

平安优质企业混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12	投资组合报告附注	52
§ 8	基金份额持有人信息	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9	开放式基金份额变动	54
§ 10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8	其他重大事件	58
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安优质企业混合型证券投资基金	
基金简称	平安优质企业混合	
基金主代码	012475	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 19 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,869,074,003.93 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C
下属分级基金的交易代码	012475	012476
报告期末下属分级基金的份额总额	2,761,436,010.76 份	107,637,993.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选基本面良好，符合产业趋势、竞争力突出的公司，在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
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、股票期权投资策略；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	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×25%+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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	许俊
	联系电话	0755-22626828	95566
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942
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 1 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 1 号

	5033 号平安金融中心 34 层	
邮政编码	518048	100818
法定代表人	罗春风	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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(2022年01月01日-2022年06月30日)		
	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C	
本期已实现收益	-380,278,249.48	-15,117,925.47	
本期利润	-211,701,986.54	-8,592,579.00	
加权平均基金份额本期利润	-0.0734	-0.0765	
本期加权平均净值利润率	-8.69%	-9.11%	
本期基金份额净值增长率	-6.85%	-7.21%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)		
	期末可供分配利润	-400,225,672.74	-16,278,558.37
	期末可供分配基金份额利润	-0.1449	-0.1512
	期末基金资产净值	2,465,538,378.75	95,377,118.65
	期末基金份额净值	0.8928	0.8861

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-10.72%	-11.39%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安优质企业混合 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	8.94%	1.28%	6.82%	0.81%	2.12%	0.47%
过去三个月	8.64%	1.24%	4.99%	1.06%	3.65%	0.18%
过去六个月	-6.85%	1.15%	-5.94%	1.09%	-0.91%	0.06%
自基金合同生效起至今	-10.72%	0.95%	-8.19%	0.94%	-2.53%	0.01%

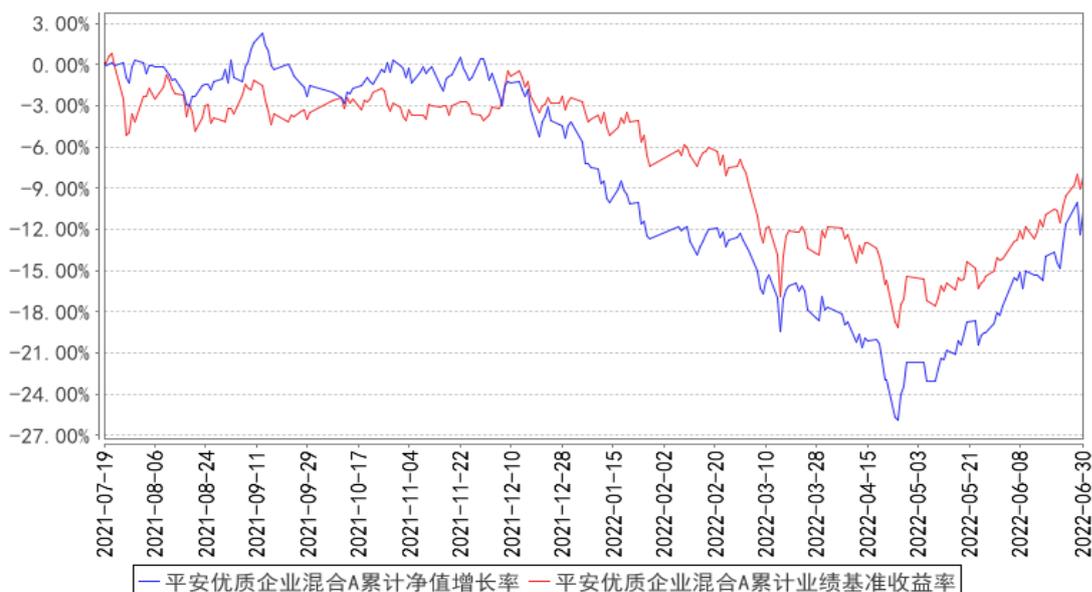
平安优质企业混合 C

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	8.87%	1.28%	6.82%	0.81%	2.05%	0.47%
过去三个月	8.42%	1.24%	4.99%	1.06%	3.43%	0.18%

