

平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF) 2022年第2季度报告

2022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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022年7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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 07 月 19 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 2022 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安鼎弘混合 (LOF)		
场内简称	鼎弘 LOF		
基金主代码	167003		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017 年 4 月 26 日		
报告期末基金份额总额	7,469,659.57 份		
投资目标	本基金转为上市开放式基金 (LOF) 后，通过合理配置大类资产和精选投资标的，在严格控制下行风险和保持资产流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。		
投资策略	本基金转为上市开放式基金 (LOF) 后，在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件，将事件性因素作为投资的主线，形成以事件驱动为核心的投资策略。		
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*80%		
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。		
基金管理人	平安基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	平安鼎弘混合 (LOF) A	平安鼎弘混合 C	平安鼎弘混合 D
下属分级基金的交易代码	167003	010228	010229
报告期末下属分级基金的份额总额	7,469,337.53 份	147.42 份	174.62 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 (2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)		
	平安鼎弘混合 (LOF) A	平安鼎弘混合 C	平安鼎弘混合 D
1. 本期已实现收益	-57,306.07	-1.02	-1.55
2. 本期利润	302,628.82	6.09	6.81
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0403	0.0411	0.0390
4. 期末基金资产净值	8,259,896.19	162.93	193.05
5. 期末基金份额净值	1.1058	1.1052	1.1055

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. 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

平安鼎弘混合 (LOF) 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	3.79%	0.42%	2.16%	0.28%	1.63%	0.14%
过去六个月	-0.67%	0.39%	-0.29%	0.29%	-0.38%	0.10%
过去一年	-1.65%	0.49%	1.04%	0.25%	-2.69%	0.24%
过去三年	3.98%	0.42%	15.10%	0.25%	-11.12%	0.17%
过去五年	9.66%	0.36%	26.52%	0.25%	-16.86%	0.11%
自基金合同生效起至今	10.58%	0.36%	28.73%	0.25%	-18.15%	0.11%

平安鼎弘混合 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	3.88%	0.42%	2.16%	0.28%	1.72%	0.14%

过去六个月	-0.60%	0.39%	-0.29%	0.29%	-0.31%	0.10%
过去一年	-1.62%	0.49%	1.04%	0.25%	-2.66%	0.24%
自基金合同生效起至今	1.83%	0.45%	5.85%	0.25%	-4.02%	0.20%

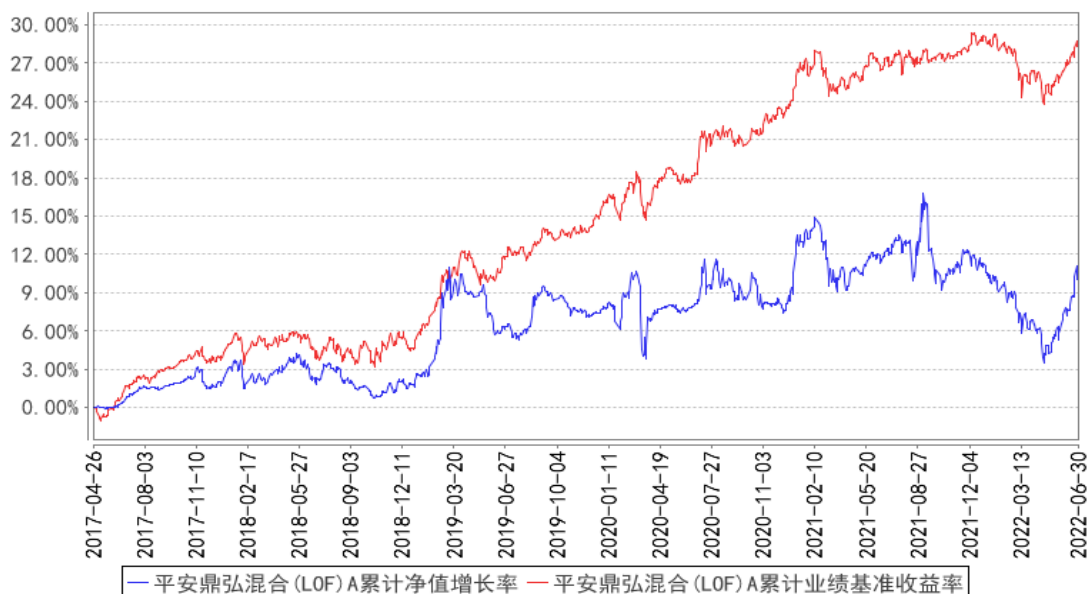
平安鼎弘混合 D

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	3.66%	0.42%	2.16%	0.28%	1.50%	0.14%
过去六个月	-0.84%	0.39%	-0.29%	0.29%	-0.55%	0.10%
过去一年	-1.75%	0.49%	1.04%	0.25%	-2.79%	0.24%
自基金合同生效起至今	1.86%	0.45%	5.85%	0.25%	-3.99%	0.20%

