

平安鼎信债券型证券投资基金 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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	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的真实、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	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.11 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安鼎信债券型证券投资基金	
基金简称	平安鼎信债券	
基金主代码	002988	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 21 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	760,326,009.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	平安鼎信债券 A	平安鼎信债券 C
下属分级基金的交 易代码	002988	020930
报告期末下属分级 基金的份额总额	713,814,555.35 份	46,511,453.90 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在谨慎投资的前提下，力争战胜业绩比较基准，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。
投资策略	转型为“平安鼎信债券型证券投资基金”后，本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险均高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	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	广东省深圳市福田区益田路

	5033 号平安金融中心 34 层	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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	2024 年 3 月 4 日 (基金合同生效日) -2024 年 6 月 30 日
	平安鼎信债券 A	平安鼎信债券 C
本期已实现收益	7,142,753.19	368,238.92
本期利润	10,158,260.04	648,313.00
加权平均基金份额 本期利润	0.0336	0.0135
本期加权平均净 值利润率	3.15%	1.26%
本期基金份额净 值增长率	6.90%	2.15%
3.1.2 期末数 和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	27,992,336.03	1,757,394.10
期末可供分配基 金份额利润	0.0392	0.0378
期末基金资产净 值	768,900,061.99	50,044,685.38

期末基金份额净值	1.0772	1.0760
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	36.45%	2.15%

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

平安鼎信债券 A

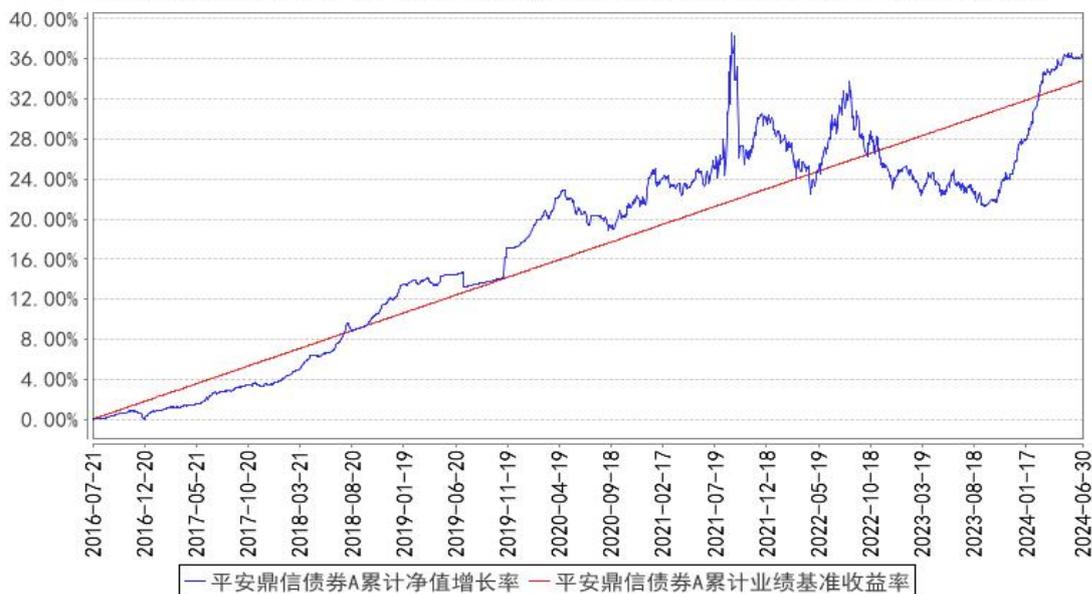
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.18%	0.07%	0.26%	0.01%	-0.08%	0.06%
过去三个月	1.32%	0.13%	0.80%	0.01%	0.52%	0.12%
过去六个月	6.90%	0.17%	1.61%	0.01%	5.29%	0.16%
过去一年	10.54%	0.18%	3.29%	0.01%	7.25%	0.17%
过去三年	9.78%	0.42%	10.54%	0.01%	-0.76%	0.41%
自基金合同生效起至今	36.45%	0.27%	33.79%	0.01%	2.66%	0.26%

平安鼎信债券 C

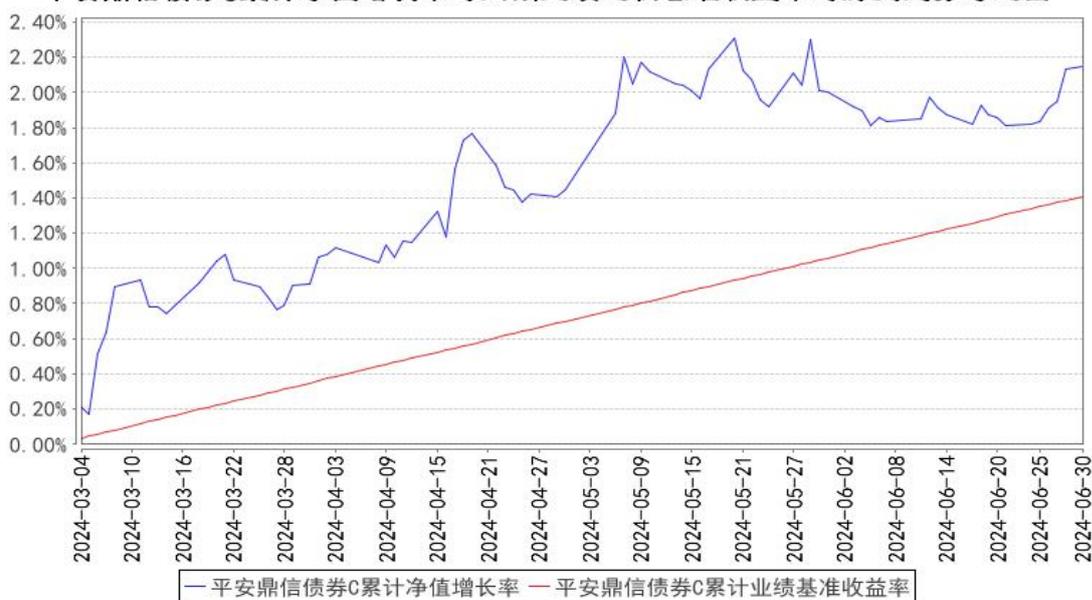
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.14%	0.07%	0.35%	0.01%	-0.21%	0.06%
过去三个月	1.22%	0.13%	1.06%	0.01%	0.16%	0.12%
自基金合同生效起至今	2.15%	0.13%	1.41%	0.01%	0.74%	0.12%

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

平安鼎信债券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



平安鼎信债券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 2016 年 7 月 21 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、本基金于 2024 年 3 月 1 日增设 C 类份额，C 类份额从 2024 年 3 月 4 日开始有份额，所以上 C 类份额走势图从 2024 年 3 月 4 日开始。

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		
张文平	公司总经理助理兼固定收益投资总监，平安鼎信债券型证券投资基金基金经理	2023 年 9 月 22 日	-	13 年	张文平先生，南京大学硕士。先后担任毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。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兼固定收益投资总监。同时担任平安如意中短债债券型证券投资基金、平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金、平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金、平安惠铭纯债债券型证券投资基金、平安惠澜纯债债券型证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安鼎信债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金基金经理。
江正清	平安鼎信债券型证券投资基金基金经	2023 年 11 月 8 日	-	7 年	江正清先生，香港中文大学金融学专业硕士，曾任宝盈基金管理有限公司固收研究员。2021 年 3 月加入平安基金管理有限公司，现担任固定收益投资中心研究部高级

