

平安养老目标日期 2035 三年持有期混合
型基金中基金（FOF）
2021 年中期报告

2021 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 27 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 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	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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	41

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	41
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	41
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12	本报告期投资基金情况	42
7.13	投资组合报告附注	错误!未定义书签。
§ 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	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	48
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.9	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	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	平安养老 2035	
基金主代码	007238	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 6 月 19 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	427,724,383.90 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安养老 2035A	平安养老 2035C
下属分级基金的交易代码	007238	007239
报告期末下属分级基金的份额总额	315,666,498.02 份	112,057,885.88 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，通过基金资产配置和组合管理，在合理控制投资组合波动性的同时，力争实现与其承担的风险相对应的长期稳健回报，追求基金资产的长期稳健增值。在 2035 年 12 月 31 日以前，本基金侧重于资本增值，当期收益为辅；在 2035 年 12 月 31 日之后，本基金侧重于当期收益，资本增值为辅。
投资策略	本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益的平衡，即在股混类基金、债券类基金、货币市场基金和其他资产之间的配置比例；其次，本基金将精选具有较高投资价值的证券投资基金、股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	中证平安 2035 退休宝指数收益率*95%+同期银行活期存款利率*5%
风险收益特征	本基金是混合型基金中基金，是目标日期基金，风险与收益水平会随着投资者目标时间期限的接近而逐步降低。本基金的预期风险与收益在投资初始阶段属于较高水平；随着目标投资期限的逐步接近，本基金将逐步降低预期风险与收益水平，转变成为中等风险的证券投资基金；在临近目标期限和目标期限达到以后，本基金转变成为低风险的证券投资基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	招商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	陈特正	张燕
	联系电话	0755-22626828	0755-83199084
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95555
传真		0755-23997878	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		罗春风	缪建民

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(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	平安养老 2035A	平安养老 2035C
本期已实现收益	20,748,296.79	6,882,855.73
本期利润	24,188,243.64	8,305,261.83
加权平均基金份额本期利润	0.0790	0.0798
本期加权平均净值利润率	5.59%	5.68%
本期基金份额净值增长率	5.57%	5.44%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	98,926,999.98	34,318,637.05
期末可供分配基金份额利润	0.3134	0.3063
期末基金资产净值	466,313,975.65	164,699,443.23
期末基金份额净值	1.4772	1.4698
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	47.72%	46.98%

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

平安养老 2035A

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	2.68%	0.67%	0.43%	0.27%	2.25%	0.40%
过去三个月	7.97%	0.63%	3.42%	0.35%	4.55%	0.28%
过去六个月	5.57%	0.88%	4.04%	0.49%	1.53%	0.39%
过去一年	20.66%	0.86%	11.97%	0.51%	8.69%	0.35%

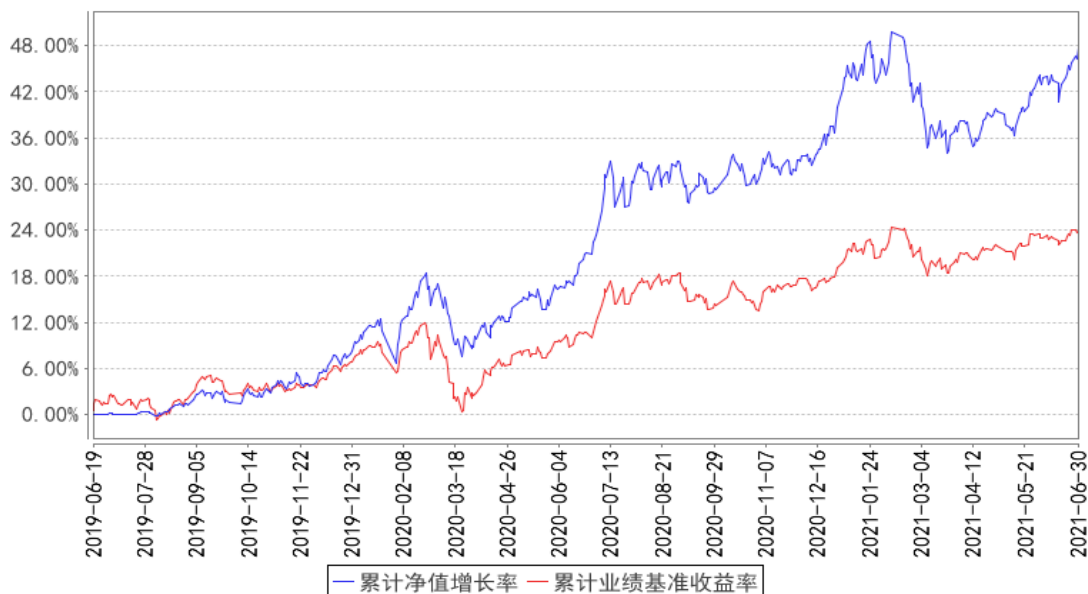
自基金合同生效 起至今	47.72%	0.77%	24.02%	0.55%	23.70%	0.22%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

