平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 3 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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 2024 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 9

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13

§6 审计报告 14

6.1 审计报告基本信息 14
6.2 审计报告的基本内容 14

§7 年度财务报表 15

7.1 资产负债表 15
7.2 利润表 17
7.3 净资产变动表 18
7.4 报表附注 20

§8 投资组合报告 49

8.1 期末基金资产组合情况 49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 49
8.3 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 50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59
8.6 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 59
8.7 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 59
8.8 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 59
8.9 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 59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 59
8.12 投资组合报告附注 59

§9 基金份额持有人信息 60

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 60
9.2 期末上市基金前十名持有人 60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 60
9.4 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 61
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 61

§10 开放式基金份额变动 61

§11 重大事件揭示 61

11.1 基金份额持有人大会决议 61
11.2 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 61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 61
11.4 基金投资策略的改变 61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 62
11.8 其他重大事件 66

§12 影响投资者决策的其他重要信息 68

12.1 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 68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 69

§13 备查文件目录 69

13.1 备查文件目录 69
13.2 存放地点 69
13.3 查阅方式 69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	平安新兴产业混合（LOF）
场内简称	平安新兴产业 LOF
基金主代码	501099
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2020 年 4 月 10 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	100,260,164.55 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 7 月 1 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，充分利用公司投资研究优势，精选投资标的，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在大类资产配置过程中，本基金将对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究。通过综合考虑相关类别资产的风险收益水平及市场走势，结合经济、金融的政策调整、环境改变及其发展趋势，动态调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例，优化投资组合。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×65%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×15%+中债总指数收益率×20%。
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。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可投资于科创板上市的股票，除了需要承担与证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临投资科创板股票的特殊风险。

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	潘琦
	联系电话	0755-22626828	0755-22168257
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	PANQI003@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	广东省深圳市福田区益田路5023 号平安金融中心 B 座
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-2,959,069.80	-97,500,567.29	127,978,704.44
本期利润	13,630,929.42	-134,604,693.76	81,963,494.42
加权平均基金份额本期利润	0.0958	-0.6580	0.4007
本期加权平均净值利润率	6.66%	-42.73%	22.53%
本期基金份额净值增长率	-7.36%	-33.03%	25.18%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	23,657,565.65	68,370,851.79	178,179,766.01
期末可供分配基金	0.2360	0.3342	0.8711

份额利润			
期末基金资产净值	123,917,730.20	272,928,101.64	407,532,795.40
期末基金份额净值	1.2360	1.3342	1.9923
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	23.60%	33.42%	99.23%

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）；

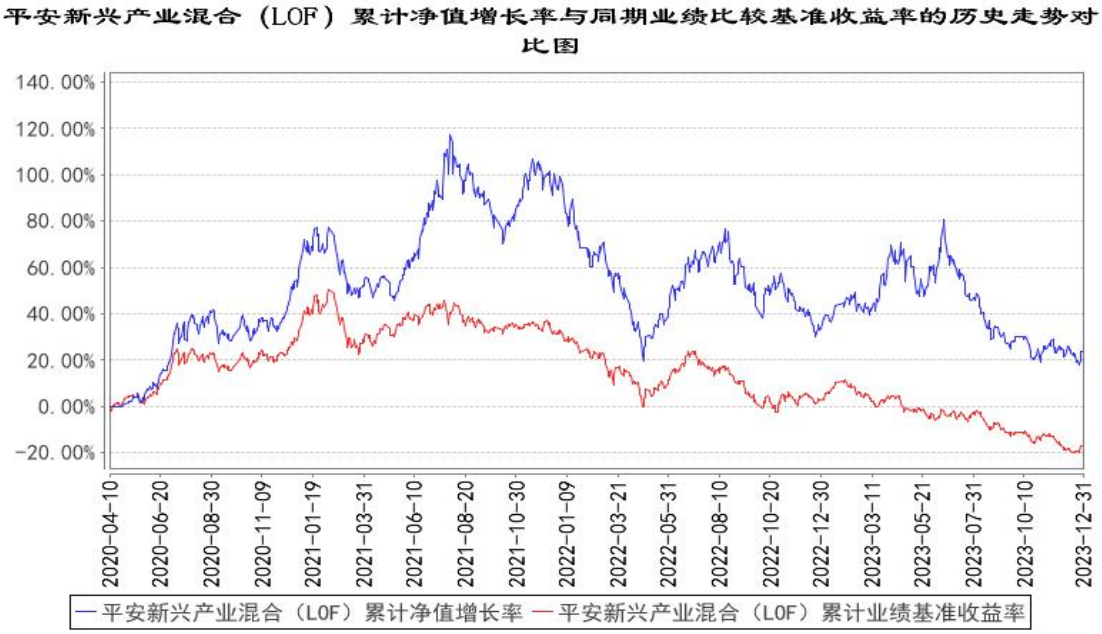
3.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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
过去三个月	-4.84%	1.34%	-6.50%	0.93%	1.66%	0.41%
过去六个月	-24.96%	1.34%	-14.27%	0.89%	-10.69%	0.45%
过去一年	-7.36%	1.75%	-19.13%	0.88%	11.77%	0.87%
过去三年	-22.34%	1.81%	-37.43%	1.14%	15.09%	0.67%
自基金合同生效起至今	23.60%	1.76%	-17.07%	1.13%	40.67%	0.63%

