

平安匠心优选混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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

送出日期：2023 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 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	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	9
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	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	11
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 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44

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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安匠心优选混合型证券投资基金	
基金简称	平安匠心优选混合	
基金主代码	008949	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 2 月 21 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	
报告期末基金份额总额	844,372,774.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C
下属分级基金的交易代码	008949	008950
报告期末下属分级基金的份额总额	761,339,561.86 份	83,033,212.83 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越基金业绩比较基准的资本增值。
投资策略	本基金通过定量、定性相结合的方法分析宏观经济、财政及货币政策、市场情绪、行业周期、资金供需情况等因素综合分析以及对资本市场发展趋势的判断，在评价未来一段时间各类的预期风险收益率、相关性的基础上，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	许俊
	联系电话	0755-22626828	010-66596688
	电子邮箱	funds@pingan.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	518048	100818
法定代表人	罗春风	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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(2023年1月1日-2023年6月30日)		
	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C	
本期已实现收益	-26,087,742.27	-3,177,138.57	
本期利润	13,455,567.42	1,079,177.93	
加权平均基金份额本期利润	0.0173	0.0126	
本期加权平均净值利润率	1.65%	1.23%	
本期基金份额净值增长率	1.34%	0.94%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)		
	期末可供分配利润	23,855,511.44	371,481.49
	期末可供分配基金份额利润	0.0313	0.0045
	期末基金资产净值	785,195,073.30	83,404,694.32
	期末基金份额净值	1.0313	1.0045

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	25.00%	21.69%

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

平安匠心优选混合 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	0.53%	1.21%	1.02%	0.65%	-0.49%	0.56%
过去三个月	-4.11%	0.99%	-3.37%	0.62%	-0.74%	0.37%
过去六个月	1.34%	0.93%	0.25%	0.63%	1.09%	0.30%
过去一年	-12.30%	1.10%	-9.74%	0.74%	-2.56%	0.36%
过去三年	5.47%	1.57%	-1.92%	0.90%	7.39%	0.67%
自基金合同生效起至今	25.00%	1.57%	-1.21%	0.91%	26.21%	0.66%

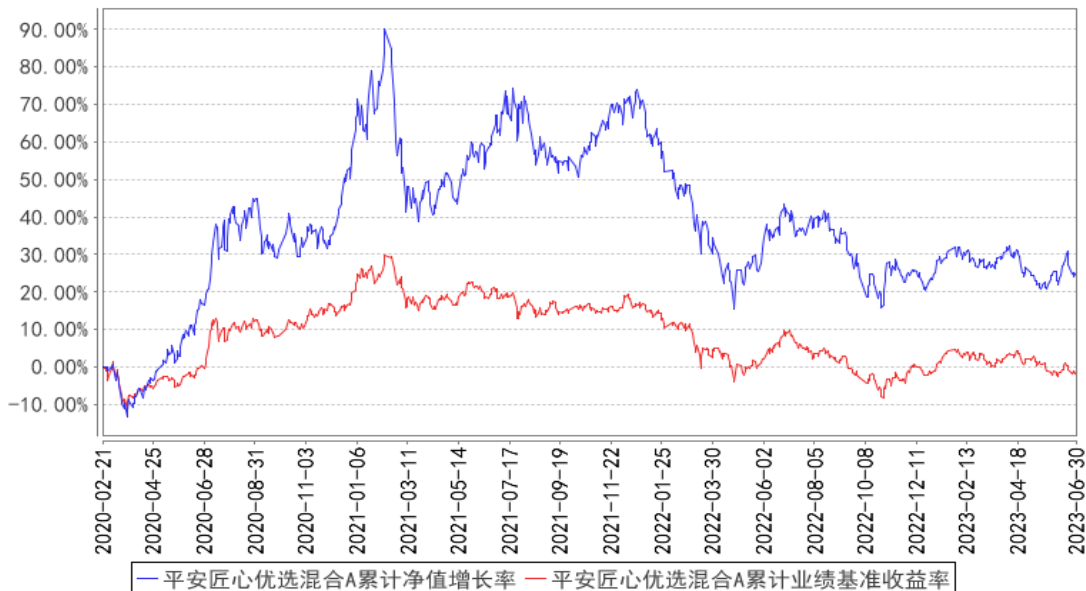
平安匠心优选混合 C

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	0.47%	1.21%	1.02%	0.65%	-0.55%	0.56%
过去三个月	-4.30%	0.99%	-3.37%	0.62%	-0.93%	0.37%
过去六个月	0.94%	0.93%	0.25%	0.63%	0.69%	0.30%
过去一年	-12.99%	1.10%	-9.74%	0.74%	-3.25%	0.36%
过去三年	2.98%	1.57%	-1.92%	0.90%	4.90%	0.67%
自基金合同生效	21.69%	1.57%	-1.21%	0.91%	22.90%	0.66%

