

# 平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 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                                | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 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        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 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                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 41        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 42        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 44        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 44        |
| 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   | 44        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 44        |
| 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 .....    | 44        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 44        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 44        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 45        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 45        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 46        |
| 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 .....      | 46        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>46</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>47</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 47        |
| 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 .....      | 47        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 47        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 48        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 52        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>52</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 52        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 53        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 53        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 53        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 53        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                 |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称            | 平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 平安鑫利混合            |                 |
| 基金主代码           | 003626            |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                 |
| 基金合同生效日         | 2016 年 12 月 7 日   |                 |
| 基金管理人           | 平安基金管理有限公司        |                 |
| 基金托管人           | 平安银行股份有限公司        |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 45,694,853.52 份   |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 平安鑫利混合 A          | 平安鑫利混合 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 003626            | 006433          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 13,157,466.45 份   | 32,537,387.07 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在严格控制风险的基础上，本基金通过灵活的资产配置，力求在有效分散风险的同时实现基金资产的长期稳健增值。              |
| 投资策略   | 本基金转型为开放式基金后，将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%                                  |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。                  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人                           | 基金托管人                         |
|---------|---------------------------------|-------------------------------|
| 名称      | 平安基金管理有限公司                      | 平安银行股份有限公司                    |
| 信息披露负责人 | 姓名                              | 李帅帅                           |
|         | 联系电话                            | 0755-25878287                 |
|         | 电子邮箱                            | LISHUAI130@pingan.com.cn      |
| 客户服务电话  | 400-800-4800                    | 95511-3                       |
| 传真      | 0755-23997878                   | 0755-82080387                 |
| 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 | 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号          |
| 办公地址    | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 | 广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 |
| 邮政编码    | 518048                          | 518001                        |
| 法定代表人   | 罗春风                             | 谢永林                           |

## 2.4 信息披露方式

|                       |                            |
|-----------------------|----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称        | 证券时报                       |
| 登载基金中期报告正文的基金管理人互联网网址 | 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |               |
|---------------|-------------------------------------|---------------|
|               | 平安鑫利混合 A                            | 平安鑫利混合 C      |
| 本期已实现收益       | 159,247.11                          | 224,442.60    |
| 本期利润          | 175,545.20                          | 264,969.73    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0133                              | 0.0134        |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.14%                               | 1.16%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.15%                               | 1.10%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)               |               |
|               |                                     |               |
| 期末可供分配利润      | 2,052,376.70                        | 4,822,382.43  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1560                              | 0.1482        |
| 期末基金资产净值      | 15,295,737.60                       | 37,573,070.61 |
| 期末基金份额净值      | 1.1625                              | 1.1548        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)               |               |

|             |        |        |
|-------------|--------|--------|
| 基金份额累计净值增长率 | 19.69% | 11.23% |
|-------------|--------|--------|

