

平安港股通红利精选混合型发起式证券投资
基金
2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：南京银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 07 月 12 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 11 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安港股通红利精选混合发起式
基金主代码	021046
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 3 月 26 日
报告期末基金份额总额	74,768,443.31 份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力求获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>2、股票（含存托凭证）投资策略</p> <p>本基金将深度挖掘红利主题股票的投资机会，综合采用定量分析和定性分析相结合的研究方法挖掘优质公司，构建股票投资组合。</p> <p>（1）“红利”主题的界定</p> <p>本基金管理人将同时满足以下两项特征的股票作为符合红利主题的公司，构建基础股票池：</p> <p>①在过去两年中，至少有一年实施现金分红且两年平均现金分红率（现金分红/净利润）或股息率（现金分红/市值）处于市场前 50%；</p> <p>②经营状况良好、无重大违法违规事项、红利分配与经营情况不存在重大异常。未来市场可能推出财产股息、负债股息等现金股利和股票股利的替代方式，本基金将关注在这些方式中能够提供优厚股东权益回报的公司。若因市场中的常见分红方式发生变化而导致红利主题股票的投资机会减少，在不改变基金投资目标及风险收益</p>

	<p>特征的前提下，基金管理人在履行适当程序后，可以对红利主题的界定方法进行变更，并在招募说明书更新中公告。</p> <p>(2) 红利主题股票投资策略</p> <p>本基金根据红利主题范畴选出基础股票池后，在此基础上通过定性分析和定量分析相结合的方法挖掘出优质上市公司，构建股票投资组合。</p> <p>在定性方面，本基金将综合考虑上市公司的核心业务竞争力、行业发展前景、市场地位、经营管理能力、人才资源、治理结构、研发投入、创新属性等因素，把握公司盈利能力的质量和持续性。</p> <p>在定量方面，本基金将在宏观经济分析、行业分析的基础上，根据公司的基本面及财务报表信息，灵活运用各类财务指标评估公司的价值，筛选出经营相对稳健且估值合理的上市公司。</p> <p>(3) 港股通标的股票投资策略</p> <p>(4) 存托凭证的投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p>	
业绩比较基准	中证港股通高股息投资全收益指数(经汇率调整)×85%+人民币银行活期存款利率(税后)×15%	
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。本基金投资港股通标的的股票，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。	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	南京银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安港股通红利精选混合发起式 A	平安港股通红利精选混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	021046	021047
报告期末下属分级基金的份额总额	72,960,719.32 份	1,807,723.99 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2024年4月1日-2024年6月30日)	
	平安港股通红利精选混合发起式 A	平安港股通红利精选混合发起式 C
1. 本期已实现收益	1,167,016.07	18,536.40
2. 本期利润	7,386,885.77	77,227.36
3. 加权平均基金份额本期利	0.1085	0.1031

