

平安恒鑫混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 3 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。本年度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 2022 年 03 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 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46

8.3 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	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
8.6 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	50
8.7 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	50
8.8 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	50
8.9 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	50
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
8.12 投资组合报告附注	51
§ 9 基金份额持有人信息	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
9.3 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	53
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	53
§ 10 开放式基金份额变动	53
§ 11 重大事件揭示	54
11.1 基金份额持有人大会决议	54
11.2 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	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4 基金投资策略的改变	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	56
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	58
12.1 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	58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 13 备查文件目录	58
13.1 备查文件目录	58
13.2 存放地点	59
13.3 查阅方式	59

§ 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	927,993,571.78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	646,401,408.86份	281,592,162.92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	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	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年 2 月 2 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	平安恒鑫混合 A	平安恒鑫混合 C
本期已实现收益	26,150,988.47	6,016,029.84
本期利润	36,571,768.09	9,777,670.91
加权平均基金份额本期利润	0.0592	0.0470
本期加权平均净值利润率	5.75%	4.52%
本期基金份额净值增长率	6.96%	6.47%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
期末可供分配利润	31,819,521.00	12,503,353.42
期末可供分配基金份额利润	0.0492	0.0444
期末基金资	691,383,455.49	299,812,849.12

产净值		
期末基金份额净值	1.0696	1.0647
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	6.96%	6.47%

注：1. 本基金自 2021 年 2 月 2 日成立，截至报告期末未满一年。

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
过去三个月	0.79%	0.23%	1.02%	0.15%	-0.23%	0.08%
过去六个月	5.11%	0.31%	0.73%	0.20%	4.38%	0.11%
自基金合同生效起至今	6.96%	0.27%	1.85%	0.22%	5.11%	0.05%

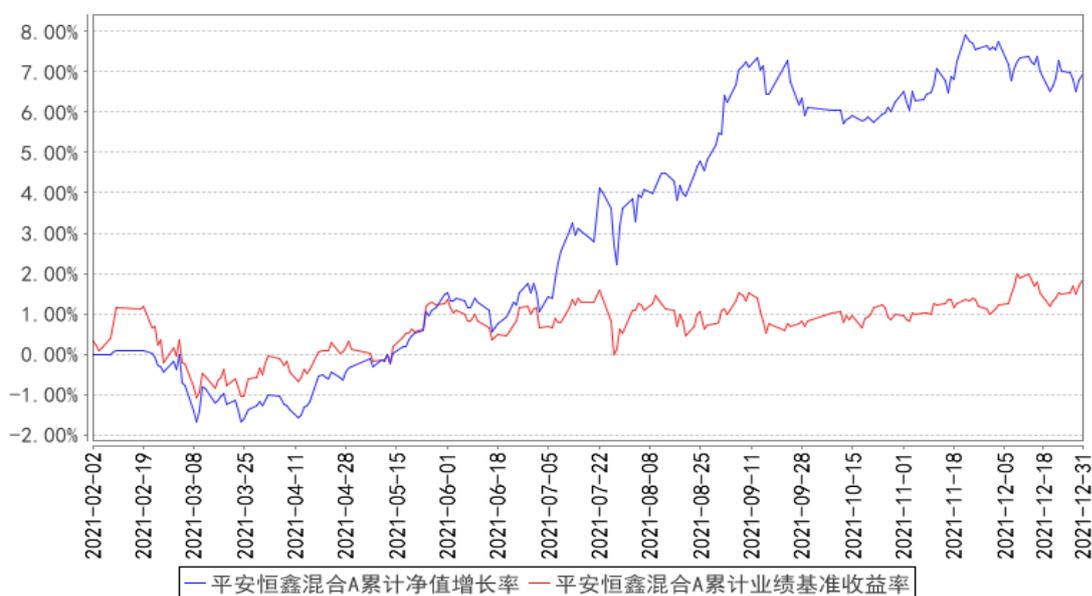
平安恒鑫混合 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