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

平安鑫利混合 A

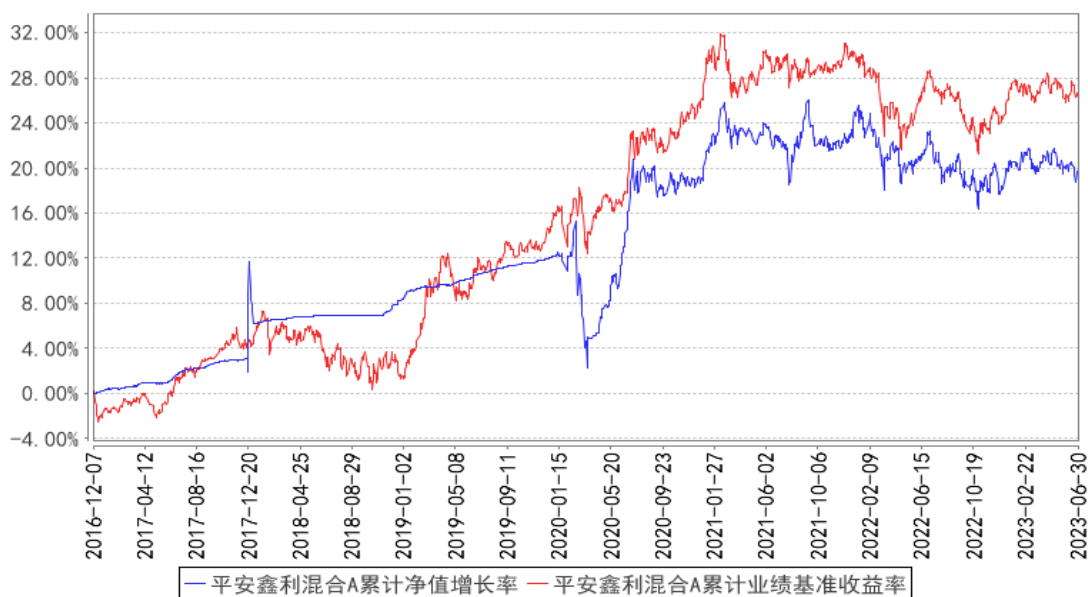
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | -0.39%   | 0.29%       | 0.71%      | 0.25%         | -1.10% | 0.04% |
| 过去三个月      | -0.73%   | 0.27%       | -0.30%     | 0.24%         | -0.43% | 0.03% |
| 过去六个月      | 1.15%    | 0.29%       | 1.76%      | 0.25%         | -0.61% | 0.04% |
| 过去一年       | -2.86%   | 0.35%       | -1.46%     | 0.29%         | -1.40% | 0.06% |
| 过去三年       | 3.73%    | 0.37%       | 7.13%      | 0.36%         | -3.40% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.69%   | 0.36%       | 26.72%     | 0.35%         | -7.03% | 0.01% |

平安鑫利混合 C

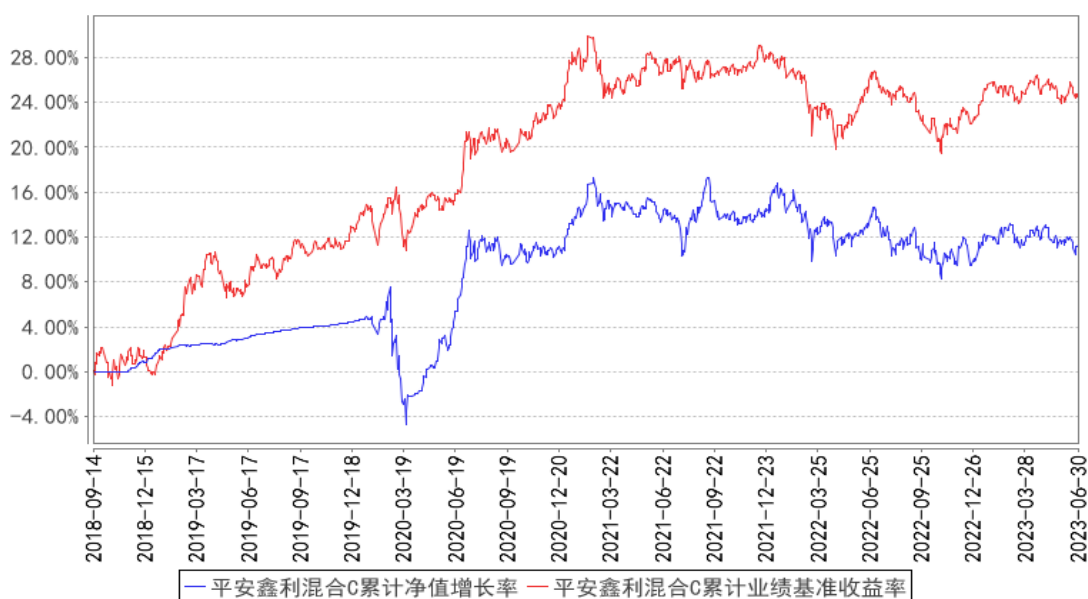
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月      | -0.39%   | 0.29%       | 0.71%      | 0.25%         | -1.10%  | 0.04%  |
| 过去三个月      | -0.75%   | 0.27%       | -0.30%     | 0.24%         | -0.45%  | 0.03%  |
| 过去六个月      | 1.10%    | 0.29%       | 1.76%      | 0.25%         | -0.66%  | 0.04%  |
| 过去一年       | -2.95%   | 0.35%       | -1.46%     | 0.29%         | -1.49%  | 0.06%  |
| 过去三年       | 3.39%    | 0.37%       | 7.13%      | 0.36%         | -3.74%  | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 11.23%   | 0.36%       | 24.80%     | 0.38%         | -13.57% | -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

