

平安恒鑫混合型证券投资基金

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 02 月 02 日（基金合同生效日）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	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	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45

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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	49
§ 9 开放式基金份额变动.....	49
§ 10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安恒鑫混合型证券投资基金	
基金简称	平安恒鑫混合	
基金主代码	011175	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 2 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	714,886,929.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安恒鑫混合 A	平安恒鑫混合 C
下属分级基金的交易代码	011175	011176
报告期末下属分级基金的份额总额	596,589,894.33 份	118,297,035.08 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，充分利用研究投资优势，追求超越基金业绩比较基准的资本增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、股票期权策略；7、资产支持证券投资策略；8、信用衍生品投资策略
业绩比较基准	中证全债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+ 恒生指数收益率（经汇率调整）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金若投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	郭明
	联系电话	0755-22626828	010-66105799
	电子邮箱	funds@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	北京市西城区复兴门内大街 55

	5033 号平安金融中心 34 层	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	上海证券报
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 2 月 2 日(基金合同生效日)-2021 年 6 月 30 日)	
	平安恒鑫混合 A	平安恒鑫混合 C
本期已实现收益	7,203,551.85	1,183,462.87
本期利润	11,232,595.44	2,071,793.00
加权平均基金份额本期利润	0.0170	0.0137
本期加权平均净值利润率	1.71%	1.38%
本期基金份额净值增长率	1.76%	1.55%
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	6,722,641.61	1,090,891.74
期末可供分配基金份额利润	0.0113	0.0092
期末基金资产净值	607,080,046.65	120,133,437.69

期末基金份额净值	1.0176	1.0155
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	1.76%	1.55%

注：1. 本基金自 2021 年 2 月 2 日成立，截至报告期末未满半年。

2. 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；

3. 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）；

4. 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

平安恒鑫混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.26%	0.20%	-0.14%	0.15%	0.40%	0.05%
过去三个月	3.08%	0.19%	1.62%	0.18%	1.46%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.76%	0.21%	1.11%	0.23%	0.65%	-0.02%

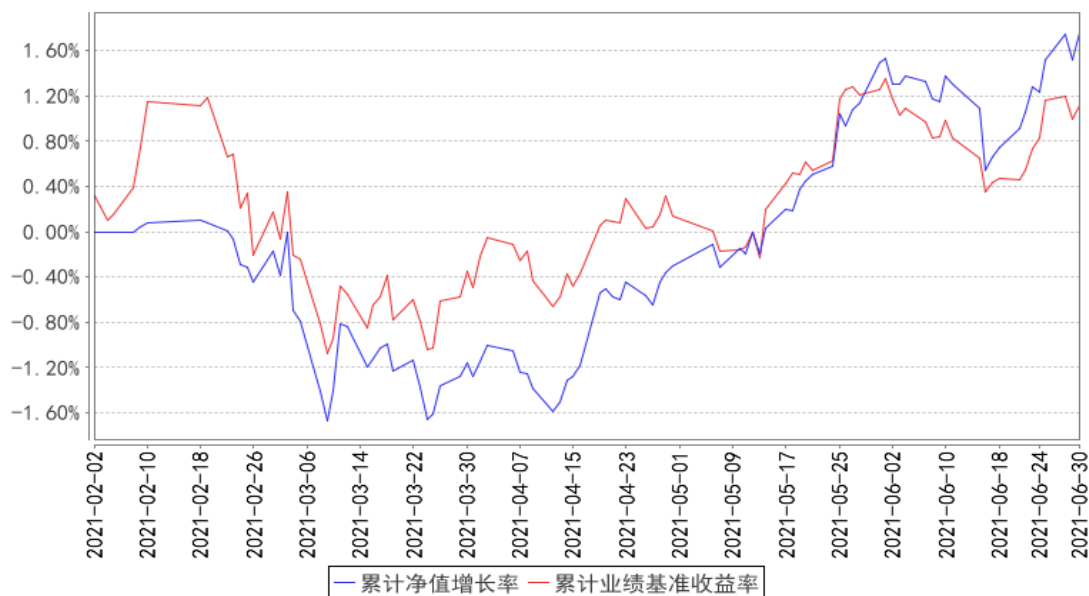
平安恒鑫混合 C

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	0.21%	0.20%	-0.14%	0.15%	0.35%	0.05%
过去三个月	2.95%	0.19%	1.62%	0.18%	1.33%	0.01%