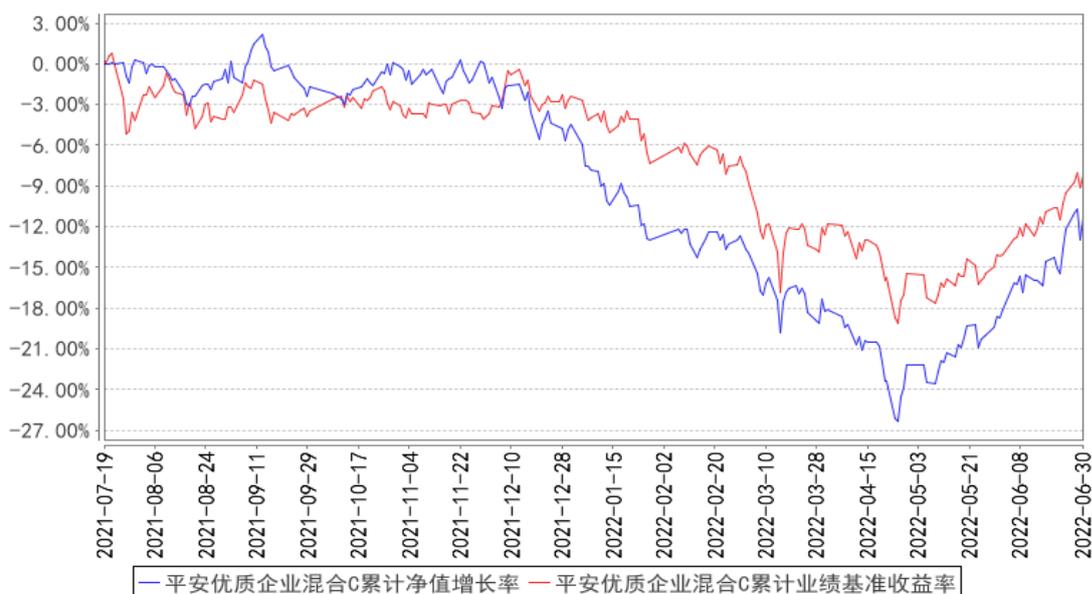
过去六个月	-7.21%	1.15%	-5.94%	1.09%	-1.27%	0.06%
自基金合同生效起至今	-11.39%	0.96%	-8.19%	0.94%	-3.20%	0.02%

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

平安优质企业混合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



平安优质企业混合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 07 月 19 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。

3.3 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成立于 2011 年 1 月 7 日，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（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 2022 年 6 月 30 日，平安基金共管理 169 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5504 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		
薛冀颖	平安优质企业混合型证券投资基金基金经理	2021 年 7 月 19 日	-	11 年	薛冀颖先生，清华大学信息科学技术专业博士研究生，曾担任鹏华基金管理有限公司研究员、融通基金管理有限公司基金经理。2020 年 6 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安优质企业混合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

2022 年上半年市场波动较大，在调整之后有一定反弹，其中上证指数下跌 6.63%，深证综指下跌 12.09%，创业板综指下跌 15.91%，沪深 300 下跌 9.22%。板块之间分化明显，4 月底之前，电子、国防军工、新能源等板块跌幅相对较大，煤炭、房地产、银行等板块表现相对靠前，4 月底之后，成长相关的板块反弹幅度相对较大，特别是新能源板块反弹的力度和持续性都较好。本基金年初以来面对市场新增的一些利空因素：如大宗商品涨价超预期、国内疫情反复以及俄乌冲突等，在组合结构上进行了一些调整，适当降低了一些之前涨幅较大、预期过于饱满、同时受到上游成本压力及终端消费影响的个股，适当增加了一些跟稳增长相关的房地产、基建等领域的个股。二季度在市场下跌后适当进行了组合结构调整，减仓了一季度超额收益比较大的稳增长相关个股，加仓了跌幅比较大的成长股，主要在于年初以来的市场利空因素都有一定改善，比如随着大宗商品价格见顶回落，市场对通胀的预期在减弱，对美国加息的预期也已经充分反应，国内疫

情相比 4 月已经大幅好转，因此在下跌之后认为市场的风险已经较充分释放，虽然市场有可能还会反复，但很多优质公司股价都已处于较合理位置，从长期角度来看具有一定吸引力。目前本基金持仓较为均衡，重点选择符合产业趋势、竞争力突出、成长潜力较大的优质公司进行配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安优质企业混合 A 的基金份额净值 0.8928 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.85%，同期业绩比较基准收益率为-5.94%；截至本报告期末平安优质企业混合 C 的基金份额净值 0.8861 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.21%，同期业绩比较基准收益率为-5.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年年初以来市场有明显调整，主要的利空因素有：大宗商品年初以来价格持续超预期；美国即将开始加息周期；疫情反复对经济的影响，特别是上海的疫情让市场的担忧较大。随后市场的下跌已经对悲观预期有较充分的反应，同时前期利空因素有明显改善：随着需求的走弱，大宗商品的价格见顶回落，较多企业的盈利能力有望得到改善；美联储加息市场已经有较充分的预期，但随着美国经济逐渐出现衰退的迹象，最终实际加息次数和力度未必达到市场的悲观预期，对于疫情导致的物流受阻等影响，随着管控经验的提升，对生产经营活动的影响在逐渐减弱，因此市场有明显反弹，特别是成长方向的较多个股表现强势，主要在于宏观经济有一定压力，相关的金融地产、周期以及消费板块都受到一定程度的影响，市场对这些板块中的公司的未来业绩有一定担心，而成长领域的一些方向，如光伏、风电、新能源车、汽车智能化等，有自身的产业趋势，受宏观经济影响相对较小，行业的成长性较为确定，并且未来有较大的空间，同时因为宏观经济的压力，流动性会相对宽裕，在此背景下，成长方向预计持续有较多的结构性机会。总体而言因宏观环境的不确定性，尽量要多寻找所在行业符合产业趋势、行业景气度较高以及竞争力突出、管理层优秀、成长潜力较大的优质公司进行配置，同时要考量公司业绩增速和估值的匹配度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、