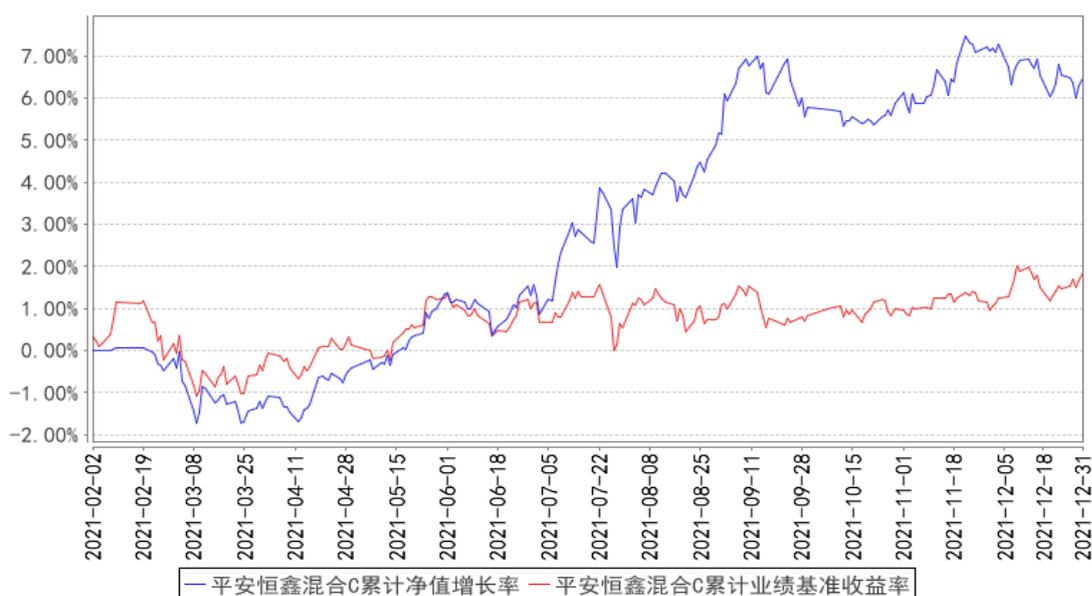
过去三个月	0.66%	0.23%	1.02%	0.15%	-0.36%	0.08%
过去六个月	4.84%	0.31%	0.73%	0.20%	4.11%	0.11%
自基金合同生效起 至今	6.47%	0.27%	1.85%	0.22%	4.62%	0.05%

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

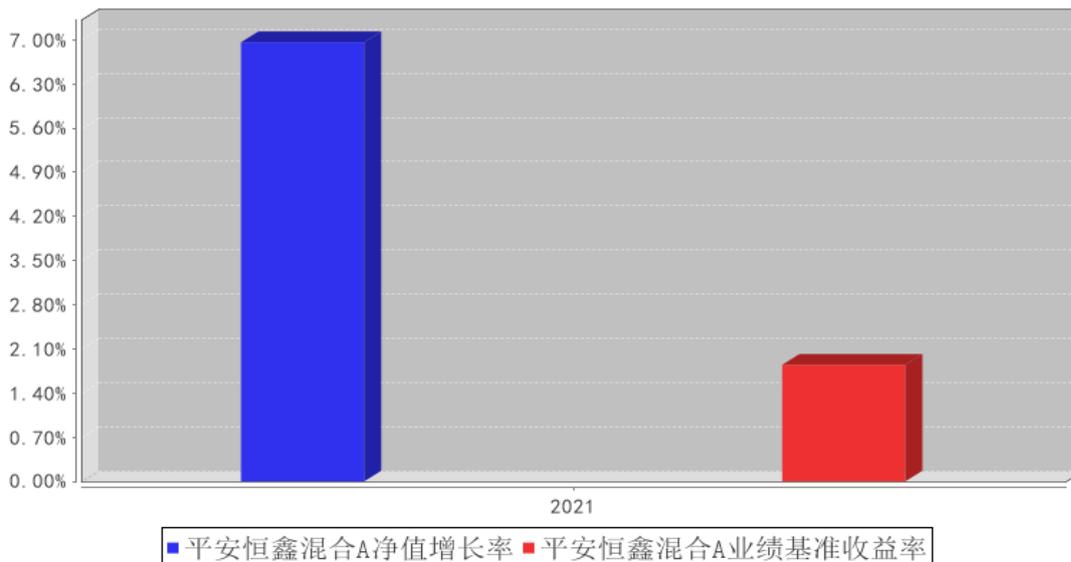


注：1、本基金基金合同于 2021 年 02 月 02 日正式生效，截至报告期末未满一年；

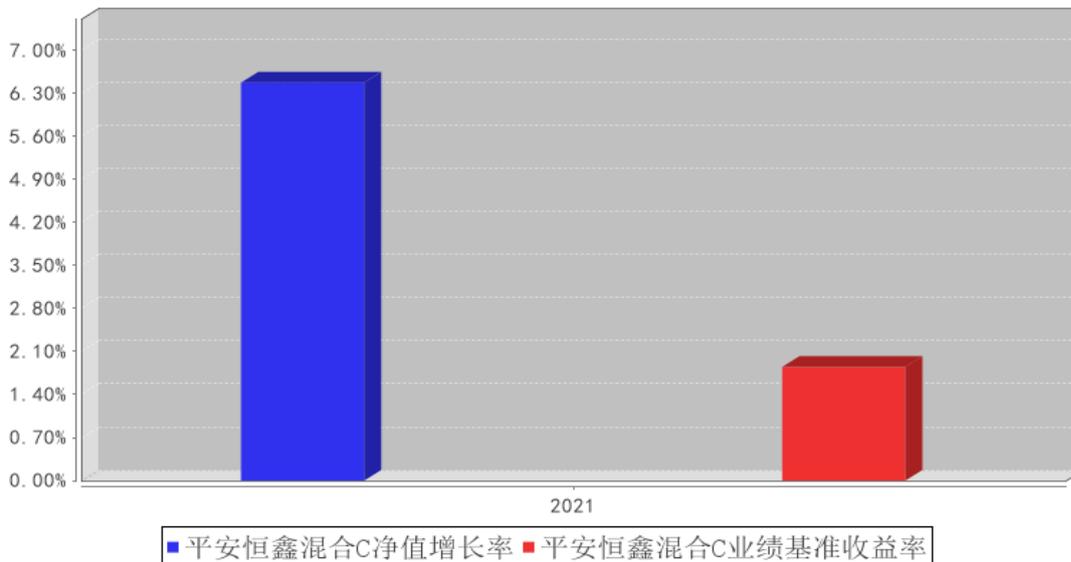
2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



