

平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF) 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 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	6
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	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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内容的真实、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	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	43
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	43

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	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末上市基金前十名持有人	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 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	45
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF)		
基金简称	平安鼎弘混合 (LOF)		
场内简称	平安鼎弘 (扩位证券简称: 鼎弘 LOF)		
基金主代码	167003		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017 年 4 月 26 日		
基金管理人	平安基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	15,401,047.12 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2017 年 6 月 6 日		
下属分级基金的基 金简称	平安鼎弘混合 (LOF) A	平安鼎弘混合 C	平安鼎弘混合 D
下属分级基金的交 易代码	167003	010228	010229
报告期末下属分级 基金的份额总额	15,400,725.08 份	147.42 份	174.62 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金转为上市开放式基金 (LOF) 后, 通过合理配置大类资产和精选投资标的, 在严格控制下行风险和保持资产流动性的基础上, 力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金转为上市开放式基金 (LOF) 后, 在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上, 深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件, 将事件性因素作为投资的主线, 形成以事件驱动为核心的投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*80%

风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。
--------	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	郭明
	联系电话	0755-22626828	010-66105799
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		罗春风	陈四清

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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01月01日-2021年06月30日)		
	平安鼎弘混合(LOF)A	平安鼎弘混合C	平安鼎弘混合D
本期已实现收益	3,100,612.47	8.35	18.45
本期利润	1,673,058.80	2.59	4.76
加权平均基金份额本期	0.0855	0.0176	0.0203

利润			
本期加权平均净值利润率	7.64%	1.57%	1.81%
本期基金份额净值增长率	1.67%	1.59%	1.75%
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	1,914,077.52	17.97	21.53
期末可供分配基金份额利润	0.1243	0.1219	0.1233
期末基金资产净值	17,314,802.60	165.61	196.48
期末基金份额净值	1.1243	1.1234	1.1252
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	12.43%	3.51%	3.68%

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

平安鼎弘混合 (LOF) 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	0.23%	0.20%	-0.25%	0.17%	0.48%	0.03%
过去三个月	1.96%	0.24%	1.72%	0.20%	0.24%	0.04%
过去六个月	1.67%	0.39%	1.96%	0.27%	-0.29%	0.12%
过去一年	3.66%	0.40%	7.38%	0.27%	-3.72%	0.13%
过去三年	9.91%	0.36%	21.99%	0.27%	- 12.08%	0.09%
自基金合同生效 起至今	12.43%	0.32%	27.40%	0.25%	- 14.97%	0.07%

平安鼎弘混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	0.23%	0.19%	-0.25%	0.17%	0.48%	0.02%
过去三个月	1.90%	0.24%	1.72%	0.20%	0.18%	0.04%
过去六个月	1.59%	0.39%	1.96%	0.27%	-0.37%	0.12%
自基金合同生效 起至今	3.51%	0.37%	4.75%	0.25%	-1.24%	0.12%

平安鼎弘混合 D

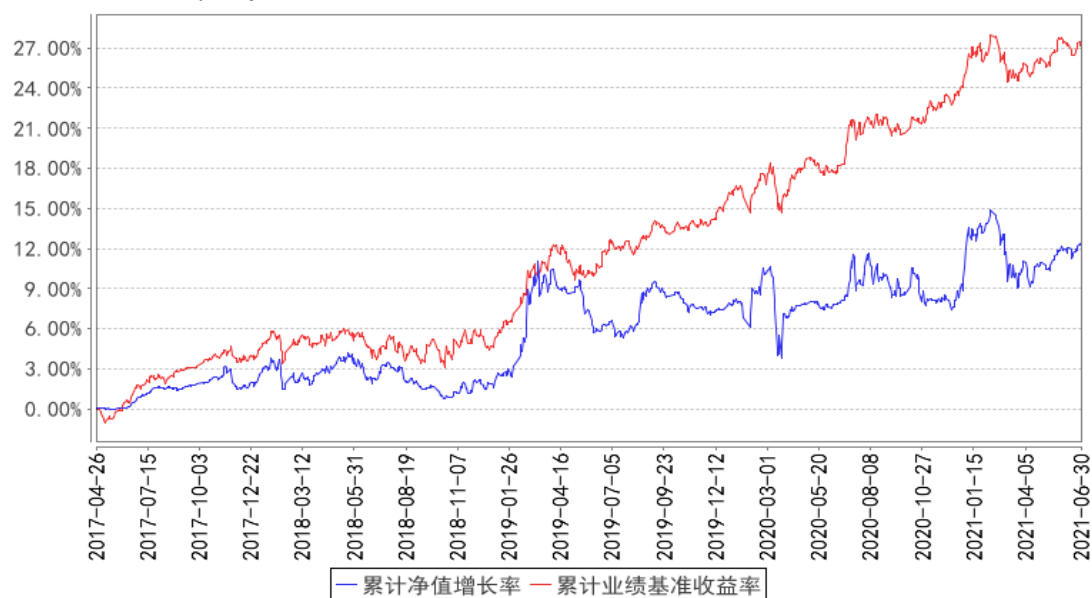
阶段	份额净 值增长 率①	份额净 值增长 率标准 差②	业绩比 较基准 收益率③	业绩比 较基准 收益率 标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.22%	0.20%	-0.25%	0.17%	0.47%	0.03%

