

平安价值回报混合型证券投资基金 2024 年中期报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 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 2024 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	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	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	12
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 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45

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	45
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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安价值回报混合型证券投资基金	
基金简称	平安价值回报混合	
基金主代码	013767	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 4 月 14 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	58,888,454.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	平安价值回报混合 A	平安价值回报混合 C
下属分级基金的交 易代码	013767	013768
报告期末下属分级 基金的份额总额	54,497,517.00 份	4,390,937.28 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，充分利用研究投资优势，追求超越基金业绩比较基准的资本增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）行业配置策略，（2）个股精选策略，（3）港股通投资标的股票投资策略，（4）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、股票期权投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、可转换债券及可交换债券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×25%+ 恒生指数收益率（经汇率调整）×5%
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。 本基金若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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	郭明
	联系电话	0755-22626828	(010)66105799
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路	北京市西城区复兴门内大街 55

	5033 号平安金融中心 34 层	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 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	罗春风	廖林

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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	平安价值回报混合 A	平安价值回报混合 C
本期已实现收益	7,283,320.20	544,365.82
本期利润	8,402,126.25	618,895.85
加权平均基金份额 本期利润	0.1446	0.1367
本期加权平均净 值利润率	15.90%	15.24%
本期基金份额净 值增长率	17.31%	16.84%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-3,304,016.66	-338,632.08
期末可供分配基 金份额利润	-0.0606	-0.0771
期末基金资产净 值	52,345,305.93	4,143,392.50

期末基金份额净值	0.9605	0.9436
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-3.95%	-5.64%

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

平安价值回报混合 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	-1.63%	0.97%	-2.15%	0.35%	0.52%	0.62%
过去三个月	7.26%	0.91%	-0.60%	0.55%	7.86%	0.36%
过去六个月	17.31%	0.98%	2.06%	0.67%	15.25%	0.31%
过去一年	3.68%	0.85%	-5.67%	0.65%	9.35%	0.20%
自基金合同生效起至今	-3.95%	0.89%	-8.87%	0.74%	4.92%	0.15%

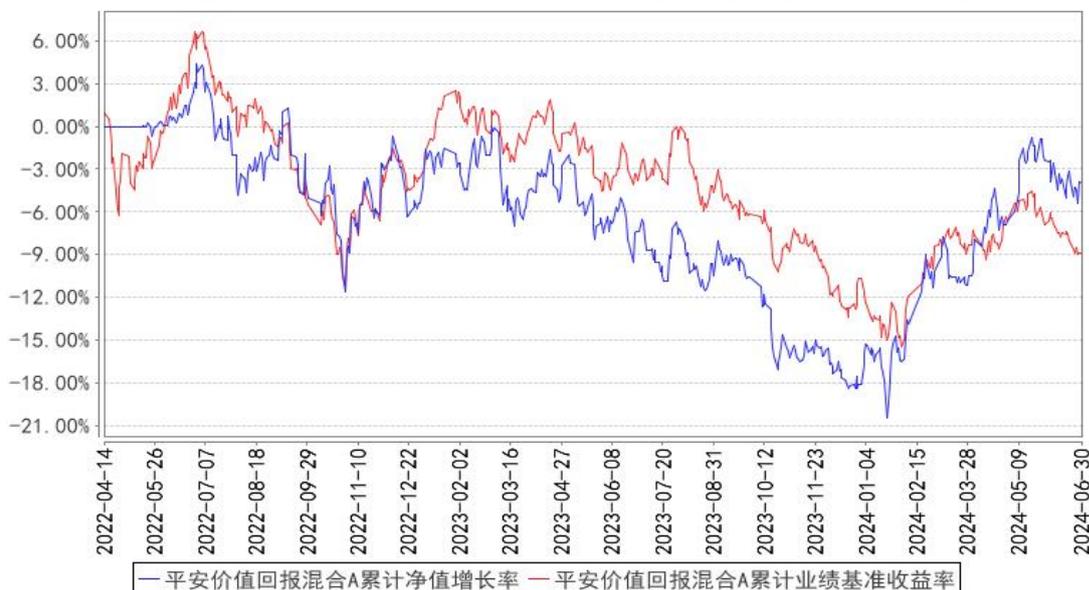
平安价值回报混合 C

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	-1.70%	0.97%	-2.15%	0.35%	0.45%	0.62%
过去三个月	7.04%	0.91%	-0.60%	0.55%	7.64%	0.36%
过去六个月	16.84%	0.98%	2.06%	0.67%	14.78%	0.31%
过去一年	2.86%	0.85%	-5.67%	0.65%	8.53%	0.20%
自基金合同生效起	-5.64%	0.89%	-8.87%	0.74%	3.23%	0.15%