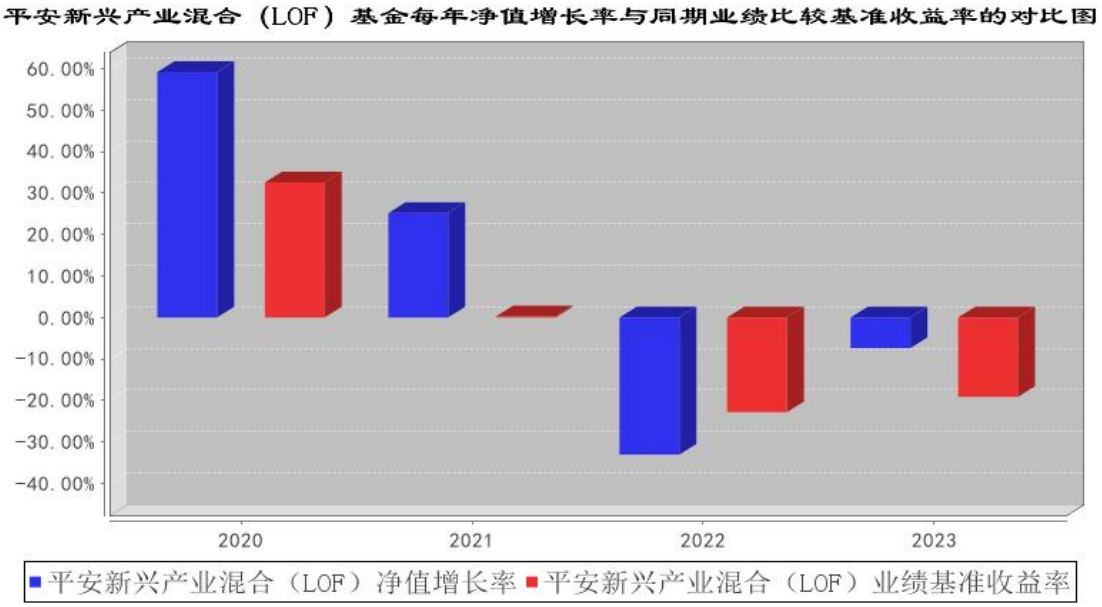
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于 2020 年 04 月 10 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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同于 2020 年 04 月 10 日正式生效，合同生效当年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过往三年无利润分配情况。

§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，注册资本金为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金"以专业承载信赖"，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。截至 2023 年 12 月 31 日，平安基金共管理 194 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5668 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		
翟森	平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2020 年 12 月 29 日	-	8 年	翟森先生，北京大学计算机应用技术硕士。曾担任深圳前海大宇资本管理有限公司研究员。2016 年 6 月加入平安基金管理有限公司，曾担任研究中心行业研究员，现担任平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）、平安灵活配置混合型证券投资基金、平安科技创新混合型证券投资基金基金经理。
李化松	公司总经理助理，平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020 年 4 月 15 日	2023 年 3 月 15 日	17 年	李化松先生，北京大学硕士。先后担任国信证券有限责任公司经济研究所分析师、华宝兴业基金管理有限公司研究部分析师、嘉实基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理。2018 年 3 月加入平安基金管理有限公司，现任公司总经理助理，同时担任平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安高端制造混合型证券投资基金、平安研究睿选混合型证券投资基金、平安稳健增长混合型证券投资基金、平安均衡优选 1 年持有期混合型证券投资基金、平安均衡成长 2 年持有期混合型证

					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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，具体按其综合业绩表现、管理规模和对团队的贡献等情况进行评定。

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公

平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

针对基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形，公司进一步加强了对投资指令下达、交易执行和反向交易控制等环节的控制措施，同时强化了对相关同反向交易价差及组合收益率差异的事后监测分析，按监管要求完善了相关信息披露，进一步落实对兼任基金经理投资交易行为的规范和监督。本报告期内，相关制度措施执行情况良好，未发现同一基金经理管理公募基金、私募资产管理计划之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.3.3 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

回顾去年全年，市场风格相较于过去几年发生了明显的变化，市场板块轮动迅速，中小市值个股表现活跃。尤其在博弈性质明显加强的背景下，整体市场波动明显加大。在这种背景下我们看到除高股息领域可见相对稳定的回报，成长领域的投资机会交易性特征增强，这也同时削减了短期的定价的有效性，加大了投资难度。以上半年为例，市场在科技领域呈现出较好的投资机会，尤其是在以人工智能为主的方向上，出现了从算力到应用环节的全行业的投资机会。但下半年该方向上也出现了巨大的回撤，阶段性的止盈相较于对基本面的把握对管理人的考验更大。

去年产品的表现来看，以上市场特征也是我们去年下半年出现了较大回撤的原因，上半年我们较好的把握数字经济以及人工智能方向的产业趋势的投资机会，无论是绝对收益还是相较于市场取得的阶段性业绩较好。但由于下半年没有及时进行阶段性的止盈，出现了较大的回撤，下半

年整体表现不尽如人意。未来产品配置会从从宏观环境、产业趋势、以及阶段性风格来进行考虑，各个因素在不同时期所占有的权重不相同，在不同时期考虑使用不同的举措来应对短期波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2360 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.36%，业绩比较基准收益率为-19.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的一年，短期看市场的核心矛盾在于相对低的风险偏好对于盈利的担忧与经济推动力迫切转向新质生产力之间的矛盾。目前是新老经济产业交替的时期，市场对于不确定性的保守定价已经在短期达到了极限，因此我们相信修复的时间点也越来越近。我们仍然相信国内经济在向高质量发展转型的过程中，会是由科技创新等新质生产力来推动的，在这一过程中包括人工智能、新能源、高端制造等各个产业仍然富有增长韧性。尤其是人工智能方向，已经在近一年的快速迭代中证明了其能力，带来下一次工业革命的曙光，目前在一些细分应用上已经开始潜移默化的影响诸多人的工作，甚至成为生产力工具，其在各行各业带来的效率提升的速度是超过以往任何一次工业革命的。如果说历史上的工业革命仅是从物理生产力中的本质革命，而人工智能是从底层的组织架构与运转模式上的变革。

接下来我们仍然会沿着产业趋势的方向寻找投资机会，包括人工智能、高端制造、新能源、智能汽车等方向依然是我们未来研究的要点。以自下而上选股为首要目标，对应市场风险偏好选择出有高性价比的投资标的。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.9 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，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损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 20730 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安新兴产业混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了平安新兴产业混合型证券投资基金(LOF) （以下简称“平安新兴产业混合基金”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了平安新兴产业混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安新兴产业混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	平安新兴产业混合基金的基金管理人平安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安新兴产业混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算平安新兴产业混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

	基金管理人治理层负责监督平安新兴产业混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对平安新兴产业混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安新兴产业混合基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	曹翠丽　　李崇
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	14,057,423.35	36,422,867.87
结算备付金		908,198.32	2,268,747.28
存出保证金		255,412.63	446,800.00
交易性金融资产	7.4.7.2	112,738,993.10	249,242,366.33
其中：股票投资		112,738,993.10	249,242,366.33
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		1,439,989.14	-
应收股利		-	-
应收申购款		37,600.42	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		129,437,616.96	288,380,781.48
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 12 月 31 日**	**上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,565,716.92	13,821,206.25
应付赎回款		2,190,961.53	-
应付管理人报酬		64,853.84	358,082.49
应付托管费		10,808.95	59,680.43
应付销售服务费		-	-
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	7.4.7.9	687,545.52	1,213,710.67
负债合计		5,519,886.76	15,452,679.84
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	100,260,164.55	204,557,249.85
未分配利润	7.4.7.12	23,657,565.65	68,370,851.79
净资产合计		123,917,730.20	272,928,101.64
负债和净资产总计		129,437,616.96	288,380,781.48