假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安优质企业混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：平安优质企业混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	189,909,981.45	544,872,475.04
结算备付金		137,300,568.48	473,846,745.09
存出保证金		1,596,069.02	1,322,477.10
交易性金融资产	6.4.7.2	2,297,303,863.99	2,113,766,351.29
其中：股票投资		2,297,303,863.99	2,113,766,351.29
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		659,042.59	-
应收申购款		155,078.03	198,489.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	313,041.17
资产总计		2,626,924,603.56	3,134,319,578.74
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		49,472,811.91	101,590,063.93
应付赎回款		7,498,494.36	4,318,808.95
应付管理人报酬		3,046,269.67	3,951,336.92
应付托管费		507,711.60	658,556.15
应付销售服务费		60,647.02	78,714.32
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	5,423,171.60	9,116,618.78

负债合计		66,009,106.16	119,714,099.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,869,074,003.93	3,145,638,985.54
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-308,158,506.53	-131,033,505.85
净资产合计		2,560,915,497.40	3,014,605,479.69
负债和净资产总计		2,626,924,603.56	3,134,319,578.74

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,869,074,003.93 份，其中平安优质企业混合 A 基金份额总额 2,761,436,010.76 份，基金份额净值 0.8928 元。平安优质企业混合 C 基金份额总额 107,637,993.17 份，基金份额净值 0.8861 元。

6.2 利润表

会计主体：平安优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-197,758,839.85
1. 利息收入		2,196,653.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,181,764.27
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		14,889.21
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-375,114,541.73
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-388,798,520.00
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	13,683,978.27
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	6.4.7.20	175,101,609.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	57,438.99
减：二、营业总支出		22,535,725.69

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,866,225.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,144,370.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	375,040.45
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	150,088.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-220,294,565.54
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-220,294,565.54
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-220,294,565.54

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	3,145,638,985.54	-	-131,033,505.85	3,014,605,479.69
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	3,145,638,985.54	-	-131,033,505.85	3,014,605,479.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-276,564,981.61	-	-177,125,000.68	-453,689,982.29

(一)、综合收益总额	-	-	-220,294,565.54	-220,294,565.54
(二)、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)	-276,564,981.61	-	43,169,564.86	-233,395,416.75
其中:1.基金申购款	19,306,695.10	-	-2,883,178.02	16,423,517.08
2.基金赎回款	-295,871,676.71	-	46,052,742.88	-249,818,933.83
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,869,074,003.93	-	-308,158,506.53	2,560,915,497.40

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

平安优质企业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[2021]957号《关于准予平安优质企业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《平安优质企业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339,569,136.50元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0737号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《平安优质企业混合型证券投资基金基金合同》于2021年7月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,340,949,620.55份基金份额,其中认购资金利息折合1,380,484.05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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《平安优质企业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。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安优质企业混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票、衍生工具(股指期货、国债期货、股票期权)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券)、资产支持证券、信用衍生品、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、现金等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本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60%-95%,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%。

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。股指期货、国债期货、股票期权合约的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×25%+恒生指数收益率(经汇率调整)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安优质企业混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计政策除了下述会计政策变更外，其余与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计政策的变更

6.4.4.1.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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股票投资、债券投资、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。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，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。

6.4.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余

成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.1.3 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行

价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除相关交易费用及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。

6.4.4.1.4 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：

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(可转换债券除外)，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。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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31

日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

i) 于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款, 金额分别为 544,872,475.04 元、473,846,745.09 元、1,322,477.10 元、313,041.17 元和 198,489.05 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款, 金额分别为 544,951,650.12 元、474,079,308.72 元、1,323,779.56 元、0.00 元和 198,489.05 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 2,113,766,351.29 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 2,113,766,351.29 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 101,590,063.93 元、4,318,808.95 元、3,951,336.92 元、658,556.15 元、78,714.32 元、8,946,772.23 元和 9,846.55 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 101,590,063.93 元、4,318,808.95 元、3,951,336.92 元、658,556.15 元、78,714.32 元、8,946,772.23 元和 9,846.55 元。

ii) 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》, 本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露, 这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	189,909,981.45
等于：本金	189,880,774.73
加：应计利息	29,206.72
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	189,909,981.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,203,047,764.51	-	2,297,303,863.99	94,256,099.48
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,203,047,764.51	-	2,297,303,863.99	94,256,099.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	55.18
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,304,101.68
其中：交易所市场	5,304,101.68
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	119,014.74
合计	5,423,171.60

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安优质企业混合 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,027,073,092.37	3,027,073,092.37
本期申购	12,918,120.55	12,918,120.55
本期赎回（以“-”号填列）	-278,555,202.16	-278,555,202.16
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	2,761,436,010.76	2,761,436,010.76

平安优质企业混合 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	118,565,893.17	118,565,893.17
本期申购	6,388,574.55	6,388,574.55
本期赎回（以“-”号填列）	-17,316,474.55	-17,316,474.55
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	107,637,993.17	107,637,993.17