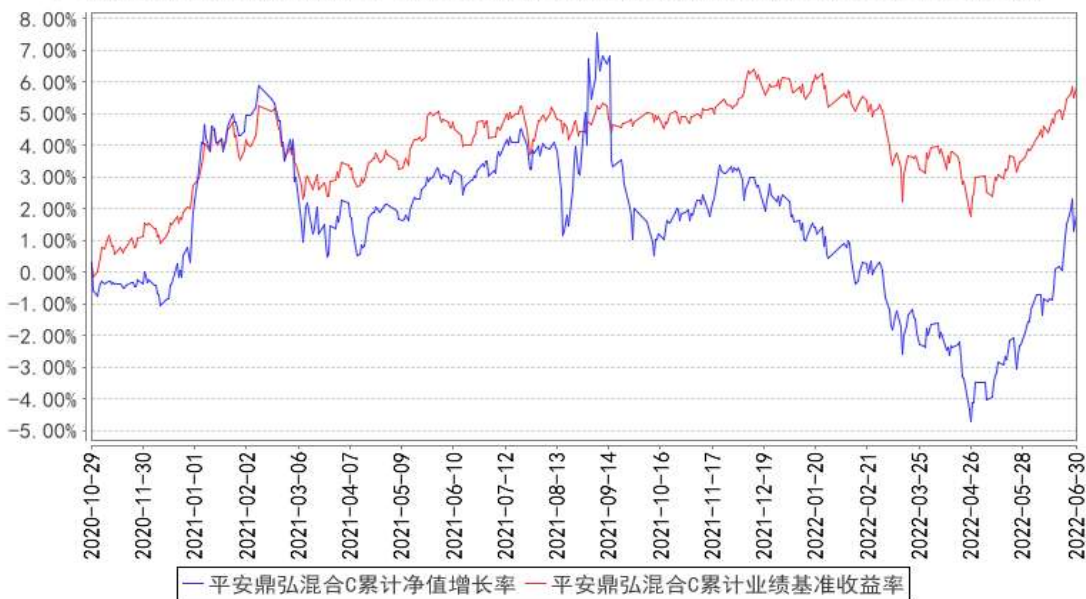
注：平安鼎弘 C 类和 D 类份额“自基金合同生效起至今”均指 2020 年 10 月 29 日至 2022 年 06 月 30 日

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

平安鼎弘混合 (LOF) 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



平安鼎弘混合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



平安鼎弘混合D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 2017 年 4 月 26 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、本基金于 2020 年 10 月 27 日增设 C 类和 D 类份额，C 类和 D 类份额都是从 2020 年 10 月 29 日开始有份额，所以以上 C 类和 D 类份额走势图均从 2020 年 10 月 29 日开始。

§ 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		
曾小丽	平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)基金经理	2021年12月2日	-	10年	曾小丽女士,中国人民大学世界经济专业硕士,曾先后担任大公国际资信评估有限公司信用评审委员、信用分析师、光大保德信基金管理有限公司基金经理兼固收研究团队联席团队队长。2021年8月加入平安基金管理有限公司,现任平安鼎信债券型证券投资基金、平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安3-5年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安双债添益债券型证券投资基金、平安合享1年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安添利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。

4.1.1 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

二季度受疫情影响，经济下行压力加大，债券市场收益率整体呈区间震荡走势，短端表现好于中长端。具体来看，4 月利率债期限结构走陡，短端下行，长端上行；信用债利率下降较快。当月央行虽未降低公开市场操作利率，但资金利率中枢明显下移，月度均值大幅低于此前各月，在隔夜市场表现尤为显著。5 月因为票据利率再度走低，PMI 数据不佳，资金面持续宽松，债券配置需求旺盛，从信用到利率，均表现为利率下行、市场走牛。6 月由于 PMI 数据超预期，上海疫情得到控制，美联储加息预期升温，权益市场持续走好等，利率整体以窄幅震荡为主，曲线略有扁平，信用利差有所走阔。

权益市场方面，4 月 A 股在上海疫情升级和人民币汇率快速贬值的双重打击下，所有行业和板块指数普跌，上证综指下探 2900 点下方，市场情绪降至冰点。随着 5 月疫情逐渐缓解，人民币转为高位震荡，地产基建的政策开始加快落地，市场情绪开始修复，5-6 月股指连续反弹，上证指数重新回到 3400 点附近。整体看，二季度 Wind 全 A 上涨 5.10%，创业板指上涨 5.68%，沪深 300 上涨 6.21%，中证 500 上涨 2.04%；风格上来看，市值因子大盘风格略占优于中小盘；成长风格的表现强于价值风格。转债指数跟随权益市场波动，中证转债指数 4 月份下跌 1.4%，5 月和 6 月分别反弹 2.26%和 3.82%。

二季度本基金纯债部分主要配置高等级信用债获取票息收益，同时阶段性通过长久期利率债提高久期获取资本利得收益。转债部分，一方面优选估值合理的优质个券，另一方面通过量化策略优选性价比较高的低价券进行配置。权益部分，均衡配置，主要配置景气度向上、估值合理的行业和公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安鼎弘混合 (LOF) A 的基金份额净值 1.1058 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.79%，同期业绩比较基准收益率为 2.16%；截至本报告期末平安鼎弘混合 C 的基金份额净值 1.1052 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.88%，同期业绩比较基准收益率为 2.16%；截至本报告期末平安鼎弘混合 D 的基金份额净值 1.1055 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.66%，同期业绩比较基准收益率为 2.16%。