注： 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2360 元，基金份额总额 100,260,164.55 份。

7.2 利润表

会计主体：平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		16,092,475.07	-128,915,542.32
1.利息收入		133,426.03	181,198.31
其中：存款利息收入	7.4.7.13	124,230.60	179,398.31
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		9,195.43	1,800.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-805,623.24	-91,992,614.16
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-2,296,955.46	-94,275,568.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	174,628.92	959,485.72
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,316,703.30	1,323,469.04
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	16,589,999.22	-37,104,126.47
4.汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列）			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	174,673.06	-
减：二、营业总支出		2,461,545.65	5,689,151.44
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	1,964,030.91	4,726,313.78
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	327,338.60	787,718.96
3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		6.72	2.37
8．其他费用	7.4.7.23	170,169.42	175,116.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,630,929.42	-134,604,693.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,630,929.42	-134,604,693.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,630,929.42	-134,604,693.76

7.3 净资产变动表

会计主体：平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	204,557,249.85	-	68,370,851.79	272,928,101.64
二、本期期初净资产	204,557,249.85	-	68,370,851.79	272,928,101.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-104,297,085.30	-	-44,713,286.14	-149,010,371.44
（一）、综合收益总额	-	-	13,630,929.42	13,630,929.42
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	-104,297,085.30	-	-58,344,215.56	-162,641,300.86

“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	43,980,455.69	-	26,882,926.72	70,863,382.41
2.基金赎回款	-148,277,540.99	-	-85,227,142.28	-233,504,683.27
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	100,260,164.55	-	23,657,565.65	123,917,730.20
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	204,557,249.85	-	202,975,545.55	407,532,795.40
二、本期期初净资产	204,557,249.85	-	202,975,545.55	407,532,795.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-134,604,693.76	-134,604,693.76
（一）、综合收益总额	-	-	-134,604,693.76	-134,604,693.76
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	204,557,249.85	-	68,370,851.79	272,928,101.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）(原名为平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置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[2020]77 号《关于准予平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置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《平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置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 204,388,232.00 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 0159 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 204,557,249.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 169,017.85 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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]169 号文审核同意，本基金 10,973,702.00 份基金份额于 2020 年 7 月 1 日在上交所挂牌交易。

基金合同生效后的前 3 年为封闭运作期，在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业务。基金合同生效三年后，本基金转为上市开放式基金(LOF)，投资人在开放日办理基金份额的场内、场外申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，若该工作日为非港股通交易日时，则本基金不开放申购和赎回，具体以届时公告为准。

根据《关于平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满相关安排的公告》，本基金于 2023 年 4 月 9 日封闭运作期届满，自 2023 年 4 月 10 日起转为开放式运作，接受场内、场外申购赎回，基金名称变更为“平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF)”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）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(包括中小板、创业板、科创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、证券公司短期公司债、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)、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相关规定。在封闭运作期内，基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例为 0%-100%，投资于港股通标的股票比例为股票资产的 0-50%；投资于本基金合同界定的科技创新证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%，包括新股及战略配售等。

本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×65%+恒生指数收益率(经汇率估值调整)×15%+中债总指数收益率×20%。

7.4.2 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》、《平安新兴产业混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值

并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价

值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 现金分红与红利再投资，登记在基金份额持有人开放式基金

账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(3) 本基金每一基金份额享有同等分配权；(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性

折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

根据中国证监会于 2024 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通买卖、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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	14,057,423.35	36,422,867.87

等于：本金	14,056,368.92	36,417,796.19
加：应计利息	1,054.43	5,071.68
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	14,057,423.35	36,422,867.87

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		108,457,340.81	-	112,738,993.10	4,281,652.29
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		108,457,340.81	-	112,738,993.10	4,281,652.29
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		261,550,713.26	-	249,242,366.33	-12,308,346.93
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	261,550,713.26	-	249,242,366.33	-12,308,346.93

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,464.74	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	514,080.78	1,038,710.67
其中：交易所市场	514,080.78	1,038,710.67
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	175,000.00
合计	687,545.52	1,213,710.67

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	204,557,249.85	204,557,249.85
本期申购	43,980,455.69	43,980,455.69
本期赎回（以“-”号填列）	-148,277,540.99	-148,277,540.99
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	100,260,164.55	100,260,164.55

注：截至 2023 年 12 月 31 日止，本基金于上交所上市的基金份额为 5,994,185.00 份(2022 年 12 月 31 日：17,713,822.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 94,265,979.55 份(2022 年 12 月 31 日：186,843,427.85 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通；未上市的基金份额登记在注册登记系统。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	80,679,198.72	-12,308,346.93	68,370,851.79
本期期初	80,679,198.72	-12,308,346.93	68,370,851.79
本期利润	-2,959,069.80	16,589,999.22	13,630,929.42
本期基金份额交易产生的变动数	-48,455,474.08	-9,888,741.48	-58,344,215.56
其中：基金申购款	24,646,247.27	2,236,679.45	26,882,926.72
基金赎回款	-73,101,721.35	-12,125,420.93	-85,227,142.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,264,654.84	-5,607,089.19	23,657,565.65

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	88,495.09	136,832.28
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	29,294.33	34,571.82
其他	6,441.18	7,994.21
合计	124,230.60	179,398.31

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,296,955.46	-94,275,568.92
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	-2,296,955.46	-94,275,568.92

7.4.7.14.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,422,299,488.18	2,701,208,108.94
减：卖出股票成本总额	2,418,613,075.99	2,788,374,929.12
减：交易费用	5,983,367.65	7,108,748.74
买卖股票差价收入	-2,296,955.46	-94,275,568.92

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,870.54	661.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	172,758.38	958,824.50
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	174,628.92	959,485.72

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,703,791.79	12,945,398.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本	7,515,056.99	11,977,808.43