	理助理				研究员、平安鑫享混合型证券投资基金、平安可转债债券型证券投资基金、平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金、平安鼎信债券型证券投资基金基金经理助理。
--	-----	--	--	--	---

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

2024 年上半年，宏观经济先强后弱，一季度有所修复，景气度提升，但二季度边际趋弱。固

定资产投资方面，制造业投资整体波动较小，但地产投资、基建投资均有所回落。外需较为旺盛，叠加阶段性的抢出口，出口恢复正增长，态势良好。由于经济增长三驾马车中的二驾表现不佳，导致就业和收入预期不佳，消费增速下滑。通胀方面，CPI 转正、PPI 回落幅度缩窄，预计未来通胀温和回升。政策方面，财政政策并未明显扩张，更多是托底经济，货币政策维持稳健宽松格局。资金面方面，流动性维持合理充裕，市场利率围绕政策利率波动，流动性较为宽裕。在此背景下，上半年债券收益率持续下行。报告期内，本产品以信用债投资为主，结合市场情况灵活进行久期和杠杆调节，力争增强组合收益。权益资产方面，A 股先跌后涨再跌，市场成交并不活跃，行业表现呈现巨大分化，存量资金在不同行业之间快速切换，显示出投资机构预期不太稳定，缺乏核心投资方向的特征。本组合在权益资产总体投资较为稳健，控制仓位，力争通过精选行业和个股获取绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安鼎信债券 A 的基金份额净值 1.0772 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.90%，同期业绩比较基准收益率为 1.61%；截至本报告期末平安鼎信债券 C 的基金份额净值 1.0760 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.15%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年债券牛市行情可能持续。一方面在于经济基本面依然存在内需不足、融资收缩的局面，债券资产荒的格局没有改变，对利率形成向下的牵引力量。另一方面美联储 9 月份开始可能会开启降息周期，对国内货币政策宽松的制约有所减轻，利好债券市场。虽然下半年稳经济的政策大概率会逐步出台，但是力度总体可控，对债市影响有限。

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 人的情形。本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末，以上情况已经消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向中国证监会或相关派出机构报告并提出了解决方案。

§ 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关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安鼎信债券型证券投资基金

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	66,056,596.95	3,529,772.48
结算备付金		6,009,323.20	189,576.28
存出保证金		205,905.81	15,899.53

交易性金融资产	6.4.7.2	1,031,093,416.02	29,270,467.33
其中：股票投资		133,220,102.00	2,811,351.87
基金投资		-	-
债券投资		897,873,314.02	26,459,115.46
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,143,175.53	884,689.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,104,508,417.51	33,890,405.23
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		238,966,225.65	-
应付清算款		45,378,973.31	2,043,004.97
应付赎回款		70,576.35	107,888.69
应付管理人报酬		250,943.53	9,249.26
应付托管费		62,735.90	2,312.31
应付销售服务费		13,092.17	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		50,993.47	499.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	770,129.76	99,660.01
负债合计		285,563,670.14	2,262,614.54
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	760,326,009.25	31,385,396.95
未分配利润	6.4.7.12	58,618,738.12	242,393.74
净资产合计		818,944,747.37	31,627,790.69
负债和净资产总计		1,104,508,417.51	33,890,405.23

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 760,326,009.25 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0772 元，基金份额 713,814,555.35 份；C 类基金份额净值 1.0760 元，基金份额 46,511,453.90 份。

6.2 利润表

会计主体：平安鼎信债券型证券投资基金

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		12,500,127.20	43,118.46
1. 利息收入		42,151.18	1,697.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,696.74	1,697.07
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		13,454.44	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,097,911.92	-123,738.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,784,614.21	-409,887.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	15,092,466.18	270,062.72
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	22,645.15	-
股利收益	6.4.7.19	767,414.80	16,085.66
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	3,295,580.93	165,156.11
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	64,483.17	4.04
减：二、营业总支出		1,693,554.16	129,710.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	692,367.01	39,757.47
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	173,091.80	9,939.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	58,541.87	-

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		673,871.40	43,166.37
其中：卖出回购金融资产支出		673,871.40	43,166.37
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		15,276.24	591.04
8. 其他费用	6.4.7.23	80,405.84	36,256.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,806,573.04	-86,591.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,806,573.04	-86,591.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,806,573.04	-86,591.90

6.3 净资产变动表

会计主体：平安鼎信债券型证券投资基金

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	31,385,396.95	-	242,393.74	31,627,790.69
二、本期期初净资产	31,385,396.95	-	242,393.74	31,627,790.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	728,940,612.30	-	58,376,344.38	787,316,956.68
（一）、综合收益总额	-	-	10,806,573.04	10,806,573.04
（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）	728,940,612.30	-	47,569,771.34	776,510,383.64
其中：1. 基金申购款	1,200,445,126.06	-	79,443,041.78	1,279,888,167.84
2. 基金赎回款	-471,504,513.76	-	-31,873,270.44	-503,377,784.20

(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	760,326,009.25	-	58,618,738.12	818,944,747.37
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	20,430,537.09	-	-436,221.83	19,994,315.26
二、本期期初净资产	20,430,537.09	-	-436,221.83	19,994,315.26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	88,956.54	-	-87,797.46	1,159.08
(一)、综合收益总额	-	-	-86,591.90	-86,591.90
(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)	88,956.54	-	-1,205.56	87,750.98
其中：1. 基金申购款	255,829.63	-	-4,622.04	251,207.59
2. 基金赎回款	-166,873.09	-	3,416.48	-163,456.61
(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	20,519,493.63	-	-524,019.29	19,995,474.34

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

平安鼎信债券型证券投资基金(原名为平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鼎信债券型证券投资基金, 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[2016]第 1274 号《关于准予平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准, 由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司, 已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鼎信定期开放债券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 500,024,404.35 元, 经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具普华永道中天验字(2016)第 959 号验资报告。经向中国证监会备案,《平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 21 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 500,034,407.16 份基金份额, 其中认购资金利息折合 10,002.81 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。

根据本基金的基金管理人平安基金管理有限公司于 2018 年 3 月 24 日发布的《关于平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金转型为平安大华鼎信债券型证券投资基金的公告》, 本基金第一个开放期于 2018 年 2 月 23 日到期, 在第一个开放期的最后一日日终触发本基金的转型条件。根据《平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定, 自 2018 年 3 月 24 日起, 本基金名称变更为“平安大华鼎信债券型证券投资基金”, 运作方式由原定期开放式变更为开放式。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》, 平安大华鼎信债券型证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安鼎信债券型证券投资基金。

根据《平安鼎信债券型证券投资基金招募说明书》, 本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额, 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《平安鼎信债券型证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含

分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款)、同业存单、现金资产、中小企业私募债)、国债期货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相关规定)。本基金亦参与因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证。

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%, 权益类资产(包括股票、权证, 以及法律法规或中国证监会允许投资的其他权益类金融工具)的投资比例合计不超过基金资产的 20%, 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准是: 三年期银行定期存款利率(税后)+1.5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制, 同时, 在信息披露和估值方面, 也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	66,056,596.95

等于：本金	66,053,776.16
加：应计利息	2,820.79
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	66,056,596.95

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	132,114,946.59	-	133,220,102.00	1,105,155.41	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	73,711,607.41	255,702.31	74,253,511.31	286,201.59
	银行间市场	813,113,999.61	8,462,442.71	823,619,802.71	2,043,360.39
	合计	886,825,607.02	8,718,145.02	897,873,314.02	2,329,561.98
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,018,940,553.61	8,718,145.02	1,031,093,416.02	3,434,717.39	