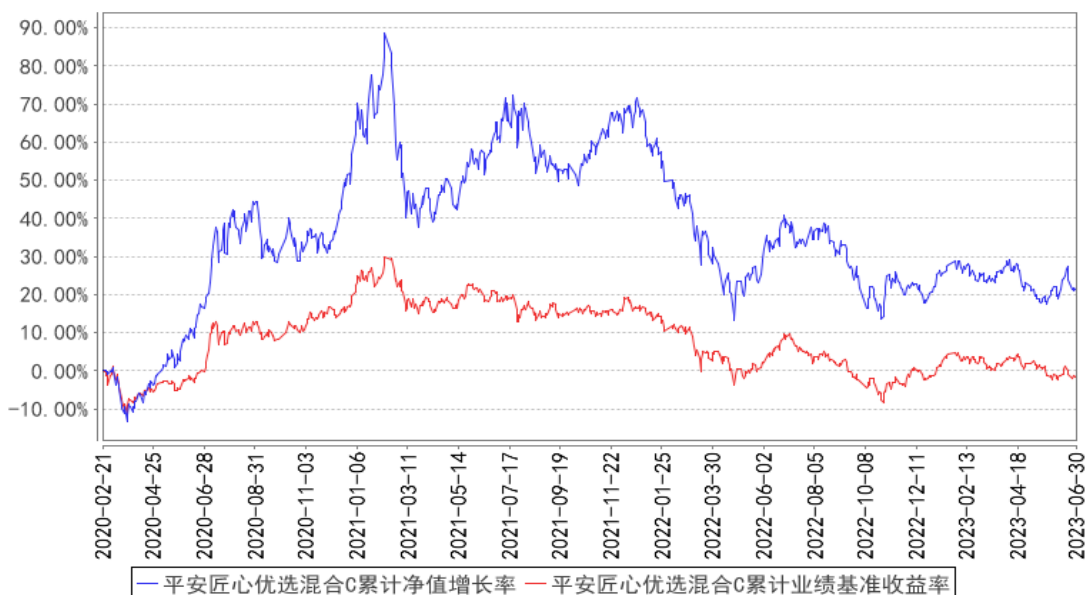
起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

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

平安匠心优选混合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



平安匠心优选混合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、本基金合同于 2020 年 02 月 21 日生效；

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。

3.3 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、海外、专户七大业务板块（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 2023 年 6 月 30 日，平安基金共管理 186 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5,721.58 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		
张淼	权益投资中心投资执行总经理，平安匠心优选混合型证券投资基金基金经理	2021 年 10 月 26 日	-	18 年	张淼女士，清华大学公共管理专业硕士。曾历任北京中关村科技控股有限公司投资管理部研究员、东方基金管理有限责任公司行业研究员，基金经理助理、嘉实基金管理有限公司研究部副总监。2021 年 6 月加入平安基金管理有限公司，现任权益投资中心投资执行总经理，同时担任平安匠心优选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

上半年市场跌宕起伏，主要是对于经济复苏预期以及海外加息进度的调整，年初各项指标显示经济强复苏，同时叠加市场认为美国加息很快结束，因此与总量相关的板块带动市场强劲上涨，但进入 3-4 月份，两会对于今年经济增长目标的制定略低于市场预期，同时硅谷银行事件，使得市场风险偏好下降，微观指标也将投资者带回弱复苏的现实，市场开始调整，ChatGPT 相关板块随着算力需求增加、各种大模型不断推出，带动 TMT 上涨。6 月份之后，陆续有稳经济政策出台，市场悲观预期开始逐步扭转，市场逐步有企稳迹象。