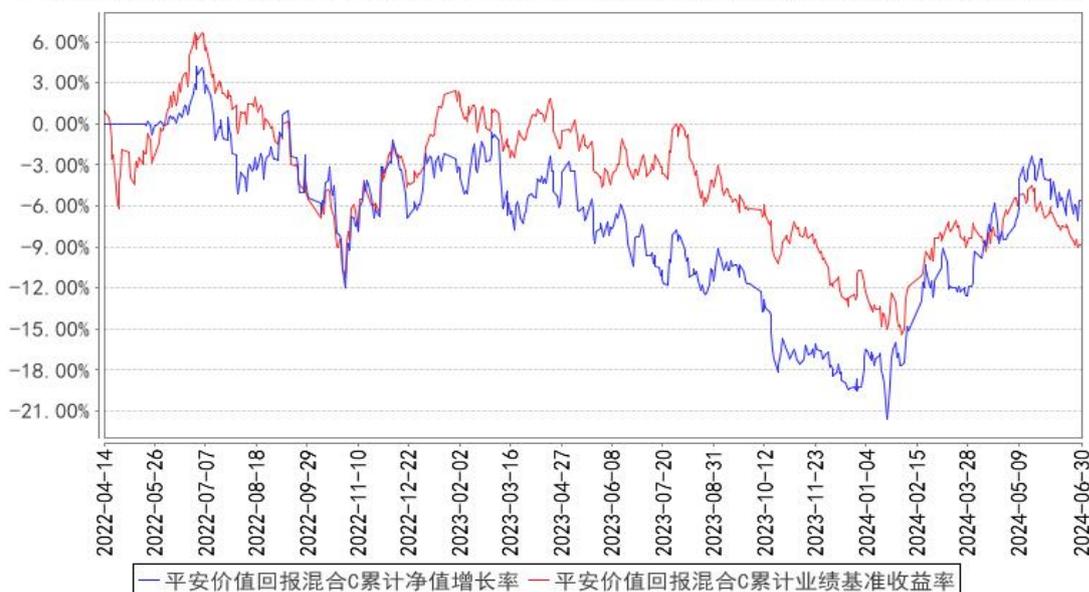
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

平安价值回报混合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



平安价值回报混合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、本基金基金合同于 2022 年 04 月 14 日正式生效；

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

3.3 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、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）。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 2024 年 6 月 30 日，平安基金共管理 206 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6655 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		
刘杰	平安价值回报混合型证券投资基金基金经理	2022 年 4 月 14 日	-	16 年	刘杰先生，外交学院经济学硕士。曾先后担任金元证券投资银行部项目经理，天弘基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理，英大基金管理有限公司专户投资部投资经理、基金经理等。2017 年 8 月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资研究部投资经理。现担任平安行业先锋混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安价值回报混合型证券投资基金、平安股息精选沪港深股票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

截至本期末，在投资策略方面，本产品仍保持较高的股票仓位，通过结构调整来应对市场波动。从长期价值及成长性视角，结合中短期估值以及基本面边际变化，同时将股息率也纳入选股标准进行综合考量，自下而上选取个股。力争通过个股配置获取超额收益及应对市场波动的冲击。产品运作层面，本产品继续从估值合理性、股息率，及公司基本面出发综合考虑选取投资标的，目前重点配置了能源煤炭、银行、交通运输、公用事业、大消费等方向的品种，仍坚持自下而上为主，持股相对分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安价值回报混合 A 的基金份额净值 0.9605 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.31%，同期业绩比较基准收益率为 2.06%；截至本报告期末平安价值回报混合 C 的基金份额净值 0.9436 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.84%，同期业绩比较基准收益率为 2.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为影响 2024 年权益市场走势的主要因素包括国内外经济形势、国际货币环境、国际贸易关系等。国内经济走势筑稳向好的中长期趋势不变，而外需目前来看好于市场预期，为中国制造业“出海”寻找新的成长方向提供了更多机会，我们也在努力发掘中国制造业中具备全球竞争力、能够走向全球成长壮大的细分品种；国际货币环境目前来看短期宽松难现，但一旦主要国家开启宽松周期，全球资本市场估值有望边际修复，基本面也会出现边际改善；国际贸易关系在今年全球“大选年”的背景下，可能存在一定扰动因素，但我们相信，在国际分工及全球化的大趋势下，国际市场会是中国制造业的重要成长与发展方向。

2024 年权益市场可能仍将表现为一定的分化特征。一方面，市场将继续在具备防御属性的低估值高股息品种如公用事业、大金融、交运、资源股中寻找相对确定的现金回报机会，短期可能会有加速集中的特征；而与此同时，数字经济、人工智能、智能驾驶、机器人等为代表的长期创新成长方向在相关品种估值充分调整后，个股机会也将逐渐显现。同时，大消费板块长期成长逻辑仍存，部分品种甚至还有很好的股息现金回报。若能结合国内外宏观经济走势、经济结构及人口特征变化趋势，在上述板块的中也将发掘到结构性投资机会。