过去三个月	2.01%	0.24%	1.72%	0.20%	0.29%	0.04%
过去六个月	1.75%	0.39%	1.96%	0.27%	-0.21%	0.12%
自基金合同生效起至今	3.68%	0.37%	4.75%	0.25%	-1.07%	0.12%

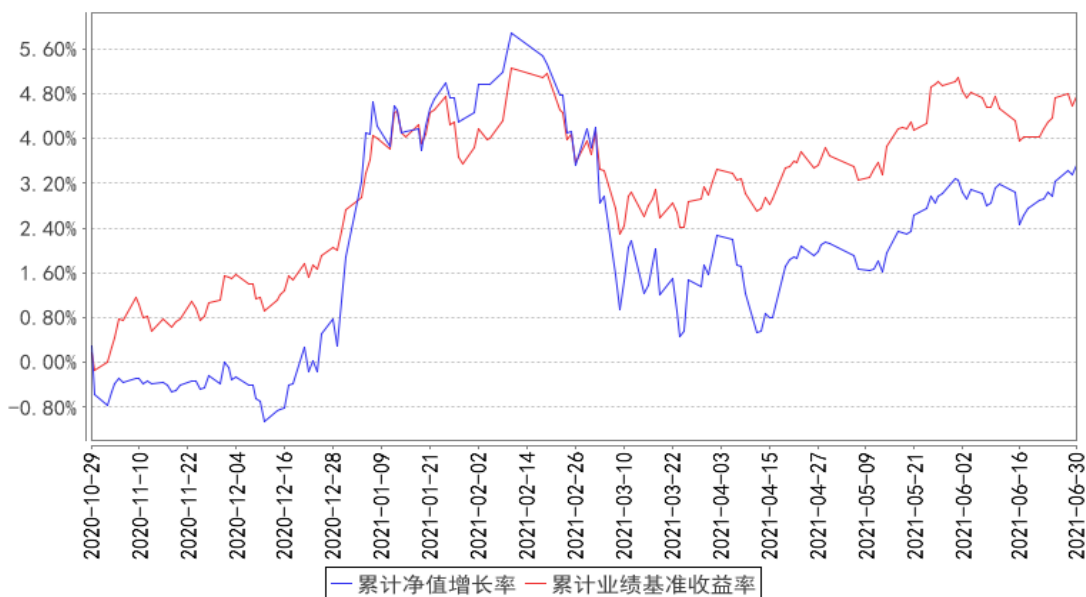
注：平安鼎弘 C 类和 D 类份额“自基金合同生效起至今”均指 2020 年 10 月 29 日至 2021 年 06 月 30 日