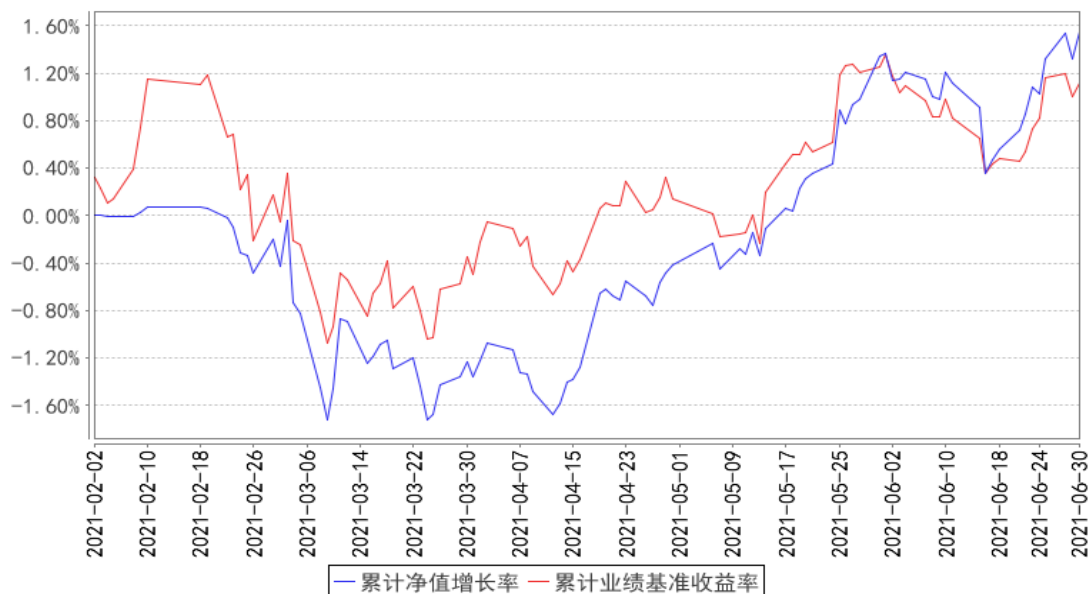
自基金合同生效 起至今	1.55%	0.21%	1.11%	0.23%	0.44%	-0.02%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

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

平安恒鑫混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安恒鑫混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2021 年 02 月 02 日正式生效，截至报告期末未满半年；

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

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 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		
张文平	公司总经理助理兼固定收益投资总监，平安恒鑫混合型证券投资基金基金经理	2021 年 2 月 2 日	-	10 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、平安合庆 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安双债添益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、平安恒鑫混合型证券投资基金、平安双季增享 6 个月持有期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

上半年，国内经济延续复苏态势。疫苗接种、疫情控制，海外经济修复，带动出口维持强势；疫情有所反复但影响有限，国内消费继续修复；出口及消费支撑下，制造业投资逐步修复；房地产领域面对相对严厉的政策约束，但销售平稳、竣工较强，地产投资平稳；基建投资相对平稳。通胀方面，年初以来海外疫情波动与国内“碳中和”催动大宗商品价格一路上行，推动 PPI 快速上行；猪肉价格作为国内通胀“压舱石”，维持 CPI 处于低位。货币政策目标聚焦防风险和为经济复苏维持良好环境，整体偏宽松。在此背景下，债市收益率整体下行。策略上，报告期内本产品