平安恒鑫混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1. 本基金合同于 2021 年 02 月 02 日正式生效；

2. 2021 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于2021年2月2日正式生效，自基金合同生效日至报告期末未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2021 年 12 月 31 日，平安基金共管理 158 只公募基金，公募资产管理总规模约为 4,561.10 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、平安双季盈 6 个月持有期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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 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。

4.3.3 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

宏观层面，经济在紧信用政策下压力逐步加大，尤其以地产为代表，融资端和销售端的收紧逐步转化为地产公司的信用风险。流动性方面在消费和制造业投资内生动能偏弱背景下一直维持相对充裕的状态。紧信用宽货币的宏观背景对长久期资产相对有利，债市和权益市场的长久期资产表现也优于短久期资产。组合在投资上相对长久期的资产配置，权益资产采取相对均衡的行业配置，避免单一风险对组合造成太大的冲击。

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 1.0696 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.96% 同期业绩比较基准收益率为 1.85%；截至本报告期末平安恒鑫混合 C 的基金份额净值 1.0647 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.47%，同期业绩比较基准收益率为 1.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

需求收缩，供给冲击，预期转弱仍为当前的宏观背景，去年四季度开始供给压力有所缓解，往后看，预期随着调控政策的不断落地有望逐步转强，未来需求端企稳节奏和力度是影响资产节奏的关键因素。海外看，压力在胀，国内看，压力在滞，外需压力在供给释放和非常规政策退出背景下将逐步增大，内需的稳定较去年更加重要。流动性层面，货币政策合理充裕的定调没有变化，但后期随着稳增长政策的不断加码，货币政策将不断让位于财政。对证券市场而言，长久期资产面临一定的压力。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，维持相对均衡的配置，通过挖掘结构性机会，力增实现收益率增强。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，

确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——平安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P00934 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安恒鑫混合型证券投资基金全体持有人：
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了平安恒鑫混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们审计了平安恒鑫混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了平安恒鑫混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	平安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括平安恒鑫混合型证券投资基金

	<p>2021 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安恒鑫混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算平安恒鑫混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安恒鑫混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对平安恒鑫混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表</p>

	使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安恒鑫混合型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	韩健	谭麟林
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 22 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	553,351.43
结算备付金		49,593,068.74
存出保证金		237,177.24
交易性金融资产	7.4.7.2	1,290,823,203.35
其中：股票投资		243,124,597.50
基金投资		-
债券投资		1,047,698,605.85
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		355,159.11
应收利息	7.4.7.5	11,147,704.87
应收股利		-
应收申购款		54,126.42
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,352,763,791.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日

负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		359,039,104.44
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		689,516.83
应付托管费		172,379.21
应付销售服务费		133,743.01
应付交易费用	7.4.7.7	1,170,965.53
应交税费		116,312.95
应付利息		70,464.58
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	175,000.00
负债合计		361,567,486.55
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	927,993,571.78
未分配利润	7.4.7.10	63,202,732.83
所有者权益合计		991,196,304.61
负债和所有者权益总计		1,352,763,791.16

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，本报告期自基金合同生效日 2022 年 2 月 2 日起至 2021 年 12 月 31 日止。报告截止日 2021 年 12 月 31 日，平安恒鑫混合型证券投资基金 A 基金份额净值人民币 1.0696 元，基金份额总额 646,401,408.86 份；平安恒鑫混合型证券投资基金 C 基金份额净值人民币 1.0647 元，基金份额总额 281,592,162.92 份；总份额合计 927,993,571.78 份。

7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
一、收入		63,305,522.16
1. 利息收入		26,950,424.91
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,183,535.67
债券利息收入		25,182,408.91
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		584,480.33
证券出借利息收入		-