平安养老 2035C

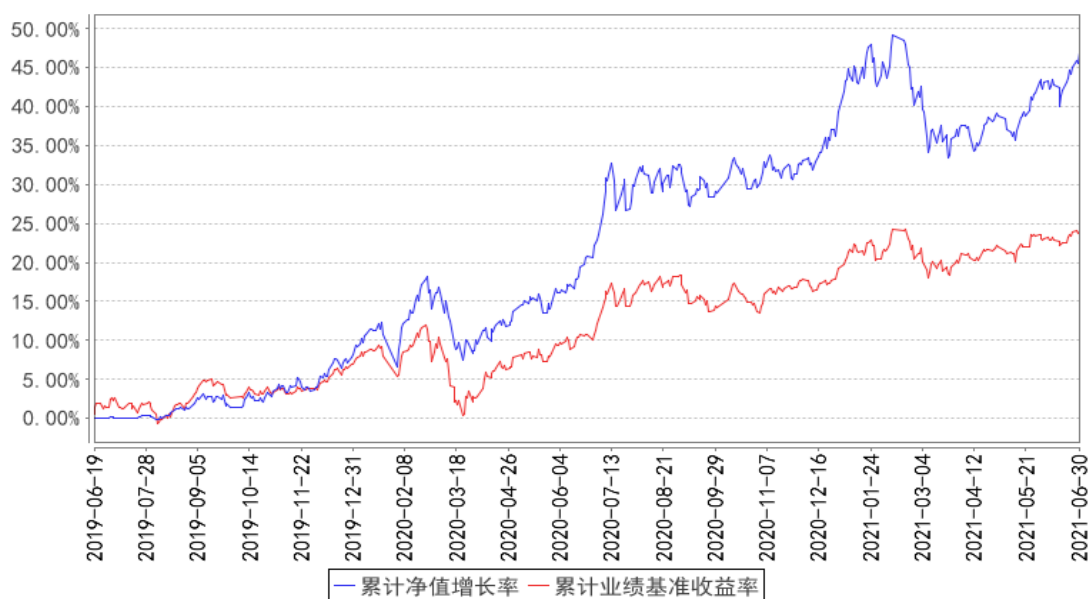
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①—③	②—④
过去一个月	2.66%	0.67%	0.43%	0.27%	2.23%	0.40%
过去三个月	7.91%	0.63%	3.42%	0.35%	4.49%	0.28%
过去六个月	5.44%	0.88%	4.04%	0.49%	1.40%	0.39%
过去一年	20.36%	0.86%	11.97%	0.51%	8.39%	0.35%
自基金合同生效 起至今	46.98%	0.77%	24.02%	0.55%	22.96%	0.22%

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

平安养老2035A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



平安养老2035C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 2019 年 06 月 19 日正式生效；

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

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块。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 2021 年 6 月 30 日，平安基金共管理 138 只公募基金，公募资产管理总规模约为 3,831 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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
张文君	平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理	2019 年 6 月 19 日	-	13 年	张文君女士, 厦门大学硕士。先后担任恒安标准人寿保险有限公司投资分析师、上海博鸿投资咨询合伙企业投研经理、上海苍石资产管理有限公司投资经理。2017 年 2 月加入平安基金管理有限公司, 曾任 FOF 投资中心 FOF 研究员。现担任平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、平安养老目标日期 2025 一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金经理。
高莺	FOF 投资中心养老金投资团队投资执行总经理, 平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理	2019 年 6 月 20 日	-	13 年	高莺女士, 浙江大学硕士, 美国爱荷华州立大学博士, 曾先后担任联邦家庭贷款银行资本市场分析师、美国太平洋投资管理公司 (PIMCO) 养老金投资部投资研究岗。2019 年 1 月加入平安基金管理有限公司, 现任 FOF 投资中心养老金投资团队投资执行总经理。同时担任平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、平安养老目标日期 2025 一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、平安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、平安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 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