以赚取稳定票息和骑乘收益为主，同时，动态调整组合久期和杠杆，适当进行波段交易以增厚组合收益。权益及转债方面，本产品以绝对收益思路为主，通过挖掘结构性机会，实现了收益率增强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安恒鑫混合 A 的基金份额净值 1.0176 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.76%，同期业绩比较基准收益率为 1.11%；截至本报告期末平安恒鑫混合 C 的基金份额净值 1.0155 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年：第一，全球疫情逐步受控，全球经济延续复苏，这带动国内出口相关的产业维持高景气，同时国内消费领域依然有修复空间，出口和消费支撑下，制造业投资有望维持强势。第二，稳宏观杠杆率的诉求下，结构性紧信用料将贯穿整个下半年，地产和基建很难发力。以上多空因素叠加，国内经济有望维持平稳。政策层面，稳增长、保就业的诉求下，预计央行偏宽松的基调较难变化，资金面有望平稳。基于以上基本面及政策面判断，我们预计债券市场震荡为主。纯债策略上，我们将以赚取票息和骑乘收益为主，同时适当进行波段操作，力争在保障安全性、流动性的情况下，为客户创造良好的收益。权益及转债策略上，我们将以绝对收益思路为主，通过挖掘结构性机会，力争实现收益率增强。

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

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

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

本报告期内，平安恒鑫混合型证券投资基金的管理人——平安基金管理有限公司在平安恒鑫混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，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恒鑫混合型证券投资基金 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：平安恒鑫混合型证券投资基金

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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	21,513,347.58
结算备付金		28,764,748.45
存出保证金		61,860.60
交易性金融资产	6.4.7.2	952,470,336.70
其中：股票投资		133,916,211.16
基金投资		—

债券投资		818,554,125.54
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	-
应收证券清算款		297,677.04
应收利息	6.4.7.5	12,693,030.52
应收股利		-
应收申购款		265,907.34
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,016,066,908.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 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		255,999,402.00
应付证券清算款		15,261,966.04
应付赎回款		16,370,781.74
应付管理人报酬		507,171.71
应付托管费		126,792.91
应付销售服务费		53,117.41
应付交易费用	6.4.7.7	287,478.22
应交税费		71,582.55
应付利息		52,844.57
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	122,286.74
负债合计		288,853,423.89
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	714,886,929.41
未分配利润	6.4.7.10	12,326,554.93
所有者权益合计		727,213,484.34
负债和所有者权益总计		1,016,066,908.23

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 02 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 02 月 02 日起至 2021 年 06 月 30 日止。报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 714,886,929.41 份，其中平安恒鑫混合 A 基金份额总额 596,589,894.33 份，基金份额净值 1.0176 元。平安恒鑫混合 C 基金份额总额 118,297,035.08 份，基金份额净值 1.0155 元。

6.2 利润表

会计主体：平安恒鑫混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同 生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		18,840,487.46
1. 利息收入		10,405,996.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	870,724.88
债券利息收入		8,975,906.50
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		559,364.70
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,330,813.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,047,386.95
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,041,962.79
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	-
股利收益	6.4.7.16	1,336,238.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,917,373.72
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	186,303.76
减：二、费用		5,536,099.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,626,912.97
2. 托管费	6.4.10.2.2	656,728.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	306,017.74
4. 交易费用	6.4.7.19	571,048.79
5. 利息支出		1,245,835.87
其中：卖出回购金融资产支出		1,245,835.87
6. 税金及附加		26,976.87
7. 其他费用	6.4.7.20	102,578.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,304,388.44
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,304,388.44

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安恒鑫混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）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（基金净值）	828,585,541.47	-	828,585,541.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,304,388.44	13,304,388.44
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）	-113,698,612.06	-977,833.51	-114,676,445.57
其中：1. 基金申购款	4,169,429.40	37,683.41	4,207,112.81
2. 基金赎回款	-117,868,041.46	-1,015,516.92	-118,883,558.38
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）	714,886,929.41	12,326,554.93	727,213,484.34

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

平安恒鑫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[2020]2742号《关于准予平安恒鑫混合型证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安恒鑫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828,315,538.91元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(21)第00065号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安恒鑫混合型证券投资基金基金合同》于2021年2月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为828,585,541.47份基金份额,其中认购资金利息折合270,002.56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”)。

根据《平安恒鑫混合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。其中A类基金份额类别为在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额;C类基金份额为从本类别基金资产净值中计提销售服务费,且不收取认购/申购费用的基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金各类基金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《平安恒鑫混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围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(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、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品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)。本基金的投资组合比例为:本股票资产占基金资产的比例为0%-30%,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%;本基金投资于同业存单的比例不得超过基金资产的20%;本基金投资于可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)的比例不得超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率 $\times$ 80%+