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

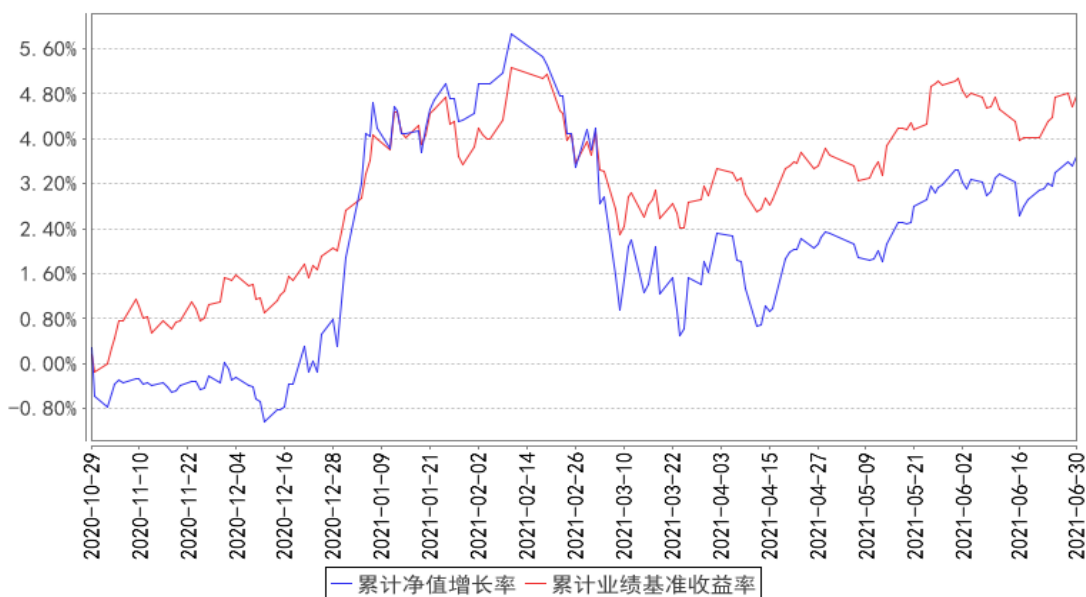
平安鼎弘混合 (LOF) A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安鼎弘混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安鼎弘混合D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 2017 年 4 月 26 日正式生效；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓。建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定；
- 3、本基金于 2020 年 10 月 27 日增设 C 类和 D 类份额，C 类和 D 类份额都是从 2020 年 10 月 29 日开始有份额，所以以上 C 类和 D 类份额走势图均从 2020 年 10 月 29 日开始。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏宁	平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理	2020年3月23日	-	9年	苏宁先生，北京大学西方经济学硕士研究生。曾先后担任易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益研究员兼基金经理助理。2019年6月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心投资经理。现担任平安惠诚纯债债券型证券投资基金、平安元盛超短债债券型证券投资基金、平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF)、平安合享1年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠润纯债债券型证券投资基金、平安惠享纯债债券型证券投资基金、平安鼎信债券型证券投资基金、平安合悦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安元丰中短债债券型证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

2021 年上半年，经济延续修复。PPI 同比走高，核心 CPI 整体不高。货币政策以稳为主，资金面整体宽松。债券收益率整体下行，信用利差与级别利差压缩。权益市场整体震荡走势。本基金权益仓位保持稳定。持仓结构方面，主要配置高景气行业龙头，债券配置短久期品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安鼎弘混合 (LOF) A 的基金份额净值 1.1243 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.67%，同期业绩比较基准收益率为 1.96%；截至本报告期末平安鼎弘混合 C 的基金份额净值 1.1234 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.59%，同期业绩比较基准收益率为 1.96%；截至本报告期末平安鼎弘混合 D 的基金份额净值 1.1252 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.75%，同期业绩比较基准收益率为 1.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为国内宏观经济运行平稳，经济发展动力增强。但经济恢复中仍有一些结构性的问题，整体上游好于下游，外需好于内需。展望下半年，稳增长的宏观政策或边际加强，货币政策稳字当头，仍以呵护流动性为主，对债券市场来说整体影响偏正面。本基金将保持短久期债券的配置力度。权益市场中期看具有较高的投资价值，本基金继续选择行业景气向上的优质公司和行业龙头投资。

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，以上情况未消除。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证监会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

本报告期内，本基金托管人在对平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)的托管人——平安基金管理有限公司在平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)2021年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)

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	3,765,855.06	260,515.30
结算备付金		914,575.86	2,073,123.37
存出保证金		7,331.21	821,567.50
交易性金融资产	6.4.7.2	12,587,259.86	59,507,585.97
其中:股票投资		2,510,277.46	14,550,415.97
基金投资		-	-
债券投资		10,076,982.40	44,957,170.00
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	3,200,000.00	10,000,000.00
应收证券清算款		-	2,904.11
应收利息	6.4.7.5	126,847.96	335,763.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		20,601,869.95	73,001,459.87
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		3,200,000.00	-
应付赎回款		-	101,848.25
应付管理人报酬		17,129.67	72,887.89
应付托管费		3,568.70	15,184.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,363.88	28,663.04
应交税费		-	1,058.98
应付利息		465.62	465.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	59,177.39	129,038.20
负债合计		3,286,705.26	349,146.96
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	15,401,047.12	65,703,376.10
未分配利润	6.4.7.10	1,914,117.57	6,948,936.81
所有者权益合计		17,315,164.69	72,652,312.91
负债和所有者权益总计		20,601,869.95	73,001,459.87