因此，2024 年权益市场接下来的走势，在国债收益率持续下行、银行定存利率迈入“1”字头时代且权益市场持续波动的背景下，我们认为追求相对稳健回报的投资者正不断增加，且各类机构的增量资金不断入市购买高股息红利资产的趋势也将进一步加强。我们继续看好低估值高股息的价值股投资机会，并将继续自下而上选取基本面稳健、具备中长期投资价值、估值及股息率具备安全边际的个股品种加入组合中，力争更好地为持有人实现持续稳健的长期回报。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——平安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：平安价值回报混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,300,168.37	3,318,867.61
结算备付金		64,931.88	1,207,095.60
存出保证金		26,312.34	26,395.73
交易性金融资产	6.4.7.2	52,885,877.73	51,327,535.83

其中：股票投资		52,885,877.73	51,123,630.02
基金投资		-	-
债券投资		-	203,905.81
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		110,124.05	37,678.79
应收股利		586,929.90	-
应收申购款		2,857.51	2,335.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		56,977,201.78	55,919,909.22
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		82,930.53	1,062,034.30
应付赎回款		171,809.45	8,395.24
应付管理人报酬		56,276.59	56,782.81
应付托管费		9,379.44	9,463.81
应付销售服务费		2,803.69	2,604.94
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	165,303.65	230,545.46
负债合计		488,503.35	1,369,826.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	58,888,454.28	66,686,326.40
未分配利润	6.4.7.12	-2,399,755.85	-12,136,243.74
净资产合计		56,488,698.43	54,550,082.66
负债和净资产总计		56,977,201.78	55,919,909.22

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 58,888,454.28 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.9605 元，基金份额 54,497,517.00 份；C 类基金份额净值 0.9436 元，基金份额 4,390,937.28 份。

6.2 利润表

会计主体：平安价值回报混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,493,837.01	-448,057.16
1. 利息收入		10,037.18	14,807.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,037.18	14,578.18
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		-	228.98
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,288,740.04	-269,746.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	6,558,890.58	-1,333,888.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	205.92	865.70
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	1,729,643.54	1,063,275.63
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	1,193,336.08	-194,291.16
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	1,723.71	1,173.52
减：二、营业总支出		472,814.91	765,541.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	339,582.04	588,068.78
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,596.97	98,011.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	16,145.17	16,858.70

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	60,490.73	62,602.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,021,022.10	-1,213,598.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,021,022.10	-1,213,598.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,021,022.10	-1,213,598.79

6.3 净资产变动表

会计主体：平安价值回报混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	66,686,326.40	-	-12,136,243.74	54,550,082.66
二、本期期初净资产	66,686,326.40	-	-12,136,243.74	54,550,082.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,797,872.12	-	9,736,487.89	1,938,615.77
（一）、综合收益总额	-	-	9,021,022.10	9,021,022.10
（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）	-7,797,872.12	-	715,465.79	-7,082,406.33
其中：1. 基金申购款	1,229,999.97	-	-72,989.38	1,157,010.59
2. 基金赎回款	-9,027,872.09	-	788,455.17	-8,239,416.92
（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	58,888,454.28	-	-2,399,755.85	56,488,698.43
项目	上年度可比期间 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	92,058,382.11	-	-4,963,151.85	87,095,230.26
二、本期期初净资产	92,058,382.11	-	-4,963,151.85	87,095,230.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,322,649.75	-	-720,726.42	-16,043,376.17
（一）、综合收益总额	-	-	-1,213,598.79	-1,213,598.79
（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）	-15,322,649.75	-	492,872.37	-14,829,777.38
其中：1. 基金申购款	955,075.66	-	-41,502.14	913,573.52
2. 基金赎回款	-16,277,725.41	-	534,374.51	-15,743,350.90
（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	76,735,732.36	-	-5,683,878.27	71,051,854.09

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安价值回报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[2021]2648号《关于准予平安价值回报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《平安价值回报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 293,158,384.37 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(2022)第 0289 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安价值回报混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 4 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 293,223,734.53 份基金份额,其中认购资金利息折合 65,350.16 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《平安价值回报混合型证券投资基金基金招募说明书》,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《平安价值回报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、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票、衍生工具(股指期货、国债期货、股票期权)、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、政府支持债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、信用衍生品、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。本基金股票资产(含存托凭证)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。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 70%+中证全债指数收益率 \times 25%+恒生指数收益率(经汇率调整) \times 5%。

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》、《平安价值回报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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深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[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。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/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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	3,300,168.37
等于：本金	3,299,863.63
加：应计利息	304.74
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	3,300,168.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	51,204,380.90	-	52,885,877.73	1,681,496.83
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	51,204,380.90	-	52,885,877.73	1,681,496.83

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
----	-----

	2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	106,625.03
其中：交易所市场	106,625.03
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	58,678.62
合计	165,303.65