其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,612,276.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,329,240.10
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	16,125,784.02
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	2,157,252.35
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	14,182,420.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	560,400.09
减：二、费用		16,956,083.16
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,242,698.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,560,674.68
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	995,373.04
4. 交易费用	7.4.7.19	3,877,875.90
5. 利息支出		3,966,519.60
其中：卖出回购金融资产支出		3,966,519.60
6. 税金及附加		74,535.38
7. 其他费用	7.4.7.20	238,405.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,349,439.00
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,349,439.00

7.3 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12月31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12月31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）	-	46,349,439.00	46,349,439.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	99,408,030.31	16,853,293.83	116,261,324.14

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	876,465,697.08	51,868,424.73	928,334,121.81
2. 基金赎回款	-777,057,666.77	-35,015,130.90	-812,072,797.67
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)	927,993,571.78	63,202,732.83	991,196,304.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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”)系由基金管理人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》、《平安恒鑫混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,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号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据是否收取销售服务费,将基金份额分为平安恒鑫混合 A 份额和平安恒鑫混合 C 份额。本基金首次设立募集资金份额为 828,585,541.47 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(21)第 00065 号验资报告。《平安恒鑫混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2021 年 2 月 2 日正式生效。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《平安恒鑫混合型证券投资基金更新的招募说明书》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(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的相关规定。基金的投资组合比例为:本基金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。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: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%。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 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 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列

示外，其他以公允价值计量且其公允价值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。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4 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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债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。贷款及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。

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，贷款及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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种

(可转换债券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后净额确认。

3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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自动转为相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；基金份额持有人可对各类基金份额选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；

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) 由于本基金 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。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.13 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) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 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，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈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〉的通知》（中基协发[2014]24 号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1

日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不计缴企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4) 对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适

用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2021年12月31日
活期存款	553,351.43
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	553,351.43

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	234,694,314.05	243,124,597.50	8,430,283.45	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	374,721,860.36	375,753,805.85	1,031,945.49
	银行间市场	667,224,608.25	671,944,800.00	4,720,191.75
	合计	1,041,946,468.61	1,047,698,605.85	5,752,137.24
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,276,640,782.66	1,290,823,203.35	14,182,420.69	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,584.34
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	20,976.39
应收债券利息	11,125,037.44
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	106.70
合计	11,147,704.87

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,132,892.27
银行间市场应付交易费用	38,073.26
合计	1,170,965.53

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	175,000.00
合计	175,000.00

7.4.7.9 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 12 月 31 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	484,783,542.69	484,783,542.69
本期赎回（以“-”号填列）	-507,383,925.72	-507,383,925.72
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	646,401,408.86	646,401,408.86

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12月31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	391,682,154.39	391,682,154.39
本期赎回（以“-”号填列）	-269,673,741.05	-269,673,741.05
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	281,592,162.92	281,592,162.92

注：1、本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

2、本基金自 2021 年 1 月 18 日至 2021 年 1 月 29 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 828,315,538.91 元，折合为 828,315,538.91 份基金份额（其中 A 类基金份额 668,770,919.63 份，C 类基金份额 159,544,619.28 份）。根据《平安恒鑫混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 270,002.56 元在本基金成立后，折合为 270,002.56 份基金份额（其中 A 类基金份额 230,872.26 份，C 类基金份额 39,130.30 份），划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 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	26,150,988.47	10,420,779.62	36,571,768.09
本期基金份额交易产生的变动数	5,668,532.53	2,741,746.01	8,410,278.54
其中：基金申购款	21,234,751.42	8,727,900.00	29,962,651.42
基金赎回款	-15,566,218.89	-5,986,153.99	-21,552,372.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,819,521.00	13,162,525.63	44,982,046.63

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	6,016,029.84	3,761,641.07	9,777,670.91

本期基金份额交易产生的变动数	6,487,323.58	1,955,691.71	8,443,015.29
其中：基金申购款	15,990,898.33	5,914,874.98	21,905,773.31
基金赎回款	-9,503,574.75	-3,959,183.27	-13,462,758.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,503,353.42	5,717,332.78	18,220,686.20

7.4.7.11 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12月31日	
活期存款利息收入		86,497.57
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		990,492.57
其他		1,545.53
合计		1,183,535.67

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		3,329,240.10
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		3,329,240.10

7.4.7.12.2 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12月31日	
卖出股票成交总额		1,375,011,485.66
减：卖出股票成本总额		1,371,682,245.56
买卖股票差价收入		3,329,240.10

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月31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	16,125,784.02
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	16,125,784.02

7.4.7.13.2 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12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,716,324,564.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,667,063,276.42
减：应收利息总额	33,135,503.96
买卖债券差价收入	16,125,784.02

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.14.3 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。

7.4.7.14.4 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。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 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。

7.4.7.16 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12月31日
股票投资产生的股利收益	2,157,252.35
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	2,157,252.35

7.4.7.17 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12月31日
1. 交易性金融资产	14,182,420.69
股票投资	8,430,283.45
债券投资	5,752,137.24
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	14,182,420.69

