,362.41	16,256.40
本期基金份额交易产生的变动数	15,133.07	2,458.17	17,591.24
其中：基金申购款	45,712.81	6,601.62	52,314.43
基金赎回款	-30,579.74	-4,143.45	-34,723.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,751.88	11,804.73	44,556.61
平安鑫利混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,695,849.38	2,167,462.73	22,863,312.11
本期利润	-12,649,365.20	174,067.11	-12,475,298.09
本期基金份额交易产生的变动数	-7,105,387.37	-1,988,920.10	-9,094,307.47
其中：基金申购款	803,029.28	158,467.14	961,496.42
基金赎回款	-7,908,416.65	-2,147,387.24	-10,055,803.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	941,096.81	352,609.74	1,293,706.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	34,810.30
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	10,866.94
其他	719.66
合计	46,396.90

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,383,668.99
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	-7,383,668.99

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	192,981,326.83
减：卖出股票成本总额	200,364,995.82
买卖股票差价收入	-7,383,668.99

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证券出借产生的股票投资收益。

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 2020年1月1日至2020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	-5,751,284.91
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	-5,751,284.91

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
----	----

	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	756,258,856.26
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	752,791,288.02
减：应收利息总额	9,218,853.15
买卖债券差价收入	-5,751,284.91

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

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	5,125,000.00
减：卖出资产支持证券成本总额	5,000,000.00
减：应收利息总额	72,876.71
资产支持证券投资收益	52,123.29

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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,143.88
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	7,143.88

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	182,429.52
股票投资	226,579.00
债券投资	-44,149.48
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	182,429.52

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	13,593.83
基金转换费收入	548.32
合计	14,142.15

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	514,980.63
银行间市场交易费用	13,082.50
合计	528,063.13

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	25,858.56
信息披露费	34,098.48
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	78,557.04

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
平安银行	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	基金管理人的最终控股母公司

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
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
深圳联新投资管理有限公司(“深圳联新”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
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

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：本基金于本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

注：本基金于本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

注：本基金于本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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	391,114.34	2,828,220.74
其中：支付销售机构的客户维护费	175,633.71	1,169,140.80

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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/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
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	65,185.74	471,370.10

注：支付基金托管人平安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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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		
	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		
	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C	合计
陆金所	-	63,885.91	63,885.91
平安基金	-	5.62	5.62
平安人寿	-	876.79	876.79
平安证券	-	16.73	16.73
合计	-	64,785.05	64,785.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C	合计
平安基金	-	16,423.50	16,423.50
陆金所	-	454,216.14	454,216.14
平安人寿	-	328.94	328.94
合计	-	470,968.58	470,968.58

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 0.1%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 × 0.1% / 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
平安银行-活期	1,864,705.72	34,810.30	510,591.99	17,436.37

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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(2020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：截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未从事证券银行间债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

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涉及的财务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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能

性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,932,800.00	125,233,000.00
合计	7,932,800.00	125,233,000.00

注：未评级的债券投资为政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	54,134,500.00
合计	-	54,134,500.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	60,660,000.00
AAA 以下	118,027.50	30,435,000.00
未评级	673,008.00	-
合计	791,035.50	91,095,000.00

注：未评级的债券投资为政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	5,000,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	5,000,000.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额中有 400,000 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.2 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金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%,本基金与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上述比例限制)。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%。于报告期末日,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 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。于报告期末,本基金确认的净赎回申请未超过 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