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

平安优质企业混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-50,177,326.90	-75,521,825.93	-125,699,152.83
本期利润	-380,278,249.48	168,576,262.94	-211,701,986.54
本期基金份额交易产生的变动数	30,229,903.64	11,273,603.72	41,503,507.36
其中：基金申购款	-1,519,373.55	-413,615.22	-1,932,988.77
基金赎回款	31,749,277.19	11,687,218.94	43,436,496.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-400,225,672.74	104,328,040.73	-295,897,632.01

平安优质企业混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-2,384,482.46	-2,949,870.56	-5,334,353.02
本期利润	-15,117,925.47	6,525,346.47	-8,592,579.00
本期基金份额交易产生的变动数	1,223,849.56	442,207.94	1,666,057.50
其中：基金申购款	-717,652.01	-232,537.24	-950,189.25
基金赎回款	1,941,501.57	674,745.18	2,616,246.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,278,558.37	4,017,683.85	-12,260,874.52

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	951,868.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,211,641.03

其他	18,254.99
合计	2,181,764.27

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-388,798,520.00
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	-388,798,520.00

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	10,195,989,194.02
减：卖出股票成本总额	10,556,046,859.80
减：交易费用	28,740,854.22
买卖股票差价收入	-388,798,520.00

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于股票投资产生的证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,683,978.27
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	13,683,978.27

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	175,101,609.41

股票投资	175,101,609.41
债券投资	-
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	175,101,609.41

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	55,063.99
基金转换费收入	2,375.00
合计	57,438.99

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	27,978.38
其他	3,095.30
合计	150,088.42

6.4.7.24 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
平安银行股份有限公司（“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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,866,225.88
其中：支付销售机构的客户维护费	9,204,686.75

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,144,370.94

注：支付基金托管行中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C	合计
陆基金	-	7,395.18	7,395.18
平安基金	-	453.96	453.96
平安人寿	-	45,642.34	45,642.34
平安银行	-	11,547.08	11,547.08
中国银行	-	152,516.71	152,516.71
合计	-	217,555.27	217,555.27

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 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：

日销售服务费 = C 类基金前一日基金资产净值 × 0.80% / 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：本基金本报告期末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 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	189,909,981.45	951,868.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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(2022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	受限期	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

300834	星辉环材	2022年 1月6日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022年 3月25日	6个月	新股锁定	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301103	何氏眼科	2022年 3月14日	6个月	新股锁定	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301109	军信股份	2022年 4月6日	6个月	新股锁定	23.21	16.14	1,837	42,642.25	29,649.18	-
301116	益客食品	2022年 1月10日	6个月	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301122	采纳股份	2022年 1月19日	6个月	新股锁定	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301123	奕东电子	2022年 1月14日	6个月	新股锁定	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301130	西点药业	2022年 2月16日	6个月	新股锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022年 4月1日	6个月	新股锁定	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301153	中科江南	2022年 5月10日	6个月	新股锁定	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022年 1月7日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301163	宏德股份	2022年 4月11日	6个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301175	中科环保	2022年 6月30日	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	63,694	243,311.08	243,311.08	-
301181	标榜股份	2022年 2月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022年 1月4日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-

		日									
301201	诚达药业	2022年 1月12日	6个月	新股锁定	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-	
301207	华兰疫苗	2022年 2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-	
301216	万凯新材	2022年 3月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-	
301219	腾远钴业	2022年 3月10日	6个月	新股锁定	96.62	87.82	578	55,847.58	50,759.96	-	
301235	华康医疗	2022年 1月21日	6个月	新股锁定	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-	
301236	软通动力	2022年 3月8日	6个月	新股锁定	48.59	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	-	
301237	和顺科技	2022年 3月16日	6个月	新股锁定	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-	
301238	瑞泰新材	2022年 6月10日	6个月	新股锁定	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-	
301248	杰创智能	2022年 4月13日	6个月	新股锁定	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-	
301256	华融化学	2022年 3月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-	
301258	富士莱	2022年 3月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-	
301263	泰恩康	2022年 3月22日	6个月	新股锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-	
688048	长光华芯	2022年 3月25日	6个月	新股锁定	80.80	111.97	6,790	548,632.00	760,276.30	-	
688176	亚虹医药	2021年 12月29日	6个月	新股锁定	22.98	12.53	37,990	873,010.20	476,014.70	-	
688237	超卓	2022年	1个月	新股未	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-	

	航科	6月24日	内(含)	上市							
688259	创耀科技	2022年1月5日	6个月	新股锁定	66.60	79.22	1,595	106,227.00	126,355.90		-
688283	坤恒顺维	2022年2月8日	6个月	新股锁定	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95		-
688322	奥比中光	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71		-
688331	荣昌生物	2022年3月24日	6个月	新股锁定	48.00	42.94	15,915	763,920.00	683,390.10		-
688349	三一重能	2022年6月15日	6个月	新股锁定	29.80	36.94	32,650	972,970.00	1,206,091.00		-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23		-