总额		
减：应计利息总额	15,379.43	8,267.93
减：交易费用	596.99	497.43
买卖债券差价收入	172,758.38	958,824.50

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,316,703.30	1,323,469.04
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	1,316,703.30	1,323,469.04

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	16,589,999.22	-37,104,126.47
股票投资	16,589,999.22	-35,349,828.40
债券投资	-	-1,754,298.07
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	16,589,999.22	-37,104,126.47

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	174,673.06	-
合计	174,673.06	-

注：本基金的赎回费率按持有期间递减。赎回费计入基金资产的比例根据《平安新兴产业混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》确定。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	169.42	116.33
合计	170,169.42	175,116.33

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	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
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	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
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	234,500,637.75	5.00	-	-
平安证券	-	-	138,549,949.92	2.57

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.1.5 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12月31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	169,456.75	4.98	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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（%）
平安证券	99,936.12	2.58	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,964,030.91	4,726,313.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	693,921.24	1,618,597.60
应支付基金管理人的净管理费	1,270,109.67	3,107,716.18

注：1.自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 9 日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

2.自 2023 年 4 月 10 日起，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	327,338.60	787,718.96

注：1.自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 9 日，支付基金托管人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。

2.自 2023 年 4 月 10 日起，支付基金托管人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。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	14,057,423.35	88,495.09	36,422,867.87	136,832.28

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁定	12.05	19.92	127	1,530.35	2,529.84	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股锁定	53.63	75.36	26	1,394.38	1,959.36	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月	新股锁定	41.18	48.64	52	2,141.36	2,529.28	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14	6 个月	新股锁定	41.00	44.16	39	1,599.00	1,722.24	-

		日								
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	6 个月	新股锁定	33.25	58.19	101	3,358.25	5,877.19	-
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定	41.66	64.11	75	3,124.50	4,808.25	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股锁定	16.82	26.68	190	3,195.80	5,069.20	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.87	15.51	400	2,748.00	6,204.00	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	26.87	43.69	97	2,606.39	4,237.93	-
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股锁定	2.66	4.45	2,180	5,798.80	9,701.00	-
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股锁定	22.88	32.44	170	3,889.60	5,514.80	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：同）。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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，并按照合约规定的重新定价日或到期日进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,057,423.35	-	-	-	14,057,423.35
结算备付金	908,198.32	-	-	-	908,198.32
存出保证金	255,412.63	-	-	-	255,412.63
交易性金融资产	-	-	-	112,738,993.10	112,738,993.10
应收申购款	-	-	-	37,600.42	37,600.42
应收清算款	-	-	-	1,439,989.14	1,439,989.14
资产总计	15,221,034.30	-	-	114,216,582.66	129,437,616.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,190,961.53	2,190,961.53
应付管理人报酬	-	-	-	64,853.84	64,853.84
应付托管费	-	-	-	10,808.95	10,808.95
应付清算款	-	-	-	2,565,716.92	2,565,716.92
其他负债	-	-	-	687,545.52	687,545.52
负债总计	-	-	-	5,519,886.76	5,519,886.76
利率敏感度缺口	15,221,034.30	-	-	108,696,695.90	123,917,730.20
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					

货币资金	36,422,867.87	-	-	-	36,422,867.87
结算备付金	2,268,747.28	-	-	-	2,268,747.28
存出保证金	446,800.00	-	-	-	446,800.00
交易性金融资产	-	-	-	249,242,366.33	249,242,366.33
资产总计	39,138,415.15	-	-	249,242,366.33	288,380,781.48
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	358,082.49	358,082.49
应付托管费	-	-	-	59,680.43	59,680.43
应付清算款	-	-	-	13,821,206.25	13,821,206.25
其他负债	-	-	-	1,213,710.67	1,213,710.67
负债总计	-	-	-	15,452,679.84	15,452,679.84
利率敏感度缺口	39,138,415.15	-	-	233,789,686.49	272,928,101.64

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	-	4,344,781.17	-	4,344,781.17
资产合计	-	4,344,781.17	-	4,344,781.17
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净	-	4,344,781.17	-	4,344,781.17

额				
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	-	6,376,831.21	-	6,376,831.21
资产合计	-	6,376,831.21	-	6,376,831.21
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	-	6,376,831.21	-	6,376,831.21

7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 日）	上年度末 （2022 年 12 月 31 日 ）
	所有外币相对于人民币贬值 5%	-217,239.06	-318,841.56
	所有外币相对于人民币升值 5%	217,239.06	318,841.56

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	112,738,993.10	90.98	249,242,366.33	91.32
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	112,738,993.10	90.98	249,242,366.33	91.32

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末 （2022 年 12 月 31 日 ）
分析	沪深 300 指数上升 5%	5,747,266.38	11,234,835.94
	沪深 300 指数下降 5%	-5,747,266.38	-11,234,835.94

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	112,688,840.01	244,769,149.24
第二层次	-	3,675,672.00
第三层次	50,153.09	797,545.09
合计	112,738,993.10	249,242,366.33

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生的当期期初为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	797,545.09	797,545.09
当期购买	-	31,386.43	31,386.43
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	797,545.09	797,545.09
当期利得或损失总额	-	18,766.66	18,766.66
其中：计入损益的利得或损失	-	18,766.66	18,766.66
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	50,153.09	50,153.09
期末仍持有的第三层次金	-	18,766.66	18,766.66

融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			

项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,627,461.18	1,627,461.18
当期购买	-	795,918.10	795,918.10
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,627,461.18	1,627,461.18
当期利得或损失总额	-	1,626.99	1,626.99
其中：计入损益的利得或损失	-	1,626.99	1,626.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	797,545.09	797,545.09
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,626.99	1,626.99

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	50,153.09	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	51.41%-217.52%	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

流通受限股票	797,545.09	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	23.19%-247.56%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	112,738,993.10	87.10
	其中：股票	112,738,993.10	87.10
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	14,965,621.67	11.56
8	其他各项资产	1,733,002.19	1.34
9	合计	129,437,616.96	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 4,344,781.17 元，占净值比例 3.51%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	97,721,277.55	78.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,910,528.88	6.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,535,480.50	1.24
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	1,226,925.00	0.99
S	综合	-	-
	合计	108,394,211.93	87.47