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	699,023.92

其中：交易所市场	623,307.06
银行间市场	75,716.86
应付利息	-
预提费用	71,105.84
合计	770,129.76

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安鼎信债券 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	31,385,396.95	31,385,396.95
本期申购	1,030,757,348.58	1,030,757,348.58
本期赎回（以“-”号填列）	-348,328,190.18	-348,328,190.18
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	713,814,555.35	713,814,555.35

平安鼎信债券 C

项目	本期 2024年3月1日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	169,687,777.48	169,687,777.48
本期赎回（以“-”号填列）	-123,176,323.58	-123,176,323.58
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	46,511,453.90	46,511,453.90

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

平安鼎信债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-373,024.87	615,418.61	242,393.74
本期期初	-373,024.87	615,418.61	242,393.74
本期利润	7,142,753.19	3,015,506.85	10,158,260.04
本期基金份额交易产生的变动数	21,222,607.71	23,462,245.15	44,684,852.86

其中：基金申购款	32,253,161.15	35,823,247.79	68,076,408.94
基金赎回款	-11,030,553.44	-12,361,002.64	-23,391,556.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,992,336.03	27,093,170.61	55,085,506.64

平安鼎信债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	368,238.92	280,074.08	648,313.00
本期基金份额交易产生的变动数	1,389,155.18	1,495,763.30	2,884,918.48
其中：基金申购款	5,344,289.86	6,022,342.98	11,366,632.84
基金赎回款	-3,955,134.68	-4,526,579.68	-8,481,714.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,757,394.10	1,775,837.38	3,533,231.48

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	13,842.78
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	14,213.69
其他	640.27
合计	28,696.74

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	-6,784,614.21
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	-6,784,614.21

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	494,302,596.40

减：卖出股票成本总额	499,945,446.35
减：交易费用	1,141,764.26
买卖股票差价收入	-6,784,614.21

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	5,785,069.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,307,396.55
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	15,092,466.18

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	4,038,954,934.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,990,633,701.19
减：应计利息总额	38,909,591.99
减：交易费用	104,244.34
买卖债券差价收入	9,307,396.55

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
国债期货投资收益	22,645.15

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	767,414.80
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	767,414.80

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	3,295,580.93
股票投资	1,083,468.07

债券投资	2,212,112.86
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	3,295,580.93

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	61,779.36
基金转换费收入	2,703.81
合计	64,483.17

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	14,918.54
信息披露费	46,887.30
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	80,405.84

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

本基金的基金管理人于 2024 年 8 月 6 日宣告 2024 年度第 1 次分红，向截至 2024 年 8 月 7 日止在本基金注册登记人平安基金管理有限公司登记在册的全体持有人，其中，A 类按每 10 份基金份额派发红利 0.31 元，C 类按每 10 份基金份额派发红利 0.30 元。

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
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
中国平安财产保险股份有限公司(“平安财险”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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(%)
方正证券	-	-	2,784,701.00	4.65
平安证券	-	-	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
方正证券	-	-	628,494.24	2.16
平安证券	-	-	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回购 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 (%)
方正证券	-	-	2,000,000.00	1.75

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 (%)
-	-	-	-	-
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 (%)
方正证券	2,008.47	4.64	2,008.47	8.11

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	692,367.01	39,757.47
其中：应支付销售机构的客户维护	231,109.55	436.49

费		
应支付基金管理人的净管理费	461,257.46	39,320.98

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 0.40% 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 × 0.40% / 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	173,091.80	9,939.39

注：支付基金托管行平安银行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。

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		
	平安鼎信债券 A	平安鼎信债券 C	合计
陆基金	-	4.22	4.22
平安基金	-	382.81	382.81
平安人寿	-	5.72	5.72
合计	-	392.75	392.75
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		
	平安鼎信债券 A	平安鼎信债券 C	合计
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金，再由平安基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.35% / 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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2024 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日
	平安鼎信债券 A	平安鼎信债券 C
基金合同生效日 (2016 年 7 月 21 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	17,962,279.21	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	17,962,279.21	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.5164%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	-
	平安鼎信债券 A	平安鼎信债券 C
基金合同生效日 (2016 年 7 月 21 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	17,962,279.21	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	17,962,279.21	-

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	87.5376%	-
-------------------------	----------	---

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。

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

份额单位：份

平安鼎信债券 A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
平安财险	46,784,878.82	6.5542	-	-
平安汇通	2,000,433.69	0.2802	2,000,433.69	6.3738

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

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
平安银行-活期	66,056,596.95	13,842.78	154,644.51	629.91

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。

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

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止, 本基金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 225,566,225.65 元, 是以如下债券作为抵押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
102200170	22 建发集 MTN003	2024 年 7 月 1 日	101.72	300,000	30,515,434.52
102280793	22 中交二公 MTN001	2024 年 7 月 1 日	101.75	21,000	2,136,797.18
102281121	22 保利发展 MTN002(绿色)	2024 年 7 月 1 日	100.85	300,000	30,255,279.45
102381845	23 中交一公 MTN001A	2024 年 7 月 1 日	103.98	131,000	13,620,835.96
102382526	23 中交投 MTN003A	2024 年 7 月 1 日	103.59	300,000	31,078,209.84
102001337	20 河钢集 MTN006	2024 年 7 月 2 日	106.62	200,000	21,324,872.13
102001852	20 新乡投资 MTN002	2024 年 7 月 2 日	106.99	200,000	21,397,355.19
102282651	22 晋能电力 MTN007	2024 年 7 月 2 日	103.79	100,000	10,379,360.66
132280067	22 河钢集 GN002	2024 年 7 月 2 日	105.19	100,000	10,519,115.85
102282526	22 沪电力 MTN003	2024 年 7 月 3 日	103.48	300,000	31,043,901.64
102482095	24 保利发展 MTN004	2024 年 7 月 3 日	100.75	400,000	40,298,698.08
合计				2,352,000	242,569,860.50

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 13,400,000.00 元, 于 2024 年 07 月 01 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

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，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 78.49%（上年度末：38.71%）。

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上市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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，

并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	66,056,596.95	-	-	-	66,056,596.95
结算备付金	6,009,323.20	-	-	-	6,009,323.20
存出保证金	205,905.81	-	-	-	205,905.81
交易性金融资产	197,602,284.60	357,999,587.17	342,271,442.25	133,220,102.00	1,031,093,416.02
应收申购款	-	-	-	1,143,175.53	1,143,175.53
资产总计	269,874,110.56	357,999,587.17	342,271,442.25	134,363,277.53	1,104,508,417.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	70,576.35	70,576.35
应付管理人报酬	-	-	-	250,943.53	250,943.53
应付托管费	-	-	-	62,735.90	62,735.90
应付清算款	-	-	-	45,378,973.31	45,378,973.31
卖出回购金融资产款	238,966,225.65	-	-	-	238,966,225.65
应付销售服务费	-	-	-	13,092.17	13,092.17
应交税费	-	-	-	50,993.47	50,993.47
其他负债	-	-	-	770,129.76	770,129.76
负债总计	238,966,225.65	-	-	46,597,444.49	285,563,670.14
利率敏感度缺口	30,907,884.91	357,999,587.17	342,271,442.25	87,765,833.04	818,944,747.37
上年度末 2023年12月31日					
资产					
货币资金	3,529,772.48	-	-	-	3,529,772.48
结算备付金	189,576.28	-	-	-	189,576.28
存出保证金	15,899.53	-	-	-	15,899.53
交易性金融资产	20,267,801.36	4,145,417.93	2,045,896.17	2,811,351.87	29,270,467.33
应收申购款	-	-	-	884,689.61	884,689.61
资产总计	24,003,049.65	4,145,417.93	2,045,896.17	3,696,041.48	33,890,405.23