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安价值回报混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,990,393.69	61,990,393.69
本期申购	614,300.06	614,300.06
本期赎回（以“-”号填列）	-8,107,176.75	-8,107,176.75
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	54,497,517.00	54,497,517.00

平安价值回报混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,695,932.71	4,695,932.71
本期申购	615,699.91	615,699.91
本期赎回（以“-”号填列）	-920,695.34	-920,695.34
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	4,390,937.28	4,390,937.28

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

平安价值回报混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,571,965.90	339,144.07	-11,232,821.83
本期期初	-11,571,965.90	339,144.07	-11,232,821.83
本期利润	7,283,320.20	1,118,806.05	8,402,126.25
本期基金份额交易产生的变动数	984,629.04	-306,144.53	678,484.51
其中：基金申购款	-61,181.64	34,208.01	-26,973.63
基金赎回款	1,045,810.68	-340,352.54	705,458.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,304,016.66	1,151,805.59	-2,152,211.07

平安价值回报混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-927,914.83	24,492.92	-903,421.91
本期期初	-927,914.83	24,492.92	-903,421.91
本期利润	544,365.82	74,530.03	618,895.85
本期基金份额交易产生的变动数	44,916.93	-7,935.65	36,981.28
其中：基金申购款	-79,282.67	33,266.92	-46,015.75
基金赎回款	124,199.60	-41,202.57	82,997.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-338,632.08	91,087.30	-247,544.78

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	6,642.18
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	3,168.31
其他	226.69
合计	10,037.18

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,558,890.58
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	6,558,890.58
----	--------------

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	199,575,573.64
减：卖出股票成本总额	192,520,230.09
减：交易费用	496,452.97
买卖股票差价收入	6,558,890.58

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	649.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-444.00
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	205.92

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	306,200.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	300,444.00
减：应计利息总额	6,200.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-444.00

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,729,643.54
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	1,729,643.54

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	1,193,336.08
股票投资	1,193,112.08
债券投资	224.00
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	1,193,336.08

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	1,704.84
基金转换费收入	18.87
合计	1,723.71

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	18,897.06
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	1,129.28
其他	682.83
合计	60,490.73

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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
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

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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（%）
平安证券	53,061,101.58	13.51	15,233,448.00	3.25

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 2024年1月1日至2024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 (%)
平安证券	39,047.20	14.49	18,822.99	17.65
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)
平安证券	10,988.01	3.23	10,988.01	5.63

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	339,582.04
其中：应支付销售机构的客户维护 费	162,996.44	282,264.64
应支付基金管理人的净管理费	176,585.60	305,804.14

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 1.20% 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 × 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,596.97	98,011.52

注：支付基金托管行工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安价值回报混合 A	平安价值回报混合 C	合计
方正证券	-	16.28	16.28
工商银行	-	9,120.82	9,120.82
平安基金	-	53.57	53.57
平安人寿	-	638.85	638.85
平安银行	-	3,060.74	3,060.74
平安证券	-	356.67	356.67
合计	-	13,246.93	13,246.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	平安价值回报混合 A	平安价值回报混合 C	合计
方正证券	-	8.54	8.54
工商银行	-	10,275.67	10,275.67
平安人寿	-	1,185.47	1,185.47
平安银行	-	399.85	399.85
平安证券	-	377.89	377.89
合计	-	12,247.42	12,247.42

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金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：

C 类基金日销售服务费=C 类基金前一日基金资产净值×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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
工商银行-活期	3,300,168.37	6,642.18	4,016,025.25	9,362.86

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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

注：本基金本报告期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。

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（2024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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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：本基金未持有除国债、央行票据及政策性金融债之外的债券和资产支持证券）。

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公司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 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

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。

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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,300,168.37	-	-	-	3,300,168.37
结算备付金	64,931.88	-	-	-	64,931.88
存出保证金	26,312.34	-	-	-	26,312.34
交易性金融资产	-	-	-	52,885,877.73	52,885,877.73
应收股利	-	-	-	586,929.90	586,929.90
应收申购款	-	-	-	2,857.51	2,857.51
应收清算款	-	-	-	110,124.05	110,124.05
资产总计	3,391,412.59	-	-	53,585,789.19	56,977,201.78
负债					