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 15,401,047.12 份，其中平安鼎弘混合 (LOF) A 基金份额总额 15,400,725.08 份，基金份额净值 1.1243 元。平安鼎弘混合 C 基金份额总额 147.42 份，基金份额净值 1.1234 元。平安鼎弘混合 D 基金份额总额 174.62 份，基金份额净值 1.1252 元。

6.2 利润表

会计主体：平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF)

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		1,943,217.38	3,431,242.50
1. 利息收入		138,837.73	2,614,258.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,349.16	119,014.47
债券利息收入		70,057.48	2,126,570.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		51,431.09	368,673.87

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,223,393.97	28,922.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,625,627.27	2,708,436.19
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	282,424.56	-2,723,752.09
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	299,374.37	-
股利收益	6.4.7.16	15,967.77	44,238.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,427,573.12	718,619.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	8,558.80	69,441.53
减：二、费用		270,151.23	2,158,254.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	130,856.33	1,110,854.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,261.77	231,428.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	39,931.87	621,505.70
5. 利息支出		-	49,937.66
其中：卖出回购金融资产 支出		-	49,937.66
6. 税金及附加		1,675.69	5,631.71
7. 其他费用	6.4.7.20	70,425.57	138,896.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,673,066.15	1,272,988.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,673,066.15	1,272,988.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF)

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	65,703,376.10	6,948,936.81	72,652,312.91

值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,673,066.15	1,673,066.15
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)	-50,302,328.98	-6,707,885.39	-57,010,214.37
其中:1.基金申购款	1,013,869.92	144,968.48	1,158,838.40
2.基金赎回款	-51,316,198.90	-6,852,853.87	-58,169,052.77
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)	15,401,047.12	1,914,117.57	17,315,164.69
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)	191,116,532.75	14,725,379.43	205,841,912.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,272,988.19	1,272,988.19
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)	-48,565,416.16	-3,933,919.29	-52,499,335.45
其中:1.基金申购款	3,147,355.03	244,981.64	3,392,336.67
2.基金赎回款	-51,712,771.19	-4,178,900.93	-55,891,672.12

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）	142,551,116.59	12,064,448.33	154,615,564.92

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

平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)(原名为平安大华鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安大华鼎弘混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]3140号《关于准予平安大华鼎弘混合型证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(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《平安大华鼎弘混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币202,573,315.75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(2017)第231号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华鼎弘混合型证券投资基金基金合同》于2017年4月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为202,701,052.24份基金份额,其中认购资金利息折合127,736.49份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”),登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

经深交所深证上[2017]338号文审核同意,本基金34,793,864.00份基金份额于2017年6月6日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《平安鼎弘混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)至18个月后对应日前一个工作日止,本基金在封闭期内不办理申购赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所(以下简称“深交所”)转让基金份额。封闭期

届满后，本基金转换为上市开放式基金 (LOF)，投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。自 2018 年 10 月 26 日起，本基金转换为上市开放式基金 (LOF)，基金名称变更为“平安大华鼎弘混合型证券投资基金 (LOF)”。

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》，平安大华鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF)。

根据《平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》，本基金根据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。在投资人申购时收取申购费用而不计提销售服务费的基金份额，称为 A 类、D 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、D 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、D 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《平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的股票 (包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券 (包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券 (含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款 (包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具 (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：股票资产占基金资产的比例为 0-30%；封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转为上市开放式基金 (LOF) 后，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 20% + 中证综合债指数收益率 \times 80%。

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》、《平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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	3,765,855.06
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	3,765,855.06

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	2,320,979.79	2,510,277.46	189,297.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,982.40	982.47
	银行间市场	10,068,000.00	5,950.00
	合计	10,076,982.40	6,932.47
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	12,391,029.72	12,587,259.86	196,230.14

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	3,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,200,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告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	567.38
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	466.10
应收债券利息	125,811.51
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	2.97
合计	126,847.96

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

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	5,416.36
银行间市场应付交易费用	947.52
合计	6,363.88