沪深 300 指数收益率 $\times 15\% +$ 恒生指数收益率（经汇率调整） $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本基金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 02 月 02 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(2)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(3)由于 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；(4)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票

的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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	21,513,347.58
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	21,513,347.58

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		129,628,915.21	133,916,211.16	4,287,295.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	233,442,946.56	234,280,525.54	837,578.98
	银行间市场	584,481,101.21	584,273,600.00	-207,501.21
	合计	817,924,047.77	818,554,125.54	630,077.77
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		947,552,962.98	952,470,336.70	4,917,373.72

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

注：本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于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	426.36
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	64,997.57
应收债券利息	12,627,581.57
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	25.02
合计	12,693,030.52

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	247,633.65
银行间市场应付交易费用	39,844.57
合计	287,478.22

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	37,271.81
应付证券出借违约金	-
预提费用	85,014.93
合计	122,286.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安恒鑫混合 A

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	669,001,791.89	669,001,791.89
本期申购	1,018,697.71	1,018,697.71
本期赎回（以“-”号填列）	-73,430,595.27	-73,430,595.27
-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	596,589,894.33	596,589,894.33

平安恒鑫混合 C

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	159,583,749.58	159,583,749.58
本期申购	3,150,731.69	3,150,731.69
本期赎回（以“-”号填列）	-44,437,446.19	-44,437,446.19
-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	118,297,035.08	118,297,035.08

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安恒鑫混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	7,203,551.85	4,029,043.59	11,232,595.44
本期基金份额交易产生的变动数	-480,910.24	-261,532.88	-742,443.12
其中：基金申购款	3,302.42	5,260.81	8,563.23
基金赎回款	-484,212.66	-266,793.69	-751,006.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,722,641.61	3,767,510.71	10,490,152.32

平安恒鑫混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,183,462.87	888,330.13	2,071,793.00
本期基金份额交易产生的变动数	-92,571.13	-142,819.26	-235,390.39
其中：基金申购款	10,902.85	18,217.33	29,120.18
基金赎回款	-103,473.98	-161,036.59	-264,510.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,090,891.74	745,510.87	1,836,402.61

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	65,026.64
定期存款利息收入	105,000.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	700,503.72
其他	194.52
合计	870,724.88

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2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,047,386.95
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	-2,047,386.95

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2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	163,812,488.38
减：卖出股票成本总额	165,859,875.33
买卖股票差价收入	-2,047,386.95

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2月2日（基金合同生效日）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	4,041,962.79
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	4,041,962.79
----	--------------

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2月2日（基金合同生效日）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	1,712,319,794.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,693,233,016.93
减：应收利息总额	15,044,815.04
买卖债券差价收入	4,041,962.79

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收益。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,336,238.06
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,336,238.06

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 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,917,373.72
股票投资	4,287,295.95
债券投资	630,077.77
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	4,917,373.72

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	185,574.68
基金转换费收入	729.08
合计	186,303.76

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	542,771.29
银行间市场交易费用	28,277.50
合计	571,048.79

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	35,795.76
信息披露费	49,219.17
证券出借违约金	—
银行费用	16,063.64
账户维护费	1,500.00
合计	102,578.57

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、注册登记机构、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
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
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

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 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
平安证券	31,152,530.00	6.79

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
平安证券	92,489,782.99	11.12

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 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	

	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
平安证券	513,920,000.00	5.94

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	22,160.01	6.79	22,160.01	6.79

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 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,626,912.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,270,068.62

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 0.80%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 × 0.80% / 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2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	656,728.21

注：支付基金托管行工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安恒鑫混合 A	平安恒鑫混合 C	合计
工商银行	—	92,945.47	92,945.47
陆金所	—	35,767.33	35,767.33
平安基金	—	75.23	75.23
平安人寿	—	73,468.28	73,468.28
平安银行	—	4,118.69	4,118.69
平安证券	—	363.93	363.93
合计	—	206,738.93	206,738.93

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 0.50% 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 $\times$ 0.50% / 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：本基金本报告期内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：本基金本报告期内转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行-活期	21,513,347.58	65,026.64