应付赎回款	-	-	-	171,809.45	171,809.45
应付管理人报酬	-	-	-	56,276.59	56,276.59
应付托管费	-	-	-	9,379.44	9,379.44
应付清算款	-	-	-	82,930.53	82,930.53
应付销售服务费	-	-	-	2,803.69	2,803.69
其他负债	-	-	-	165,303.65	165,303.65
负债总计	-	-	-	488,503.35	488,503.35
利率敏感度缺口	3,391,412.59	-	-	53,097,285.84	56,488,698.43
上年度末 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	3,318,867.61	-	-	-	3,318,867.61
结算备付金	1,207,095.60	-	-	-	1,207,095.60
存出保证金	26,395.73	-	-	-	26,395.73
交易性金融资产	203,905.81	-	-	51,123,630.02	51,327,535.83
应收申购款	-	-	-	2,335.66	2,335.66
应收清算款	-	-	-	37,678.79	37,678.79
资产总计	4,756,264.75	-	-	51,163,644.47	55,919,909.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,395.24	8,395.24
应付管理人报酬	-	-	-	56,782.81	56,782.81
应付托管费	-	-	-	9,463.81	9,463.81
应付清算款	-	-	-	1,062,034.30	1,062,034.30
应付销售服务费	-	-	-	2,604.94	2,604.94
其他负债	-	-	-	230,545.46	230,545.46
负债总计	-	-	-	1,369,826.56	1,369,826.56
利率敏感度缺口	4,756,264.75	-	-	49,793,817.91	54,550,082.66

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：于本报告期末，本基金未持有交易性债券资产投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：本基金持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.37%），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）。

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 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	24,280,084.45	-	24,280,084.45
资产合计	-	24,280,084.45	-	24,280,084.45
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	-	24,280,084.45	-	24,280,084.45
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	5,659,402.18	-	5,659,402.18
资产合计	-	5,659,402.18	-	5,659,402.18
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	-	5,659,402.18	-	5,659,402.18

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		
	所有外币相对于人民币贬值 5%		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对于人	-1,214,004.22	-282,970.11

	人民币贬值 5%		
	所有外币相对于人民币升值 5%	1,214,004.22	282,970.11

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	52,885,877.73	93.62	51,123,630.02	93.72
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	52,885,877.73	93.62	51,123,630.02	93.72

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		
	沪深 300 指数上升 5%		
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）		上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	本期末（2024 年 6 月 30 日）		
分析	沪深 300 指数上升 5%	1,431,258.23	1,862,584.31

	沪深 300 指数下降 5%	-1,431,258.23	-1,862,584.31
--	-------------------	---------------	---------------

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	52,885,877.73	51,123,630.02
第二层次	-	203,905.81
第三层次	-	-
合计	52,885,877.73	51,327,535.83

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的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	52,885,877.73	92.82
	其中：股票	52,885,877.73	92.82
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	3,365,100.25	5.91
8	其他各项资产	726,223.80	1.27
9	合计	56,977,201.78	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 24,280,084.45 元，占净值比例 42.98%。

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	6,679,578.80	11.82
C	制造业	8,720,752.48	15.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,727,089.00	6.60
E	建筑业	1,433,934.00	2.54
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,278,006.00	4.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	-	-

业			
J	金融业	5,212,373.00	9.23
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	554,060.00	0.98
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,605,793.28	50.64

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	2,210,830.40	3.91
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	-	-
能源	5,452,855.94	9.65
金融	5,037,564.64	8.92
医疗	-	-
工业	7,895,914.12	13.98
地产业	-	-
信息技术	1,965,693.68	3.48
电信服务	603,244.97	1.07
公用事业	1,113,980.70	1.97
合计	24,280,084.45	42.98

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	03618	重庆农村商业 银行	421,000	1,471,632.61	2.61
1	601077	渝农商行	224,300	1,125,986.00	1.99
2	03969	中国通号	641,000	1,965,693.68	3.48
3	01766	中国中车	392,000	1,803,163.62	3.19
4	601009	南京银行	169,300	1,759,027.00	3.11
5	601825	沪农商行	260,000	1,747,200.00	3.09
6	00598	中国外运	501,000	1,737,560.18	3.08
7	601225	陕西煤业	66,500	1,713,705.00	3.03
8	605368	蓝天燃气	125,100	1,706,364.00	3.02
9	03328	交通银行	304,000	1,700,797.43	3.01