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	59,177.39
合计	59,177.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安鼎弘混合 (LOF) A

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	65,702,897.33	65,702,897.33
本期申购	1,013,869.92	1,013,869.92
本期赎回 (以“-”号填列)	-51,316,042.17	-51,316,042.17
-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	15,400,725.08	15,400,725.08

平安鼎弘混合 C

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	147.42	147.42

本期申购	-	-
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	147.42	147.42

平安鼎弘混合 D

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	331.35	331.35
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-156.73	-156.73
-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	174.62	174.62

6.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

平安鼎弘混合 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,888,540.41	1,060,345.72	6,948,886.13
本期利润	3,100,612.47	-1,427,553.67	1,673,058.80
本期基金份额 交易产生的变动数	-6,724,902.00	17,034.59	-6,707,867.41
其中: 基金申 购款	156,598.34	-11,629.86	144,968.48
基金赎 回款	-6,881,500.34	28,664.45	-6,852,835.89
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	2,264,250.88	-350,173.36	1,914,077.52

平安鼎弘混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9.62	5.98	15.60
本期利润	8.35	-5.76	2.59
本期基金份额 交易产生的变	-	-	-

动数			
其中：基金申购款			
基金赎回款			
本期已分配利润			
本期末	17.97	0.22	18.19

平安鼎弘混合 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21.59	13.49	35.08
本期利润	18.45	-13.69	4.76
本期基金份额交易产生的变动数	-18.51	0.53	-17.98
其中：基金申购款			
基金赎回款	-18.51	0.53	-17.98
本期已分配利润			
本期末	21.53	0.33	21.86

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	9,419.34
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	7,790.20
其他	139.62
合计	17,349.16

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	2,625,627.27
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	2,625,627.27

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	18,667,120.28
减：卖出股票成本总额	16,041,493.01
买卖股票差价收入	2,625,627.27

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 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	282,424.56
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	282,424.56

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	56,113,191.59
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	55,381,846.23
减：应收利息总额	448,920.80
买卖债券差价收入	282,424.56

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 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买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	299,374.37

6.4.7.16 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	15,967.77
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	15,967.77

6.4.7.17 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	-1,106,813.12
股票投资	-1,251,005.82
债券投资	144,192.70
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-320,760.00
权证投资	-
期货投资	-320,760.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,427,573.12

6.4.7.18 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	8,558.80
合计	8,558.80

6.4.7.19 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	38,629.37
银行间市场交易费用	1,302.50
合计	39,931.87

6.4.7.20 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	17,356.09
信息披露费	3,068.52
证券出借违约金	-
银行费用	1,648.18
账户维护费	18,000.00
上市费	29,752.78
其他	600.00
合计	70,425.57

6.4.7.21 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、基金销售机构
工商银行	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
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：本基金于本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

金额单位：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	
	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 (%)
平安证券	47,600,000.00	8.46	-	-

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

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	130,856.33	1,110,854.50
其中：支付销售机构的客户维护费	23,338.08	182,473.53

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.20%/ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的托管费	27,261.77	231,428.00

注：支付基金托管人工商银行的托管费按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。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25%/ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

平安鼎弘混合 (LOF) A

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(%)
平安汇通	7,573,905.36	49.1789	55,073,905.36	83.8226

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
工商银行-活期	3,765,855.06	9,419.34	209,189.22	29,318.93

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(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 0.05%（上年末：48.17%）。

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	3,765,855.06	-	-	-	3,765,855.06
结算备付金	914,575.86	-	-	-	914,575.86
存出保证金	7,331.21	-	-	-	7,331.21
交易性金融资产	8,982.40	10,068,000.00	-	2,510,277.46	12,587,259.86
买入返售金融资产	3,200,000.00	-	-	-	3,200,000.00
应收利息	-	-	-	126,847.96	126,847.96
资产总计	7,896,744.53	10,068,000.00	-	2,637,125.42	20,601,869.95
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	17,129.67	17,129.67
应付托管费	-	-	-	3,568.70	3,568.70
应付证券清算款	-	-	-	3,200,000.00	3,200,000.00
应付交易费用	-	-	-	6,363.88	6,363.88
应付利息	-	-	-	465.62	465.62
其他负债	-	-	-	59,177.39	59,177.39
负债总计	-	-	-	3,286,705.26	3,286,705.26
利率敏感度缺口	7,896,744.53	10,068,000.00	-	-649,579.84	17,315,164.69
上年度末 2020年12月31日					
资产					
银行存款	260,515.30	-	-	-	260,515.30
结算备付金	2,073,123.37	-	-	-	2,073,123.37