宏观经济如预期稳中回落，但从库存表现来看仍处于主动补库阶段，经济整体可能会强于市场一致预期。在央行半年度工作例会中反复强调“稳”，并强调国内外环境复杂严峻，加强维护经济总体平稳。同时央行也通过不同渠道反复强调多关注央行操作利率而非量，并改变银行存款计价方式，引导银行端更有利于支持实体经济。一系列措施释放央行“保持流动性合理充裕”要落在实处的信息。因此从流动性方面，依然维持央行会根据经济的表现相机抉择的观点。

权益方面：

从估值方面，截至 6 月底，万德全 A 20.9X 处于历史 48%分位，动态看今年 WIND 全 A 估值 18X，处于 28%分位，整体看估值合理。上半年以来，市场开始逐步企稳回升，但结构分化显著，前半段以医药为主要反弹品种；近期，以新能源、科技等高成长性的标的估值得到显著修复。当前，自上而下分析来看，在滞涨阶段且流动性相对较温和下，很难看到市场整体贝塔的机会。结合紧信用、稳利率的环境，资金开始从高估值的标的逐步流入低估值且高成长的品种，例如 5 月初开始的新能源车，以及 6 月以来的半导体，启动阶段的短期估值均处于历史较低水平。核心品种，例如消费、医药等也呈现出高增长的二线标的表现强于高估值、稳定增长的一线标的。综合来看，均是在当前的宏观经济稳定回落下，在流动性非大幅宽松的环境中，相比于长期增长逻辑市场更加关注在估值模型分子端短期利润的兑现上。

固收方面：

在经济逐步进入滞涨阶段，信用见顶、宏观见顶、预计债市整体呈现震荡向上走势；在流动性稳定充裕的政策下，利率预计会有阶段性机会；信用端仍建议以高等级为主。

组合配置中：

权益方面，继续维持较为稳健的投资策略，在下滑线配置指引下，阶段性适度偏向权益资产，仍坚持核心部分以均衡品种为主，并兼顾估值与成长的匹配度。四月市场触底后，逐步逢低增加了泛科技、新能源车的配置，为组合带来了较显著的超额收益；介于部分高弹性新能源品种短期涨幅较大，组合中兑现了部分收益，并同时增加了估值仍具有吸引力的偏科技的品种；在宏观如预期小幅回落的基础上，降低了部分顺周期的品种，增加了估值合理成长性较好的制造业标的。目前看以上操作为组合带来了一定的正贡献。

固收方面，上半年，随着二季度经济同比增速逐步降速，适度增加了中长久期利率债基的配置，拉长组合久期，取得了一定超额回报；信用方面仍以中高等级信用债基为主要配置选择。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安养老 2035A 的基金份额净值 1.4772 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.57%，同期业绩比较基准收益率为 4.04%；截至本报告期末平安养老 2035C 的基金份额净值 1.4698 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.44%，同期业绩比较基准收益率为 4.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济的表现来看，当前逐步从经济高涨阶段逐步进入到滞涨阶段，预计下半年将维持稳步回落的走势，韧性可能会强于预期。在 CPI 压力较小，PPI 预期未来会有所回落的环境下，为货币政策留有更大空间。但本轮的商品价格上涨时由全球的需求来带动的，疫情带来复苏节奏不均衡，欧美当前仍处于较强复苏期，因此输入性通胀仍然对未来的预期带来扰动。从政策面，我们认为需要更多的关注核心通胀的变化。

权益品种，消费方面，由于对于下半年是否能继续维持高增速有所担忧，估值匹配度较弱，叠加交易层面筹码的腾挪，整体表现相对弱势。但随着估值逐步进入合理区间，长期的配置价值也会逐步显现，未来这一点也是我们关注的方向。

顺周期方面，在经济开始逐步走入滞涨过程中，其板块性的配置机会逐步退出，但结构上增速较好的品种仍有一定的机会，尤其在碳中和大背景下有持续成长性的品种，组合中仍有保持小幅配置比例的必要性。

科技标的中，从长期角度来看，相对看好新能源汽车、半导体、被动元器件等赛道，在未来电气化逐步替代化石能源的趋势中，相关的电子产品，成长空间也会呈几何倍数的增加。从长期

来看，科技板块空间依然很大，在国产替代及产业电子化的背景下，未来科技的周期性会有所减弱。但从估值的修复来看，近两个月的反弹使得个别品种的估值安全边际减弱，科技的长期性需要不断的短期业绩验证来证明，因此未来预计波动会有所增加。

固收选择方面，在经济逐步进入滞涨阶段，信用见顶、宏观见顶、预计债市整体呈现震荡向上走势；在流动性稳定充裕的政策下，利率预计会有阶段性机会；信用端仍建议以高等级为主。久期：建议继续中性久期。