负债					
应付赎回款	-	-	-	107,888.69	107,888.69
应付管理人报酬	-	-	-	9,249.26	9,249.26
应付托管费	-	-	-	2,312.31	2,312.31
应付清算款	-	-	-	2,043,004.97	2,043,004.97
应交税费	-	-	-	499.30	499.30
其他负债	-	-	-	99,660.01	99,660.01
负债总计	-	-	-	2,262,614.54	2,262,614.54
利率敏感度缺口	24,003,049.65	4,145,417.93	2,045,896.17	1,433,426.94	31,627,790.69

注：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

假设	除市场利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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-9,562,084.95	-93,589.27
市场利率下降25个基点	9,850,118.14	95,082.45	

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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	133,220,102.00	16.27	2,811,351.87	8.89
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	133,220,102.00	16.27	2,811,351.87	8.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深300指数”以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）	
分析	沪深300指数上升5%	-	-
	沪深300指数下降5%	-	-

注：于本报告期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为16.27%（上年度末：8.89%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

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	189,572,177.11	6,628,885.26
第二层次	841,521,238.91	22,641,582.07
第三层次	-	-
合计	1,031,093,416.02	29,270,467.33

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	133,220,102.00	12.06
	其中：股票	133,220,102.00	12.06

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	897,873,314.02	81.29
	其中：债券	897,873,314.02	81.29
	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	72,065,920.15	6.52
8	其他各项资产	1,349,081.34	0.12
9	合计	1,104,508,417.51	100.00

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	31,020,616.00	3.79
C	制造业	39,691,669.00	4.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,571,052.00	0.44
E	建筑业	2,927,670.00	0.36
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	-	-
J	金融业	56,009,095.00	6.84
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	133,220,102.00	16.27

7.2.2 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。

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	601398	工商银行	2,293,600	13,073,520.00	1.60
2	601288	农业银行	2,733,800	11,919,368.00	1.46
3	601988	中国银行	2,565,700	11,853,534.00	1.45
4	601939	建设银行	1,601,000	11,847,400.00	1.45
5	000338	潍柴动力	488,100	7,926,744.00	0.97
6	600938	中国海油	195,500	6,451,500.00	0.79
7	000333	美的集团	79,600	5,134,200.00	0.63
8	600036	招商银行	148,900	5,090,891.00	0.62
9	600150	中国船舶	103,900	4,229,769.00	0.52
10	601857	中国石油	407,400	4,204,368.00	0.51
11	601088	中国神华	92,800	4,117,536.00	0.50
12	601225	陕西煤业	149,400	3,850,038.00	0.47
13	600489	中金黄金	247,200	3,658,560.00	0.45
14	600660	福耀玻璃	74,900	3,587,710.00	0.44
15	300308	中际旭创	20,000	2,757,600.00	0.34
16	603619	中曼石油	98,700	2,311,554.00	0.28
17	300502	新易盛	18,300	1,931,565.00	0.24
18	002155	湖南黄金	102,700	1,858,870.00	0.23
19	600011	华能国际	187,900	1,807,598.00	0.22
20	600027	华电国际	254,100	1,763,454.00	0.22
21	002475	立讯精密	42,300	1,662,813.00	0.20
22	300818	耐普矿机	63,300	1,614,150.00	0.20
23	300433	蓝思科技	86,100	1,571,325.00	0.19
24	601611	中国核建	187,000	1,512,830.00	0.18
25	002001	新和成	75,700	1,453,440.00	0.18
26	601998	中信银行	216,100	1,447,870.00	0.18
27	601618	中国中冶	456,400	1,414,840.00	0.17
28	603979	金诚信	27,700	1,399,681.00	0.17
29	600685	中船防务	50,100	1,397,790.00	0.17
30	300476	胜宏科技	33,800	1,090,388.00	0.13
31	300843	胜蓝股份	40,400	1,085,952.00	0.13
32	603890	春秋电子	111,100	1,006,566.00	0.12
33	603993	洛阳钼业	113,300	963,050.00	0.12
34	601020	华钰矿业	71,800	919,040.00	0.11
35	600216	浙江医药	76,300	837,774.00	0.10
36	600761	安徽合力	38,000	822,320.00	0.10
37	603283	赛腾股份	10,500	802,200.00	0.10
38	000552	甘肃能化	224,900	780,403.00	0.10
39	002142	宁波银行	35,200	776,512.00	0.09
40	601899	紫金矿业	28,800	506,016.00	0.06

41	002916	深南电路	3,800	401,926.00	0.05
42	002281	光迅科技	10,100	377,437.00	0.05

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	601988	中国银行	19,061,030.00	60.27
2	601288	农业银行	18,323,132.00	57.93
3	601857	中国石油	15,175,960.00	47.98
4	000333	美的集团	14,335,578.00	45.33
5	601398	工商银行	13,372,609.00	42.28
6	600938	中国海油	12,925,935.00	40.87
7	601939	建设银行	11,824,997.00	37.39
8	600188	兖矿能源	10,482,922.00	33.14
9	601088	中国神华	9,067,566.00	28.67
10	600660	福耀玻璃	8,719,231.00	27.57
11	601958	金铂股份	8,713,977.00	27.55
12	603619	中曼石油	8,385,457.00	26.51
13	601225	陕西煤业	8,225,612.00	26.01
14	000338	潍柴动力	7,892,393.00	24.95
15	600489	中金黄金	7,860,520.78	24.85
16	600036	招商银行	7,721,922.00	24.41
17	002155	湖南黄金	7,650,241.00	24.19
18	600761	安徽合力	7,135,223.80	22.56
19	600985	淮北矿业	6,928,446.55	21.91
20	600256	广汇能源	6,535,130.00	20.66
21	600031	三一重工	6,390,336.00	20.20
22	600028	中国石化	6,024,627.00	19.05
23	300567	精测电子	5,875,497.00	18.58
24	001979	招商蛇口	5,562,259.00	17.59
25	601899	紫金矿业	5,430,288.00	17.17
26	600048	保利发展	5,279,192.00	16.69
27	300739	明阳电路	5,048,451.24	15.96
28	688590	新致软件	5,037,582.90	15.93
29	603979	金诚信	4,912,842.00	15.53
30	601028	玉龙股份	4,519,629.00	14.29
31	000977	浪潮信息	4,471,757.00	14.14
32	300856	科思股份	4,461,463.00	14.11
33	601699	潞安环能	4,339,938.80	13.72
34	002001	新和成	4,240,599.00	13.41
35	002142	宁波银行	4,166,951.00	13.17
36	603283	赛腾股份	4,137,894.00	13.08