存出保证金	36,018.70	-	-	785,548.80	821,567.50
交易性金融资产	44,957,170.00	-	-	14,550,415.97	59,507,585.97
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	335,763.62	335,763.62
应收证券清算款	-	-	-	2,904.11	2,904.11
资产总计	57,326,827.37	-	-	15,674,632.50	73,001,459.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	101,848.25	101,848.25
应付管理人报酬	-	-	-	72,887.89	72,887.89
应付托管费	-	-	-	15,184.98	15,184.98
应付交易费用	-	-	-	28,663.04	28,663.04
应付利息	-	-	-	465.62	465.62
应交税费	-	-	-	1,058.98	1,058.98
其他负债	-	-	-	129,038.20	129,038.20
负债总计	-	-	-	349,146.96	349,146.96
利率敏感度缺口	57,326,827.37	-	-	15,325,485.54	72,652,312.91

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	36,119.82	7,840.05
	市场利率上升 25 个基点	-35,709.61	-7,827.84

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。

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	2,510,277.46	14.50	14,550,415.97	20.03
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	2,510,277.46	14.50	14,550,415.97	20.03

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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	沪深300指数上升5%	222,580.45	795,694.65
	沪深300指数下降5%	-222,580.45	-795,694.65

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	2,510,277.46	12.18
	其中：股票	2,510,277.46	12.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,076,982.40	48.91
	其中：债券	10,076,982.40	48.91
	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	3,200,000.00	15.53
	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	4,680,430.92	22.72
8	其他各项资产	134,179.17	0.65
9	合计	20,601,869.95	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	17,029.60	0.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,076,359.66	11.99
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	3,474.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	6,770.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,392.40	0.38
J	金融业	174,783.80	1.01
K	房地产业	2,381.00	0.01
L	租赁和商务服务业	90,030.00	0.52

M	科学研究和技术服务业	37,581.60	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	8,538.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	27,937.40	0.16
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,510,277.46	14.50

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	600519	贵州茅台	100	205,670.00	1.19
2	002415	海康威视	1,900	122,550.00	0.71
3	300014	亿纬锂能	1,170	121,598.10	0.70
4	000568	泸州老窖	500	117,970.00	0.68
5	601888	中国中免	300	90,030.00	0.52
6	300207	欣旺达	2,500	81,400.00	0.47
7	688366	昊海生科	349	73,045.70	0.42
8	688002	睿创微纳	710	70,879.30	0.41
9	688036	传音控股	289	60,545.50	0.35
10	600036	招商银行	1,100	59,609.00	0.34
11	000858	五粮液	200	59,578.00	0.34
12	300750	宁德时代	100	53,480.00	0.31
13	601288	农业银行	15,900	48,177.00	0.28
14	300450	先导智能	800	48,112.00	0.28
15	688599	天合光能	1,640	46,494.00	0.27
16	002475	立讯精密	1,000	46,000.00	0.27
17	300124	汇川技术	600	44,556.00	0.26
18	002459	晶澳科技	900	44,100.00	0.25
19	002240	盛新锂能	1,500	42,825.00	0.25
20	000661	长春高新	100	38,700.00	0.22
21	603259	药明康德	240	37,581.60	0.22
22	002821	凯莱英	100	37,260.00	0.22
23	688007	光峰科技	886	37,105.68	0.21
24	601166	兴业银行	1,800	36,990.00	0.21
25	000807	云铝股份	2,900	34,510.00	0.20
26	600563	法拉电子	200	31,672.00	0.18