我们仍坚持从长期的角度出发，秉承价值投资理念，力争为投资者创造长期的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。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、资本市场风险监控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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,637,656.44	39,603,736.79
结算备付金		226,443.42	141,503.93
存出保证金		20,535.73	45,670.98
交易性金融资产	6.4.7.2	595,723,920.47	502,684,516.57
其中：股票投资		4,859,010.00	12,111,600.00
基金投资		550,860,910.47	490,572,916.57
债券投资		40,004,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	6,800,000.00	10,000,000.00
应收证券清算款		12,369,143.50	4,022,165.55
应收利息	6.4.7.5	202,557.07	5,483.31
应收股利		255.60	1,505.16
应收申购款		1,602,975.03	548,266.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	8,864.76	659.73
资产总计		631,592,352.02	557,053,508.23
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2021年6月30日	2020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		-	-
应付证券清算款		4,630.32	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		263,538.56	244,882.51
应付托管费		73,557.74	64,925.40
应付销售服务费		32,565.66	27,829.48
应付交易费用	6.4.7.7	29,749.84	30,357.57
应交税费		81,130.87	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,760.15	189,000.00
负债合计		578,933.14	556,994.96
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	427,724,383.90	398,059,426.24
未分配利润	6.4.7.10	203,289,034.98	158,437,087.03
所有者权益合计		631,013,418.88	556,496,513.27
负债和所有者权益总计		631,592,352.02	557,053,508.23

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 427,724,383.90 份，其中平安养老 2035A 基金份额总额 315,666,498.02 份，基金份额净值 1.4772 元。平安养老 2035C 基金份额总额 112,057,885.88 份，基金份额净值 1.4698 元。

6.2 利润表

会计主体：平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
一、收入		36,302,009.24	53,417,010.38
1. 利息收入		121,175.44	231,557.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	84,808.82	67,923.83
债券利息收入		16,306.85	163,633.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,059.77	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,303,680.19	9,711,182.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-260,244.62	-156,568.82
基金投资收益	6.4.7.13	27,527,962.30	7,667,802.01
债券投资收益	6.4.7.14	-	3,180.00
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	4,035,962.51	2,196,769.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,862,352.95	43,461,311.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	14,800.66	12,958.54
减：二、费用		3,808,503.77	2,146,213.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,517,800.95	1,130,263.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	416,813.66	300,480.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	181,450.62	117,890.83
4. 交易费用	6.4.7.20	1,581,061.12	487,654.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		9,917.27	32.29
7. 其他费用	6.4.7.21	101,460.15	109,891.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,493,505.47	51,270,797.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,493,505.47	51,270,797.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净	398,059,426.24	158,437,087.03	556,496,513.27

值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,493,505.47	32,493,505.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	29,664,957.66	12,358,442.48	42,023,400.14
其中:1.基金申购款	29,664,957.66	12,358,442.48	42,023,400.14
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	427,724,383.90	203,289,034.98	631,013,418.88
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	344,473,508.09	28,261,706.58	372,735,214.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,270,797.21	51,270,797.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	29,147,734.90	4,001,389.72	33,149,124.62
其中:1.基金申购款	29,147,734.90	4,001,389.72	33,149,124.62
2.基金赎回款	-	-	-

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	373,621,242.99	83,533,893.51	457,155,136.50

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

平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF) (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[2019]590 号《关于准予平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)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《平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)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 330,589,881.94 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(2019)第 0348 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于 2019 年 6 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,623,043.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 33,161.88 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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)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,但不从本类别基金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《平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》的有关规定, 本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金 (以下简称“证券投资基金”, 包含封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金 (LOF) 和交易型开放式指数基金 (ETF)、QDII 基金、香港互认基金等中国证监会允许投资的基金)、股票、债券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。具体包括: 经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金 (含 QDII 基金)、香港互认基金、股票 (包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票)、港股通标的股票、债券 (包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券 (含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款 (包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、现金, 以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为: 投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%, 投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金 (含商品期货基金和黄金 ETF) 占基金资产的比例合计原则上不超过 60%, 其中对商品基金投资占基金资产的比例不超过 10%。本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额, 包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的, 基金管理人在履行适当程序后, 可以做出相应调整。本基金的业绩比较基准为: 中证平安 2035 退休宝指数收益率 $\times 95\%$ + 同期银行活期存款利率 $\times 5\%$ 。