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的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。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、应收申购款、存出保证金、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,864,705.72	-	-	-	1,864,705.72
结算备付金	44,774.73	-	-	-	44,774.73
存出保证金	154,243.25	-	-	-	154,243.25
交易性金融资产	8,605,808.00	-	118,027.50	3,399,775.00	12,123,610.50
应收利息	-	-	-	40,116.95	40,116.95
应收申购款	-	-	-	89,871.31	89,871.31
其他资产	-	-	-	3,000.00	3,000.00
资产总计	10,669,531.70	-	118,027.50	3,532,763.26	14,320,322.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,059,357.74	1,059,357.74
应付管理人报酬	-	-	-	5,540.32	5,540.32
应付托管费	-	-	-	923.38	923.38
应付证券清算款	-	-	-	63.34	63.34
卖出回购金融资产款	400,000.00	-	-	-	400,000.00
应付销售服务费	-	-	-	882.87	882.87
应付交易费用	-	-	-	12,162.00	12,162.00
应交税费	-	-	-	3.71	3.71
其他负债	-	-	-	68,978.80	68,978.80
负债总计	400,000.00	-	-	1,147,912.16	1,547,912.16
利率敏感度缺口	10,269,531.70	-	118,027.50	2,384,851.10	12,772,410.30
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,695,836.95	-	-	-	29,695,836.95
存出保证金	1,228.28	-	-	-	1,228.28
交易性金融资产	255,288,500.00	20,174,000.00	-	-	275,462,500.00
应收利息	-	-	-	4,139,320.31	4,139,320.31
应收申购款	-	-	-	200.00	200.00
其他资产	-	-	-	3,000.00	3,000.00
资产总计	284,985,565.23	20,174,000.00	-	4,142,520.31	309,302,085.54
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	159,635.33	159,635.33
应付托管费	-	-	-	26,605.91	26,605.91
应付证券清算款	-	-	-	20,138,732.68	20,138,732.68
应付销售服务费	-	-	-	26,594.75	26,594.75
应付交易费用	-	-	-	21,971.62	21,971.62
应交税费	-	-	-	6,313.33	6,313.33
其他负债	-	-	-	181,000.00	181,000.00
负债总计	-	-	-	20,560,853.62	20,560,853.62
利率敏感度缺口	284,985,565.23	20,174,000.00	-	-16,418,333.31	288,741,231.92

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	10,734.44	271,478.13
	2. 市场利率上升 25 个基点	-10,692.72	-270,517.70

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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素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

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。开放期内或按照《基金合同》的约定，本基金转型为开放式基金后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2020年6月30日		上年度末 2019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	3,399,775.00	26.62	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	3,399,775.00	26.62	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准增加 5%	229,074.10	-
	2. 业绩比较基准减少 5%	-229,074.10	-

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

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	3,399,775.00	23.74
	其中：股票	3,399,775.00	23.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,723,835.50	60.92
	其中：债券	8,723,835.50	60.92
	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	1,909,480.45	13.33
8	其他各项资产	287,231.51	2.01
9	合计	14,320,322.46	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	2,535,385.00	19.85
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	57,656.00	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	323,524.00	2.53
J	金融业	190,598.00	1.49
K	房地产业	215,332.00	1.69
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	77,280.00	0.61
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	3,399,775.00	26.62

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	200	292,576.00	2.29
2	002850	科达利	1,600	110,720.00	0.87
3	002695	煌上煌	4,200	105,924.00	0.83
4	300014	亿纬锂能	2,200	105,270.00	0.82
5	603899	晨光文具	1,900	103,740.00	0.81
6	300059	东方财富	4,900	98,980.00	0.77
7	600570	恒生电子	900	96,930.00	0.76
8	002508	老板电器	3,000	93,330.00	0.73
9	300760	迈瑞医疗	300	91,710.00	0.72
10	600030	中信证券	3,800	91,618.00	0.72
11	002007	华兰生物	1,800	90,198.00	0.71
12	000596	古井贡酒	600	90,144.00	0.71
13	300136	信维通信	1,700	90,134.00	0.71

14	000636	风华高科	3,000	87,570.00	0.69
15	000661	长春高新	200	87,060.00	0.68
16	002084	海鸥住工	9,500	85,975.00	0.67
17	000860	顺鑫农业	1,500	85,470.00	0.67
18	600436	片仔癀	500	85,125.00	0.67
19	002555	三七互娱	1,800	84,240.00	0.66
20	300567	精测电子	1,200	81,900.00	0.64
21	600383	金地集团	5,900	80,830.00	0.63
22	603259	药明康德	800	77,280.00	0.61
23	603866	桃李面包	1,500	76,335.00	0.60
24	002624	完美世界	1,300	74,932.00	0.59
25	600563	法拉电子	1,200	74,160.00	0.58
26	002100	天康生物	4,600	74,060.00	0.58
27	002273	水晶光电	4,300	73,702.00	0.58
28	600161	天坛生物	1,600	72,528.00	0.57
29	600201	生物股份	2,600	72,384.00	0.57
30	300724	捷佳伟创	800	70,824.00	0.55
31	002938	鹏鼎控股	1,400	70,084.00	0.55
32	300326	凯利泰	2,400	69,840.00	0.55
33	001914	招商积余	2,200	67,606.00	0.53
34	300188	美亚柏科	3,400	67,422.00	0.53
35	000631	顺发恒业	22,600	66,896.00	0.52
36	002475	立讯精密	1,300	66,755.00	0.52
37	000625	长安汽车	6,000	66,000.00	0.52
38	002311	海大集团	1,300	61,867.00	0.48
39	600009	上海机场	800	57,656.00	0.45