8.2.2 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	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗	-	-
工业	-	-
地产业	-	-
信息科技	4,344,781.17	3.51
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	4,344,781.17	3.51

注：以上分类采用全球行业分类标准。

8.3 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	002475	立讯精密	244,400	8,419,580.00	6.79
2	688279	峰岹科技	52,749	6,652,703.88	5.37

3	300308	中际旭创	54,455	6,148,514.05	4.96
4	300480	光力科技	236,730	5,054,185.50	4.08
5	301391	卡莱特	41,329	4,731,343.92	3.82
6	688728	格科微	218,728	4,477,362.16	3.61
7	301205	联特科技	42,200	4,420,450.00	3.57
8	01415	高伟电子	208,000	4,344,781.17	3.51
9	300502	新易盛	84,200	4,152,744.00	3.35
10	002465	海格通信	318,500	4,092,725.00	3.30
11	002241	歌尔股份	180,800	3,798,608.00	3.07
12	002843	泰嘉股份	140,900	3,733,850.00	3.01
13	300115	长盈精密	272,000	3,604,000.00	2.91
14	002126	银轮股份	188,300	3,515,561.00	2.84
15	688097	博众精工	95,522	3,209,539.20	2.59
16	688687	凯因科技	86,894	3,029,124.84	2.44
17	000100	TCL 科技	613,400	2,637,620.00	2.13
18	000725	京东方 A	659,200	2,570,880.00	2.07
19	603800	道森股份	96,200	2,539,680.00	2.05
20	600535	天士力	130,700	2,224,514.00	1.80
21	688361	中科飞测	28,807	2,144,105.01	1.73
22	301312	智立方	19,400	2,101,796.00	1.70
23	688115	思林杰	60,103	2,083,771.01	1.68
24	688249	晶合集成	116,665	2,012,471.25	1.62
25	688020	方邦股份	36,947	1,791,190.56	1.45
26	688053	思科瑞	30,645	1,530,411.30	1.24
27	603052	可川科技	33,800	1,473,004.00	1.19
28	002156	通富微电	54,900	1,269,288.00	1.02
29	603203	快克智能	43,900	1,269,149.00	1.02
30	601728	中国电信	232,500	1,257,825.00	1.02
31	300232	洲明科技	142,700	1,255,760.00	1.01
32	300136	信维通信	53,000	1,250,800.00	1.01
33	688278	特宝生物	23,557	1,233,208.95	1.00
34	002273	水晶光电	90,800	1,229,432.00	0.99
35	601595	上海电影	47,500	1,226,925.00	0.99
36	688025	杰普特	13,079	1,210,461.45	0.98
37	688328	深科达	16,878	756,978.30	0.61
38	300316	晶盛机电	15,181	669,330.29	0.54
39	600366	宁波韵升	80,700	627,039.00	0.51
40	688478	晶升股份	11,943	621,036.00	0.50
41	688047	龙芯中科	5,440	601,718.40	0.49
42	688234	天岳先进	8,843	584,257.01	0.47
43	300705	九典制药	17,200	571,556.00	0.46
44	001339	智微智能	12,800	440,064.00	0.36
45	301413	安培龙	1,009	73,250.79	0.06

46	001326	联域股份	511	27,833.95	0.02
47	001358	兴欣新材	390	18,570.24	0.01
48	301526	国际复材	2,180	9,701.00	0.01
49	301116	益客食品	664	8,512.48	0.01
50	301516	中远通	400	6,204.00	0.01
51	301555	惠柏新材	170	5,514.80	0.00
52	301508	中机认检	190	5,069.20	0.00
53	301489	思泉新材	75	4,808.25	0.00
54	301517	陕西华达	97	4,237.93	0.00
55	001239	永达股份	127	2,529.84	0.00
56	001306	夏厦精密	26	1,959.36	0.00
57	688253	英诺特	33	825.33	0.00
58	300979	华利集团	12	631.68	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300394	天孚通信	48,873,226.72	17.91
2	300308	中际旭创	41,030,176.59	15.03
3	300502	新易盛	40,953,259.82	15.01
4	688256	寒武纪	35,401,426.04	12.97
5	601138	工业富联	31,485,084.94	11.54
6	002230	科大讯飞	29,807,474.40	10.92
7	688041	海光信息	26,434,573.07	9.69
8	688111	金山办公	26,216,857.30	9.61
9	601728	中国电信	24,177,140.00	8.86
9	00728	中国电信	1,383,930.76	0.51
10	000032	深桑达 A	25,293,143.98	9.27
11	300693	盛弘股份	24,296,529.00	8.90
12	600050	中国联通	22,743,271.00	8.33
13	603019	中科曙光	22,604,674.60	8.28
14	300634	彩讯股份	22,455,030.00	8.23
15	000938	紫光股份	20,696,900.69	7.58
16	002555	三七互娱	20,680,210.87	7.58
17	002517	恺英网络	20,085,795.50	7.36
18	688981	中芯国际	20,022,711.52	7.34
19	300002	神州泰岳	19,253,152.70	7.05
20	601360	三六零	19,081,428.30	6.99
21	002126	银轮股份	18,923,289.00	6.93
22	600941	中国移动	18,289,535.96	6.70
23	300033	同花顺	17,887,277.00	6.55
24	688579	山大地纬	17,850,617.78	6.54