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

金额单位：人民币元

本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
平安证券股份有限公司	605011	杭州热电	公开发行	525	3,239.25
平安证券股份有限公司	605162	新中港	公开发行	1,377	8,358.39

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位）	期末成本总额	期末估值总额	备注

							股)			
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新债未上市	100.00	100.00	2,040	203,997.32	203,997.32	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上

市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021 年 6 月 30 日	重大事项停牌	56.35	2021 年 7 月 1 日	59.49	18,500	791,144.00	1,042,475.00	-

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 2021 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 155,999,402.00 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
101901667	19 光明 MTN002	2021 年 7 月 1 日	101.25	400,000	40,500,000.00
102000275	20 云投 MTN002	2021 年 7 月 1 日	95.75	200,000	19,150,000.00
102000697	20 华电 MTN003A	2021 年 7 月 1 日	99.57	270,000	26,883,900.00
102001225	20 大唐发电 MTN001	2021 年 7 月 1 日	100.18	222,000	22,239,960.00
102001353	20 华能水电 MTN001	2021 年 7 月 1 日	101.99	250,000	25,497,500.00
102001718	20 大唐集 MTN002	2021 年 7 月 1 日	102.42	400,000	40,968,000.00
合计				1,742,000	175,239,360.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 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 100,000,000.00 元，截至 2021 年 7 月 1 日到期。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同责任，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 101.26%。

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	21,513,347.58	-	-	-	21,513,347.58
结算备付金	28,764,748.45	-	-	-	28,764,748.45
存出保证金	61,860.60	-	-	-	61,860.60
交易性金融资产	119,416,703.24	645,332,822.30	53,804,600.00	133,916,211.16	952,470,336.70
应收利息	-	-	-	12,693,030.52	12,693,030.52
应收申购款	-	-	-	265,907.34	265,907.34
应收证券清算款	-	-	-	297,677.04	297,677.04
资产总计	169,756,659.87	645,332,822.30	53,804,600.00	147,172,826.06	1,016,066,908.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,370,781.74	16,370,781.74
应付管理人报酬	-	-	-	507,171.71	507,171.71
应付托管费	-	-	-	126,792.91	126,792.91

应付证券清算款	-	-	-	15,261,966.04	15,261,966.04
卖出回购金融资产款	255,999,402.00	-	-	-	255,999,402.00
应付销售服务费	-	-	-	53,117.41	53,117.41
应付交易费用	-	-	-	287,478.22	287,478.22
应付利息	-	-	-	52,844.57	52,844.57
应交税费	-	-	-	71,582.55	71,582.55
其他负债	-	-	-	122,286.74	122,286.74
负债总计	255,999,402.00	-	-	32,854,021.89	288,853,423.89
利率敏感度缺口	-86,242,742.13	645,332,822.30	53,804,600.00	114,318,804.17	727,213,484.34

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）
分析	市场利率下降 25 个基点	5,280,562.49
	市场利率上升 25 个基点	-5,254,504.37

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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	133,916,211.16	18.41
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	133,916,211.16	18.41

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）
分析	沪深 300 指数上升 5%	2,130,094.09
	沪深 300 指数下降 5%	-2,130,094.09

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	133,916,211.16	13.18
	其中：股票	133,916,211.16	13.18
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	818,554,125.54	80.56

	其中：债券	818,554,125.54	80.56
	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	50,278,096.03	4.95
8	其他各项资产	13,318,475.50	1.31
9	合计	1,016,066,908.23	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	3,214,569.00	0.44
B	采矿业	7,503,560.00	1.03
C	制造业	82,820,653.55	11.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	7,372,429.44	1.01
F	批发和零售业	251,115.78	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	579,180.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,654,290.40	0.36
J	金融业	24,740,333.80	3.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,151,050.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	1,616,008.80	0.22
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	133,916,211.16	18.41