37	601838	成都银行	4,134,036.00	13.07
38	600150	中国船舶	4,119,415.00	13.02
39	300394	天孚通信	4,112,326.80	13.00
40	600547	山东黄金	4,002,686.00	12.66
41	600310	广西能源	4,000,957.00	12.65
42	600027	华电国际	3,952,183.00	12.50
43	002738	中矿资源	3,838,444.20	12.14
44	300308	中际旭创	3,789,460.00	11.98
45	000932	华菱钢铁	3,645,698.00	11.53
46	601001	晋控煤业	3,590,516.00	11.35
47	603993	洛阳钼业	3,528,174.00	11.16
48	002422	科伦药业	3,494,392.00	11.05
49	300229	拓尔思	3,377,554.00	10.68
50	000425	徐工机械	3,354,282.00	10.61
51	600023	浙能电力	3,282,035.00	10.38
52	605368	蓝天燃气	3,197,922.00	10.11
53	600176	中国巨石	3,193,930.42	10.10
54	002408	齐翔腾达	3,116,423.40	9.85
55	601600	中国铝业	3,111,058.00	9.84
56	601689	拓普集团	3,105,971.00	9.82
57	603225	新凤鸣	3,093,930.00	9.78
58	605117	德业股份	3,056,013.40	9.66
59	000552	甘肃能化	3,027,330.00	9.57
60	002126	银轮股份	2,998,283.00	9.48
61	300580	贝斯特	2,973,445.00	9.40
62	600011	华能国际	2,953,684.00	9.34
63	002244	滨江集团	2,939,304.00	9.29
64	300274	阳光电源	2,806,407.00	8.87
65	000528	柳 工	2,720,921.00	8.60
66	300057	万顺新材	2,704,416.00	8.55
67	002791	坚朗五金	2,697,947.00	8.53
68	601101	昊华能源	2,696,423.08	8.53
69	601998	中信银行	2,621,213.00	8.29
70	000063	中兴通讯	2,533,049.00	8.01
71	600325	华发股份	2,501,877.00	7.91
72	301046	能辉科技	2,492,172.00	7.88
73	603383	顶点软件	2,488,094.00	7.87
74	000589	贵州轮胎	2,450,188.00	7.75
75	688037	芯源微	2,408,038.21	7.61
76	300502	新易盛	2,400,873.00	7.59
77	688036	传音控股	2,382,948.34	7.53
78	300818	耐普矿机	2,379,842.80	7.52
79	300272	开能健康	2,360,108.00	7.46

80	002318	久立特材	2,342,076.00	7.41
81	300750	宁德时代	2,338,249.00	7.39
82	000065	北方国际	2,318,787.00	7.33
83	000858	五粮液	2,299,657.27	7.27
84	600276	恒瑞医药	2,291,249.00	7.24
85	688676	金盘科技	2,196,239.16	6.94
86	002709	天赐材料	2,185,759.00	6.91
87	300260	新莱应材	2,117,462.00	6.69
88	603198	迎驾贡酒	2,073,215.00	6.56
89	601233	桐昆股份	2,062,430.00	6.52
90	002371	北方华创	2,039,311.00	6.45
91	600926	杭州银行	2,011,526.40	6.36
92	000651	格力电器	2,003,744.00	6.34
93	603220	中贝通信	1,993,526.51	6.30
94	601666	平煤股份	1,930,731.00	6.10
95	300894	火星人	1,930,649.00	6.10
96	000902	新洋丰	1,903,834.00	6.02
97	601020	华钰矿业	1,899,692.00	6.01
98	002597	金禾实业	1,890,929.00	5.98
99	688208	道通科技	1,865,567.07	5.90
100	600348	华阳股份	1,863,248.50	5.89
101	002111	威海广泰	1,846,437.00	5.84
102	002455	百川股份	1,843,757.00	5.83
103	600141	兴发集团	1,836,228.00	5.81
104	603279	景津装备	1,820,906.00	5.76
105	603890	春秋电子	1,769,940.00	5.60
106	603019	中科曙光	1,734,704.00	5.48
107	002475	立讯精密	1,717,605.00	5.43
108	003021	兆威机电	1,712,538.00	5.41
109	601918	新集能源	1,712,201.00	5.41
110	002895	川恒股份	1,698,802.00	5.37
111	301266	宇邦新材	1,689,319.00	5.34
112	000933	神火股份	1,686,443.00	5.33
113	300014	亿纬锂能	1,681,445.00	5.32
114	688116	天奈科技	1,680,448.24	5.31
115	002335	科华数据	1,679,037.00	5.31
116	601611	中国核建	1,660,653.00	5.25
117	300693	盛弘股份	1,660,261.90	5.25
118	603876	鼎胜新材	1,648,444.00	5.21
119	300398	飞凯材料	1,620,748.00	5.12
120	600050	中国联通	1,587,656.00	5.02
121	002050	三花智控	1,576,665.00	4.99
122	002049	紫光国微	1,565,745.30	4.95

123	600941	中国移动	1,553,534.00	4.91
124	300433	蓝思科技	1,507,629.00	4.77
125	603179	新泉股份	1,498,130.00	4.74
126	003011	海象新材	1,497,891.00	4.74
127	300798	锦鸡股份	1,493,015.00	4.72
128	603278	大业股份	1,475,556.00	4.67
129	600933	爱柯迪	1,471,512.00	4.65
130	600961	株冶集团	1,457,160.00	4.61
131	688636	智明达	1,457,077.26	4.61
132	601618	中国中冶	1,418,978.00	4.49
133	688059	华锐精密	1,410,995.35	4.46
134	300727	润禾材料	1,399,521.00	4.42
135	600685	中船防务	1,377,907.00	4.36
136	603477	巨星农牧	1,370,361.00	4.33
137	300258	精锻科技	1,366,624.00	4.32
138	300737	科顺股份	1,360,068.00	4.30
139	601658	邮储银行	1,336,648.00	4.23
140	300843	胜蓝股份	1,321,994.00	4.18
141	300879	大叶股份	1,307,048.06	4.13
142	300498	温氏股份	1,284,818.00	4.06
143	000657	中钨高新	1,265,281.00	4.00
144	300900	广联航空	1,239,562.00	3.92
145	688066	航天宏图	1,234,693.58	3.90
146	300373	扬杰科技	1,191,091.00	3.77
147	603596	伯特利	1,190,721.00	3.76
148	601677	明泰铝业	1,177,400.00	3.72
149	688678	福立旺	1,150,667.37	3.64
150	688425	铁建重工	1,150,200.55	3.64
151	601818	光大银行	1,149,919.00	3.64
152	600528	中铁工业	1,149,633.00	3.63
153	000404	长虹华意	1,148,089.00	3.63
154	603806	福斯特	1,134,392.20	3.59
155	002959	小熊电器	1,118,033.00	3.53
156	300814	中富电路	1,112,582.00	3.52
157	002271	东方雨虹	1,097,998.00	3.47
158	300476	胜宏科技	1,096,218.00	3.47
159	001286	陕西能源	1,095,211.00	3.46
160	600529	山东药玻	1,094,082.00	3.46
161	002756	永兴材料	1,079,186.00	3.41
162	688063	派能科技	1,073,455.66	3.39
163	600383	金地集团	1,066,231.00	3.37
164	002487	大金重工	1,066,134.00	3.37
165	600600	青岛啤酒	1,065,469.00	3.37