25	000063	中兴通讯	17,653,123.69	6.47
26	000988	华工科技	16,675,774.18	6.11
27	300418	昆仑万维	16,167,815.40	5.92
28	603063	禾望电气	16,128,449.24	5.91
29	300170	汉得信息	15,822,184.74	5.80
30	600536	中国软件	15,309,052.79	5.61
31	002174	游族网络	15,305,768.00	5.61
32	600633	浙数文化	14,979,497.30	5.49
33	000977	浪潮信息	14,957,795.76	5.48
34	301236	软通动力	14,836,053.50	5.44
35	002929	润建股份	14,772,201.10	5.41
36	600498	烽火通信	14,043,115.28	5.15
37	600363	联创光电	13,980,393.99	5.12
38	300383	光环新网	13,551,347.00	4.97
39	688498	源杰科技	13,489,741.65	4.94
40	600602	云赛智联	13,405,236.83	4.91
41	002558	巨人网络	13,191,839.30	4.83
42	300130	新国都	12,879,606.05	4.72
43	002472	双环传动	12,715,845.00	4.66
44	002236	大华股份	12,678,800.00	4.65
45	600373	中文传媒	11,772,617.00	4.31
46	688378	奥来德	11,727,299.31	4.30
47	002908	德生科技	11,544,877.18	4.23
48	002475	立讯精密	11,386,577.00	4.17
49	601801	皖新传媒	11,326,877.01	4.15
50	601689	拓普集团	11,315,678.00	4.15
51	603000	人民网	11,151,819.86	4.09
52	002624	完美世界	10,992,540.00	4.03
53	300280	紫天科技	10,835,489.00	3.97
54	688036	传音控股	10,563,453.73	3.87
55	300364	中文在线	9,836,005.21	3.60
56	000719	中原传媒	9,620,436.30	3.52
57	002368	太极股份	9,485,558.00	3.48
58	300766	每日互动	9,325,876.00	3.42
59	301205	联特科技	9,065,121.40	3.32
60	603258	电魂网络	8,991,131.87	3.29
61	301018	申菱环境	8,834,074.00	3.24
62	688012	中微公司	8,637,552.43	3.16
63	603997	继峰股份	8,551,304.00	3.13
64	688328	深科达	8,505,836.98	3.12
65	300592	华凯易佰	8,472,278.00	3.10
66	301312	智立方	8,433,170.50	3.09
67	688700	东威科技	8,356,801.88	3.06

68	300533	冰川网络	8,348,896.26	3.06
69	000768	中航西飞	8,309,603.00	3.04
70	300474	景嘉微	8,164,585.00	2.99
71	002912	中新赛克	7,954,974.80	2.91
72	603197	保隆科技	7,923,898.50	2.90
73	300491	通合科技	7,803,478.00	2.86
74	603800	道森股份	7,788,311.00	2.85
75	688025	杰普特	7,672,706.20	2.81
76	300494	盛天网络	7,609,357.00	2.79
77	600850	电科数字	7,603,713.89	2.79
78	002602	世纪华通	7,547,123.00	2.77
79	600977	中国电影	7,533,157.00	2.76
80	601019	山东出版	7,500,988.00	2.75
81	300624	万兴科技	7,482,679.00	2.74
82	300559	佳发教育	7,444,380.85	2.73
83	601633	长城汽车	7,348,056.01	2.69
84	605133	嵘泰股份	7,336,804.16	2.69
85	688332	中科蓝讯	7,329,817.42	2.69
86	300133	华策影视	7,298,602.22	2.67
87	301181	标榜股份	7,227,428.72	2.65
88	600183	生益科技	7,187,841.00	2.63
89	300274	阳光电源	7,068,410.00	2.59
90	688037	芯源微	7,011,291.65	2.57
91	300229	拓尔思	6,991,805.00	2.56
92	000700	模塑科技	6,977,695.00	2.56
93	688201	信安世纪	6,886,177.25	2.52
94	002156	通富微电	6,875,624.00	2.52
95	002605	姚记科技	6,846,381.00	2.51
96	000681	视觉中国	6,839,995.00	2.51
97	301391	卡莱特	6,829,152.00	2.50
98	600760	中航沈飞	6,807,784.80	2.49
99	601921	浙版传媒	6,727,281.76	2.46
100	688521	芯原股份	6,634,237.09	2.43
101	000625	长安汽车	6,591,549.00	2.42
102	002843	泰嘉股份	6,535,920.13	2.39
103	600933	爱柯迪	6,477,236.00	2.37
104	688326	经纬恒润	6,336,168.01	2.32
105	003021	兆威机电	6,320,227.06	2.32
106	300604	长川科技	6,280,905.00	2.30
107	300996	普联软件	6,226,042.31	2.28
108	001270	铖昌科技	6,216,631.80	2.28
109	600266	城建发展	6,174,052.00	2.26
110	603893	瑞芯微	5,986,795.00	2.19

111	002463	沪电股份	5,978,841.90	2.19
112	603881	数据港	5,967,430.51	2.19
113	688518	联赢激光	5,939,296.66	2.18
114	603186	华正新材	5,916,110.00	2.17
115	688728	格科微	5,883,352.56	2.16
116	300480	光力科技	5,880,587.98	2.15
117	603203	快克智能	5,863,499.36	2.15
118	600415	小商品城	5,838,351.00	2.14
119	688095	福昕软件	5,790,272.91	2.12
120	300510	金冠股份	5,723,104.00	2.10
121	688561	奇安信	5,715,340.34	2.09
122	688208	道通科技	5,697,440.64	2.09
123	688599	天合光能	5,688,555.79	2.08
124	300598	诚迈科技	5,606,191.60	2.05
125	300182	捷成股份	5,598,913.00	2.05
126	688772	珠海冠宇	5,576,174.25	2.04
127	601098	中南传媒	5,472,723.00	2.01

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。

8.4.2 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	300394	天孚通信	51,020,022.30	18.69
2	300308	中际旭创	46,663,276.88	17.10
3	300502	新易盛	42,075,577.24	15.42
4	688256	寒武纪	36,542,376.21	13.39
5	601138	工业富联	31,693,937.00	11.61
6	002230	科大讯飞	28,536,808.06	10.46
7	000032	深桑达 A	26,751,917.00	9.80
8	688041	海光信息	26,092,391.71	9.56
9	300634	彩讯股份	25,174,359.00	9.22
10	688111	金山办公	24,536,451.51	8.99
11	600941	中国移动	24,387,794.00	8.94
12	601728	中国电信	22,722,148.16	8.33
12	00728	中国电信	1,332,724.88	0.49
13	002517	恺英网络	23,748,257.48	8.70
14	300002	神州泰岳	23,154,884.49	8.48
15	300693	盛弘股份	22,484,767.15	8.24
16	000938	紫光股份	22,029,822.60	8.07
17	601360	三六零	21,788,052.49	7.98
18	600050	中国联通	21,734,744.97	7.96
19	603019	中科曙光	21,226,544.00	7.78
20	000063	中兴通讯	20,457,090.00	7.50