27	300910	瑞丰新材	300	31,365.00	0.18
28	002049	紫光国微	200	30,838.00	0.18
29	688408	中信博	149	29,919.20	0.17
30	000933	神火股份	3,000	28,350.00	0.16
31	600660	福耀玻璃	500	27,925.00	0.16
32	002271	东方雨虹	500	27,660.00	0.16
33	002709	天赐材料	250	26,645.00	0.15
34	601601	中国太保	900	26,073.00	0.15
35	688396	华润微	286	26,031.72	0.15
36	000825	太钢不锈	3,400	25,466.00	0.15
37	300628	亿联网络	300	25,140.00	0.15
38	002594	比亚迪	100	25,100.00	0.14
39	601012	隆基股份	280	24,875.20	0.14
40	603489	八方股份	100	23,638.00	0.14
41	600600	青岛啤酒	200	23,130.00	0.13
42	000725	京东方 A	3,700	23,088.00	0.13
43	601799	星宇股份	100	22,572.00	0.13
44	600406	国电南瑞	960	22,310.40	0.13
45	300502	新易盛	700	21,875.00	0.13
46	000932	华菱钢铁	3,200	21,120.00	0.12
47	002410	广联达	300	20,460.00	0.12
48	300122	智飞生物	100	18,673.00	0.11
49	600570	恒生电子	200	18,650.00	0.11
50	000636	风华高科	603	18,222.66	0.11
51	002714	牧原股份	280	17,029.60	0.10
52	002291	星期六	900	16,902.00	0.10
53	603882	金域医学	100	15,977.00	0.09
54	603806	福斯特	120	12,615.60	0.07
55	002460	赣锋锂业	100	12,109.00	0.07
56	603799	华友钴业	100	11,420.00	0.07
57	600309	万华化学	100	10,882.00	0.06
58	002601	龙佰集团	300	10,374.00	0.06
59	300015	爱尔眼科	130	9,227.40	0.05
60	600031	三一重工	300	8,721.00	0.05
61	300816	艾可蓝	100	8,538.00	0.05
62	300408	三环集团	200	8,484.00	0.05
63	603899	晨光文具	100	8,456.00	0.05
64	002414	高德红外	280	7,722.40	0.04
65	000333	美的集团	100	7,137.00	0.04
66	600884	杉杉股份	300	6,996.00	0.04
67	002352	顺丰控股	100	6,770.00	0.04
68	002648	卫星石化	140	5,486.60	0.03

69	002353	杰瑞股份	100	4,470.00	0.03
70	600131	国网信通	300	3,972.00	0.02
71	300059	东方财富	120	3,934.80	0.02
72	600966	博汇纸业	300	3,915.00	0.02
73	002138	顺络电子	100	3,877.00	0.02
74	600019	宝钢股份	500	3,820.00	0.02
75	603708	家家悦	200	3,474.00	0.02
76	002444	巨星科技	100	3,408.00	0.02
77	300433	蓝思科技	100	2,941.00	0.02
78	002044	美年健康	300	2,733.00	0.02
79	002078	太阳纸业	200	2,670.00	0.02
80	002050	三花智控	100	2,398.00	0.01
81	000002	万科A	100	2,381.00	0.01
82	002340	格林美	200	1,870.00	0.01

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	601288	农业银行	532,789.00	0.73
2	600036	招商银行	525,186.00	0.72
3	601166	兴业银行	412,293.00	0.57
4	300014	亿纬锂能	289,504.00	0.40
5	002415	海康威视	202,680.00	0.28
6	000858	五粮液	143,822.00	0.20
7	000568	泸州老窖	136,641.00	0.19
8	601888	中国中免	131,462.00	0.18
9	000636	风华高科	118,799.00	0.16
10	002475	立讯精密	110,664.00	0.15
11	601012	隆基股份	103,174.00	0.14
12	300207	欣旺达	99,763.00	0.14
13	688002	睿创微纳	89,197.36	0.12
14	000807	云铝股份	77,628.00	0.11
15	002714	牧原股份	76,970.00	0.11
16	300450	先导智能	75,025.00	0.10
17	601601	中国太保	74,754.00	0.10
18	600031	三一重工	73,953.00	0.10
19	000933	神火股份	65,563.00	0.09
20	300124	汇川技术	62,566.00	0.09

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	300014	亿纬锂能	1,303,118.00	1.79
2	000568	泸州老窖	1,183,386.00	1.63
3	601012	隆基股份	1,093,106.00	1.50
4	600519	贵州茅台	867,797.00	1.19
5	000858	五粮液	812,554.00	1.12
6	601888	中国中免	799,843.00	1.10
7	600031	三一重工	551,511.00	0.76
8	000636	风华高科	521,757.00	0.72
9	600660	福耀玻璃	513,059.00	0.71
10	600036	招商银行	486,705.00	0.67
11	300124	汇川技术	479,987.00	0.66
12	601288	农业银行	472,747.00	0.65
13	600563	法拉电子	470,696.00	0.65
14	002459	晶澳科技	454,703.00	0.63
15	002475	立讯精密	440,718.00	0.61
16	300750	宁德时代	438,597.00	0.60
17	002460	赣锋锂业	407,359.00	0.56
18	002709	天赐材料	397,695.00	0.55
19	002601	龙佰集团	358,399.00	0.49
20	603313	梦百合	351,656.64	0.48