润		
4. 期末基金资产净值	79,929,585.19	1,978,532.28
5. 期末基金份额净值	1.0955	1.0945

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安港股通红利精选混合发起式 A

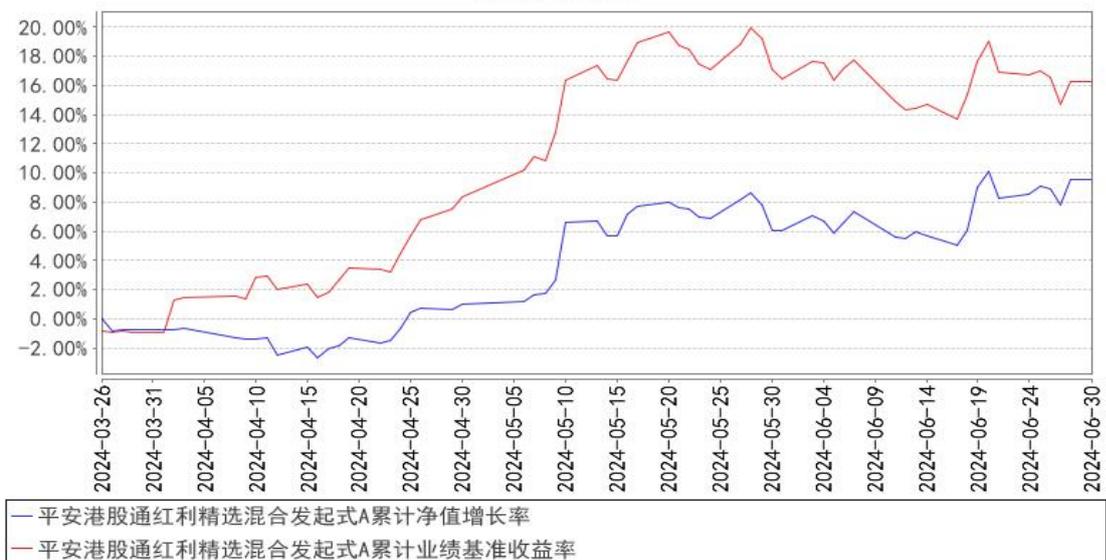
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.36%	0.93%	17.29%	1.05%	-6.93%	-0.12%
自基金合同生效起至今	9.55%	0.90%	16.23%	1.02%	-6.68%	-0.12%

平安港股通红利精选混合发起式 C

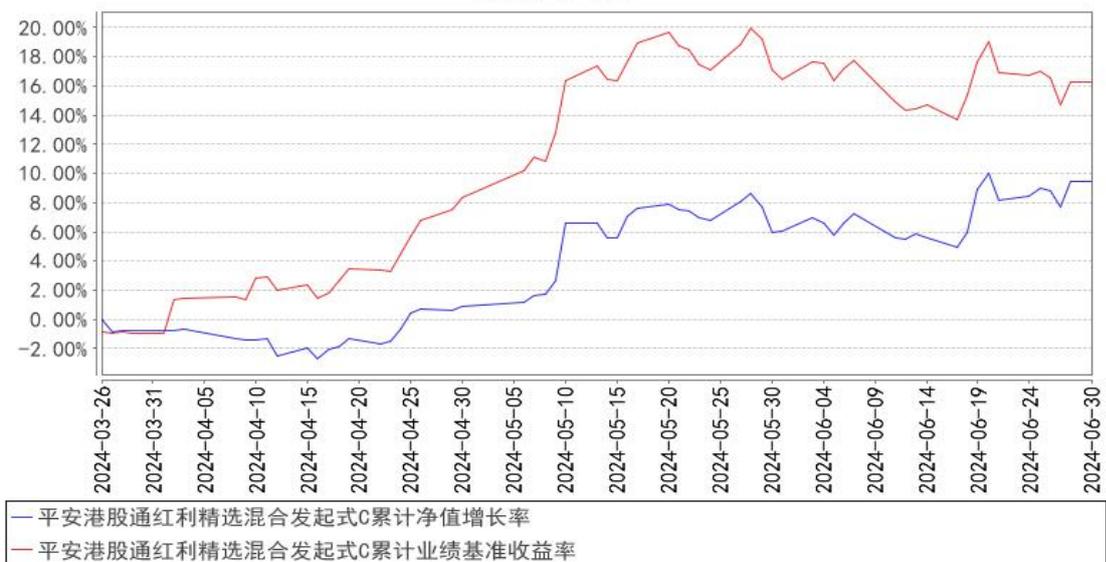
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.25%	0.93%	17.29%	1.05%	-7.04%	-0.12%
自基金合同生效起至今	9.45%	0.90%	16.23%	1.02%	-6.78%	-0.12%

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

平安港股通红利精选混合发起式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



平安港股通红利精选混合发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2024 年 03 月 26 日正式生效，截至报告期末未满半年；
 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁琳	平安港股通红利精选混合型发起式证券投资基金基金经理	2024年3月26日	-	13年	丁琳女士，厦门大学国际金融专业硕士，曾担任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司投资经理，2020年4月加入平安基金管理有限公司，现担任平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安消费精选混合型证券投资基金、平安港股通红利精选混合型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