21	688981	中芯国际	19,720,173.41	7.23
22	603997	继峰股份	19,002,816.00	6.96
23	002555	三七互娱	18,747,561.00	6.87
24	300418	昆仑万维	18,687,731.55	6.85
25	688579	山大地纬	18,441,825.16	6.76
26	688326	经纬恒润	18,096,976.31	6.63
27	000988	华工科技	17,979,623.00	6.59
28	002126	银轮股份	17,949,082.16	6.58
29	300033	同花顺	17,157,512.94	6.29
30	002236	大华股份	17,110,345.00	6.27
31	300170	汉得信息	16,908,271.56	6.20
32	002174	游族网络	16,722,249.00	6.13
33	000977	浪潮信息	16,029,742.59	5.87
34	300672	国科微	15,942,791.00	5.84
35	301236	软通动力	15,787,846.78	5.78
36	600498	烽火通信	15,311,358.30	5.61
37	600363	联创光电	15,153,030.85	5.55
38	600536	中国软件	15,048,534.61	5.51
39	603063	禾望电气	14,866,767.17	5.45
40	600633	浙数文化	14,595,987.00	5.35
41	002475	立讯精密	14,152,338.96	5.19
42	002558	巨人网络	13,800,612.25	5.06
43	688262	国芯科技	13,480,835.34	4.94
44	688332	中科蓝讯	13,132,935.57	4.81
45	600602	云赛智联	13,093,704.57	4.80
46	002908	德生科技	12,637,871.60	4.63
47	002929	润建股份	12,565,914.00	4.60
48	300130	新国都	12,471,182.00	4.57
49	300101	振芯科技	12,282,825.15	4.50
50	688498	源杰科技	12,189,559.13	4.47
51	300474	景嘉微	12,169,866.98	4.46
52	688700	东威科技	11,973,519.60	4.39
53	002472	双环传动	11,896,449.00	4.36
54	300280	紫天科技	11,790,384.00	4.32
55	688279	峰岹科技	11,508,511.59	4.22
56	300383	光环新网	11,446,123.00	4.19
57	688036	传音控股	11,407,944.68	4.18
58	601801	皖新传媒	11,132,008.00	4.08
59	603000	人民网	11,028,163.63	4.04
60	601689	拓普集团	10,986,391.00	4.03
61	300766	每日互动	10,618,338.00	3.89
62	600373	中文传媒	10,493,820.03	3.84
63	300533	冰川网络	10,400,293.00	3.81

64	002965	祥鑫科技	10,396,720.00	3.81
65	300408	三环集团	10,194,311.00	3.74
66	600183	生益科技	10,017,901.00	3.67
67	002624	完美世界	9,898,444.00	3.63
68	603258	电魂网络	9,888,890.00	3.62
69	300364	中文在线	9,883,440.88	3.62
70	002368	太极股份	9,555,426.23	3.50
71	688561	奇安信	9,505,121.05	3.48
72	688378	奥来德	9,446,624.61	3.46
73	688676	金盘科技	8,958,946.11	3.28
74	301391	卡莱特	8,851,054.00	3.24
75	000719	中原传媒	8,759,344.61	3.21
76	300926	博俊科技	8,711,359.12	3.19
77	688012	中微公司	8,376,518.54	3.07
78	002837	英维克	8,342,278.91	3.06
79	300494	盛天网络	8,316,499.00	3.05
80	000768	中航西飞	8,230,346.25	3.02
81	300491	通合科技	8,223,353.00	3.01
82	688023	安恒信息	8,133,577.61	2.98
83	688521	芯原股份	8,104,169.09	2.97
84	603197	保隆科技	7,912,669.00	2.90
85	603383	顶点软件	7,785,616.20	2.85
86	301018	申菱环境	7,776,786.90	2.85
87	688328	深科达	7,738,981.47	2.84
88	300592	华凯易佰	7,702,207.00	2.82
89	688439	振华风光	7,649,267.20	2.80
90	300857	协创数据	7,465,168.00	2.74
91	301181	标榜股份	7,421,039.70	2.72
92	001269	欧晶科技	7,367,434.27	2.70
93	605133	嵘泰股份	7,339,881.00	2.69
94	002912	中新赛克	7,304,010.00	2.68
95	003029	吉大正元	7,284,544.00	2.67
96	688031	星环科技	7,275,338.76	2.67
97	600850	电科数字	7,213,550.00	2.64
98	300624	万兴科技	7,186,011.58	2.63
99	002602	世纪华通	7,175,033.00	2.63
100	605333	沪光股份	7,132,841.00	2.61
101	600435	北方导航	7,093,870.64	2.60
102	600977	中国电影	7,035,644.21	2.58
103	000700	模塑科技	7,034,101.69	2.58
104	601019	山东出版	6,975,164.00	2.56
105	002605	姚记科技	6,923,951.39	2.54
106	600760	中航沈飞	6,803,156.60	2.49

107	300133	华策影视	6,800,386.00	2.49
108	300274	阳光电源	6,765,771.18	2.48
109	601633	长城汽车	6,748,856.56	2.47
110	688132	邦彦技术	6,476,748.65	2.37
111	600933	爱柯迪	6,423,680.00	2.35
112	600415	小商品城	6,356,325.00	2.33
113	688369	致远互联	6,336,410.95	2.32
114	000625	长安汽车	6,320,824.00	2.32
115	000681	视觉中国	6,299,835.00	2.31
116	300559	佳发教育	6,285,374.00	2.30
117	601921	浙版传媒	6,264,658.00	2.30
118	688037	芯源微	6,263,140.19	2.29
119	002463	沪电股份	6,153,440.00	2.25
120	600266	城建发展	6,118,212.80	2.24
121	603881	数据港	6,117,394.62	2.24
122	688201	信安世纪	6,064,773.32	2.22
123	688595	芯海科技	6,053,731.87	2.22
124	300229	拓尔思	5,981,628.99	2.19
125	001270	铖昌科技	5,954,308.00	2.18
126	688518	联赢激光	5,952,008.09	2.18
127	688095	福昕软件	5,937,368.71	2.18
128	603186	华正新材	5,908,925.00	2.17
129	603893	瑞芯微	5,902,951.00	2.16
130	301312	智立方	5,881,321.84	2.15
131	300604	长川科技	5,792,617.00	2.12
132	688025	杰普特	5,764,586.27	2.11
133	002156	通富微电	5,761,579.00	2.11
134	003021	兆威机电	5,750,275.00	2.11
135	000034	神州数码	5,654,601.00	2.07
136	300996	普联软件	5,530,440.84	2.03
137	300803	指南针	5,499,849.00	2.02
138	002897	意华股份	5,495,228.45	2.01
139	600418	江淮汽车	5,493,515.00	2.01
140	688599	天合光能	5,489,903.45	2.01