10	01288	农业银行	557,000	1,697,931.62	3.01
11	600282	南钢股份	338,100	1,683,738.00	2.98
12	00883	中国海洋石油	81,000	1,655,966.59	2.93
13	01088	中国神华	47,000	1,542,109.76	2.73
14	600970	中材国际	118,900	1,433,934.00	2.54
15	02099	中国黄金国际	30,000	1,371,758.04	2.43
16	00639	首钢资源	392,000	1,144,865.79	2.03
17	600971	恒源煤电	95,500	1,140,270.00	2.02
18	601000	唐山港	242,300	1,138,810.00	2.02
19	000333	美的集团	17,600	1,135,200.00	2.01
20	600012	皖通高速	40,800	569,976.00	1.01
20	00995	安徽皖通高速公路	66,000	563,214.83	1.00
21	000786	北新建材	38,200	1,133,012.00	2.01
22	000552	甘肃能化	325,900	1,130,873.00	2.00
23	600188	兖矿能源	25,800	586,434.00	1.04
23	01171	兖矿能源	53,400	543,906.17	0.96
24	00177	江苏宁沪高速公路	148,000	1,125,188.41	1.99
25	603365	水星家纺	69,000	1,079,850.00	1.91
26	002327	富安娜	85,500	859,275.00	1.52
27	01258	中国有色矿业	135,000	839,072.36	1.49
28	00107	四川成渝高速公路	262,000	817,797.79	1.45
29	600295	鄂尔多斯	79,094	784,612.48	1.39
30	03369	秦港股份	355,000	631,802.73	1.12
31	00257	光大环境	176,000	629,676.19	1.11
32	00811	新华文轩	68,000	603,244.97	1.07
33	002884	凌霄泵业	30,800	591,360.00	1.05
34	03898	时代电气	20,900	587,510.37	1.04
35	600025	华能水电	54,100	583,198.00	1.03
36	300628	亿联网络	15,800	580,966.00	1.03
37	601939	建设银行	78,400	580,160.00	1.03
38	600285	羚锐制药	23,900	578,619.00	1.02
39	600985	淮北矿业	34,400	575,856.00	1.02
40	600236	桂冠电力	74,500	571,415.00	1.01
41	601006	大秦铁路	79,500	569,220.00	1.01
42	600023	浙能电力	80,000	568,800.00	1.01
43	01898	中煤能源	68,000	566,007.63	1.00
44	01816	中广核电力	179,000	561,991.84	0.99
45	605098	行动教育	13,000	554,060.00	0.98
46	00371	北控水务集团	252,000	551,988.86	0.98
47	600348	华阳股份	55,200	549,792.00	0.97
48	601666	平煤股份	44,814	501,916.80	0.89

49	601001	晋控煤业	29,100	480,732.00	0.85
50	600886	国投电力	16,300	297,312.00	0.53
51	600066	宇通客车	11,400	294,120.00	0.52
52	01658	邮储银行	40,000	167,202.98	0.30

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	03618	重庆农村商业银行	3,070,402.76	5.63
1	601077	渝农商行	2,743,250.00	5.03
2	601825	沪农商行	4,376,359.00	8.02
3	00598	中国外运	2,936,149.65	5.38
3	601598	中国外运	1,292,775.00	2.37
4	600373	中文传媒	3,757,268.00	6.89
5	01088	中国神华	1,972,926.67	3.62
5	601088	中国神华	1,639,311.00	3.01
6	03969	中国通号	3,333,661.58	6.11
7	000708	中信特钢	3,320,414.00	6.09
8	000932	华菱钢铁	3,271,666.00	6.00
9	002601	龙佰集团	3,070,089.00	5.63
10	00998	中信银行	1,974,052.46	3.62
10	601998	中信银行	1,087,666.00	1.99
11	02099	中国黄金国际	2,759,287.86	5.06
12	00883	中国海洋石油	1,525,786.34	2.80
12	600938	中国海油	1,225,161.00	2.25
13	00639	首钢资源	2,724,320.70	4.99
14	603758	秦安股份	2,665,892.00	4.89
15	600985	淮北矿业	2,653,138.00	4.86
16	601009	南京银行	2,652,767.00	4.86
17	00992	联想集团	2,625,168.55	4.81
18	600971	恒源煤电	2,569,762.00	4.71
19	01171	兖矿能源	1,543,884.34	2.83
19	600188	兖矿能源	1,020,231.00	1.87
20	600282	南钢股份	2,481,119.00	4.55
21	00371	北控水务集团	2,364,930.88	4.34
22	002154	报喜鸟	2,360,440.00	4.33
23	603365	水星家纺	2,326,709.00	4.27
24	600096	云天化	2,322,573.00	4.26
25	01288	农业银行	2,307,378.47	4.23
26	601225	陕西煤业	2,208,235.00	4.05
27	601158	重庆水务	2,206,107.78	4.04