港股股市在四月中旬开始迎来情绪面改善，其中恒生指数从底部开始累计反弹超过 20%。然

而，由于基本面仍然疲软，港股在持续一个月的大涨后，于五月下旬开始出现回调，并进入震荡局面。资金面和宏观政策持续发力是本轮上涨的主要动力，其中海外资金回流和南向资金持续流入，提振了港股市场的投资气氛以及估值。政策方面，国务院发布新“国九条”，提出强化上市公司现金分红监管，加大对分红优质公司的激励力度，多措并举推动提高股息率。在投资策略上，我们专注于基本面稳定的高分红板块，特别是金融、能源和通讯服务行业，这三大板块构成了我们投资组合的主要持仓。鉴于目前经济复苏状况仍存在较多不确定因素，我们将维持基本面较为稳定的高分红股份作为主要投资部署。我们继续看好电信、公用事业、能源和金融等几大领域，我们认为这些行业在经济恢复过程当中能带来良好的能见度和成长性，并能维持高分红。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安港股通红利精选混合发起式 A 的基金份额净值 1.0955 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.36%，同期业绩比较基准收益率为 17.29%；截至本报告期末平安港股通红利精选混合发起式 C 的基金份额净值 1.0945 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.25%，同期业绩比较基准收益率为 17.29%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	73,894,093.91	89.53
	其中：股票	73,894,093.91	89.53
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	7,437,233.12	9.01
8	其他资产	1,205,464.45	1.46
9	合计	82,536,791.48	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 73,894,093.91 元，占净值比

例 90.22%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 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	1,418,605.90	1.73
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	-	-
能源	20,099,164.91	24.54
金融	28,484,391.41	34.78
医疗	-	-
工业	1,656,021.35	2.02
地产业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	17,075,074.57	20.85
公用事业	5,160,835.77	6.30
合计	73,894,093.91	90.22

注：以上分类采用全球行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00883	中国海洋石油	352,000	7,196,299.26	8.79
2	00941	中国移动	102,000	7,168,188.72	8.75
3	00939	建设银行	1,298,000	6,835,480.35	8.35
4	03988	中国银行	1,810,000	6,360,010.58	7.76
5	00857	中国石油股份	770,000	5,551,832.44	6.78
6	01288	农业银行	1,794,000	5,468,742.05	6.68
7	00762	中国联通	832,000	5,444,537.78	6.65
8	00728	中国电信	1,056,000	4,462,348.07	5.45
9	03328	交通银行	674,000	3,770,846.94	4.60
10	00386	中国石油化工股份	756,000	3,491,329.56	4.26

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司在本报告编制日前

一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,197.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	981,135.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	221,131.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,205,464.45

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安港股通红利精选混合 发起式 A	平安港股通红利精选混合 发起式 C
报告期期初基金份额总额	10,000,999.00	2,000.00
报告期期间基金总申购份额	66,979,950.93	2,897,469.34
减：报告期期间基金总赎回份额	4,020,230.61	1,091,745.35
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	72,960,719.32	1,807,723.99

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	平安港股通红利精选混合发起式 A	平安港股通红利精选混合发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	13.71	-

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	13.37	10,000,000.00	13.37	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	13.37	10,000,000.00	13.37	3 年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024/04/01-2024/04/07	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	13.37
	2	2024/04/08-2024/06/30	-	35,217,347.55	-	35,217,347.55	47.10

	3	2024/04/08-2024/06/30	-	25,154,960.76	3,982,873.64	21,172,087.12	28.32
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安港股通红利精选混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安港股通红利精选混合型发起式证券投资基金基金合同
- (3) 平安港股通红利精选混合型发起式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

10.2 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

10.3 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，客户服务热线：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2024 年 07 月 12 日