从操作的角度来看，组合整体仓位以及持仓的大方向没有发生太大变化，我们一直在科技、制造、消费医药几个领域积极寻找机会，上半年在 AI 相关领域没有重配，也错失了一些机会。在 TMT 板块，用面板材料和设备替代了消费电子的持仓，主要原因还是希望寻找行业空间大，竞争格局相对较好的标的，同时这些公司也在积极拥抱 AI，但我们还是希望从公司质地以及是否能够打开更大的空间角度去寻找标的。医药板块也是基于竞争格局、产品周期以及长期短期业绩确定性，结合估值在内部做了个股置换。我们认为中国消费市场空间巨大，但在总量经济有压力的情况下，消费表现不佳，制造板块，我们看好汽车零部件在未来整车行业变革过程中的阿尔法机会，因此

一直都保持着零部件的持仓，在上半年获得超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安匠心优选混合 A 的基金份额净值 1.0313 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.34%，同期业绩比较基准收益率为 0.25%；截至本报告期末平安匠心优选混合 C 的基金份额净值 1.0045 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.94%，同期业绩比较基准收益率为 0.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 6 月份之后，稳经济政策开始陆续出台，经济开始有逐步企稳的迹象，工业企业盈利增速负值进一步收窄。7 月下旬将召开政治局会议，市场对经济复苏有所期待。海外情况，其实今年以来市场一直低估了美国经济的韧性以及美联储加息的幅度，6 月份会议美联储给的指引是年内再加息两次，7 月份加息之后，美联储的加息可能接近尾声，那么将有助于资金回流 A 股。

我们对于今年的市场不悲观，对于板块配置，今年以来组合一直保持在四个重点领域，相对均衡，展望下半年，依然会是这种思路，只是在 4 季度可能会增加总量相关的个股配置，另外半导体板块，下半年可以积极寻找明年进入行业以及产品周期向上的子领域。科技制造领域，尽量去寻找子行业空间大，中国制造业其实走过了模仿制造进入研发制造的阶段，竞争力凸显。医药板块在经历了前期调整之后，积极寻找创新药领域的机会。这些领域的优质公司能够迎来更快的增长。耐心持有，陪伴优质公司成长。

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、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安匠心优选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：平安匠心优选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	82,618,801.00	60,790,415.21
结算备付金		1,154,700.53	2,011,114.38
存出保证金		86,750.74	201,911.58
交易性金融资产	6.4.7.2	798,631,836.24	869,075,936.77
其中：股票投资		798,631,836.24	869,075,936.77

基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		822,923.60	11,807,381.18
应收股利		608,831.58	-
应收申购款		44,001.62	50,164.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		883,967,845.31	943,936,923.95
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2023年6月30日	2022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		-	-
应付清算款		12,973,495.73	19.35
应付赎回款		326,304.80	354,569.36
应付管理人报酬		1,081,686.09	1,206,121.09
应付托管费		180,281.02	201,020.21
应付销售服务费		55,364.84	61,244.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	750,945.21	1,164,802.66
负债合计		15,368,077.69	2,987,777.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	844,372,774.69	926,588,165.17
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	24,226,992.93	14,360,981.52
净资产合计		868,599,767.62	940,949,146.69
负债和净资产总计		883,967,845.31	943,936,923.95

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 844,372,774.69 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0313 元，基金份额 761,339,561.86 份；C 类基金份额净值 1.0045 元，基金份额 83,033,212.83 份。

6.2 利润表

会计主体：平安匠心优选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		22,869,560.14	-266,336,204.44
1. 利息收入		143,298.60	281,630.39
其中：存款利息收入	6.4.7.13	143,298.60	281,630.39
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-21,096,183.76	-176,720,934.48
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-27,001,724.52	-181,418,426.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	5,905,540.76	4,697,491.74
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	43,799,626.19	-90,171,605.05
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	22, 819. 11	274, 704. 70
减：二、营业总支出		8, 334, 814. 79	11, 706, 437. 75
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	6, 747, 145. 81	9, 499, 561. 89
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1, 124, 524. 36	1, 583, 260. 31
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	349, 022. 70	487, 444. 39
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	114, 121. 92	136, 171. 16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14, 534, 745. 35	-278, 042, 642. 19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14, 534, 745. 35	-278, 042, 642. 19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14, 534, 745. 35	-278, 042, 642. 19

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安匠心优选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	926, 588, 165. 17	-	14, 360, 981. 52	940, 949, 146. 69
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	926, 588, 165. 17	-	14, 360, 981. 52	940, 949, 146. 69
三、本期	-82, 215, 390. 48	-	9, 866, 011. 41	-72, 349, 379. 07