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》、各项具体会计准则及相关规定 (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》、《平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	14,637,656.44
定期存款	-
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	-
合计	14,637,656.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,518,499.60	4,859,010.00	340,510.40	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	39,995,600.00	40,004,000.00	8,400.00
	合计	39,995,600.00	40,004,000.00	8,400.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	492,783,591.58	550,860,910.47	58,077,318.89	
其他	-	-	-	

合计	537,297,691.18	595,723,920.47	58,426,229.29
----	----------------	----------------	---------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,800,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	3,144.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	101.90
应收债券利息	198,400.00
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	901.70
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	9.30
合计	202,557.07

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	8,864.76
待摊费用	-
合计	8,864.76

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	29,499.84
银行间市场应付交易费用	250.00
合计	29,749.84

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	93,760.15
合计	93,760.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安养老 2035A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	299,408,765.36	299,408,765.36
本期申购	16,257,732.66	16,257,732.66
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-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	315,666,498.02	315,666,498.02

平安养老 2035C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,650,660.88	98,650,660.88
本期申购	13,407,225.00	13,407,225.00
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-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	112,057,885.88	112,057,885.88

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安养老 2035A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	73,565,812.40	46,002,718.80	119,568,531.20
本期利润	20,748,296.79	3,439,946.85	24,188,243.64
本期基金份额交易产生的变动数	4,612,890.79	2,277,812.00	6,890,702.79
其中：基金申购款	4,612,890.79	2,277,812.00	6,890,702.79
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	98,926,999.98	51,720,477.65	150,647,477.63

平安养老 2035C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,736,442.42	15,132,113.41	38,868,555.83
本期利润	6,882,855.73	1,422,406.10	8,305,261.83
本期基金份额交易产生的变动数	3,699,338.90	1,768,400.79	5,467,739.69
其中：基金申购款	3,699,338.90	1,768,400.79	5,467,739.69
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,318,637.05	18,322,920.30	52,641,557.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	83,163.48
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	1,369.01
其他	276.33
合计	84,808.82

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-260,244.62
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	-260,244.62

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	34,632,738.62
减：卖出股票成本总额	34,892,983.24
买卖股票差价收入	-260,244.62

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于股票投资产生的证券出借差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	389,396,561.46
减：卖出/赎回基金成本总额	361,868,599.16
基金投资收益	27,527,962.30

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.16.2 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。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	39,704.60
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	3,996,257.91
合计	4,035,962.51

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	4,862,352.95
股票投资	-951,482.08
债券投资	8,400.00
资产支持证券投资	-
基金投资	5,805,435.03
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	4,862,352.95

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
销售服务费	14,800.66
合计	14,800.66

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	85,207.36
银行间市场交易费用	250.00
交易基金产生的费用	1,495,603.76
其中：申购费	16,116.16
赎回费	703,881.69
交易费	5,330.56

转换费	770,275.35
合计	1,581,061.12

6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021年1月1日至2021年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	18,688.94
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	2,685,559.47
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	519,291.89

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,600.00
账户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	101,460.15

6.4.7.22 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无须作披露的分部报告。

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

截至本财务报表批准报出日，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

招商银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
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
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
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
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
上海陆金所基金销售有限公司(“陆金所”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构

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

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股票交易。

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 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,517,800.95	1,130,263.83
其中：支付销售机构的客户维护费	583,407.47	431,214.02

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×0.60%/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
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	416,813.66	300,480.04

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的0.15%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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×0.15%/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		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安养老 2035A	平安养老 2035C	合计
陆金所	-	41,344.93	41,344.93

平安基金		277.80	277.80
平安人寿		29,131.31	29,131.31
平安银行		88,884.88	88,884.88
平安证券		3,341.22	3,341.22
招商银行		9,739.53	9,739.53
合计		172,719.67	172,719.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安养老 2035A	平安养老 2035C	合计
陆金所		29,048.84	29,048.84
平安基金		181.87	181.87
平安人寿		12,986.50	12,986.50
平安银行		63,922.07	63,922.07
平安证券		2,020.00	2,020.00
招商银行		7,126.31	7,126.31
合计		115,285.59	115,285.59

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 0.25% 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：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 × 0.25% / 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自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

份额单位：份

平安养老 2035A

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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（%）
平安人寿	60,002,333.33	19.0081	60,002,333.33	20.0403

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
招商银行-活期	14,637,656.44	83,163.48	37,694,606.99	67,086.08