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	600000	浦发银行	762,400	7,624,000.00	1.05
2	600028	中国石化	1,721,000	7,503,560.00	1.03
3	601668	中国建筑	1,583,100	7,361,415.00	1.01
4	000166	申万宏源	1,550,700	7,257,276.00	1.00
5	601288	农业银行	2,330,500	7,061,415.00	0.97
6	300567	精测电子	78,700	4,832,180.00	0.66
7	300014	亿纬锂能	41,700	4,333,881.00	0.60
8	002475	立讯精密	84,900	3,905,400.00	0.54
9	000625	长安汽车	138,600	3,642,408.00	0.50
10	600519	贵州茅台	1,600	3,290,720.00	0.45
11	601799	星宇股份	14,400	3,250,368.00	0.45
12	601012	隆基股份	36,540	3,246,213.60	0.45
13	300498	温氏股份	223,700	3,214,569.00	0.44
14	601888	中国中免	10,500	3,151,050.00	0.43
15	600577	精达股份	448,400	2,860,792.00	0.39
16	300059	东方财富	85,320	2,797,642.80	0.38
17	000858	五 粮 液	8,800	2,621,432.00	0.36
18	600660	福耀玻璃	44,800	2,502,080.00	0.34
19	603501	韦尔股份	7,700	2,479,400.00	0.34
20	603113	金能科技	136,800	2,470,608.00	0.34
21	603986	兆易创新	13,100	2,461,490.00	0.34
22	300207	欣旺达	74,700	2,432,232.00	0.33
23	300750	宁德时代	4,500	2,406,600.00	0.33
24	600584	长电科技	63,800	2,403,984.00	0.33
25	002460	赣锋锂业	19,500	2,361,255.00	0.32
26	000887	中鼎股份	191,800	2,316,944.00	0.32
27	600380	健康元	167,400	2,298,402.00	0.32
28	002271	东方雨虹	41,500	2,295,780.00	0.32
29	300408	三环集团	51,300	2,176,146.00	0.30
30	000876	新 希 望	147,300	2,160,891.00	0.30
31	000568	泸州老窖	8,300	1,958,302.00	0.27
32	600570	恒生电子	20,800	1,939,600.00	0.27
33	002444	巨星科技	56,400	1,922,112.00	0.26
34	300458	全志科技	20,100	1,761,966.00	0.24
35	000825	太钢不锈	225,700	1,690,493.00	0.23
36	000636	风华高科	54,400	1,643,968.00	0.23
37	603259	药明康德	10,320	1,616,008.80	0.22
38	603035	常熟汽饰	89,000	1,450,700.00	0.20
39	600031	三一重工	49,600	1,441,872.00	0.20
40	603995	甬金股份	30,700	1,180,415.00	0.16

41	300450	先导智能	18,080	1,087,331.20	0.15
42	600460	士兰微	18,500	1,042,475.00	0.14
43	600563	法拉电子	6,200	981,832.00	0.14
44	600600	青岛啤酒	7,000	809,550.00	0.11
45	603833	欧派家居	5,500	780,780.00	0.11
46	002410	广联达	10,300	702,460.00	0.10
47	300910	瑞丰新材	6,400	669,120.00	0.09
48	002245	蔚蓝锂芯	29,400	579,180.00	0.08
49	300628	亿联网络	6,702	561,627.60	0.08
50	603129	春风动力	3,400	421,872.00	0.06
51	603489	八方股份	1,600	378,208.00	0.05
52	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.03
53	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
54	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
55	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
56	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
57	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
58	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
59	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
60	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
61	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
62	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603035	常熟汽饰	9,155,149.21	1.26
2	600577	精达股份	7,798,426.88	1.07
3	600000	浦发银行	7,771,305.00	1.07
4	601288	农业银行	7,762,903.00	1.07
5	600028	中国石化	7,604,666.00	1.05
6	601668	中国建筑	7,586,748.00	1.04
7	603113	金能科技	7,554,325.40	1.04
8	000166	申万宏源	7,263,830.80	1.00
9	300498	温氏股份	7,038,643.20	0.97
10	600519	贵州茅台	6,989,567.00	0.96
11	000568	泸州老窖	6,397,140.00	0.88
12	300014	亿纬锂能	6,361,910.00	0.87
13	600297	广汇汽车	5,721,446.40	0.79
14	000858	五粮液	4,925,798.00	0.68
15	002078	太阳纸业	4,752,110.00	0.65