增减变动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	14,534,745.35	14,534,745.35
（二）、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）	-82,215,390.48	-	-4,668,733.94	-86,884,124.42
其中：1. 基金申购款	11,830,156.15	-	480,107.37	12,310,263.52
2. 基金赎回款	-94,045,546.63	-	-5,148,841.31	-99,194,387.94
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	844,372,774.69	-	24,226,992.93	868,599,767.62
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	1,138,766,033.85	-	465,870,669.78	1,604,636,703.63

产（基金净值）				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产（基金净值）	1,138,766,033.85	-	465,870,669.78	1,604,636,703.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-104,195,183.63	-	-285,880,603.90	-390,075,787.53
（一）、综合收益总额	-	-	-278,042,642.19	-278,042,642.19
（二）、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）	-104,195,183.63	-	-7,837,961.71	-112,033,145.34
其中：1. 基金申购款	97,806,478.55	-	22,554,653.43	120,361,131.98
2. 基金赎回款	-202,001,662.18	-	-30,392,615.14	-232,394,277.32
（三）、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）	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,034,570,850.22	-	179,990,065.88	1,214,560,916.10

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

平安匠心优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1894号《关于准予平安匠心优选混合型证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安匠心优选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币5,343,782,789.97元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0026号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安匠心优选混合型证券投资基金基金合同》于2020年2月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,344,719,094.15份基金份额,其中认购资金利息折合936,304.18份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《平安匠心优选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,但不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额,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《平安匠心优选混合型证券投资基金基金合同》

的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、港股通标的股票、衍生工具(股指期货、国债期货、股票期权等)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券等)、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、现金等，以及法律法规或中国证监会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。本基金可以根据有关法律法规的规定进行转融通证券出借业务交易。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。

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》、《平安匠心优选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。

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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 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

本基金本报告期末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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	82,618,801.00
等于：本金	82,611,210.22
加：应计利息	7,590.78
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	82,618,801.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	802,753,126.82	-	798,631,836.24	-4,121,290.58

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	802,753,126.82	-	798,631,836.24	-4,121,290.58	

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

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.48
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	651,232.30
其中：交易所市场	651,232.30
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,711.43
合计	750,945.21

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安匠心优选混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	836,369,271.42	836,369,271.42
本期申购	8,036,379.92	8,036,379.92
本期赎回（以“-”号填列）	-83,066,089.48	-83,066,089.48
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	761,339,561.86	761,339,561.86

平安匠心优选混合 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	90,218,893.75	90,218,893.75
本期申购	3,793,776.23	3,793,776.23

本期赎回（以“-”号填列）	-10,979,457.15	-10,979,457.15
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	83,033,212.83	83,033,212.83

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

平安匠心优选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	438,902,464.60	-424,102,272.71	14,800,191.89
本期利润	-26,087,742.27	39,543,309.69	13,455,567.42
本期基金份额交易产生的变动数	-38,683,386.35	34,283,138.48	-4,400,247.87
其中：基金申购款	4,055,145.92	-3,663,679.65	391,466.27
基金赎回款	-42,738,532.27	37,946,818.13	-4,791,714.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	374,131,335.98	-350,275,824.54	23,855,511.44

平安匠心优选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	44,825,404.28	-45,264,614.65	-439,210.37
本期利润	-3,177,138.57	4,256,316.50	1,079,177.93
本期基金份额交易产生的变动数	-3,435,644.64	3,167,158.57	-268,486.07
其中：基金申购款	1,793,819.00	-1,705,177.90	88,641.10
基金赎回款	-5,229,463.64	4,872,336.47	-357,127.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,212,621.07	-37,841,139.58	371,481.49

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	121,786.19
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	20,261.05
其他	1,251.36
合计	143,298.60

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-27,001,724.52
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	-27,001,724.52

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	836,788,471.84
减：卖出股票成本总额	861,525,990.50
减：交易费用	2,264,205.86
买卖股票差价收入	-27,001,724.52

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,905,540.76
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	5,905,540.76

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	43,799,626.19

股票投资	43,799,626.19
债券投资	-
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	43,799,626.19

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	10,041.82
基金转换费收入	12,777.29
合计	22,819.11

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 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,146.54
账户维护费	9,000.00
其他	2,763.95
合计	114,121.92