平安鑫利混合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



平安鑫利混合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 2016 年 12 月 7 日正式生效；  
 2、自 2018 年 9 月 14 日起增设 C 类份额；  
 3、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、海外、专户七大业务板块（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 2023 年 6 月 30 日，平安基金共管理 186 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5,721.58 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 |        |   |
| 刘杰 | 平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2020 年 11 月 30 日 | -    | 15 年   | 刘杰先生，外交学院经济学硕士。曾先后担任金元证券投资银行部项目经理，天弘基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理，英大基金管理有限公司专户投资部投资经理、基金经理等。2017 年 8 月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资研究部投资经理。现担任平安行业先锋混合型证券投资基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安价值回报混合型证券投资基金、平安股息精选沪港深股票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

本期权益仓位重点配置了医药生物、食品饮料、公用事业、消费者服务、交通运输、轻工、机械设备、传媒等方向，仍坚持自下而上为主，持股相对分散。在上半年的实际运作中，我们继续从长期视角、中短期估值以及基本面相对变化的角度出发，对于估值及股息率具有较强吸引力的大金融价值板块继续持有，对于之前受疫情影响较大的可选消费、交通运输、社会服务等品种也持续保持乐观。同时，我们自下而上选取了相当数量的个股品种，加入到我们的组合中。

回顾本期，市场重回主题轮动，人工智能等板块的股价震荡上涨。而本产品继续从估值及基本面出发，维持之前的持仓品种，从业绩确定性及中长期回报角度进行配置，相信随着基本面不断改善，业绩与估值匹配的价值风格会进一步获得市场主流资金认可，力争为持有人创造稳健持续的长期回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安鑫利混合 A 的基金份额净值 1.1625 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.15%,同期业绩比较基准收益率为 1.76%;截至本报告期末平安鑫利混合 C 的基金份额净值 1.1548 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.10%,同期业绩比较基准收益率为 1.76%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为影响 2023 年下半年权益市场定价的主要因素包括国内外经济走势、国际货币环境、国际贸易关系等。权益市场将继续在低估值高股息品种如公用事业、交运、建筑、金融中寻找相对确定的现金回报机会。同时,数字经济、人工智能、智能驾驶、机器人等为代表的创新方向的投资机会也将被继续充分挖掘。同时,受疫情影响的消费股改善空间大,尤其出行链相关板块,业绩修复确定性强,预计也将受到重视。而低估值的以大金融为代表的价值股,基本面也有望受益于经济活动常态化后的逐步回暖,存在较大的估值与业绩修复空间。因此,自上而下我们看好高股息的价值股及创新引领的成长股的投资机会,而消费股及顺周期品种也会因基本面的修复带来投资机会。同时,我们将继续自下而上选取个股品种,加入到组合中,力争为持有人创造稳健持续的长期回报。