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

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	189,909,981.45	-	-	-	189,909,981.45
结算备付金	137,300,568.48	-	-	-	137,300,568.48
存出保证金	1,596,069.02	-	-	-	1,596,069.02
交易性金融资产	-	-	-2,297,303,863.99	2,297,303,863.99	2,297,303,863.99
应收股利	-	-	-	659,042.59	659,042.59
应收申购款	-	-	-	155,078.03	155,078.03
资产总计	328,806,618.95	-	-2,298,117,984.61	2,626,924,603.56	2,626,924,603.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,498,494.36	7,498,494.36
应付管理人报酬	-	-	-	3,046,269.67	3,046,269.67
应付托管费	-	-	-	507,711.60	507,711.60
应付清算款	-	-	-	49,472,811.91	49,472,811.91
应付销售服务费	-	-	-	60,647.02	60,647.02
其他负债	-	-	-	5,423,171.60	5,423,171.60
负债总计	-	-	-	66,009,106.16	66,009,106.16
利率敏感度缺口	328,806,618.95	-	-2,232,108,878.45	2,560,915,497.40	2,560,915,497.40
上年度末 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	544,872,475.04	-	-	-	544,872,475.04
结算备付金	473,846,745.09	-	-	-	473,846,745.09
存出保证金	1,322,477.10	-	-	-	1,322,477.10
交易性金融资产	-	-	-2,113,766,351.29	-	2,113,766,351.29
应收利息	-	-	-	313,041.17	313,041.17
应收申购款	-	-	-	198,489.05	198,489.05
资产总计	1,020,041,697.23	-	-2,114,277,881.51	-	3,134,319,578.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,318,808.95	4,318,808.95
应付管理人报酬	-	-	-	3,951,336.92	3,951,336.92
应付托管费	-	-	-	658,556.15	658,556.15
应付证券清算款	-	-	-	101,590,063.93	101,590,063.93
应付销售服务费	-	-	-	78,714.32	78,714.32
应付交易费用	-	-	-	8,946,772.23	8,946,772.23
其他负债	-	-	-	169,846.55	169,846.55
负债总计	-	-	-	119,714,099.05	119,714,099.05
利率敏感度缺口	1,020,041,697.23	-	-1,994,563,782.46	-	3,014,605,479.69

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

注：于本期末，本基金未持有债券资产（上年末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	121,803,069.75	-	121,803,069.75

资产合计	-	121,803,069.75	-	121,803,069.75
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	121,803,069.75	-	121,803,069.75
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	88,488,083.54	-	88,488,083.54
资产合计	-	88,488,083.54	-	88,488,083.54
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	88,488,083.54	-	88,488,083.54

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	所有外币相对于人民币升值 5%	6,090,153.49	4,424,404.18
	所有外币相对于人民币贬值 5%	-6,090,153.49	-4,424,404.18

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 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,297,303,863.99	89.71	2,113,766,351.29	70.12
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,297,303,863.99	89.71	2,113,766,351.29	70.12

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	沪深300指数上升5%	92,671,407.33	25,618,589.69
	沪深300指数下降5%	-92,671,407.33	-25,618,589.69

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	2,292,456,454.87	2,110,115,135.40
第二层次	914,460.59	948,459.64
第三层次	3,932,948.53	2,702,756.25
合计	2,297,303,863.99	2,113,766,351.29

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	2,297,303,863.99	87.45
	其中：股票	2,297,303,863.99	87.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	327,210,549.93	12.46
8	其他各项资产	2,410,189.64	0.09
9	合计	2,626,924,603.56	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 121,803,069.75 元，占净值比例 4.76%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	45,007,816.00	1.76
C	制造业	1,625,235,059.81	63.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	92,897,118.48	3.63
F	批发和零售业	59,758,789.12	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	11,460,115.03	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,600,122.24	2.48
J	金融业	107,186,282.46	4.19
K	房地产业	59,240,400.66	2.31
L	租赁和商务服务业	40,762,750.00	1.59
M	科学研究和技术服务业	70,063,146.04	2.74
N	水利、环境和公共设施管理业	272,960.26	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	2,175,500,794.24	84.95

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	75,682,690.15	2.96
能源	-	-
金融	-	-
医疗	-	-
工业	15,297,211.13	0.60
地产业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	30,823,168.47	1.20
公用事业	-	-
合计	121,803,069.75	4.76

注：以上分类采用全球行业分类标准。

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	603606	东方电缆	1,300,800	99,641,280.00	3.89
2	300750	宁德时代	185,577	99,098,118.00	3.87
3	601012	隆基绿能	1,465,316	97,634,005.08	3.81
4	600519	贵州茅台	40,539	82,902,255.00	3.24
5	600522	中天科技	3,239,100	74,823,210.00	2.92
6	300347	泰格医药	612,034	70,047,291.30	2.74
7	300496	中科创达	485,700	63,374,136.00	2.47
8	603596	伯特利	771,160	61,831,608.80	2.41
9	600887	伊利股份	1,546,547	60,238,005.65	2.35
10	600048	保利发展	3,392,921	59,240,400.66	2.31
11	300122	智飞生物	491,916	54,607,595.16	2.13
12	000858	五粮液	242,600	48,988,218.00	1.91
13	300059	东方财富	1,861,831	47,290,507.40	1.85
14	601669	中国电建	5,999,800	47,218,426.00	1.84
15	600487	亨通光电	3,176,200	46,181,948.00	1.80
16	002729	好利科技	919,195	45,380,657.15	1.77
17	000400	许继电气	2,299,300	44,146,560.00	1.72
18	603297	永新光学	379,730	42,419,638.30	1.66
19	601888	中国中免	175,000	40,762,750.00	1.59
20	688533	上声电子	554,053	39,581,546.32	1.55
21	600702	舍得酒业	183,800	37,493,362.00	1.46