16	300207	欣旺达	4,628,718.51	0.64
17	300567	精测电子	4,562,998.00	0.63
18	600031	三一重工	4,398,154.92	0.60
19	002036	联创电子	4,119,825.42	0.57
20	600483	福能股份	4,111,399.00	0.57

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603035	常熟汽饰	8,660,734.74	1.19
2	603113	金能科技	5,370,282.00	0.74
3	600297	广汇汽车	5,216,352.06	0.72
4	002078	太阳纸业	4,911,573.08	0.68
5	300568	星源材质	4,811,398.00	0.66
6	600577	精达股份	4,587,642.00	0.63
7	002036	联创电子	4,404,514.82	0.61
8	600483	福能股份	4,339,846.48	0.60
9	000568	泸州老窖	4,228,232.00	0.58
10	300498	温氏股份	3,794,288.90	0.52
11	002966	苏州银行	3,728,040.00	0.51
12	300207	欣旺达	3,431,068.28	0.47
13	600519	贵州茅台	3,237,310.00	0.45
14	002415	海康威视	3,090,403.00	0.42
15	600919	江苏银行	2,970,929.10	0.41
16	300231	银信科技	2,936,573.03	0.40
17	300170	汉得信息	2,933,925.00	0.40
18	600985	淮北矿业	2,744,244.43	0.38
19	601899	紫金矿业	2,645,424.00	0.36
20	601311	骆驼股份	2,505,956.54	0.34

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	295,488,790.54
卖出股票收入（成交）总额	163,812,488.38

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	62,136,311.10	8.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,072,000.00	10.87
	其中：政策性金融债	20,058,000.00	2.76
4	企业债券	144,040,822.30	19.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	455,809,600.00	62.68
7	可转债（可交换债）	67,834,392.14	9.33
8	同业存单	-	-
9	其他	9,661,000.00	1.33
10	合计	818,554,125.54	112.56

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	102001353	20 华能水电 MTN001	600,000	61,194,000.00	8.41
2	101901183	19 越秀集团 MTN003	500,000	50,670,000.00	6.97
3	155848	19 延长 Y5	500,000	50,165,000.00	6.90
4	102100991	21 金地 MTN004	500,000	49,885,000.00	6.86
5	102000697	20 华电 MTN003A	500,000	49,785,000.00	6.85

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 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

中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 7 月 14 日做出银罚字〔2020〕43 号处罚决定，由于中国民生银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资（二）为“四证”不全的房地产项目提供融资（三）违规为土地储备中心提供融资（四）违规为地方政府提供融资，接受地方政府担保或承诺（五）多名股东在已派出董事的情况下，以推荐代替提名方式推举独立董事及监事（六）多名股东在股权质押超比例的情况下违规在股东大会上行使表决权，派出董事在董事会上的表决权也未受限（七）股东持股份额发生重大变化未向监管部门报告（八）多名拟任高管人员及董事未经核准即履职（九）关联交易不合规（十）理财产品风险信息披露不合规（十一）年报信息披露不真实（十二）贷款资金被挪用，虚增贷款（十三）以贷转存，虚增存款（十四）贸易背景审查不尽职（十五）向关系人发放信用贷款（十六）违规转让正常类信贷资产（十七）违规转让不良资产（十八）同业投资他行非保本理财产品审查不到位，接受对方机构违规担保，少计风险加权资产（十九）同业投资未穿透底层资产计提资本拨备，少计风险加权资产（二十）同业存放业务期限超过一年（二十一）违规开展票据转贴现交易（二十二）个别理财产品管理费长期未入账（二十三）理财业务风险隔离不充分（二十四）违规向非高净值客户销售投向股权类资产的理财产品（二十五）非标准化资产纳入标准化资产统计，实际非标债权资产比例超监管要求（二十六）违规出具补充协议及与事实不符的投资说明（二十七）以代销名义变相向本行授信客户融资，并承担兜底风险（二十八）向不符合条件的借款人办理收益权转让再融资业务（二十九）代理福费廷业务违规承担风险，会计处理不规范（三十）迟报瞒报多起案件（风险）信息。根据相关规定对公司没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 万元。

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。

7.12.2 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	61,860.60
2	应收证券清算款	297,677.04
3	应收股利	—
4	应收利息	12,693,030.52
5	应收申购款	265,907.34
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	13,318,475.50