28	01766	中国中车	2,201,457.69	4.04
29	605368	蓝天燃气	2,196,949.00	4.03
30	000543	皖能电力	2,191,370.00	4.02
31	600546	山煤国际	2,153,811.00	3.95
32	002884	凌霄泵业	2,070,727.00	3.80
33	601019	山东出版	2,062,175.00	3.78
34	600295	鄂尔多斯	2,034,416.06	3.73
35	000895	双汇发展	2,017,571.00	3.70
36	01898	中煤能源	1,722,726.01	3.16
36	601898	中煤能源	280,768.00	0.51
37	00177	江苏宁沪高速公路	1,769,790.29	3.24
37	600377	宁沪高速	221,775.00	0.41
38	601881	中国银河	1,987,854.00	3.64
39	000983	山西焦煤	1,968,097.00	3.61
40	600348	华阳股份	1,955,596.00	3.58
41	600023	浙能电力	1,924,162.00	3.53
42	002128	电投能源	1,894,821.00	3.47
43	601666	平煤股份	1,833,571.00	3.36
44	000786	北新建材	1,825,893.00	3.35
45	03328	交通银行	1,766,843.77	3.24
46	600176	中国巨石	1,738,795.00	3.19
47	601000	唐山港	1,709,846.00	3.13
48	002027	分众传媒	1,694,131.00	3.11
49	03968	招商银行	1,693,348.29	3.10
50	600028	中国石化	1,053,595.00	1.93
50	00386	中国石油化工股份	573,774.55	1.05
51	600025	华能水电	1,616,340.00	2.96
52	601699	潞安环能	1,615,911.00	2.96
53	000933	神火股份	1,526,594.00	2.80
54	600970	中材国际	1,510,411.00	2.77
55	00995	安徽皖通高速公路	938,514.45	1.72
55	600012	皖通高速	570,316.00	1.05
56	601006	大秦铁路	1,494,559.00	2.74
57	600256	广汇能源	1,425,142.00	2.61
58	02601	中国太保	1,424,567.56	2.61
59	000090	天健集团	1,409,859.00	2.58
60	002327	富安娜	1,401,683.00	2.57
61	00392	北京控股	1,390,944.90	2.55
62	00388	香港交易所	1,379,417.21	2.53
63	000923	河钢资源	1,175,410.00	2.15
64	000683	远兴能源	1,170,313.00	2.15

65	600782	新钢股份	1,159,574.00	2.13
66	01258	中国有色矿业	1,146,131.90	2.10
67	000700	模塑科技	1,143,781.00	2.10
68	600919	江苏银行	1,143,266.00	2.10
69	000725	京东方 A	1,136,483.00	2.08
70	02328	中国财险	1,135,545.91	2.08
71	002763	汇洁股份	1,135,180.00	2.08
72	000552	甘肃能化	1,129,301.00	2.07
73	600346	恒力石化	1,129,227.00	2.07
74	002955	鸿合科技	1,120,344.00	2.05

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	600373	中文传媒	3,907,460.00	7.16
2	000895	双汇发展	3,669,852.00	6.73
3	03618	重庆农村商业银行	1,837,675.08	3.37
3	601077	渝农商行	1,728,090.00	3.17
4	000933	神火股份	3,499,551.08	6.42
5	00998	中信银行	2,261,543.17	4.15
5	601998	中信银行	1,172,152.00	2.15
6	000983	山西焦煤	3,340,614.00	6.12
7	002601	龙佰集团	3,292,403.00	6.04
8	601666	平煤股份	3,256,702.00	5.97
9	000708	中信特钢	3,136,183.56	5.75
10	000932	华菱钢铁	3,128,624.00	5.74
11	600985	淮北矿业	3,036,149.00	5.57
12	600919	江苏银行	2,944,477.00	5.40
13	00598	中国外运	1,456,837.28	2.67
13	601598	中国外运	1,440,182.00	2.64
14	600023	浙能电力	2,767,903.00	5.07
15	601825	沪农商行	2,763,200.00	5.07
16	600188	兖矿能源	1,851,274.50	3.39
16	01171	兖矿能源	901,502.55	1.65
17	600025	华能水电	2,719,707.00	4.99
18	603365	水星家纺	2,713,479.00	4.97
19	603758	秦安股份	2,647,719.00	4.85
20	00995	安徽皖通高速公路	2,620,941.06	4.80
20	600012	皖通高速	16,740.00	0.03
21	601006	大秦铁路	2,605,359.03	4.78

22	601088	中国神华	1,891,282.00	3.47
22	01088	中国神华	665,735.06	1.22
23	601000	唐山港	2,536,788.00	4.65
24	00992	联想集团	2,422,786.13	4.44
25	600377	宁沪高速	1,664,571.00	3.05
25	00177	江苏宁沪高速公路	697,824.22	1.28
26	600546	山煤国际	2,324,141.00	4.26
27	600096	云天化	2,284,589.00	4.19
28	002327	富安娜	2,280,670.80	4.18
29	600886	国投电力	2,276,653.00	4.17
30	600901	江苏金租	2,272,227.00	4.17
31	601019	山东出版	2,271,865.00	4.16
32	002154	报喜鸟	2,227,411.00	4.08
33	601158	重庆水务	2,216,315.00	4.06
34	002128	电投能源	2,183,810.00	4.00
35	000543	皖能电力	2,181,678.00	4.00
36	600282	南钢股份	2,135,325.00	3.91
37	600941	中国移动	1,885,633.00	3.46
37	00941	中国移动	246,938.43	0.45
38	605098	行动教育	2,069,652.00	3.79
39	600027	华电国际	1,738,621.00	3.19
39	01071	华电国际电力股份	299,195.30	0.55
40	001965	招商公路	2,035,607.56	3.73
41	600461	洪城环境	1,957,471.00	3.59
42	601881	中国银河	1,946,124.00	3.57
43	600176	中国巨石	1,886,481.00	3.46
44	02285	泉峰控股	1,842,022.11	3.38
45	00371	北控水务集团	1,773,188.77	3.25
46	600350	山东高速	1,772,192.00	3.25
47	600642	申能股份	1,700,481.00	3.12
48	01898	中煤能源	1,407,946.32	2.58
48	601898	中煤能源	277,805.00	0.51
49	600028	中国石化	1,081,934.00	1.98
49	00386	中国石油化工股份	602,953.50	1.11
50	600019	宝钢股份	1,671,920.00	3.06
51	600285	羚锐制药	1,658,756.33	3.04
52	600971	恒源煤电	1,656,840.00	3.04
53	002027	分众传媒	1,649,198.00	3.02
54	00639	首钢资源	1,640,181.78	3.01
55	605368	蓝天燃气	1,623,244.00	2.98
56	03968	招商银行	1,608,264.04	2.95