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于2021年6月30日，本基金持有基金管理人平安基金所管理的公开募集证券投资基金合计62,267,970.53元，占本基金资产净值的比例为9.87%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2021年1月1日至2021年 6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	12,336.60	-
当期持有基金产生的应支付销售	14,800.66	12,958.54

服务费（元）		
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	128,137.06	50,372.82
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	30,786.85	12,593.46
当期交易所交易基金产生的交易费（元）	1,920.42	-

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF 除外)，应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易所基金产生的申购费和当期交易所基金产生的赎回费为零。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

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(2021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%。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券（上年末：同）。

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、流通受限制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 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,637,656.44	-	-	-	14,637,656.44
结算备付金	226,443.42	-	-	-	226,443.42
存出保证金	20,535.73	-	-	-	20,535.73
交易性金融资产	40,004,000.00	-	-	-555,719,920.47	595,723,920.47
买入返售金融资产	6,800,000.00	-	-	-	6,800,000.00
应收利息	-	-	-	202,557.07	202,557.07
应收股利	-	-	-	255.60	255.60
应收申购款	-	-	-	1,602,975.03	1,602,975.03
应收证券清算款	-	-	-	12,369,143.50	12,369,143.50
其他资产	-	-	-	8,864.76	8,864.76
资产总计	61,688,635.59	-	-	-569,903,716.43	631,592,352.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	263,538.56	263,538.56
应付托管费	-	-	-	73,557.74	73,557.74
应付证券清算款	-	-	-	4,630.32	4,630.32
应付销售服务费	-	-	-	32,565.66	32,565.66
应付交易费用	-	-	-	29,749.84	29,749.84
应交税费	-	-	-	81,130.87	81,130.87
其他负债	-	-	-	93,760.15	93,760.15
负债总计	-	-	-	578,933.14	578,933.14
利率敏感度缺口	61,688,635.59	-	-	-569,324,783.29	631,013,418.88

上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	39,603,736.79	-	-	-	39,603,736.79
结算备付金	141,503.93	-	-	-	141,503.93
存出保证金	45,670.98	-	-	-	45,670.98
交易性金融资产	-	-	-	502,684,516.57	502,684,516.57
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	5,483.31	5,483.31
应收股利	-	-	-	1,505.16	1,505.16
应收申购款	-	-	-	548,266.21	548,266.21
应收证券清算款	-	-	-	4,022,165.55	4,022,165.55
其他资产	-	-	-	659.73	659.73
资产总计	49,790,911.70	-	-	507,262,596.53	557,053,508.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	244,882.51	244,882.51
应付托管费	-	-	-	64,925.40	64,925.40
应付销售服务费	-	-	-	27,829.48	27,829.48
应付交易费用	-	-	-	30,357.57	30,357.57
其他负债	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	-	-	-	556,994.96	556,994.96
利率敏感度缺口	49,790,911.70	-	-	-506,705,601.57	556,496,513.27

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

注：于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净值的比例为 6.34%(上年末：无)，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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	4,859,010.00	0.77	12,111,600.00	2.18
交易性金融资产—基金投资	550,860,910.47	87.30	490,572,916.57	88.15
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	555,719,920.47	88.07	502,684,516.57	90.33

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）		上年度末（2020年12月31日）
	本期末（2021年6月30日）		
分析	沪深 300 指数上升 5%	19,563,544.06	15,488,500.82
	沪深 300 指数下降 5%	-19,563,544.06	-15,488,500.82

6.4.14 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	4,859,010.00	0.77
	其中：股票	4,859,010.00	0.77
2	基金投资	550,860,910.47	87.22
3	固定收益投资	40,004,000.00	6.33
	其中：债券	40,004,000.00	6.33
	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	6,800,000.00	1.08
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,864,099.86	2.35
8	其他各项资产	14,204,331.69	2.25
9	合计	631,592,352.02	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	-	-
C	制造业	4,859,010.00	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,859,010.00	0.77

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	300408	三环集团	100,000	4,242,000.00	0.67
2	600519	贵州茅台	300	617,010.00	0.10

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	000568	泸州老窖	7,382,578.00	1.33
2	600519	贵州茅台	6,491,296.00	1.17
3	601166	兴业银行	4,768,514.00	0.86
4	300408	三环集团	3,869,370.00	0.70
5	300433	蓝思科技	2,759,243.68	0.50
6	600031	三一重工	2,134,822.00	0.38
7	300035	中科电气	1,179,127.00	0.21
8	003038	鑫铂股份	6,924.64	0.00