#### 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 人的情形。本基金本报

告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末，以上情况已经消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向中国证监会或相关派出机构报告并提出了解决方案。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 16,467,703.29          | 3,619,074.23             |
| 结算备付金      |         | 362,845.14             | 94,912.64                |
| 存出保证金      |         | 15,242.37              | 17,049.61                |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 22,086,845.50          | 30,415,188.42            |
| 其中：股票投资    |         | 11,897,785.23          | 10,179,322.67            |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 10,189,060.27          | 20,235,865.75            |
| 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    | 14,860,101.04             | -                           |
| 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         |            | -                         | 3,855,316.43                |
| 应收股利          |            | -                         | -                           |
| 应收申购款         |            | 10.00                     | 9,338.88                    |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 53,792,747.34             | 38,010,880.21               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2022年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                           |                             |
| 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         |            | 813,597.00                | -                           |
| 应付赎回款         |            | 117.79                    | 10,122.77                   |
| 应付管理人报酬       |            | 18,946.00                 | 19,412.74                   |
| 应付托管费         |            | 3,157.64                  | 3,235.47                    |
| 应付销售服务费       |            | 1,897.89                  | 1,933.37                    |
| 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    | 86,222.81                 | 137,994.49                  |
| 负债合计          |            | 923,939.13                | 172,698.84                  |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 45,694,853.52             | 33,045,397.67               |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 7,173,954.69              | 4,792,783.70                |
| 净资产合计         |            | 52,868,808.21             | 37,838,181.37               |
| 负债和净资产总计      |            | 53,792,747.34             | 38,010,880.21               |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 45,694,853.52 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1625 元，基金份额 13,157,466.45 份；C 类基金份额净值 1.1548 元，基金份额 32,537,387.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | 645,890.38                               | -298,131.37                                   |
| 1. 利息收入                |            | 77,902.82                                | 15,836.80                                     |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13   | 9,452.49                                 | 12,828.58                                     |
| 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             |            | 68,450.33                                | 3,008.22                                      |
| 证券出借利息收入               |            | -  | -   |
| 其他利息收入                 |            | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 510,553.11                               | 165,397.35                                    |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14   | 164,448.14                               | -194,266.72                                   |
| 基金投资收益                 |            | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.15   | 165,606.02                               | 272,450.52                                    |
| 资产支持证券投资               | 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   | 180,498.95                               | 87,213.55                                     |
| 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   | 56,825.22                                | -479,602.04                                   |
| 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   | 609.23                                   | 236.52  |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 205,375.45                               | 254,266.79                                    |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 113,978.71                               | 134,242.14                                    |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 18,996.45                                | 22,373.67                                     |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 11,349.01                                | 14,584.21                                     |
| 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 | 61,051.28  | 83,066.77   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 440,514.93 | -552,398.16 |
| 减：所得税费用             |          | -          | -           |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 440,514.93 | -552,398.16 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -          | -           |
| 六、综合收益总额            |          | 440,514.93 | -552,398.16 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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）      | 33,045,397.67                         | -      | 4,792,783.70 | 37,838,181.37 |
| 加：会计政策变更             | -                                     | -      | -            | -             |
| 前期差错更正               | -                                     | -      | -            | -             |
| 其他                   | -                                     | -      | -            | -             |
| 二、本年期初净资产（基金净值）      | 33,045,397.67                         | -      | 4,792,783.70 | 37,838,181.37 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 12,649,455.85                         | -      | 2,381,170.99 | 15,030,626.84 |
| （一）、综合收益总额           | -                                     | -      | 440,514.93   | 440,514.93    |

|  |                                 |        |               |               |
|--|---------------------------------|--------|---------------|---------------|
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | 12,649,455.85                   | -      | 1,940,656.06  | 14,590,111.91 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 13,262,528.27                   | -      | 2,041,564.77  | 15,304,093.04 |
| 2. 基金赎回款                                 | -613,072.42                     | -      | -100,908.71   | -713,981.13   |
| (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)                          | 45,694,853.52                   | -      | 7,173,954.69  | 52,868,808.21 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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)                          | 51,905,440.09                   | -      | 10,416,929.11 | 62,322,369.20 |
| 加：会计政策变更                                 | -                               | -      | -             | -             |
| 前期差错更正                                   | -                               | -      | -             | -             |