22	002556	辉隆股份	3,178,000	37,182,600.00	1.45
23	605337	李子园	1,317,124	36,457,992.32	1.42
24	600732	爱旭股份	1,097,300	36,232,846.00	1.41
25	002459	晶澳科技	436,220	34,417,758.00	1.34
26	000333	美的集团	557,107	33,643,691.73	1.31
27	09868	小鹏汽车-W	293,600	31,736,990.30	1.24
28	00700	腾讯控股	101,700	30,823,168.47	1.20
29	002938	鹏鼎控股	996,100	30,092,181.00	1.18
30	300777	中简科技	598,900	28,866,980.00	1.13
31	603997	继峰股份	2,557,950	27,830,496.00	1.09
32	600521	华海药业	1,163,366	26,408,408.20	1.03
33	002466	天齐锂业	206,900	25,821,120.00	1.01
34	002821	凯莱英	89,200	25,778,800.00	1.01
35	002475	立讯精密	758,713	25,636,912.27	1.00
36	002371	北方华创	92,120	25,528,294.40	1.00
37	601688	华泰证券	1,764,000	25,048,800.00	0.98
38	601800	中国交建	2,698,700	25,043,936.00	0.98
39	603688	石英股份	188,100	24,943,941.00	0.97
40	002192	融捷股份	160,300	24,638,110.00	0.96
41	002326	永太科技	746,912	24,595,812.16	0.96
42	300009	安科生物	2,428,600	24,553,146.00	0.96
43	03690	美团-W	141,900	23,566,453.73	0.92
44	002129	TCL 中环	392,700	23,126,103.00	0.90
45	600998	九州通	1,893,700	22,553,967.00	0.88
46	600039	四川路桥	1,959,616	20,634,756.48	0.81
47	000739	普洛药业	995,200	20,540,928.00	0.80
48	02020	安踏体育	247,200	20,379,246.12	0.80
49	000762	西藏矿业	364,200	20,369,706.00	0.80
50	603345	安井食品	120,000	20,144,400.00	0.79
51	002353	杰瑞股份	488,400	19,682,520.00	0.77
52	603077	和邦生物	4,543,600	19,355,736.00	0.76
53	600096	云天化	577,684	18,185,492.32	0.71
54	688301	奕瑞科技	38,271	18,103,713.84	0.71
55	600958	东方证券	1,729,176	17,654,886.96	0.69
56	000776	广发证券	919,363	17,192,088.10	0.67
57	000568	泸州老窖	69,300	17,085,222.00	0.67
58	00558	力劲科技	1,192,500	15,297,211.13	0.60
59	600989	宝丰能源	921,072	13,493,704.80	0.53
60	603198	迎驾贡酒	194,500	12,669,730.00	0.49
61	300428	立中集团	354,700	11,722,835.00	0.46
62	001965	招商公路	1,501,981	11,460,115.03	0.45
63	300073	当升科技	117,100	10,578,814.00	0.41

64	688800	瑞可达	79,969	10,100,884.39	0.39
65	300373	扬杰科技	139,186	9,917,002.50	0.39
66	000938	紫光股份	451,500	8,759,100.00	0.34
67	002906	华阳集团	190,600	8,636,086.00	0.34
68	002960	青鸟消防	300,200	8,222,478.00	0.32
69	300568	星源材质	166,047	4,822,004.88	0.19
70	688349	三一重能	32,650	1,206,091.00	0.05
71	688048	长光华芯	6,790	760,276.30	0.03
72	688331	荣昌生物	15,915	683,390.10	0.03
73	688176	亚虹医药	37,990	476,014.70	0.02
74	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
75	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.01
76	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
77	688259	创耀科技	1,595	126,355.90	0.00
78	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
79	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
80	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.00
81	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
82	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
83	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
84	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
85	301109	军信股份	1,837	29,649.18	0.00
86	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
87	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
88	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
89	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
90	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
91	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
92	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
93	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
94	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
95	301248	杰创智能	516	15,539.20	0.00
96	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
97	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
98	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
99	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
100	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
101	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
102	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
103	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
104	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
105	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00