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	5,252,360.32
卖出股票收入（成交）总额	18,667,120.28

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	10,068,000.00	58.15
	其中：政策性金融债	10,068,000.00	58.15
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）	8,982.40	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,076,982.40	58.20

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	190305	19 进出 05	100,000	10,068,000.00	58.15
2	110079	杭银转债	60	6,832.20	0.04
3	123107	温氏转债	20	2,150.20	0.01

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					299,374.37
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-320,760.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,331.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	126,847.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	134,179.17

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
平安鼎弘混合 (LOF) A	581	26,507.27	7,577,705.36	49.20	7,823,019.72	50.80

平安鼎弘混合 C	3	49.14	-	-	147.42	100.00
平安鼎弘混合 D	4	43.66	-	-	174.62	100.00
合计	585	26,326.58	7,577,705.36	49.20	7,823,341.76	50.80

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 期末上市基金前十名持有人

平安鼎弘混合 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	陈晴	86,588.00	14.06
2	蔡惠贞	72,500.00	11.77
3	程馨娴	51,780.00	8.41
4	刘丽伟	50,800.00	8.25
5	陈湛	44,900.00	7.29
6	周新	44,400.00	7.21
7	杨凯	20,246.00	3.29
8	李付生	19,100.00	3.10
9	赵辉	15,000.00	2.44
10	谢军	11,617.00	1.89

8.3 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	平安鼎弘混合 (LOF) A	220.76	0.0014
	平安鼎弘混合 C	147.42	100.0000
	平安鼎弘混合 D	156.18	89.4399
	合计	524.36	0.0034

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）。

8.4 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	平安鼎弘混合 (LOF) A	0
	平安鼎弘混合 C	0
	平安鼎弘混合 D	0

	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	平安鼎弘混合 (LOF) A	0
	平安鼎弘混合 C	0
	平安鼎弘混合 D	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安鼎弘混合 (LOF) A	平安鼎弘混合 C	平安鼎弘混合 D
基金合同生效 日 (2017 年 4 月 26 日) 基 金份额总额	202,701,052.24	-	-
本报告期期初 基金份额总额	65,702,897.33	147.42	331.35
本报告期基金 总申购份额	1,013,869.92	-	-
减：本报告期 基金总赎回份 额	51,316,042.17	-	156.73
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	15,400,725.08	147.42	174.62

§ 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

中国工商银行股份有限公司 (以下简称“本公司”) 根据工作需要, 任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理, 全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 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	
广发证券	2	11,182,580.84	46.75%	7,954.31	46.75%	-
长江证券	1	9,638,315.64	40.29%	6,855.85	40.29%	-
国盛证券	1	1,609,818.00	6.73%	1,145.01	6.73%	-
海通证券	6	1,138,718.00	4.76%	809.98	4.76%	新增 2个
招商证券	3	350,048.12	1.46%	249.03	1.46%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	3	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-

中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-

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
广发证券	34,894.20	0.21%	255,500,000.00	45.41%	-	-
长江证券	395,510.89	2.42%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	15,885,029.18	97.36%	165,200,000.00	29.36%	-	-
招商证券	-	-	57,200,000.00	10.17%	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	47,600,000.00	8.46%	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	37,200,000.00	6.61%	-	-
中信建投 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 2020 年 12	中国证监会规定报刊及	2021 年 01 月 01 日

	月 31 日基金净值公告	网站	
2	平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 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旗下部分基金新增和耕传承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 01 月 27 日
4	平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) A 类基金份额溢价风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 02 月 10 日
5	平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 31 日
6	平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 21 日
7	平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 28 日
8	平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF) 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 28 日
9	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
10	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富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	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安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 06 月 30 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	2021/01/01--2021/06/30	55,073,905.36	-	47,500,000.00	7,573,905.36	49.18
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

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

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鼎弘混合型证券投资基金(LOF)募集注册的文件
- (2) 平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)基金合同
- (3) 平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)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，客户服务热线：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021年8月31日