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	300059	东方财富	14,457,929.00	5.01
2	300750	宁德时代	9,465,103.00	3.28
3	300088	长信科技	9,181,737.00	3.18
4	300207	欣旺达	6,888,733.16	2.39
5	600438	通威股份	6,607,832.00	2.29
6	300014	亿纬锂能	6,104,897.00	2.11
7	300567	精测电子	5,298,015.56	1.83
8	300033	同花顺	4,994,333.00	1.73
9	300450	先导智能	4,988,958.00	1.73
10	300413	芒果超媒	4,924,432.40	1.71
11	300725	药石科技	4,649,417.00	1.61

12	000725	京东方 A	3,864,194.00	1.34
13	002384	东山精密	3,860,525.00	1.34
14	600048	保利地产	3,822,327.54	1.32
15	603986	兆易创新	3,523,669.00	1.22
16	300433	蓝思科技	3,051,920.10	1.06
17	603218	日月股份	3,042,659.00	1.05
18	600309	万华化学	2,827,129.40	0.98
19	000961	中南建设	2,699,591.00	0.93
20	000338	潍柴动力	2,699,563.00	0.93

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	300059	东方财富	14,094,782.82	4.88
2	300750	宁德时代	9,327,973.00	3.23
3	300088	长信科技	7,840,769.00	2.72
4	300207	欣旺达	6,358,789.00	2.20
5	600438	通威股份	6,164,087.00	2.13
6	300014	亿纬锂能	5,394,773.00	1.87
7	300567	精测电子	5,120,249.00	1.77
8	300450	先导智能	4,785,459.00	1.66
9	300033	同花顺	4,784,703.00	1.66
10	300725	药石科技	4,496,985.00	1.56
11	300413	芒果超媒	4,476,643.00	1.55
12	000725	京东方 A	3,780,697.00	1.31
13	600048	保利地产	3,774,403.00	1.31
14	002384	东山精密	3,758,569.00	1.30
15	603986	兆易创新	3,250,883.00	1.13
16	300482	万孚生物	2,889,459.00	1.00
17	603218	日月股份	2,869,626.90	0.99
18	300433	蓝思科技	2,860,493.45	0.99
19	300559	佳发教育	2,792,802.18	0.97
20	603378	亚士创能	2,719,192.00	0.94

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	203,538,191.82
卖出股票收入（成交）总额	192,981,326.83

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,605,808.00	67.38
	其中：政策性金融债	8,605,808.00	67.38
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）	118,027.50	0.92
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,723,835.50	68.30

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	200206	20 国开 06	80,000	7,932,800.00	62.11
2	018007	国开 1801	6,720	673,008.00	5.27
3	128108	蓝帆转债	750	118,027.50	0.92

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

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

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	154,243.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,116.95
5	应收申购款	89,871.31
6	其他应收款	3,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	287,231.51

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：持有股票但前十名不存在受限流通情况。

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	持有人户	户均持有的	持有人结构
---	------	-------	-------

额 级 别	数（户）	基金份额	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 （%）
平安鑫利混合 A	373	989.60	-	-	369,122.10	100.00
平安鑫利混合 C	1,099	10,068.27	-	-	11,065,025.04	100.00
合计	1,472	7,767.76	-	-	11,434,147.14	100.00

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	平安鑫利混合 A	-	-
	平安鑫利混合 C	104.66	0.0009
	合计	104.66	0.0009

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	平安鑫利混合 A	0
	平安鑫利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安鑫利混合 A	0
	平安鑫利混合 C	0

	合计	0
--	----	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C
基金合同生效日 (2016 年 12 月 7 日) 基金份额总额	200,058,990.97	-
本报告期期初基金份 额总额	119,973.72	265,747,237.12
本报告期基金总申购 份额	710,472.54	12,739,547.24
减：本报告期基金总 赎回份额	461,324.16	267,421,759.32
本报告期基金拆分变 动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期末基金份 额总额	369,122.10	11,065,025.04