106	301133	金钟股份	86	2,388.22	0.00
107	301111	粤万年青	79	2,166.18	0.00
108	301100	风光股份	99	2,136.42	0.00
109	603215	比依股份	75	1,580.25	0.00
110	301063	海锅股份	53	1,476.58	0.00
111	301185	鸥玛软件	78	1,442.22	0.00
112	301079	邵阳液压	40	992.00	0.00
113	301198	喜悦智行	40	902.00	0.00
114	301078	孩子王	56	820.96	0.00
115	301092	争光股份	23	723.58	0.00
116	688722	同益中	43	719.82	0.00
117	301118	恒光股份	15	645.45	0.00
118	301083	百胜智能	16	223.36	0.00
119	301199	迈赫股份	2	64.08	0.00
120	301081	严牌股份	3	45.24	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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	351,464,151.43	11.66
2	01800	中国交通建设	122,456,269.76	4.06
3	601800	中国交建	134,700,805.77	4.47
4	601012	隆基绿能	207,626,517.19	6.89
5	600048	保利发展	196,529,492.68	6.52
6	300274	阳光电源	192,596,525.57	6.39
7	603606	东方电缆	158,107,878.25	5.24
8	002475	立讯精密	148,650,735.94	4.93
9	601658	邮储银行	140,578,272.69	4.66
10	002192	融捷股份	138,532,398.27	4.60
11	300122	智飞生物	131,347,920.65	4.36
12	600383	金地集团	127,192,008.00	4.22
13	002371	北方华创	126,684,576.81	4.20
14	000762	西藏矿业	116,531,117.79	3.87
15	300207	欣旺达	108,918,516.99	3.61
16	601088	中国神华	106,145,182.77	3.52
17	600519	贵州茅台	105,822,130.00	3.51
18	600522	中天科技	102,416,532.47	3.40
19	600887	伊利股份	101,726,479.22	3.37
20	600919	江苏银行	101,057,545.92	3.35
21	002240	盛新锂能	100,735,755.84	3.34
22	000002	万科 A	95,712,759.00	3.17

23	601155	新城控股	92,625,571.68	3.07
24	300088	长信科技	89,419,421.24	2.97
25	300347	泰格医药	86,924,458.95	2.88
26	001979	招商蛇口	86,889,464.00	2.88
27	600111	北方稀土	86,242,875.83	2.86
28	002459	晶澳科技	86,138,923.05	2.86
29	300496	中科创达	82,503,455.01	2.74
30	300073	当升科技	81,522,093.21	2.70
31	002460	赣锋锂业	78,990,398.68	2.62
32	603596	伯特利	76,532,740.19	2.54
33	002821	凯莱英	75,895,636.51	2.52
34	601006	大秦铁路	73,712,318.60	2.45
35	300373	扬杰科技	73,484,706.53	2.44
36	000895	双汇发展	67,099,813.10	2.23
37	600958	东方证券	66,948,386.40	2.22
38	300144	宋城演艺	66,378,419.66	2.20
39	600188	兖矿能源	65,844,920.51	2.18
40	002142	宁波银行	64,507,491.20	2.14
41	002714	牧原股份	64,304,965.46	2.13
42	600487	亨通光电	63,784,426.48	2.12
43	300919	中伟股份	63,440,246.63	2.10
44	601668	中国建筑	62,670,146.23	2.08
45	601669	中国电建	62,658,775.15	2.08
46	601857	中国石油	62,654,133.00	2.08
47	300311	任子行	62,466,119.30	2.07
48	000776	广发证券	61,223,777.15	2.03

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	320,877,211.20	10.64
2	01800	中国交通建设	108,077,458.65	3.59
3	601800	中国交建	111,907,668.08	3.71
4	601012	隆基绿能	191,863,560.10	6.36
5	300274	阳光电源	182,305,195.12	6.05
6	002371	北方华创	150,820,664.57	5.00
7	601658	邮储银行	139,356,797.05	4.62
8	600048	保利发展	137,528,616.57	4.56
9	002192	融捷股份	128,652,620.11	4.27
10	600383	金地集团	120,305,765.84	3.99
11	002475	立讯精密	114,568,527.06	3.80

12	300207	欣旺达	113,068,381.04	3.75
13	601088	中国神华	109,965,701.31	3.65
14	300373	扬杰科技	109,901,896.67	3.65
15	000762	西藏矿业	108,889,299.08	3.61
16	002460	赣锋锂业	107,675,404.00	3.57
17	300014	亿纬锂能	104,581,546.29	3.47
18	002240	盛新锂能	103,962,218.58	3.45
19	600188	兖矿能源	101,928,913.80	3.38
20	600919	江苏银行	100,323,229.94	3.33
21	002472	双环传动	99,311,096.71	3.29
22	601155	新城控股	96,710,137.11	3.21
23	600522	中天科技	96,379,997.64	3.20
24	002459	晶澳科技	91,868,677.84	3.05
25	002648	卫星化学	91,253,246.60	3.03
26	600519	贵州茅台	91,116,798.64	3.02
27	002271	东方雨虹	90,907,002.64	3.02
28	000002	万科 A	89,687,023.00	2.98
29	603606	东方电缆	87,351,361.10	2.90
30	001979	招商蛇口	86,785,279.50	2.88
31	300088	长信科技	86,528,443.40	2.87
32	603806	福斯特	86,283,194.34	2.86
33	002714	牧原股份	78,995,804.32	2.62
34	600111	北方稀土	78,184,124.26	2.59
35	601006	大秦铁路	76,161,002.00	2.53
36	03898	时代电气	22,768,250.76	0.76
37	688187	时代电气	52,961,501.96	1.76
38	002821	凯莱英	74,643,663.33	2.48
39	603259	药明康德	74,396,022.11	2.47
40	002841	视源股份	74,038,152.71	2.46
41	603690	至纯科技	73,048,880.83	2.42
42	300059	东方财富	72,941,821.62	2.42
43	300122	智飞生物	71,499,677.60	2.37
44	300073	当升科技	69,283,146.82	2.30
45	002008	大族激光	68,990,609.77	2.29
46	000895	双汇发展	68,192,150.20	2.26
47	300311	任子行	66,213,026.95	2.20
48	600887	伊利股份	65,930,943.94	2.19
49	300433	蓝思科技	65,632,596.83	2.18
50	600535	天士力	65,036,875.58	2.16
51	300182	捷成股份	64,752,469.96	2.15
52	002142	宁波银行	64,749,058.39	2.15
53	601888	中国中免	64,412,709.72	2.14

