平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金
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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 17 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	平安鼎越混合
场内简称	鼎越 LOF
基金主代码	167002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 20 日
报告期末基金份额总额	30,127,762.02 份
投资目标	本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，充分挖掘市场投资机会，力争实现资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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）

1.本期已实现收益	-1,719,949.52
2.本期利润	-3,342,962.05
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1098
4.期末基金资产净值	64,405,091.50
5.期末基金份额净值	2.1377

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

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	-4.87%	0.89%	-0.17%	0.36%	-4.70%	0.53%
过去六个月	1.80%	1.33%	2.50%	0.44%	-0.70%	0.89%
过去一年	-5.19%	1.25%	-2.05%	0.43%	-3.14%	0.82%
过去三年	-11.17%	1.76%	-11.49%	0.52%	0.32%	1.24%
过去五年	129.96%	1.86%	8.59%	0.57%	121.37%	1.29%
自基金合同生效起至今	113.77%	1.58%	24.31%	0.57%	89.46%	1.01%

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

注：1、本基金基金合同于 2016 年 09 月 20 日正式生效；

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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		
林清源	平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2023 年 11 月 13 日	-	12 年	林清源先生，宾夕法尼亚大学网络工程专业硕士，曾担任融通基金管理有限公司权益投资部基金经理。2023 年 2 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安鼎越灵活配置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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度市场整体表现低迷，呈现下跌趋势，并伴随着较大的波动性。在这一复杂的市场环境下，本基金继续保持原有的投资策略，并对部分配置进行了优化调整，进一步增加了出海方向的配置。尽管市场短期波动较大，我们依然对长期投资方向充满信心。

投资策略回顾：

1. 人工智能及光模块资产

我们对人工智能（AI）产业的长期发展保持乐观态度。尽管 AI 产业目前仍处于早期阶段，但技术进步和对算力的持续需求为光模块市场带来了巨大的增长潜力。AI 应用快速爆发的预期开始回落，但算力基础设施的投入仍然维持高位。我们相信，随着 AI 模型的优化和参数量的增加，光模块作为提供算力的关键组件，其市场需求将持续上升。短期看，我们会继续关注 AI 硬件领域的投资机会，并适时调整配置，以应对市场变化。

2. 制造业出海

制造业出海是我们重点关注和加大配置的方向之一。在国内市场竞争激烈、内需压力较大的背景下，制造业企业通过国际化布局，可以有效规避经营风险，拓展新的增长空间。尤其是那些已在海外建立产能的企业，能够更好地应对国际政治经济环境的变化。二季度，我们进一步增加了对制造业出海方向的配置，期待通过这些企业的国际化战略，为基金带来更加稳健的收益。

3. 高股息资产

高股息资产在市场波动期间展现出了较高的确定性和稳健的收益，也是二季度市场表现最好的方向性资产。我们精选了基础逻辑清晰、业绩稳定的出版和通信运营公司，这些公司为我们的投资组合提供了稳定的底仓收益，同时增强了组合的抗风险能力。

展望未来，我们对市场仍持谨慎乐观态度。我们将保持一贯的投资策略，积极在人工智能、制造业出海和高股息资产三个领域捕捉更多个股机会。我们对当前的持仓充满信心，并将继续密切关注市场动向，灵活调整策略，以应对不断变化的市场环境，力争为投资者实现稳健投资回报。

4.5 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 2.1377 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.87%，业绩比较基准收益率为-0.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§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	57,529,409.95	88.64
	其中：股票	57,529,409.95	88.64
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	6,713,018.31	10.34

8	其他资产	659,738.15	1.02
9	合计	64,902,166.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,788,400.00	5.88
C	制造业	37,942,181.95	58.91
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	8,151,920.00	12.66
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	-	-
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	4,820,322.00	7.48
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,826,586.00	4.39
S	综合	-	-
	合计	57,529,409.95	89.32

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600941	中国移动	50,300	5,407,250.00	8.40
2	301061	匠心家居	112,580	5,286,756.80	8.21
3	688169	石头科技	12,901	5,064,932.60	7.86
4	605098	行动教育	113,100	4,820,322.00	7.48
5	300308	中际旭创	33,940	4,679,647.20	7.27
6	300856	科思股份	135,600	4,340,556.00	6.74

7	600938	中国海油	114,800	3,788,400.00	5.88
8	301498	乖宝宠物	59,500	3,201,100.00	4.97
9	000333	美的集团	49,100	3,166,950.00	4.92
10	300457	赢合科技	176,800	3,152,344.00	4.89

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

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。

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	30,673.70
2	应收证券清算款	622,995.33
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,069.12
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	659,738.15

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

报告期期初基金份额总额	30,225,086.58
报告期期间基金总申购份额	1,886,614.21
减：报告期期间基金总赎回份额	1,983,938.77
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	30,127,762.02

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（1）中国证监会准予平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

（2）平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金合同

（3）平安鼎越灵活配置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

9.2 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

9.3 查阅方式

（1）投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

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

平安基金管理有限公司

2024 年 7 月 18 日