6.4.7.24 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
方正证券	31,912,171.11	2.02	-	-
平安证券	7,349,622.00	0.46	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
方正证券	28,626.54	2.34	28,626.54	4.40
平安证券	6,844.61	0.56	6,844.61	1.05
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	6,747,145.81
其中：支付销售机构的客户维护 费	2,123,339.04	2,965,181.25

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 1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6	上年度可比期间 2022年1月1日至2022

	月 30 日	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1, 124, 524. 36	1, 583, 260. 31

注：支付基金托管行中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25%/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 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		
	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C	合计
陆基金	-	45, 548. 25	45, 548. 25
平安基金	-	73. 57	73. 57
平安人寿	-	180, 533. 59	180, 533. 59
平安银行	-	21, 755. 67	21, 755. 67
平安证券	-	3, 223. 67	3, 223. 67
中国银行	-	25, 825. 20	25, 825. 20
合计	-	276, 959. 95	276, 959. 95
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C	合计
陆基金	-	65, 727. 58	65, 727. 58
平安基金	-	421. 50	421. 50
平安人寿	-	252, 032. 57	252, 032. 57
平安银行	-	27, 522. 90	27, 522. 90
平安证券	-	4, 102. 39	4, 102. 39
中国银行	-	35, 562. 66	35, 562. 66
合计	-	385, 369. 60	385, 369. 60

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 0.80%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×0.80%/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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国银行-活期	82,618,801.00	121,786.19	89,385,146.79	231,971.53

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

				张)	
平安证券股份有限公司	600030	中信证券	网上定价	121,260	1,749,781.80

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（2023 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	165.75	122.11	200	33,150.60	24,422.00	-

注：1. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

2. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

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）

于本期末，本基金未持有债券投资（上年末：同）。

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，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 个工作日内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 个工作日内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 2023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	82,618,801.00	-	-	-	82,618,801.00
结算备付金	1,154,700.53	-	-	-	1,154,700.53
存出保证金	86,750.74	-	-	-	86,750.74
交易性金融资产	-	-	-	798,631,836.24	798,631,836.24
应收股利	-	-	-	608,831.58	608,831.58
应收申购款	-	-	-	44,001.62	44,001.62
应收清算款	-	-	-	822,923.60	822,923.60
资产总计	83,860,252.27	-	-	800,107,593.04	883,967,845.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	326,304.80	326,304.80
应付管理人报酬	-	-	-	1,081,686.09	1,081,686.09
应付托管费	-	-	-	180,281.02	180,281.02
应付清算款	-	-	-	12,973,495.73	12,973,495.73

应付销售服务费	-	-	-	55,364.84	55,364.84
其他负债	-	-	-	750,945.21	750,945.21
负债总计	-	-	-	15,368,077.69	15,368,077.69
利率敏感度缺口	83,860,252.27	-	-	-784,739,515.35	868,599,767.62
上年度末 2022 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	60,790,415.21	-	-	-	60,790,415.21
结算备付金	2,011,114.38	-	-	-	2,011,114.38
存出保证金	201,911.58	-	-	-	201,911.58
交易性金融资产	-	-	-	-869,075,936.77	869,075,936.77
应收申购款	-	-	-	50,164.83	50,164.83
应收清算款	-	-	-	11,807,381.18	11,807,381.18
资产总计	63,003,441.17	-	-	-880,933,482.78	943,936,923.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	354,569.36	354,569.36
应付管理人报酬	-	-	-	1,206,121.09	1,206,121.09
应付托管费	-	-	-	201,020.21	201,020.21
应付清算款	-	-	-	19.35	19.35
应付销售服务费	-	-	-	61,244.59	61,244.59
其他负债	-	-	-	1,164,802.66	1,164,802.66
负债总计	-	-	-	2,987,777.26	2,987,777.26
利率敏感度缺口	63,003,441.17	-	-	-877,945,705.52	940,949,146.69

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

注：于本期末，本基金未持有债券资产（上年末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			合计
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	66,795,399.61	-	66,795,399.61
资产合计	-	66,795,399.61	-	66,795,399.61
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	66,795,399.61	-	66,795,399.61
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	89,695,313.09	-	89,695,313.09
资产合计	-	89,695,313.09	-	89,695,313.09
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	89,695,313.09	-	89,695,313.09

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	所有外币相对于人民币贬值 5%	-3,339,769.98	-4,484,765.65
	所有外币相对于人民币升值 5%	3,339,769.98	4,484,765.65