§ 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

1、副总经理汪涛因个人原因提出辞任，经公司第三届董事会第十九次会议审议通过，离任日期为 2020 年 2 月 28 日。

2、2020 年 5 月公司董事会换届，经公司 2020 年第三次股东会审议通过，陈宁、马琳接替姚波、陈敬达成为公司新任董事，任职日期为 2020 年 5 月 27 日。

3、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内本基金投资策略未改变。

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	
长江证券	1	115,024,994.54	29.02%	81,817.18	29.02%	-
银河证券	2	69,465,786.79	17.53%	49,410.84	17.53%	-
天风证券	2	61,267,220.75	15.46%	43,579.49	15.46%	-
中信证券	3	48,843,617.95	12.32%	34,742.18	12.32%	-
东兴证券	2	33,071,342.99	8.34%	23,523.42	8.34%	-
安信证券	3	19,779,439.36	4.99%	14,067.79	4.99%	-
光大证券	2	18,898,054.05	4.77%	13,443.00	4.77%	-
兴业证券	1	16,189,062.96	4.08%	11,515.16	4.08%	-
东吴证券	2	9,923,794.00	2.50%	7,058.77	2.50%	-
方正证券	2	1,739,243.12	0.44%	1,237.19	0.44%	-
华创证券	2	906,313.00	0.23%	644.57	0.23%	-
中信建投证券	2	444,793.00	0.11%	316.39	0.11%	-
申万宏源证券	2	418,923.00	0.11%	297.98	0.11%	-
华泰证券	2	401,582.35	0.10%	285.67	0.10%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-

川财证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	7	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	已退 租
国联证券	2	-	-	-	-	已退 租
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	4	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	已退 租
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	已退 租
西南证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

中银国际证 券	1	-	-	-	-	-
------------	---	---	---	---	---	---

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
长江证券	34,356,747.84	9.25%	-	-	-	-
银河证券	49,515,038.09	13.33%	1,449,000.00	0.15%	-	-
天风证券	67,291,057.04	18.11%	215,100,000.00	21.61%	-	-
中信证券	33,644,828.30	9.06%	489,000,000.00	49.13%	-	-
东兴证券	13,552,547.63	3.65%	-	-	-	-
安信证券	10,692,832.10	2.88%	84,500,000.00	8.49%	-	-
光大证券	31,640,497.79	8.52%	195,000,000.00	19.59%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	7,124,999.58	1.92%	-	-	-	-
方正证券	1,373,814.71	0.37%	-	-	-	-
华创证券	419,074.30	0.11%	3,800,000.00	0.38%	-	-
中信建投 证券	234,994.10	0.06%	1,400,000.00	0.14%	-	-
申万宏源 证券	3,932,935.00	1.06%	600,000.00	0.06%	-	-
华泰证券	999,249.42	0.27%	2,400,000.00	0.24%	-	-
-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发华福 证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	400,000.00	0.04%	-	-
国信证券	116,250,600.00	31.29%	-	-	-	-
海通证券	458,468.88	0.12%	1,600,000.00	0.16%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 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旗下部分基金新增浙江同花顺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	2020年1月10日
2	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金2019年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月17日
3	关于平安鑫利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	2020年1月18日
4	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(摘要)	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月18日
5	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基	中国证监会规定报刊及	2020年1月18日

	金招募说明书更新	网站	
6	平安鑫利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	2020 年 2 月 12 日
7	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（摘要）	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 2 月 12 日
8	平安鑫利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	2020 年 2 月 12 日
9	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷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	2020 年 2 月 20 日
10	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海好买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	2020 年 2 月 20 日
11	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京苏宁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	2020 年 2 月 24 日
12	关于新增上海好买基金销售有限公司为平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 2 月 26 日
13	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京虹点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	2020 年 2 月 26 日
14	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承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	2020 年 2 月 28 日
15	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 2 月 29 日
16	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增弘业期货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	2020 年 3 月 3 日
17	平安基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 3 月 27 日
18	关于平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金开放日常转换与定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 8 日
19	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 21 日
20	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得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	2020 年 4 月 24 日
21	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 29 日
22	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信证券华南为销售机构及	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 5 月 6 日

	开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告		
23	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成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	2020 年 5 月 21 日
24	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增喜鹊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	2020 年 5 月 26 日
25	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金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	2020 年 6 月 1 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

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鑫利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内在规定报刊以及规定网站上披露的各项公告。

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) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>。

平安基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日