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	000568	泸州老窖	6,313,973.53	1.13
2	600519	贵州茅台	5,727,172.00	1.03
3	300433	蓝思科技	5,593,263.64	1.01
4	600031	三一重工	4,428,509.68	0.80
5	601166	兴业银行	4,307,308.00	0.77
6	002142	宁波银行	4,136,322.00	0.74
7	601601	中国太保	1,671,356.00	0.30
8	300035	中科电气	1,221,501.00	0.22
9	000002	万科A	1,216,809.00	0.22
10	003038	鑫铂股份	16,523.77	0.00

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	28,591,875.32
卖出股票收入（成交）总额	34,632,738.62

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,004,000.00	6.34
	其中：政策性金融债	40,004,000.00	6.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,004,000.00	6.34

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	210206	21 国开 06	400,000	40,004,000.00	6.34

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股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

基金的投资组合比例要求：投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）占基金资产的比例合计原则上不超于 60%，其中对商品基金投资占基金资产的比例不超过 10%。本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。建仓期满后，按照基金合同要求，基金合同生效日至 2021 年底，权益资产范围 30%—60%。

投资子基金要求：在选择养老目标基金子基金（含香港互认基金）时，重点考察子基金风格特征稳定性、风险控制和合规运作情况，并对照业绩比较基准评价中长期收益、业绩波动和回撤的情况，且被投资子基金的主要筛选条件如下：

（1）子基金运作期限应当不少于 2 年，最近 2 年平均季末基金净资产应当不低于 2 亿元；子基金为指数基金、ETF 和商品基金等品种的，运作期限应当不少于 1 年，最近定期报告披露的季末基金净资产应当不低于 1 亿元；

（2）子基金运作合规，风格清晰，中长期收益良好，业绩波动较低；

（3）子基金基金管理人及子基金基金经理最近 2 年没有重大违法违规行为；

（4）中国证监会规定的其他条件。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净	是否属于基金管理人及管理

						值比例 (%)	人关联方 所管理的 基金
1	001182	易方达 安心回 馈混合	契约 型开 放式	24,246,487.99	58,991,705.28	9.35	否
2	519133	海富通 改革驱 动混合	契约 型开 放式	15,079,582.79	41,483,932.26	6.57	否
3	001043	工银美 丽城镇 股票 A	契约 型开 放式	13,612,485.63	39,707,620.58	6.29	否
4	519704	交银先 进制造 混合	契约 型开 放式	7,661,407.15	35,647,761.33	5.65	否
5	002168	嘉实智 能汽车 股票	契约 型开 放式	8,251,137.10	34,044,191.67	5.40	否
6	519702	交银趋 势优先 混合	契约 型开 放式	9,149,149.93	31,079,662.31	4.93	否
7	006252	永赢消 费主题 混合 A	契约 型开 放式	7,244,010.11	28,519,667.80	4.52	否
8	003377	广发中 债 7- 10 年 国开债 指数 C	契约 型开 放式	22,172,949.00	25,031,042.13	3.97	否
9	005754	平安短 债债券 A	契约 型开 放式	21,576,887.61	23,674,161.09	3.75	是
10	001410	信达澳 银新能 源产业 股票	契约 型开 放式	4,872,329.64	21,910,866.39	3.47	否

11	002169	永赢稳益债券	契约型开放式	17,094,469.11	18,321,851.99	2.90	否
12	166006	中欧行业成长混合(LOF)A	上市契约型开放式(LOF)	6,595,092.87	17,394,557.44	2.76	否
13	166019	中欧价值智选混合A	契约型开放式	3,330,759.65	16,285,749.31	2.58	否
14	003961	易方达瑞程混合A	契约型开放式	4,704,451.32	16,026,183.87	2.54	否
15	006101	平安优势产业混合C	契约型开放式	5,422,013.37	13,315,922.64	2.11	是
16	004200	博时富瑞纯债债券A	契约型开放式	12,465,795.75	13,224,962.71	2.10	否
17	000121	华夏永福混合A	契约型开放式	5,073,059.36	12,332,607.30	1.95	否
18	002795	平安惠盈纯债债券A	契约型开放式	11,278,195.49	12,248,120.30	1.94	是
19	512760	国泰CES半导体ETF	交易型开放式(ETF)	8,000,000.00	12,120,000.00	1.92	否
20	002920	中欧短债债券A	契约型开放式	11,456,493.01	11,758,944.43	1.86	否
21	008015	嘉实中债3-5年国开	契约型开放式	10,391,691.39	10,548,605.93	1.67	否