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，所面临的重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 2023年6月30日		上年度末 2022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	798,631,836.24	91.94	869,075,936.77	92.36
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	798,631,836.24	91.94	869,075,936.77	92.36

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	沪深300指数上升5%	32,361,511.90	45,256,965.22
	沪深300指数下降5%	-32,361,511.90	-45,256,965.22

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	798,547,518.11	866,180,490.21
第二层次	-	-
第三层次	84,318.13	2,895,446.56
合计	798,631,836.24	869,075,936.77

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	798,631,836.24	90.35

	其中：股票	798,631,836.24	90.35
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	-	-
	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	83,773,501.53	9.48
8	其他各项资产	1,562,507.54	0.18
9	合计	883,967,845.31	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 66,795,399.61 元，占净值比例 7.69%。

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	507,478,040.41	58.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,079,945.96	2.77
F	批发和零售业	29,133.72	0.00
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	198,053,687.44	22.80
J	金融业	2,155,944.00	0.25
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	39,685.10	0.00
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	731,836,436.63	84.25

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	14,940,916.40	1.72
能源	-	-
金融	762,071.79	0.09
医疗	3,870,679.49	0.45
工业	-	-
地产业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	7,616,163.31	0.88
公用事业	39,605,568.62	4.56
合计	66,795,399.61	7.69

注：以上分类采用全球行业分类标准。

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	688378	奥来德	989,895	48,900,813.00	5.63
2	603345	安井食品	288,000	42,278,400.00	4.87
3	002410	广联达	1,294,660	42,063,503.40	4.84
4	002262	恩华药业	1,343,548	41,421,584.84	4.77
5	601058	赛轮轮胎	2,974,354	33,877,892.06	3.90
6	603383	顶点软件	576,000	31,921,920.00	3.68
7	688262	国芯科技	714,754	29,083,340.26	3.35
8	600309	万华化学	322,500	28,328,400.00	3.26
9	600519	贵州茅台	15,914	26,910,574.00	3.10
10	688369	致远互联	486,339	26,894,546.70	3.10
11	002675	东诚药业	1,786,900	26,285,299.00	3.03
12	603712	七一二	842,800	25,460,988.00	2.93
13	688008	澜起科技	442,730	25,421,556.60	2.93
14	300750	宁德时代	110,700	25,327,053.00	2.92
15	688533	上声电子	530,173	24,774,984.29	2.85
16	00902	华能国际电力股份	5,366,000	24,241,988.93	2.79
17	688498	源杰科技	80,466	22,932,810.00	2.64
18	601390	中国中铁	2,659,300	20,157,494.00	2.32
19	300567	精测电子	186,100	17,707,415.00	2.04
20	600941	中国移动	176,800	16,495,440.00	1.90

21	02380	中国电力	5,786,000	15,363,579.69	1.77
22	002212	天融信	1,556,600	15,099,020.00	1.74
23	01797	东方甄选	635,500	14,940,916.40	1.72
24	603179	新泉股份	337,300	14,804,097.00	1.70
25	300496	中科创达	148,600	14,317,610.00	1.65
26	688283	坤恒顺维	207,271	13,787,666.92	1.59
27	688368	晶丰明源	102,546	13,044,876.66	1.50
28	600720	祁连山	1,127,500	12,819,675.00	1.48
29	688019	安集科技	54,243	8,940,873.69	1.03
30	002149	西部材料	519,720	8,726,098.80	1.00
31	688153	唯捷创芯	112,041	8,196,919.56	0.94
32	002541	鸿路钢构	278,400	8,020,704.00	0.92
33	00728	中国电信	2,194,000	7,585,590.45	0.87
34	605186	健麾信息	150,100	7,429,950.00	0.86
35	002985	北摩高科	141,465	6,241,435.80	0.72
36	688036	传音控股	29,555	4,344,585.00	0.50
37	688326	经纬恒润	29,027	4,191,208.53	0.48
38	688141	杰华特	105,685	4,132,283.50	0.48
39	300693	盛弘股份	110,350	4,074,122.00	0.47
40	601668	中国建筑	683,354	3,922,451.96	0.45
41	301153	中科江南	52,116	3,906,615.36	0.45
42	06606	诺辉健康	153,500	3,870,679.49	0.45
43	002020	京新药业	272,600	3,494,732.00	0.40
44	688302	海创药业	48,284	2,564,846.08	0.30
45	300033	同花顺	12,300	2,155,944.00	0.25
46	688095	福昕软件	16,867	2,131,651.46	0.25
47	002555	三七互娱	53,500	1,866,080.00	0.21
48	688136	科兴制药	85,551	1,595,526.15	0.18
49	688108	赛诺医疗	88,284	932,279.04	0.11
50	688343	云天励飞	14,561	926,225.21	0.11
51	688371	菲沃泰	38,598	834,874.74	0.10
52	00388	香港交易所	2,800	762,071.79	0.09
53	688439	振华风光	6,481	711,743.42	0.08
54	688197	首药控股	9,570	456,106.20	0.05
55	688400	凌云光	13,111	399,623.28	0.05
56	688432	有研硅	20,044	314,490.36	0.04
57	300308	中际旭创	2,100	309,645.00	0.04
58	688507	索辰科技	1,998	259,294.74	0.03
59	688420	美腾科技	2,408	93,261.84	0.01
60	301308	江波龙	819	83,341.44	0.01
61	301165	锐捷网络	1,077	66,472.44	0.01
62	001301	尚太科技	1,164	65,544.84	0.01
63	301175	中科环保	6,370	39,685.10	0.00