166	600418	江淮汽车	1,047,273.00	3.31
167	300347	泰格医药	1,035,357.00	3.27
168	605333	沪光股份	993,587.00	3.14
169	688627	精智达	980,696.21	3.10
170	300827	上能电气	971,699.00	3.07
171	300037	新宙邦	964,912.00	3.05
172	600096	云天化	953,927.00	3.02
173	688599	天合光能	950,547.43	3.01
174	601138	工业富联	948,663.00	3.00
175	600577	精达股份	947,909.00	3.00
176	002810	山东赫达	946,537.00	2.99
177	688177	百奥泰	909,092.57	2.87
178	603799	华友钴业	900,542.00	2.85
179	002531	天顺风能	895,161.00	2.83
180	601728	中国电信	893,358.00	2.82
181	603650	彤程新材	891,135.00	2.82
182	603108	润达医疗	890,542.00	2.82
183	601137	博威合金	890,048.00	2.81
184	002966	苏州银行	869,616.00	2.75
185	688197	首药控股	863,163.79	2.73
186	300871	回盛生物	856,021.06	2.71
187	600026	中远海能	829,717.00	2.62
188	688363	华熙生物	825,745.44	2.61
189	300911	亿田智能	788,364.00	2.49
190	002815	崇达技术	787,862.00	2.49
191	603008	喜临门	785,830.00	2.48
192	600216	浙江医药	777,939.00	2.46
193	603713	密尔克卫	777,162.00	2.46
194	603966	法兰泰克	775,719.00	2.45
195	601916	浙商银行	766,598.00	2.42
196	600919	江苏银行	765,993.00	2.42
197	603878	武进不锈	761,751.00	2.41
198	600536	中国软件	745,708.00	2.36
199	688076	诺泰生物	728,823.77	2.30
200	688169	石头科技	727,617.86	2.30
201	000422	湖北宜化	717,413.00	2.27
202	300450	先导智能	698,095.00	2.21
203	601801	皖新传媒	688,496.00	2.18
204	000893	亚钾国际	688,205.00	2.18
205	688093	世华科技	686,378.95	2.17
206	300763	锦浪科技	679,541.00	2.15
207	300624	万兴科技	677,921.20	2.14
208	300890	翔丰华	674,681.04	2.13

209	600585	海螺水泥	672,708.00	2.13
210	600690	海尔智家	671,899.00	2.12
211	300926	博俊科技	655,929.00	2.07
212	300620	光库科技	651,265.00	2.06
213	603896	寿仙谷	637,043.00	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601857	中国石油	11,257,731.00	35.59
2	600188	兖矿能源	10,269,727.00	32.47
3	000333	美的集团	9,270,345.00	29.31
4	601958	金钼股份	8,579,872.00	27.13
5	601988	中国银行	7,283,766.00	23.03
6	600938	中国海油	7,203,249.00	22.78
7	600985	淮北矿业	6,938,098.25	21.94
8	601288	农业银行	6,695,280.00	21.17
9	600761	安徽合力	6,441,453.33	20.37
10	600256	广汇能源	6,433,928.00	20.34
11	600031	三一重工	6,349,844.00	20.08
12	603619	中曼石油	6,064,085.14	19.17
13	600028	中国石化	5,991,144.00	18.94
14	002155	湖南黄金	5,755,022.00	18.20
15	300567	精测电子	5,753,051.00	18.19
16	001979	招商蛇口	5,397,968.00	17.07
17	600660	福耀玻璃	5,274,336.00	16.68
18	600048	保利发展	5,206,231.00	16.46
19	688590	新致软件	5,099,903.02	16.12
20	601088	中国神华	5,048,372.00	15.96
21	300739	明阳电路	4,775,512.57	15.10
22	601899	紫金矿业	4,687,736.00	14.82
23	000977	浪潮信息	4,438,076.55	14.03
24	601225	陕西煤业	4,310,369.00	13.63
25	601699	潞安环能	4,275,459.20	13.52
26	600489	中金黄金	4,264,522.84	13.48
27	300856	科思股份	4,246,726.00	13.43
28	601028	玉龙股份	4,232,625.00	13.38
29	601838	成都银行	4,086,647.00	12.92
30	600310	广西能源	3,913,358.00	12.37
31	600547	山东黄金	3,895,232.00	12.32
32	300394	天孚通信	3,890,931.40	12.30
33	002738	中矿资源	3,854,309.00	12.19

34	000932	华菱钢铁	3,685,170.00	11.65
35	601001	晋控煤业	3,528,870.00	11.16
36	603979	金诚信	3,518,887.00	11.13
37	603283	赛腾股份	3,428,394.00	10.84
38	002422	科伦药业	3,428,051.43	10.84
39	300229	拓尔思	3,365,107.00	10.64
40	002142	宁波银行	3,330,652.00	10.53
41	600176	中国巨石	3,274,400.36	10.35
42	000425	徐工机械	3,249,825.00	10.28
43	605368	蓝天燃气	3,195,617.64	10.10
44	600023	浙能电力	3,183,816.00	10.07
45	601689	拓普集团	3,114,570.00	9.85
46	002408	齐翔腾达	3,031,000.00	9.58
47	605117	德业股份	3,026,101.92	9.57
48	601600	中国铝业	3,020,331.00	9.55
49	002126	银轮股份	3,018,422.00	9.54
50	002244	滨江集团	3,004,839.00	9.50
51	603225	新凤鸣	2,943,852.00	9.31
52	300274	阳光电源	2,895,343.00	9.15
53	300580	贝斯特	2,885,397.30	9.12
54	601101	昊华能源	2,817,167.00	8.91
55	002791	坚朗五金	2,731,610.00	8.64
56	000589	贵州轮胎	2,717,511.61	8.59
57	002001	新和成	2,714,017.00	8.58
58	600036	招商银行	2,691,256.00	8.51
59	000528	柳 工	2,675,686.00	8.46
60	688037	芯源微	2,600,993.89	8.22
61	600325	华发股份	2,594,765.59	8.20
62	300057	万顺新材	2,564,997.00	8.11
63	000063	中兴通讯	2,518,796.00	7.96
64	300750	宁德时代	2,515,259.00	7.95
65	603993	洛阳钼业	2,508,270.00	7.93
66	301046	能辉科技	2,412,794.00	7.63
67	002318	久立特材	2,362,055.00	7.47
68	000065	北方国际	2,311,785.00	7.31
69	300272	开能健康	2,288,735.00	7.24
70	002709	天赐材料	2,276,280.00	7.20
71	000858	五 粮 液	2,269,916.00	7.18
72	600276	恒瑞医药	2,264,644.32	7.16
73	603383	顶点软件	2,250,065.00	7.11
74	688036	传音控股	2,249,437.08	7.11
75	688676	金盘科技	2,171,053.80	6.86
76	000552	甘肃能化	2,098,760.00	6.64