		债指数 A					
22	000698	宝盈科技 30 混合	契约型开放式	2,702,226.08	10,084,707.73	1.60	否
23	519773	交银数据产业灵活配置混合	契约型开放式	4,116,460.83	9,278,502.71	1.47	否
24	000402	工银纯债债券 A	契约型开放式	7,503,657.28	8,635,208.80	1.37	否
25	070037	嘉实纯债债券 A	契约型开放式	6,986,026.20	8,495,007.86	1.35	否
26	515700	平安中证新能源车 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,660,000.00	7,235,200.00	1.15	是
27	003465	平安金管家货币 A	契约型开放式	5,794,566.50	5,794,566.50	0.92	是
28	512660	国泰中证军工 ETF	交易型开放式 (ETF)	5,000,000.00	5,760,000.00	0.91	否
29	070009	嘉实超短债债券 C	契约型开放式	1,678,392.65	1,766,004.75	0.28	否
30	000032	易方达信用债债券 A	契约型开放式	129,272.02	143,595.36	0.02	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

国家开发银行违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审

慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 25 日做出银保监罚决字（2020）67 号处罚决定，罚款 4880 万元。

国家开发银行海南省分行因擅自提供对外担保，违反《中华人民共和国外汇管理条例》（中华人民共和国国务院令 532 号）第四十三条相关规定，国家外汇管理局海南省分局于 2021 年 3 月 3 日作出琼汇检罚（2021）2 号处罚决定，对该分行给予警告，处人民币 4266.16 万元的罚款。

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2 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股票库之外的股票。

7.13.3 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	20,535.73
2	应收证券清算款	12,369,143.50
3	应收股利	255.60
4	应收利息	202,557.07
5	应收申购款	1,602,975.03
6	其他应收款	8,864.76
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,204,331.69

7.13.4 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。

7.13.5 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不存在流通受限的情况。

7.13.6 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 (%)
平安养老 2035A	20,984	15,043.20	60,002,333.33	19.01	255,664,164.69	80.99
平安养老 2035C	13,234	8,467.42	1,945.90	0.00	112,055,939.98	100.00
合计	33,707	12,689.48	60,004,279.23	14.03	367,720,104.67	85.97

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	平安养老 2035A	1,241,323.05	0.3932
	平安养老 2035C	274,564.31	0.2450
	合计	1,515,887.36	0.3544

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	平安养老 2035A	10~50
	平安养老 2035C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	平安养老 2035A	10~50
	平安养老 2035C	0

	合计		10~50
--	----	--	-------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安养老 2035A	平安养老 2035C
基金合同生效日 (2019 年 6 月 19 日) 基金份额总额	260,263,051.56	70,359,992.26
本报告期期初基金 份额总额	299,408,765.36	98,650,660.88
本报告期基金总申 购份额	16,257,732.66	13,407,225.00
减：本报告期基金 总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分 变动份额（份额减 少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金 份额总额	315,666,498.02	112,057,885.88

§ 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

2021 年 3 月 2 日，王金涛担任平安基金管理有限公司总经理助理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

平安养老 2035 所投资的交银施罗德先进制造混合型证券投资基金于 2021 年 7 月 1 日召开基金份额持有人大会审议基金调整投资范围及修改基金合同等相关事宜，由于直接或委托授权代表出具有效表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额未达到在权益登记日基金份额总数的

50%，未达到法定的持有人会议召开条件。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
中信证券	2	63,217,689.30	100.00%	44,966.54	100.00%	-
安信证券	1	-	-	-	-	新增 1个
东吴证券	1	-	-	-	-	新增 1个
银河证券	3	-	-	-	-	新增 3个

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。

10.8.2 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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	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	成交金额	占当期 基金 成交总 额的比例
中信证 券	-	-	48,800,000.00	100.00%	-	-	118,451,625.32	100.00%
安信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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旗下 FOF 基金 2020 年 12 月 31 日基金净值的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 05 日
2	平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
3	平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
4	平安基金管理有限公司关于北京度小满基金销售有限公司暂停销售平安养老目标日期 2025 一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）和平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 10 日
5	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商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	2021 年 03 月 11 日
6	平安基金管理有限公司关于平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）新增中国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	2021 年 03 月 26 日
7	平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 31 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 09 日
9	平安养老目标日期 2035 三年持有期	中国证监会规定报刊及	2021 年 04 月 22 日

	混合型基金中基金（FOF）2021 年第 1 季度报告	网站	
10	平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书(更新)	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
11	平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
12	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 02 日
13	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 04 日
14	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 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

注：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养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）募集注册的文件

(2) 平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同

(3) 平安养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）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

2021 年 8 月 30 日