64	301367	怡和嘉业	223	33,079.82	0.00
65	301330	熵基科技	902	32,273.56	0.00
66	00700	腾讯控股	100	30,572.86	0.00
67	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
68	301391	卡莱特	247	28,940.99	0.00
69	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
70	301327	华宝新能	315	24,919.65	0.00
71	301356	天振股份	1,105	24,199.50	0.00
72	301101	明月镜片	556	22,812.68	0.00
73	301171	易点天下	985	21,768.50	0.00
74	002230	科大讯飞	200	13,592.00	0.00
75	301277	新天地	658	12,837.58	0.00
76	301283	聚胶股份	235	8,337.80	0.00
77	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
78	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

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	002262	恩华药业	51,642,430.91	5.49
2	688378	奥来德	41,839,064.92	4.45
3	688262	国芯科技	31,988,507.20	3.40
4	600941	中国移动	20,194,247.00	2.15
4	00941	中国移动	8,865,000.86	0.94
5	601058	赛轮轮胎	28,400,619.00	3.02
6	002517	恺英网络	25,346,153.00	2.69
7	002410	广联达	23,753,601.20	2.52
8	002212	天融信	23,426,543.44	2.49
9	601390	中国中铁	22,827,371.00	2.43
10	603345	安井食品	20,937,148.12	2.23
11	688533	上声电子	20,716,114.81	2.20
12	300567	精测电子	17,282,006.00	1.84
13	002555	三七互娱	16,986,471.00	1.81
14	01797	东方甄选	16,529,889.61	1.76
15	688498	源杰科技	14,920,186.57	1.59
16	603859	能科科技	14,530,678.75	1.54
17	605186	健麾信息	14,191,804.00	1.51
18	003029	吉大正元	14,102,741.00	1.50
19	603179	新泉股份	13,429,317.21	1.43
20	603712	七一二	13,406,164.00	1.42

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	688008	澜起科技	53,219,501.09	5.66
2	601799	星宇股份	47,286,555.27	5.03
3	600809	山西汾酒	42,774,484.00	4.55
4	300122	智飞生物	39,354,792.92	4.18
5	03690	美团-W	38,419,926.89	4.08
6	002938	鹏鼎控股	34,217,703.60	3.64
7	600861	北京人力	29,159,133.43	3.10
8	600519	贵州茅台	27,613,356.64	2.93
9	002517	恺英网络	25,584,905.43	2.72
10	601668	中国建筑	22,274,450.00	2.37
11	688326	经纬恒润	22,056,136.68	2.34
12	603179	新泉股份	20,458,389.48	2.17
13	002262	恩华药业	19,089,524.85	2.03
14	00941	中国移动	10,200,965.54	1.08
14	600941	中国移动	8,280,871.00	0.88
15	002410	广联达	18,262,178.20	1.94
16	688369	致远互联	18,114,709.13	1.93
17	002555	三七互娱	17,967,150.67	1.91
18	002475	立讯精密	17,795,430.80	1.89
19	603997	继峰股份	17,384,305.00	1.85
20	00902	华能国际电力股份	16,442,164.00	1.75

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	747,280,581.46
卖出股票收入（成交）总额	836,788,471.84