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	2,012,984.40	20.99
	其中：股票	2,012,984.40	20.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,336,941.50	76.49
	其中：债券	7,336,941.50	76.49
	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	232,306.90	2.42
8	其他资产	9,987.77	0.10
9	合计	9,592,220.57	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

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	67,226.00	0.81
B	采矿业	33,558.00	0.41
C	制造业	1,460,242.40	17.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	57,344.00	0.69
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	174,464.00	2.11
H	住宿和餐饮业	25,160.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,670.00	0.56
J	金融业	47,244.00	0.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	69,879.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	31,197.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	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	2,012,984.40	24.37

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

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	601888	中国中免	300	69,879.00	0.85
2	601012	隆基绿能	980	65,297.40	0.79
3	601111	中国国航	5,500	63,855.00	0.77
4	600702	舍得酒业	300	61,197.00	0.74
5	300896	爱美客	100	60,001.00	0.73
6	603799	华友钴业	600	57,372.00	0.69
7	688005	容百科技	400	51,776.00	0.63
8	002709	天赐材料	800	49,648.00	0.60
9	300438	鹏辉能源	800	49,160.00	0.60
10	300059	东方财富	1,860	47,244.00	0.57

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	667,439.32	8.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,418,714.95	53.49
	其中：政策性金融债	4,418,714.95	53.49
4	企业债券	709,347.50	8.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,541,439.73	18.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,336,941.50	88.82

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	150205	15国开05	20,000	2,089,880.00	25.30
2	018008	国开1802	12,050	1,271,652.35	15.39

3	190208	19 国开 08	10,000	1,053,606.30	12.76
4	019658	21 国债 10	6,150	626,776.83	7.59
5	149078	20 厦贸 02	4,000	404,609.51	4.90

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投资。

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

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）8 号处罚决定，由于国家开发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、

未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差；五、未报送债券投资业务 EAST 数据；六、漏报权益类投资业务 EAST 数据；七、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；八、漏报保函业务 EAST 数据；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、漏报授信信息 EAST 数据；十三、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、EAST 系统《关联关系》表漏报；十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报；十七、理财产品登记不规范，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对国家开发银行罚款 440 万元。

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,959.49
2	应收证券清算款	8,028.28
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,987.77

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123105	拓尔转债	65,198.38	0.79
2	113527	维格转债	61,449.73	0.74
3	123132	回盛转债	60,460.92	0.73
4	113530	大丰转债	58,492.81	0.71
5	113635	升 21 转债	51,189.39	0.62

6	123100	朗科转债	50,514.70	0.61
7	128087	孚日转债	50,295.84	0.61
8	128075	远东转债	49,174.36	0.60
9	128066	亚泰转债	47,366.63	0.57
10	123103	震安转债	44,001.09	0.53
11	113629	泉峰转债	40,258.27	0.49
12	127045	牧原转债	38,699.95	0.47
13	128120	联诚转债	38,590.54	0.47
14	118003	华兴转债	38,313.21	0.46
15	113030	东风转债	38,077.27	0.46
16	123075	贝斯转债	37,616.08	0.46
17	110079	杭银转债	37,584.72	0.46
18	113602	景20转债	37,515.89	0.45
19	113565	宏辉转债	37,351.19	0.45
20	128042	凯中转债	37,066.40	0.45
21	128044	岭南转债	34,786.60	0.42
22	127038	国微转债	33,477.68	0.41
23	113504	艾华转债	32,469.47	0.39
24	123022	长信转债	32,449.04	0.39
25	113637	华翔转债	28,517.49	0.35
26	110038	济川转债	28,466.93	0.34
27	118000	嘉元转债	28,135.67	0.34
28	113598	法兰转债	26,113.48	0.32
29	110053	苏银转债	25,195.90	0.31
30	128023	亚太转债	25,100.91	0.30
31	113546	迪贝转债	24,830.03	0.30
32	113017	吉视转债	22,914.30	0.28
33	110074	精达转债	17,622.56	0.21
34	123078	飞凯转债	17,045.41	0.21
35	128140	润建转债	16,100.09	0.19
36	113620	傲农转债	14,194.38	0.17
37	113566	翔港转债	12,450.35	0.15
38	113524	奇精转债	12,174.42	0.15

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：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安鼎弘混合 (LOF) A	平安鼎弘混合 C	平安鼎弘混合 D
报告期期初基金份额总额	7,512,735.02	147.42	174.62
报告期期间基金总申购份额	21,022.05	19.00	-
减:报告期期间基金总赎回份额	64,419.54	19.00	-
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	7,469,337.53	147.42	174.62

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)募集注册的文件
- (2) 平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)基金合同
- (3) 平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 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：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2022年7月20日