7.4.7.18 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12月31日
基金赎回费收入	559,642.42
基金转换费收入	757.67
合计	560,400.09

注：本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，赎回费总额的一定比例归入基金资产。

7.4.7.19 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12月31日
交易所市场交易费用	3,814,668.40
银行间市场交易费用	63,207.50
合计	3,877,875.90

7.4.7.20 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12月31日
审计费用	56,000.00
信息披露费	110,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	43,305.68
账户维护费	28,500.00
其他	600.00
合计	238,405.68

7.4.7.21 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，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司

汇通”)	
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”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
上海陆金所基金销售有限公司(“陆基金”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
平安证券	243,546,773.43	8.20

7.4.10.1.2 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12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例(%)
平安证券	191,581,512.02	7.66

7.4.10.1.3 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12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)
平安证券	2,839,420,000.00	10.67

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 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12月31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	173,235.69	8.20	143,638.24	12.68

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。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研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	2,551,693.00

注：支付基金管理人平安基金的基金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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

7.4.10.2.2 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12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：支付基金托管人中国工商银行的基金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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 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12月31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	-	170,522.26	170,522.26
陆基金	-	367,041.06	367,041.06
平安基金	-	56,826.34	56,826.34

平安人寿	-	145,122.10	145,122.10
平安银行	-	7,270.85	7,270.85
平安证券	-	677.73	677.73
合计	-	747,460.34	747,460.34

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 × 0.50% / 当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行-活期	553,351.43	86,497.57

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。

7.4.10.7 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 12 月 31 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	301039	中集车辆	公开发行	20,640	143,654.40
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

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-

		日	日							
301060	兰卫医学	2021年 9月6 日	2022年 3月14 日	新股锁 定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年 9月7 日	2022年 3月14 日	新股锁 定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年 9月9 日	2022年 3月24 日	新股锁 定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股锁 定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股锁 定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年 9月22 日	2022年 3月29 日	新股锁 定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年 9月22 日	2022年 3月30 日	新股锁 定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年 9月30 日	2022年 4月14 日	新股锁 定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年 10月11 日	2022年 4月19 日	新股锁 定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021年 10月13 日	2022年 4月20 日	新股锁 定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021年 10月14 日	2022年 4月27 日	新股锁 定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021年 10月13 日	2022年 4月21 日	新股锁 定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021年 10月15 日	2022年 4月25 日	新股锁 定	93.09	75.34	652	60,694.68	49,121.68	-
301089	拓新药业	2021年 10月20 日	2022年 4月27 日	新股锁 定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润	2021年	2022年	新股锁	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-

	材料	10月19日	4月26日	定							
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96		-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65		-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股锁定	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20		-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44		-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50		-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70		-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50		-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60		-
688071	华依科技	2021年7月21日	2022年2月7日	新股锁定	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31		-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年7月7日	新股锁定	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20		-
688385	复旦微电	2021年7月27日	2022年2月7日	新股锁定	6.23	48.58	8,986	55,982.78	436,539.88		-
688553	汇宇制药	2021年10月14日	2022年4月26日	新股锁定	38.87	32.11	8,928	347,031.36	286,678.08		-
688718	唯赛勃	2021年7月20日	2022年1月28日	新股锁定	5.85	27.71	3,145	18,398.25	87,147.95		-
688733	壹石通	2021年8月10日	2022年2月17日	新股锁定	15.49	75.36	3,409	52,805.41	256,902.24		-

688778	厦钨新能	2021年7月29日	2022年2月7日	新股锁定	24.50	100.74	5,075	124,337.50	511,255.50	-
7.4.12.1.2 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
113052	兴业转债	2021年12月29日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	8,870	886,988.34	886,988.34	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日，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人民币197,039,104.44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
101901748	19 海淀国资 MTN003	2022年1月5日	99.71	400,000	39,884,000.00
102101805	21 成都经开 MTN002	2022年1月5日	100.69	43,000	4,329,670.00
101901747	19 鄂联投 MTN004	2022年1月6日	101.11	300,000	30,333,000.00
102102154	21 中能建	2022年1月6日	101.61	300,000	30,483,000.00

	MTN001	日			
102103054	21 大唐集 MTN008	2022 年 1 月 6 日	100.74	89,000	8,965,860.00
102000053	20 鲁能源 MTN001	2022 年 1 月 7 日	101.29	100,000	10,129,000.00
102000275	20 云投 MTN002	2022 年 1 月 7 日	96.48	200,000	19,296,000.00
102100252	21 宁河西 MTN001	2022 年 1 月 7 日	103.96	100,000	10,396,000.00
102102224	21 中交二 公 MTN002	2022 年 1 月 7 日	100.82	100,000	10,082,000.00
102103054	21 大唐集 MTN008	2022 年 1 月 7 日	100.74	64,000	6,447,360.00
102103237	21 锦江国 际 MTN002	2022 年 1 月 7 日	100.41	500,000	50,205,000.00
合计				2,196,000	220,550,890.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止,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人民币 162,000,000.00 元,已于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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的账面价值占基金净资产的比例为 87.65%（上年末：无）。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该