77	600027	华电国际	2,086,410.00	6.60
78	300260	新莱应材	2,077,409.22	6.57
79	603198	迎驾贡酒	2,047,474.00	6.47
80	600926	杭州银行	2,029,464.00	6.42
81	688208	道通科技	2,013,088.02	6.36
82	601233	桐昆股份	2,008,445.00	6.35
83	600348	华阳股份	2,003,957.00	6.34
84	002371	北方华创	1,987,698.00	6.28
85	000651	格力电器	1,971,942.00	6.23
86	601666	平煤股份	1,959,454.00	6.20
87	603220	中贝通信	1,899,377.25	6.01
88	002597	金禾实业	1,867,808.02	5.91
89	603279	景津装备	1,864,132.00	5.89
90	600141	兴发集团	1,863,184.00	5.89
91	000902	新洋丰	1,812,830.00	5.73
92	300014	亿纬锂能	1,783,649.00	5.64
93	002111	威海广泰	1,754,781.00	5.55
94	002455	百川股份	1,750,439.00	5.53
95	300894	火星人	1,728,835.00	5.47
96	601918	新集能源	1,690,281.00	5.34
97	603278	大业股份	1,682,840.00	5.32
98	002895	川恒股份	1,679,661.00	5.31
99	300398	飞凯材料	1,665,790.00	5.27
100	603019	中科曙光	1,657,751.00	5.24
101	000933	神火股份	1,643,192.00	5.20
102	003021	兆威机电	1,635,828.57	5.17
103	002335	科华数据	1,623,190.00	5.13
104	301266	宇邦新材	1,617,994.20	5.12
105	300693	盛弘股份	1,615,745.79	5.11
106	603876	鼎胜新材	1,615,350.20	5.11
107	688116	天奈科技	1,612,265.97	5.10
108	002050	三花智控	1,581,895.00	5.00
109	600050	中国联通	1,579,805.00	4.99
110	600941	中国移动	1,536,137.00	4.86
111	002049	紫光国微	1,528,591.02	4.83
112	300727	润禾材料	1,503,363.00	4.75
113	300798	锦鸡股份	1,485,826.00	4.70
114	603179	新泉股份	1,472,840.00	4.66
115	688636	智明达	1,450,593.38	4.59
116	600933	爱柯迪	1,449,737.00	4.58
117	003011	海象新材	1,411,343.00	4.46
118	601658	邮储银行	1,370,146.00	4.33
119	300737	科顺股份	1,365,073.00	4.32

120	600961	株冶集团	1,363,588.00	4.31
121	300258	精锻科技	1,352,192.00	4.28
122	603477	巨星农牧	1,305,732.00	4.13
123	688059	华锐精密	1,294,869.70	4.09
124	300498	温氏股份	1,255,392.00	3.97
125	000404	长虹华意	1,245,742.00	3.94
126	300879	大叶股份	1,232,218.26	3.90
127	601998	中信银行	1,219,696.00	3.86
128	000657	中钨高新	1,204,953.00	3.81
129	603596	伯特利	1,182,194.00	3.74
130	300900	广联航空	1,180,365.00	3.73
131	688066	航天宏图	1,178,466.21	3.73
132	601677	明泰铝业	1,154,154.00	3.65
133	300373	扬杰科技	1,151,481.00	3.64
134	603806	福斯特	1,148,121.00	3.63
135	001286	陕西能源	1,139,803.00	3.60
136	601818	光大银行	1,128,678.00	3.57
137	688425	铁建重工	1,116,081.68	3.53
138	600528	中铁工业	1,107,775.00	3.50
139	688678	福立旺	1,097,375.56	3.47
140	002271	东方雨虹	1,091,199.00	3.45
141	600011	华能国际	1,090,752.00	3.45
142	688063	派能科技	1,087,460.74	3.44
143	600529	山东药玻	1,075,657.00	3.40
144	002487	大金重工	1,070,898.00	3.39
145	600600	青岛啤酒	1,070,488.00	3.38
146	002959	小熊电器	1,065,576.00	3.37
147	300814	中富电路	1,065,369.00	3.37
148	002756	永兴材料	1,064,923.00	3.37
149	600418	江淮汽车	1,053,343.00	3.33
150	601020	华钰矿业	1,008,335.00	3.19
151	300347	泰格医药	996,275.00	3.15
152	300827	上能电气	987,907.00	3.12
153	300308	中际旭创	984,160.00	3.11
154	600383	金地集团	982,572.00	3.11
155	601138	工业富联	965,008.00	3.05
156	605333	沪光股份	961,212.00	3.04
157	603108	润达医疗	957,050.00	3.03
158	300037	新宙邦	940,187.00	2.97
159	688627	精智达	918,768.45	2.90
160	688177	百奥泰	911,362.82	2.88
161	688599	天合光能	904,000.11	2.86
162	688197	首药控股	900,626.84	2.85

163	601728	中国电信	898,694.00	2.84
164	002531	天顺风能	897,965.00	2.84
165	600096	云天化	896,850.00	2.84
166	603650	彤程新材	891,318.00	2.82
167	600577	精达股份	888,614.00	2.81
168	002810	山东赫达	878,200.00	2.78
169	002966	苏州银行	868,610.00	2.75
170	603799	华友钴业	865,870.00	2.74
171	601137	博威合金	853,088.00	2.70
172	300871	回盛生物	821,702.00	2.60
173	688363	华熙生物	811,314.39	2.57
174	603008	喜临门	804,961.00	2.55
175	603713	密尔克卫	801,484.00	2.53
176	600026	中远海能	787,935.00	2.49
177	300763	锦浪科技	781,614.00	2.47
178	600919	江苏银行	763,194.00	2.41
179	002815	崇达技术	759,957.00	2.40
180	601916	浙商银行	743,820.00	2.35
181	603878	武进不锈	742,768.00	2.35
182	603966	法兰泰克	741,190.00	2.34
183	603890	春秋电子	740,253.00	2.34
184	688169	石头科技	737,997.72	2.33
185	688076	诺泰生物	734,435.43	2.32
186	600536	中国软件	722,468.00	2.28
187	300911	亿田智能	695,278.00	2.20
188	300818	耐普矿机	694,796.00	2.20
189	300624	万兴科技	687,555.82	2.17
190	300450	先导智能	675,866.00	2.14
191	000422	湖北宜化	671,585.00	2.12
192	300890	翔丰华	667,575.00	2.11
193	300926	博俊科技	666,096.00	2.11
194	600585	海螺水泥	664,632.00	2.10
195	000893	亚钾国际	659,157.00	2.08
196	603809	豪能股份	652,200.45	2.06
197	601801	皖新传媒	645,077.00	2.04
198	600690	海尔智家	643,787.00	2.04
199	688093	世华科技	639,673.73	2.02

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	629,270,728.41
卖出股票收入（成交）总额	494,302,596.40

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	82,296,955.27	10.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	213,111,765.62	26.02
	其中：政策性金融债	172,769,234.11	21.10
4	企业债券	7,193,728.21	0.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	484,992,504.98	59.22
7	可转债（可交换债）	56,352,075.11	6.88
8	同业存单	-	-
9	其他	53,926,284.83	6.58
10	合计	897,873,314.02	109.64

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	240210	24 国开 10	1,400,000	141,204,767.12	17.24
2	2400002	24 特别国债 02	700,000	71,589,247.28	8.74
3	312410002	24 中行 TLAC 非资本债 01B	400,000	40,342,531.51	4.93
4	102482095	24 保利发展 MTN004	400,000	40,298,698.08	4.92
5	102482709	24 鲁能源 MTN001B	350,000	35,208,611.51	4.30

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金以套期保值为目的开展国债期货投资，选择流动性好、交易活跃的主力合约进行交易。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	205,905.81
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,143,175.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,349,081.34

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110095	双良转债	4,271,468.42	0.52
2	118034	晶能转债	3,195,204.83	0.39
3	111009	盛泰转债	2,613,657.29	0.32
4	127089	晶澳转债	2,405,318.99	0.29
5	127088	赫达转债	2,321,560.50	0.28
6	123190	道氏转 02	2,090,666.36	0.26
7	113053	隆 22 转债	1,983,114.44	0.24
8	110085	通 22 转债	1,972,554.81	0.24
9	113678	中贝转债	1,722,907.43	0.21
10	110081	闻泰转债	1,633,205.02	0.20
11	123178	花园转债	1,604,424.92	0.20
12	110086	精工转债	1,591,922.96	0.19