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	86,750.74
2	应收清算款	822,923.60
3	应收股利	608,831.58
4	应收利息	-
5	应收申购款	44,001.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,562,507.54

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 (%)
平安匠心优选混合 A	9,779	77,854.54	293,895,868.80	38.60	467,443,693.06	61.40
平安匠心优选混合 C	6,388	12,998.31	-	-	83,033,212.83	100.00
合计	15,936	52,985.24	293,895,868.80	34.81	550,476,905.89	65.19

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	平安匠心优选混合 A	1,352,562.25	0.1777
	平安匠心优选混合 C	6,224.57	0.0075
	合计	1,358,786.82	0.1609

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	平安匠心优选混合 A	0
	平安匠心优选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安匠心优选混合 A	50~100
	平安匠心优选混合 C	0

	合计		50~100
--	----	--	--------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C
基金合同生效日 (2020 年 2 月 21 日) 基金份额总额	5,131,939,904.63	212,779,189.52
本报告期期初基金 份额总额	836,369,271.42	90,218,893.75
本报告期基金总申 购份额	8,036,379.92	3,793,776.23
减：本报告期基金 总赎回份额	83,066,089.48	10,979,457.15
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金 份额总额	761,339,561.86	83,033,212.83

§ 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

本基金管理人公司董事杨玉萍女士因工作安排不再出任公司第四届董事会董事，公司股东平安信托有限责任公司根据《公司章程》推荐郭晓涛先生接替杨玉萍女士出任公司董事。经公司 2023 年第二次股东会审议，同意郭晓涛先生出任公司董事，杨玉萍女士不再担任公司董事。上述变更自 2023 年 3 月 17 日公司 2023 年第二次股东会做出决议之日起生效。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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、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，本基金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	161,796,667.59	10.23	118,106.57	9.67	-
中信建投证券	1	145,358,538.14	9.19	110,772.43	9.07	-
兴业证券	2	139,860,410.65	8.84	101,549.65	8.31	-
民生证券	1	123,951,545.09	7.83	90,644.38	7.42	-
中信证券	2	117,372,550.04	7.42	85,836.82	7.03	-
广发证券	3	104,591,066.96	6.61	97,405.80	7.98	-
国海证券	1	93,977,179.53	5.94	67,787.30	5.55	-
国泰君安证券	2	90,583,262.13	5.73	65,339.94	5.35	-
东方证券	3	75,880,580.77	4.80	56,628.55	4.64	-
国联证券	1	75,229,093.60	4.75	54,263.57	4.44	-
西南证券	1	69,597,899.40	4.40	50,201.41	4.11	-
浙商证券	2	66,502,690.36	4.20	47,967.33	3.93	-
招商证券	2	56,188,947.18	3.55	52,330.85	4.28	-
中国国际金融股份有限公司	2	50,573,279.60	3.20	47,099.07	3.86	-

国金证券	1	47,463,420.27	3.00	44,202.28	3.62	-
国盛证券	2	47,320,675.52	2.99	36,229.79	2.97	-
方正证券	3	31,912,171.11	2.02	28,626.54	2.34	-
华泰证券	3	26,797,916.40	1.69	19,329.63	1.58	-
安信证券	4	22,066,236.72	1.39	16,137.10	1.32	-
申万宏源证券	2	18,724,754.88	1.18	17,438.46	1.43	-
财通证券	1	9,083,630.45	0.57	6,551.87	0.54	新增
平安证券	2	7,349,622.00	0.46	6,844.61	0.56	-
国信证券	2	40,393.20	0.00	29.55	0.00	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
上海华信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	新增
西藏东财证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证	-	-	-	-	-	-

券						
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
上海华信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	2023年01月05日
2	平安匠心优选混合型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023年01月19日
3	平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年01月19日
4	平安基金管理有限公司关于暂停上海爱建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	2023年02月09日
5	关于暂停浦领基金销售有限公司办	中国证监会规定报刊及	2023年02月13日

	理相关销售业务的公告	网站	
6	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳前海微众银行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	2023 年 02 月 15 日
7	平安基金管理有限公司关于新增兴业证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 16 日
8	平安基金管理有限公司关于新增国泰君安证券股份有限公司为平安匠心优选混合型证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 27 日
9	平安匠心优选混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 29 日
10	平安匠心优选混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 21 日
11	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州银行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	2023 年 05 月 26 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匠心优选混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安匠心优选混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安匠心优选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

2023 年 8 月 29 日