7.12.4 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	123044	红相转债	4,573,032.30	0.63
2	128032	双环转债	4,378,566.01	0.60
3	127011	中鼎转 2	4,177,062.50	0.57
4	127027	靖远转债	3,590,335.56	0.49
5	110072	广汇转债	3,155,512.00	0.43
6	123007	道氏转债	3,108,116.70	0.43
7	110051	中天转债	2,771,996.20	0.38
8	128105	长集转债	2,748,585.80	0.38
9	123056	雪榕转债	2,704,956.00	0.37
10	127005	长证转债	2,440,026.20	0.34
11	123068	弘信转债	2,359,443.64	0.32
12	123071	天能转债	2,287,817.70	0.31
13	113548	石英转债	2,255,899.80	0.31
14	113504	艾华转债	2,215,569.20	0.30
15	128042	凯中转债	2,158,406.30	0.30
16	113599	嘉友转债	1,941,249.60	0.27
17	110074	精达转债	1,920,522.00	0.26
18	123059	银信转债	1,630,012.70	0.22
19	128131	崇达转 2	1,626,296.00	0.22

20	123051	今天转债	1,217,685.00	0.17
----	--------	------	--------------	------

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末投资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（%）
平安恒鑫混合 A	4,816	123,876.64	994,391.35	0.17	595,595,502.98	99.83
平安恒鑫混合 C	12,822	9,226.10	—	—	118,297,035.08	100.00
合计	17,255	41,430.71	994,391.35	0.14	713,892,538.06	99.86

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	平安恒鑫混合 A	1,488.58	0.0002
	平安恒鑫混合 C	730.21	0.0006

金			
	合计	2,218.79	0.0003

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	平安恒鑫混合 A	0
	平安恒鑫混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安恒鑫混合 A	0
	平安恒鑫混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安恒鑫混合 A	平安恒鑫混合 C
基金合同生效日 （2021 年 2 月 2 日）基金份额总额	669,001,791.89	159,583,749.58
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,018,697.71	3,150,731.69
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	73,430,595.27	44,437,446.19
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	596,589,894.33	118,297,035.08

§ 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

本基金聘用德勤会计师事务所（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	111,079,007.79	24.20%	79,009.96	24.20%	—
长江证券	1	102,122,401.29	22.25%	72,639.87	22.25%	—
海通证券	4	87,242,753.18	19.01%	62,056.35	19.01%	—
国盛证券	1	64,690,266.14	14.09%	46,013.81	14.09%	—
中泰证券	2	43,357,710.97	9.45%	30,838.81	9.44%	—
平安证券	2	31,152,530.00	6.79%	22,160.01	6.79%	—
招商证券	3	19,399,342.60	4.23%	13,798.93	4.23%	—
东方财富	2	—	—	—	—	—

证券						
东方证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	3	-	-	-	-	-
新时代	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。

3、上述租用证券公司交易单元均为本期新增所用。

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	137,314,063.20	16.50%	5,698,100,000.00	65.83%	-	-
长江证券	95,935,037.94	11.53%	5,100,000.00	0.06%	-	-
海通证券	304,597,760.89	36.61%	1,429,700,000.00	16.52%	-	-
国盛证券	119,733,033.62	14.39%	1,000,000.00	0.01%	-	-
中泰证券	20,576,002.26	2.47%	656,800,000.00	7.59%	-	-
平安证券	92,489,782.99	11.12%	513,920,000.00	5.94%	-	-
招商证券	61,347,830.66	7.37%	351,300,000.00	4.06%	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-

新时代	-	-	-	-	-	-
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	平安恒鑫混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 02 月 03 日
2	平安基金管理有限公司关于平安恒鑫混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 02 月 03 日
3	平安基金管理有限公司关于新增华鑫证券有限责任公司为平安恒鑫混合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	2021 年 03 月 05 日
4	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽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 03 月 12 日
5	平安恒鑫混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务和定期定额投资的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 06 日
6	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
7	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得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 07 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 24 日
9	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
10	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	平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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

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恒鑫混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安恒鑫混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安恒鑫混合型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日