57	600398	海澜之家	1,558,000.80	2.86
58	02601	中国太保	1,541,876.53	2.83
59	03969	中国通号	1,522,580.84	2.79
60	000333	美的集团	1,502,840.00	2.75
61	02099	中国黄金国际	1,453,856.37	2.67
62	601699	潞安环能	1,444,696.00	2.65
63	002884	凌霄泵业	1,444,626.24	2.65
64	600938	中国海油	1,287,153.00	2.36
64	00883	中国海洋石油	152,578.93	0.28
65	600348	华阳股份	1,427,504.00	2.62
66	600256	广汇能源	1,418,182.00	2.60
67	601985	中国核电	1,412,238.00	2.59
68	000651	格力电器	1,411,647.00	2.59
69	000090	天健集团	1,381,943.00	2.53
70	600007	中国国贸	1,347,538.00	2.47
71	06110	滔搏	1,323,611.83	2.43
72	00392	北京控股	1,310,323.53	2.40
73	600011	华能国际	1,290,500.00	2.37
74	00388	香港交易所	1,282,269.93	2.35
75	600346	恒力石化	1,267,083.00	2.32
76	601009	南京银行	1,236,697.00	2.27
77	02328	中国财险	1,208,134.98	2.21
78	000725	京东方 A	1,177,317.00	2.16
79	03360	远东宏信	1,170,575.20	2.15
80	000700	模塑科技	1,139,430.00	2.09
81	600295	鄂尔多斯	1,126,866.00	2.07
82	000923	河钢资源	1,108,415.00	2.03
83	000683	远兴能源	1,092,300.00	2.00

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	193,089,365.72
卖出股票收入（成交）总额	199,575,573.64

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**

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、南京银行股份有限公司、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。

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	26,312.34
2	应收清算款	110,124.05
3	应收股利	586,929.90
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,857.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	726,223.80

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 (%)
平安价值回报混合 A	722	75,481.33	-	-	54,497,517.00	100.00
平安价值回报混合 C	388	11,316.85	-	-	4,390,937.28	100.00
合计	1,076	54,729.05	-	-	58,888,454.28	100.00

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	平安价值回报混合 A	8,336.61	0.0153
	平安价值回报混合 C	50,309.10	1.1457
	合计	58,645.71	0.0996

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	平安价值回报混合 A	0

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安价值回报混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安价值回报混合 A	0
	平安价值回报混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安价值回报混合 A	平安价值回报混合 C
基金合同生效日 (2022 年 4 月 14 日) 基金份额总额	153,240,125.76	139,983,608.77
本报告期期初基金份额总额	61,990,393.69	4,695,932.71
本报告期基金总申购份额	614,300.06	615,699.91
减：本报告期基金总赎回份额	8,107,176.75	920,695.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	54,497,517.00	4,390,937.28

§ 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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金财产的诉讼事项。

本报告期，无涉及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：本报告期内托管人及其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 (%)	
海通证券	6	172,916,727.96	44.04	106,866.43	39.67	-
中泰证券	2	59,345,644.11	15.11	43,669.42	16.21	-
平安证券	2	53,061,101.58	13.51	39,047.20	14.49	-
中信建投证券	2	50,985,675.50	12.98	37,521.19	13.93	-
长江证券	1	26,406,098.84	6.72	19,432.91	7.21	-
国盛证券	1	16,988,050.00	4.33	12,501.41	4.64	-
广发证券	2	12,961,641.37	3.30	10,369.32	3.85	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	3	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-

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(%)
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	100,180.00	100.00	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	2024年01月15日
2	平安价值回报混合型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024年01月19日

3	平安基金管理有限公司关于旗下基金参与中国平安人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 15 日
4	平安价值回报混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 30 日
5	平安价值回报混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 19 日
6	关于平安价值回报混合型证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 05 月 14 日
7	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	2024 年 06 月 21 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 06 月 27 日
9	平安价值回报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	2024 年 06 月 28 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价值回报混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安价值回报混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安价值回报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

2024 年 8 月 31 日