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。

8.4.3 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	2,265,519,703.54
卖出股票收入（成交）总额	2,422,299,488.18

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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投资。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	255,412.63
2	应收清算款	1,439,989.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	37,600.42
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,733,002.19

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
7,512	13,346.67	300,357.87	0.30	99,959,806.68	99.70

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	张新华	664,247.00	11.08
2	何海添	301,223.00	5.03
3	戴利军	169,609.00	2.83
4	共青城树山投资管理有限公司－树山远星多策略精选 5 号私募证券投资基金	166,500.00	2.78
5	吴全海	114,112.00	1.90
6	完献忠	113,000.00	1.89
7	马永建	107,400.00	1.79
8	徐达	100,000.00	1.67
9	戴路辉	100,000.00	1.67
10	周灿桦	99,542.00	1.66
11	陆敏姬	99,542.00	1.66

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,068,153.72	1.0654

9.4 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 10 日）基金份额总额	204,557,249.85
本报告期期初基金份额总额	204,557,249.85
本报告期基金总申购份额	43,980,455.69
减：本报告期基金总赎回份额	148,277,540.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	100,260,164.55

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

基金管理人：本报告期内，公司 4 名董事发生变更，董事在最近 12 个月内变更未超过百分之五十。

基金托管人：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。

11.3 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，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本

基金提供审计服务 4 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 50,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	平安基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 12 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	公司管理的两只基金在债券投资过程中，参考外部评级机构的范围不符合监管规定。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改
其他	无

11.6.2 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到稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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(%)	
东北证券	3	803,351,568.21	17.14	582,210.66	17.13	-
天风证券	2	742,809,539.75	15.85	536,282.54	15.78	-
东吴证券	2	583,021,407.34	12.44	422,063.32	12.42	-
开源证券	2	310,269,596.32	6.62	224,425.83	6.60	-
恒泰证券	2	281,412,556.75	6.00	205,796.41	6.05	-
方正证券	2	234,500,637.75	5.00	169,456.75	4.98	-
长江证券	1	229,435,742.18	4.90	167,271.86	4.92	-
光大证券	2	201,552,993.94	4.30	146,082.11	4.30	-
西部证券	1	199,072,251.72	4.25	144,964.34	4.26	-

申万宏源证券	2	193,856,175.90	4.14	140,790.03	4.14	-
中信建投证券	2	181,589,083.41	3.87	130,981.23	3.85	-
华创证券	2	160,319,553.69	3.42	116,200.19	3.42	-
西南证券	1	131,766,554.30	2.81	95,191.79	2.80	-
民生证券	1	125,377,551.51	2.68	92,265.88	2.71	-
国信证券	2	76,392,948.80	1.63	57,984.95	1.71	-
东兴证券	2	63,152,282.19	1.35	45,552.01	1.34	-
国泰君安证券	1	58,917,292.12	1.26	42,498.03	1.25	-
中信证券	3	55,757,285.97	1.19	40,289.75	1.19	-
华泰证券	2	28,540,650.99	0.61	20,586.44	0.61	-
国盛证券	1	25,734,448.68	0.55	18,562.15	0.55	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	退租
大通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	退租
平安证券	4	-	-	-	-	退租 2 个
世纪证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	退租
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
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。

11.7.2 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(%)
东北证券	7,627,873.51	51.11	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	208,169.65	1.39	65,823,000.00	81.90	-	-
开源证券	-	-	14,549,000.00	18.10	-	-
恒泰证券	2,863,442.74	19.18	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	4,226,315.73	28.32	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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
3	平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置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 20 日
4	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理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 09 日
5	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富（北京）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	2023 年 02 月 13 日
6	平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 16 日
7	平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 16 日
8	平安科技创新 3 年封闭运作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	2023 年 03 月 16 日
9	平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 31 日

	告		
10	关于平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满相关安排的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 04 日
11	平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 04 日
12	平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 04 日
13	关于平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）开放申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 04 日
14	平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 07 日
15	平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 07 日
16	关于暂停平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）申购和定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 10 日
17	平安基金管理有限公司关于新增长江证券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 04 月 14 日
18	平安基金管理有限公司关于新增诚通证券股份有限公司为平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 14 日
19	平安基金管理有限公司关于新增平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 19 日
20	平安基金管理有限公司关于新增招商银行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 04 月 20 日
21	平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置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 22 日
22	平安基金管理有限公司关于新增深圳新华信通基金销售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 04 月 26 日
23	平安基金管理有限公司关于新增山西证券股份有限公司为平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 05 月 09 日
24	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享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	2023 年 05 月 12 日
25	平安基金管理有限公司关于旗下部分	中国证监会规定报刊及	2023 年 06 月 05 日

	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	网站	
26	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 07 月 07 日
27	平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 07 月 21 日
28	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 08 月 21 日
29	关于恢复平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）申购和定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 24 日
30	平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）2023 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 31 日
31	平安基金管理有限公司关于新增国金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 09 月 04 日
32	平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 28 日
33	平安新兴产业混合型证券投资基金(LOF)招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 28 日
34	平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 25 日
35	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险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 11 月 01 日
36	平安基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 05 日
37	平安基金管理有限公司关于新增上海中正达广基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 07 日
38	平安基金管理有限公司关于旗下基金所持中文传媒（代码 600373）估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 21 日
39	平安基金管理有限公司关于新增上海中欧财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 29 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定，本基金于 2023 年 4 月 9 日封闭运作期届满，自 2023 年 4 月 10 日起转为开放式运作，接受场内、场外申购赎回，基金名称变更为“平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）”。本基金更名后，基金简称变更为“平安新兴产业混合（LOF）”，场内证券简称为“新兴平安”，扩位证券简称为“平安新兴产业 LOF”，基金代码仍为“501099”。平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对基金合同、托管协议中涉及基金更名的相关内容进行修改，并根据最新的法律法规对相关内容进行修订和补充。详细内容可阅读本公司于 2023 年 4 月 4 日发布的《关于平安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满相关安排的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

（1）中国证监会准予平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）设立的文件

（2）平安新兴产业混合型证券投资基金（LOF）基金合同

（3）平安新兴产业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

13.2 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

13.3 查阅方式

（1）投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

（2）投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日