上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	553,351.43	-	-	-	553,351.43
结算备付金	49,593,068.74	-	-	-	49,593,068.74
存出保证金	237,177.24	-	-	-	237,177.24
交易性金融资产	286,660,115.75	626,367,690.10	134,670,800.00	243,124,597.50	1,290,823,203.35
应收利息	-	-	-	11,147,704.87	11,147,704.87
应收申购款	-	-	-	54,126.42	54,126.42
应收证券清算款	-	-	-	355,159.11	355,159.11
资产总计	337,043,713.16	626,367,690.10	134,670,800.00	254,681,587.90	1,352,763,791.16
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	689,516.83	689,516.83
应付托管费	-	-	-	172,379.21	172,379.21
卖出回购金融资产款	359,039,104.44	-	-	-	359,039,104.44
应付销售服务费	-	-	-	133,743.01	133,743.01
应付交易费用	-	-	-	1,170,965.53	1,170,965.53
应付利息	-	-	-	70,464.58	70,464.58
应交税费	-	-	-	116,312.95	116,312.95
其他负债	-	-	-	175,000.00	175,000.00
负债总计	359,039,104.44	-	-	2,528,382.11	361,567,486.55
利率敏感度缺口	-21,995,391.28	626,367,690.10	134,670,800.00	252,153,205.79	991,196,304.61

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。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	7,370,251.22
	市场利率上升 25 个基点	-7,272,658.98

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	243,124,597.50	24.53
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	243,124,597.50	24.53

7.4.13.4.3.2 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12月31日）
分析	沪深300指数上升5%	5,145,845.31
	沪深300指数下降5%	-5,145,845.31

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

下表按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融工具于本报告期末的账面价值。

单位：人民币元

资产 本期末（2021 年 12 月 31 日）

第一层次 第二层次 第三层次 合计

交易性金融资产

股票投资 240,062,153.00 948,459.64 2,113,984.86 243,124,597.50

债券投资 106,231,976.61 941,466,629.24 - 1,047,698,605.85

基金投资 - - - -

合计 346,294,129.61 942,415,088.88 2,113,984.86 1,290,823,203.35

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	243,124,597.50	17.97
	其中：股票	243,124,597.50	17.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,047,698,605.85	77.45
	其中：债券	1,047,698,605.85	77.45
	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	50,146,420.17	3.71
8	其他各项资产	11,794,167.64	0.87
9	合计	1,352,763,791.16	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	4,000,302.00	0.40
B	采矿业	1,327,530.00	0.13
C	制造业	164,939,283.98	16.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,092,402.20	0.21
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	281,409.94	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	9,958,944.00	1.00
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,933,200.92	3.32
J	金融业	27,434,463.60	2.77
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	100,730.08	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	28,847.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	243,124,597.50	24.53

8.2.2 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。

8.3 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	002142	宁波银行	456,870	17,488,983.60	1.76
2	300451	创业慧康	1,424,190	15,922,444.20	1.61
3	600887	伊利股份	318,200	13,192,572.00	1.33
4	600029	南方航空	1,462,400	9,958,944.00	1.00
5	300059	东方财富	268,000	9,945,480.00	1.00
6	002415	海康威视	189,600	9,919,872.00	1.00
7	600570	恒生电子	159,000	9,881,850.00	1.00
8	600600	青岛啤酒	98,800	9,781,200.00	0.99