13	123194	百洋转债	1,582,982.65	0.19
14	128105	长集转债	1,447,148.00	0.18
15	111003	聚合转债	1,279,011.70	0.16
16	118021	新致转债	1,251,583.33	0.15
17	123219	宇瞳转债	1,196,594.43	0.15
18	127068	顺博转债	1,186,266.18	0.14
19	123227	雅创转债	1,164,356.05	0.14
20	113054	绿动转债	1,155,654.54	0.14
21	118031	天 23 转债	1,138,356.12	0.14
22	127101	豪鹏转债	1,014,836.90	0.12
23	123090	三诺转债	963,775.17	0.12
24	127069	小熊转债	831,852.35	0.10
25	123209	聚隆转债	814,192.75	0.10
26	127095	广泰转债	809,653.85	0.10
27	113046	金田转债	800,775.50	0.10
28	127083	山路转债	796,704.09	0.10
29	113059	福莱转债	795,749.81	0.10
30	118022	锂科转债	795,649.92	0.10
31	113669	景 23 转债	792,635.37	0.10
32	128090	汽模转 2	788,598.17	0.10
33	113654	永 02 转债	787,287.08	0.10
34	123085	万顺转 2	730,974.90	0.09
35	118012	微芯转债	698,492.89	0.09
36	127066	科利转债	689,463.52	0.08
37	113577	春秋转债	606,707.51	0.07
38	127027	能化转债	403,513.23	0.05
39	123150	九强转债	403,430.09	0.05
40	123231	信测转债	401,259.85	0.05
41	113667	春 23 转债	400,190.80	0.05
42	113664	大元转债	399,844.29	0.05
43	113666	爱玛转债	396,032.05	0.05
44	127031	洋丰转债	396,007.72	0.05
45	127079	华亚转债	395,180.21	0.05
46	113563	柳药转债	395,100.87	0.05
47	127041	弘亚转债	394,004.15	0.05
48	123210	信服转债	236,214.62	0.03
49	113672	福蓉转债	204,909.41	0.03

7.11.5 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。

7.11.6 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。

§ 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 (%)
平安鼎信债券 A	9,285	76,878.25	519,465,667.18	72.77	194,348,888.17	27.23
平安鼎信债券 C	1,644	28,291.64	1,118,881.12	2.41	45,392,572.78	97.59
合计	10,620	71,593.79	520,584,548.30	68.47	239,741,460.95	31.53

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	平安鼎信债券 A	4,293,416.55	0.6015
	平安鼎信债券 C	144,186.52	0.3100
	合计	4,437,603.07	0.5836

注：上述从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安鼎信债券 A	50~100
	平安鼎信债券 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	平安鼎信债券 A	50~100
	平安鼎信债券 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安鼎信债券 A	平安鼎信债券 C
基金合同生效日 (2016 年 7 月 21 日)	500,034,407.16	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	31,385,396.95	-
本报告期基金总申购份额	1,030,757,348.58	169,687,777.48
减:本报告期基金总赎回份额	348,328,190.18	123,176,323.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	713,814,555.35	46,511,453.90

§ 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。

本报告期内,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、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

本基金聘用安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:本报告期内,本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:本报告期内,本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

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 (%)	
东北证券	3	361,917,582.28	32.37	266,337.38	32.37	-
东吴证券	2	268,542,072.00	24.01	197,618.47	24.01	-
申万宏源证券	2	149,856,302.25	13.40	110,281.38	13.40	-
开源证券	2	146,509,756.44	13.10	107,818.56	13.10	-
国信证券	2	85,288,717.91	7.63	62,764.77	7.63	-
国泰君安证券	2	56,584,788.53	5.06	41,642.30	5.06	新增 1 个
长江证券	1	19,358,030.70	1.73	14,245.83	1.73	-
华创证券	2	17,790,066.11	1.59	13,090.79	1.59	-
中信证券	3	11,168,175.24	1.00	8,218.93	1.00	退租 1 个
西部证券	1	1,219,731.33	0.11	897.70	0.11	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	退租 1 个
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

平安证券	2	-	-	-	-	退租 2个
世纪证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	退租 2个
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。

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(%)
东北证券	414,035,780.61	44.66	-	-	-	-
东吴证券	183,226,646.97	19.76	72,200,000.00	33.40	-	-
申万宏源证券	79,539,940.79	8.58	22,500,000.00	10.41	-	-
开源证券	68,518,119.88	7.39	56,200,000.00	25.99	-	-
国信证	84,004,454.	9.06	19,000,000.00	8.79	-	-

券	25		0			
国泰君安证券	45,793,209.38	4.94	43,500,000.00	20.12	-	-
长江证券	20,915,426.64	2.26	-	-	-	-
华创证券	12,296,698.10	1.33	2,800,000.00	1.30	-	-
中信证券	16,860,023.67	1.82	-	-	-	-
西部证券	1,904,571.31	0.21	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
世纪证	-	-	-	-	-	-

券						
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 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	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

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	平安鼎信债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 22 日
3	平安基金管理有限公司关于平安鼎信债券型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 02 月 20 日
4	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 02 月 27 日
5	平安鼎信债券型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 01 日
6	平安基金管理有限公司关于平安鼎信债券型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 01 日
7	平安鼎信债券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 03 月 01 日

8	平安鼎信债券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	2024 年 03 月 01 日
9	平安鼎信债券型证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 01 日
10	平安基金管理有限公司关于新增平安鼎信债券型证券投资基金 C 类份额销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 06 日
11	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
12	平安基金管理有限公司关于新增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 03 月 15 日
13	平安鼎信债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 30 日
14	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 04 月 11 日
15	平安基金管理有限公司关于新增平安银行股份有限公司（行 E 通）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	2024 年 04 月 12 日
16	平安鼎信债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 22 日
17	平安基金管理有限公司关于平安鼎信债券型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 25 日
18	平安基金管理有限公司关于新增交通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 05 月 16 日
19	平安基金管理有限公司关于新增北京创金启富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	2024 年 05 月 24 日
20	平安鼎信债券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	2024 年 05 月 31 日
21	平安鼎信债券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 05 月 31 日
22	平安基金管理有限公司关于新增光大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	2024 年 05 月 31 日
23	平安基金管理有限公司关于新增平安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	2024 年 06 月 03 日
24	平安基金管理有限公司关于新增海通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	2024 年 06 月 07 日

25	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波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	2024 年 06 月 13 日
26	平安基金管理有限公司关于新增申万宏源证券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 17 日
27	平安基金管理有限公司关于新增申万宏源西部证券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 17 日
28	平安基金管理有限公司关于新增平安鼎信债券型证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 06 月 26 日
29	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	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

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 年 01 月 01 日-2024 年 02 月 22 日	17,962,279.21	0.00	0.00	17,962,279.21	2.36
个人	1	2024 年 02 月 08 日-2024 年 02 月 18 日	0.00	13,021,445.04	13,021,445.04	0.00	0.00

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足投资者的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证

券投资基金运作管理办法》及《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等法律法规的规定及平安鼎信债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同的约定，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）在与本基金基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，决定自 2024 年 3 月 1 日起在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额自动转换为 A 类基金份额，并调整本基金基金份额的申赎数量限制。为此，本公司对本基金的基金合同、托管协议的相关内容进行了相应修订。详细内容可阅读本公司于 2024 年 3 月 1 日发布的《平安基金管理有限公司关于平安鼎信债券型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》。

§ 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鼎信债券型证券投资基金募集注册的文件
- （2）平安鼎信债券型证券投资基金基金合同
- （3）平安鼎信债券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