54	601668	中国建筑	64,179,273.54	2.13
55	300919	中伟股份	61,388,360.47	2.04
56	300595	欧普康视	60,824,125.72	2.02

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,564,482,763.09
卖出股票收入（成交）总额	10,195,989,194.02

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

注：本报告期末本基金未持有债券投资。

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

注：本报告期末本基金未持有债券投资。

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 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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

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	1,596,069.02
2	应收清算款	-
3	应收股利	659,042.59
4	应收利息	-
5	应收申购款	155,078.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,410,189.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末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 (%)
平安优质 企业混合 A	18,482	149,412.19	18,614,899.93	0.67	2,742,821,110.83	99.33
平安优质 企业混合 C	9,715	11,079.57	-	-	107,637,993.17	100.00
合计	28,059	102,251.47	18,614,899.93	0.65	2,850,459,104.00	99.35

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	平安优质企业混合 A	359,296.05	0.0130
	平安优质企业混合 C	116,299.91	0.1080
	合计	475,595.96	0.0166

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	平安优质企业混合 A	0
	平安优质企业混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安优质企业混合 A	10~50
	平安优质企业混合 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C
基金合同生效日 (2021年7月19日) 基金份额总额	3,196,560,278.64	144,389,341.91
本报告期期初基金份额总额	3,027,073,092.37	118,565,893.17
本报告期基金总申购份额	12,918,120.55	6,388,574.55
减：本报告期基金总赎回份额	278,555,202.16	17,316,474.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,761,436,010.76	107,637,993.17

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	4	1,808,854,808.40	8.72	1,318,626.00	8.22	-
国泰君安证券	2	1,759,212,857.78	8.48	1,259,171.89	7.85	-
国盛证券	2	1,673,499,338.11	8.07	1,192,981.76	7.44	-
浙商证券	2	1,503,977,625.50	7.25	1,075,919.37	6.71	-
国海证券	1	1,456,192,438.21	7.02	1,038,561.56	6.48	-
申万宏源证券	2	1,439,872,932.28	6.94	1,340,952.64	8.36	-

中国国际金融股份有限公司	2	1,438,811,305.88	6.94	1,341,941.24	8.37	-
长江证券	1	1,310,419,059.88	6.32	945,301.01	5.90	-
华泰证券	3	1,224,246,974.94	5.90	876,017.27	5.46	-
招商证券	2	1,195,371,447.00	5.76	1,119,920.22	6.98	-
中信建投证券	1	1,040,881,628.04	5.02	780,755.81	4.87	-
兴业证券	2	846,440,297.86	4.08	626,278.05	3.91	-
广发证券	3	767,052,986.05	3.70	714,357.69	4.46	-
东方证券	3	748,930,736.60	3.61	547,693.06	3.42	-
中信证券	2	646,028,419.80	3.11	472,440.15	2.95	-
西南证券	1	603,929,213.75	2.91	431,425.45	2.69	-
民生证券	1	453,265,758.00	2.19	331,466.72	2.07	-
国信证券	2	387,512,613.51	1.87	283,386.02	1.77	-
国联证券	1	322,722,895.69	1.56	232,777.72	1.45	新增
银河证券	2	112,086,205.28	0.54	104,386.29	0.65	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	新增 2个
国金证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海华信证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
安信证券	-	-	266,400,000.00	100.00	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海华信 证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财 证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下证券投资基金实施新会计准则等相关事宜的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 01 日
2	平安基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“平安基金”名义进行诈骗的风险提示	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 12 日
3	平安优质企业混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 21 日
4	平安基金管理有限公司关于新增东吴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	2022 年 03 月 07 日
5	平安优质企业混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 03 月 29 日
6	平安基金管理有限公司关于调整公司旗下公募基金产品风险评级相关事项的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 02 日
7	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 13 日
8	平安优质企业混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 21 日
9	平安基金管理有限公司关于新增深圳新华信通基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 22 日
10	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 29 日

	为销售机构的公告		
11	平安基金管理有限公司关于上海攀赢基金销售有限公司新增旗下部分基金为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 05 月 19 日
12	平安优质企业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	2022 年 05 月 30 日
13	平安优质企业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	2022 年 05 月 30 日
14	关于旗下基金在深圳新华信通基金销售有限公司开通费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 05 月 31 日
15	平安基金管理有限公司关于暂停中证金牛（北京）基金销售有限公司、北京微动利基金销售有限公司、喜鹊财富基金销售有限公司、上海挖财基金销售有限公司、大河财富基金销售有限公司销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 06 月 02 日
16	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	2022 年 06 月 08 日
17	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 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优质企业混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安优质企业混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安优质企业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

2022 年 08 月 30 日