9	688008	澜起科技	101,780	8,536,288.60	0.86
10	300083	创世纪	572,900	8,181,012.00	0.83
11	002859	洁美科技	216,900	8,068,680.00	0.81
12	603501	韦尔股份	22,700	7,054,479.00	0.71
13	300253	卫宁健康	415,900	6,970,484.00	0.70
14	002493	荣盛石化	381,900	6,935,304.00	0.70
15	002938	鹏鼎控股	163,400	6,933,062.00	0.70
16	603667	五洲新春	397,100	6,913,511.00	0.70
17	300443	金雷股份	117,800	6,804,128.00	0.69
18	603997	继峰股份	422,100	6,787,368.00	0.68
19	300767	震安科技	64,200	6,699,270.00	0.68
20	600519	贵州茅台	2,700	5,535,000.00	0.56
21	002036	联创电子	207,100	5,024,246.00	0.51
22	603298	杭叉集团	292,400	5,014,660.00	0.51
23	002541	鸿路钢构	93,400	5,000,636.00	0.50
24	603986	兆易创新	28,200	4,958,970.00	0.50
25	688308	欧科亿	69,741	4,929,293.88	0.50
26	600933	爱柯迪	217,500	4,193,400.00	0.42
27	601677	明泰铝业	94,400	4,162,096.00	0.42
28	300498	温氏股份	207,700	4,000,302.00	0.40
29	603035	常熟汽饰	195,600	3,466,032.00	0.35
30	000887	中鼎股份	125,800	2,743,698.00	0.28
31	600577	精达股份	351,400	2,614,416.00	0.26
32	603589	口子窖	34,900	2,473,363.00	0.25
33	300750	宁德时代	4,200	2,469,600.00	0.25
34	000568	泸州老窖	8,500	2,157,895.00	0.22
35	000539	粤电力 A	340,228	2,092,402.20	0.21
36	002192	融捷股份	10,200	1,327,530.00	0.13
37	002203	海亮股份	87,600	1,088,868.00	0.11
38	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.09
39	688778	厦钨新能	5,075	511,255.50	0.05
40	688167	炬光科技	2,014	441,066.00	0.04
41	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.04
42	688553	汇宇制药	8,928	286,678.08	0.03
43	301166	优宁维	2,528	258,233.50	0.03
44	688733	壹石通	3,409	256,902.24	0.03
45	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.01
46	688718	唯赛勃	3,145	87,147.95	0.01
47	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
48	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.01
49	301087	可孚医疗	652	49,121.68	0.00
50	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00

51	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
52	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
53	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
54	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
55	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
56	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
57	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
58	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
59	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
60	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
61	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
62	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
63	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
64	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
65	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
66	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
67	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
68	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
69	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
70	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
71	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
72	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
73	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
74	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
75	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
76	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
77	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
78	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
79	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002142	宁波银行	27,832,155.47	2.81
2	603035	常熟汽饰	26,846,074.96	2.71
3	600577	精达股份	26,488,204.88	2.67
4	601238	广汽集团	24,421,624.31	2.46
5	601988	中国银行	22,915,634.00	2.31
6	002126	银轮股份	21,373,430.18	2.16
7	000539	粤电力 A	21,099,203.39	2.13
8	300433	蓝思科技	20,650,345.00	2.08

9	600519	贵州茅台	20,171,679.00	2.04
10	688368	晶丰明源	18,661,580.58	1.88
11	000333	美的集团	18,402,551.75	1.86
12	600483	福能股份	17,354,639.79	1.75
13	601778	晶科科技	16,775,479.38	1.69
14	601288	农业银行	15,832,191.00	1.60
15	600188	兖矿能源	15,574,629.99	1.57
16	002408	齐翔腾达	15,195,981.24	1.53
17	600887	伊利股份	15,093,056.00	1.52
18	601677	明泰铝业	14,927,579.00	1.51
19	300451	创业慧康	14,848,485.60	1.50
20	000887	中鼎股份	14,774,318.14	1.49

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。

8.4.2 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	25,681,199.69	2.59
2	600577	精达股份	24,275,346.18	2.45
3	601238	广汽集团	24,039,053.13	2.43
4	000539	粤电力 A	23,285,670.07	2.35
5	601988	中国银行	23,192,896.00	2.34
6	002126	银轮股份	23,071,752.00	2.33
7	300433	蓝思科技	19,926,193.72	2.01
8	000333	美的集团	17,873,601.00	1.80
9	688368	晶丰明源	17,740,237.81	1.79
10	600483	福能股份	17,535,397.73	1.77
11	003816	中国广核	17,029,999.99	1.72
12	601778	晶科科技	16,522,876.69	1.67
13	002408	齐翔腾达	15,898,132.27	1.60
14	600188	兖矿能源	15,699,775.00	1.58
15	601288	农业银行	14,882,042.00	1.50
16	600585	海螺水泥	14,155,990.28	1.43
17	600519	贵州茅台	14,053,130.28	1.42
18	300303	聚飞光电	13,594,168.55	1.37
19	601222	林洋能源	13,501,938.66	1.36
20	000887	中鼎股份	13,198,886.18	1.33

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。

8.4.3 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	1,606,376,559.61
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,375,011,485.66
--------------	------------------

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。

8.5 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	117,863,374.60	11.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,340,000.00	12.14
	其中：政策性金融债	61,086,000.00	6.16
4	企业债券	252,316,466.30	25.46
5	企业短期融资券	2,002,400.00	0.20
6	中期票据	407,744,400.00	41.14
7	可转债（可交换债）	107,118,964.95	10.81
8	同业存单	-	-
9	其他	40,313,000.00	4.07
10	合计	1,047,698,605.85	105.70

8.6 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	210009	21 付息国债 09	600,000	60,996,000.00	6.15
2	210203	21 国开 03	500,000	51,055,000.00	5.15
3	102101745	21 晋焦煤 MTN004	500,000	50,675,000.00	5.11
4	102103054	21 大唐集 MTN008	500,000	50,370,000.00	5.08
5	102103237	21 锦江国际 MTN002	500,000	50,205,000.00	5.07

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无股指期货投资。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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 2021 年 7 月 13 日作出银保监罚决字〔2021〕26 号决定，由于中国民生银行股份有限公司逾期未履行行政义务，内部制度不完善，违规经营等，根据相关规定罚款 11450 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

8.12.3 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	237,177.24
2	应收证券清算款	355,159.11
3	应收股利	-
4	应收利息	11,147,704.87
5	应收申购款	54,126.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,794,167.64

8.12.4 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	110079	杭银转债	16,389,464.00	1.65
2	132018	G 三峡 EB1	15,495,324.00	1.56
3	123107	温氏转债	11,939,655.90	1.20
4	123099	普利转债	10,060,962.75	1.02
5	123022	长信转债	7,955,860.80	0.80
6	123114	三角转债	5,244,394.60	0.53
7	127027	靖远转债	5,166,217.20	0.52
8	127038	国微转债	5,130,229.20	0.52
9	128035	大族转债	4,920,776.56	0.50
10	127011	中鼎转 2	4,881,871.20	0.49
11	113563	柳药转债	3,025,944.90	0.31
12	110038	济川转债	1,903,627.00	0.19
13	132014	18 中化 EB	1,703,299.80	0.17
14	110075	南航转债	1,456,841.50	0.15

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	3,039	212,702.01	430,052,284.93	66.53	216,349,123.93	33.47
平安恒鑫混合 C	20,426	13,785.97	61,393,016.39	21.80	220,199,146.53	78.20
合计	23,208	39,985.93	491,445,301.32	52.96	436,548,270.46	47.04

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）。

9.2 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	2,008.96	0.0003
	平安恒鑫混合 C	139.54	0.0000
	合计	2,148.50	0.0002

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（即期末基金总份额）。

9.3 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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品的情况

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

§ 10 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	484,783,542.69	391,682,154.39
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	507,383,925.72	269,673,741.05
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）		
本报告期末基金份额总额	646,401,408.86	281,592,162.92

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

1. 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。
2. 公司监事巢傲文先生因工作调动，经公司2021年12月17日召开的2021年第四次股东会审议，不再出任公司第四届监事会监事，并由许黎女士接替巢傲文先生任职公司的监事。
3. 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金合同生效，初次聘请德勤会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内应支付给该事务所的报酬为56,000.00元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	6	1,061,330,519.02	35.72%	754,918.15	35.72%	-
太平洋证券	3	636,609,458.10	21.42%	452,821.36	21.42%	-
广发证券	2	453,514,492.69	15.26%	322,583.58	15.26%	-
国盛证券	1	280,114,546.54	9.43%	199,246.92	9.43%	-
平安证券	2	243,546,773.43	8.20%	173,235.69	8.20%	-
长江证券	1	219,430,050.22	7.38%	156,081.33	7.38%	-
中泰证券	2	57,525,172.31	1.94%	40,915.02	1.94%	-
招商证券	3	19,399,342.60	0.65%	13,798.93	0.65%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	1,277,551,33	51.07%	9,967,700,000.	37.46%	-	-

	2.37		00			
太平洋证券	181,483,612.76	7.25%	-	-	-	-
广发证券	301,962,942.90	12.07%	12,462,100,000.00	46.83%	-	-
国盛证券	272,084,875.93	10.88%	1,000,000.00	0.00%	-	-
平安证券	191,581,512.02	7.66%	2,839,420,000.00	10.67%	-	-
长江证券	173,758,974.66	6.95%	5,100,000.00	0.02%	-	-
中泰证券	41,895,569.76	1.67%	858,900,000.00	3.23%	-	-
招商证券	61,347,830.66	2.45%	351,300,000.00	1.32%	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	125,000,000.00	0.47%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于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
2	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
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
12	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 07 月 02 日
13	平安恒鑫混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 07 月 20 日
14	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）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 07 月 28 日
15	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜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 08 月 16 日
16	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜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 08 月 19 日
17	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增众惠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 08 月 23 日
18	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰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 08 月 25 日
19	平安恒鑫混合型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 31 日
20	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大河财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 09 月 09 日
21	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富（北京）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 09 月 14 日
22	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信百信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 09 月 28 日
23	平安恒鑫混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 10 月 26 日
24	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海农村商业银行股份有限	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 11 月 02 日

	公司为销售机构的公告		
25	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利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 11 月 04 日
26	平安基金管理有限公司关于新增国信证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 11 月 09 日
27	平安基金管理有限公司关于新增国信证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 11 月 12 日
28	平安恒鑫混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 11 月 30 日
29	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 11 月 30 日
30	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增诺亚正行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 12 月 03 日
31	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 12 月 20 日
32	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海攀赢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 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 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：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日