|  |                |   |               |                |
|--|----------------|---|---------------|----------------|
| 其他   | -              | - | -             | -              |
| 二、本<br>期<br>期<br>初<br>净<br>资<br>产<br>（<br>基<br>金<br>净<br>值<br>）  | 51,905,440.09  | - | 10,416,929.11 | 62,322,369.20  |
| 三、本<br>期<br>增<br>减<br>变<br>动<br>额<br>（<br>减<br>少<br>以<br>“-”<br>号<br>填<br>列<br>）   | -18,482,087.92 | - | -3,980,810.64 | -22,462,898.56 |
| （一）、<br>综<br>合<br>收<br>益<br>总<br>额   | -              | - | -552,398.16   | -552,398.16    |
| （二）、本<br>期<br>基<br>金<br>份<br>额<br>交<br>易<br>产<br>生<br>的<br>基<br>金<br>净<br>值<br>变<br>动<br>数<br>（<br>净<br>值<br>减<br>少<br>以<br>“-”<br>号<br>填<br>列<br>）                          | -18,482,087.92 | - | -3,428,412.48 | -21,910,500.40 |
| 其中：1.<br>基<br>金<br>申<br>购<br>款   | 301,195.88     | - | 59,377.98     | 360,573.86     |
| 2.<br>基<br>金<br>赎<br>回<br>款  | -18,783,283.80 | - | -3,487,790.46 | -22,271,074.26 |
| （三）、本<br>期<br>向<br>基<br>金<br>份<br>额<br>持<br>有<br>人<br>分<br>配<br>利<br>润<br>产<br>生<br>的<br>基<br>金<br>净<br>值<br>变<br>动<br>（<br>净<br>值<br>减<br>少<br>以<br>“-”<br>号<br>填<br>列<br>） | -              | - | -             | -              |
| （四）、其<br>他<br>综<br>合<br>收<br>益<br>结<br>转<br>留<br>存<br>收<br>益   | -              | - | -             | -              |
| 四、本<br>期<br>期<br>末<br>净<br>资<br>产  | 33,423,352.17  | - | 6,436,118.47  | 39,859,470.64  |

|             |  |  |  |  |
|-------------|--|--|--|--|
| 产（基金<br>净值） |  |  |  |  |
|-------------|--|--|--|--|

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：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>罗春风</u> | <u>林婉文</u> | <u>张南南</u> |
| 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

平安鑫利灵活配置混合证券投资基金（原名为平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）是根据原平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“平安大华鑫利定期开放基金”）《平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，由平安大华鑫利定期开放基金转型而来。原平安大华鑫利定期开放基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，原平安大华鑫利定期开放基金的第二次开放期自 2017 年 12 月 14 日起至 2017 年 12 月 20 日止，因在第二次开放期最后一日终触发本基金的转型条件，本基金自 2018 年 1 月 19 日起正式转型为平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》，平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金。

根据《平安鑫利灵活配置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《平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、衍生工具（权证、股指期货、国债期货等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、

分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具,以及法律法规或中国证监会允许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:封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%;债券资产占基金资产的比例范围为 0%-100%;开放期内或按照《基金合同》的约定,本基金转型为开放式基金后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%;投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。在封闭期内,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;开放期内或转型为开放式基金后,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计、与最近一期的年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）及地方教育费附加。

### （4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

### （5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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<br>2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 16,467,703.29          |
| 等于：本金          | 16,467,341.43          |
| 加：应计利息         | 361.86                 |
| 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             | 16,467,703.29          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |               |               |               |          |
|---------------|------------------------|---------------|---------------|---------------|----------|
|               | 成本                     | 应计利息          | 公允价值          | 公允价值变动        |          |
| 股票            | 12,038,811.08          | -             | 11,897,785.23 | -141,025.85   |          |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -             | -             | -             |          |
| 债券            | 交易所市场                  | -             | -             | -             |          |
|               | 银行间市场                  | 10,042,980.00 | 142,060.27    | 10,189,060.27 | 4,020.00 |
|               | 合计                     | 10,042,980.00 | 142,060.27    | 10,189,060.27 | 4,020.00 |
| 资产支持证券        | -                      | -             | -             | -             |          |

|    |               |            |               |             |
|----|---------------|------------|---------------|-------------|
| 基金 | -             | -          | -             | -           |
| 其他 | -             | -          | -             | -           |
| 合计 | 22,081,791.08 | 142,060.27 | 22,086,845.50 | -137,005.85 |

### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2023年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 14,860,101.04     | -         |
| 银行间市场 | -                 | -         |
| 合计    | 14,860,101.04     | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从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<br>2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 34,771.53         |
| 其中：交易所市场    | 34,421.53         |
| 银行间市场       | 350.00            |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 51,451.28         |
| 合计          | 86,222.81         |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 平安鑫利混合 A

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |               |
|---------------|----------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额          |
| 上年度末          | 13,248,153.94              | 13,248,153.94 |
| 本期申购          | 3,316.06                   | 3,316.06      |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -94,003.55                 | -94,003.55    |
| 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           | 13,157,466.45              | 13,157,466.45 |

## 平安鑫利混合 C

| 项目   | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |               |
|------|----------------------------|---------------|
|      | 基金份额（份）                    | 账面金额          |
| 上年度末 | 19,797,243.73              | 19,797,243.73 |
| 本期申购 | 13,259,212.21              | 13,259,212.21 |



|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -519,068.87   | -519,068.87   |
| 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           | 32,537,387.07 | 32,537,387.07 |

#### 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

##### 平安鑫利混合 A

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分     | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|-----------|--------------|
| 上年度末           | 1,906,847.68 | 70,938.53 | 1,977,786.21 |
| 本期利润           | 159,247.11   | 16,298.09 | 175,545.20   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -13,718.09   | -1,342.17 | -15,060.26   |
| 其中：基金申购款       | 511.91       | 51.26     | 563.17       |
| 基金赎回款          | -14,230.00   | -1,393.43 | -15,623.43   |
| 本期已分配利润        | -            | -         | -            |
| 本期末            | 2,052,376.70 | 85,894.45 | 2,138,271.15 |

##### 平安鑫利混合 C

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分      | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|------------|--------------|
| 上年度末           | 2,708,389.47 | 106,608.02 | 2,814,997.49 |
| 本期利润           | 224,442.60   | 40,527.13  | 264,969.73   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,889,550.36 | 66,165.96  | 1,955,716.32 |
| 其中：基金申购款       | 1,965,184.11 | 75,817.49  | 2,041,001.60 |
| 基金赎回款          | -75,633.75   | -9,651.53  | -85,285.28   |
| 本期已分配利润        | -            | -          | -            |
| 本期末            | 4,822,382.43 | 213,301.11 | 5,035,683.54 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 8,019.21                        |
| 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 | 1,291.43                        |
| 其他        | 141.85                          |
| 合计        | 9,452.49                        |

## 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 164,448.14                 |
| 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               | 164,448.14                 |

## 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 43,342,530.32              |
| 减：卖出股票成本总额 | 43,064,157.76              |
| 减：交易费用     | 113,924.42                 |
| 买卖股票差价收入   | 164,448.14                 |

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——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

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 172,726.02                 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -7,120.00                  |
| 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                           | 165,606.02                 |

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 20,352,360.27 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 20,004,670.00 |
| 减：应计利息总额               | 354,460.27    |
| 减：交易费用                 | 350.00        |
| 买卖债券差价收入               | -7,120.00     |

#### 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赎回差价收入。

#### 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申购差价收入。

#### 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——买卖权证差价收入。

#### 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——其他投资收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |
|---------------|----------------------|
|               | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 180,498.95           |
| 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            | 180,498.95           |

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产             | 56,825.22            |
| 股票投资                   | 36,135.22            |
| 债券投资                   | 20,690.00            |
| 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                     | 56,825.22            |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 609.23               |
| 合计      | 609.23               |

#### 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                   |
|------|----------------------|
|      | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 审计费用 | 17,356.09            |

|         |           |
|---------|-----------|
| 信息披露费   | 24,795.19 |
| 证券出借违约金 | -         |
| 账户维护费   | 18,000.00 |
| 其他      | 900.00    |
| 合计      | 61,051.28 |

#### 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。

#### 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         |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”）       | 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         |
| 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               |
| 方正证券股份有限公司（“方正证券”）       | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司        |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                          | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                          |
|-------|----------------------------|--------------------------|---------------------------------|--------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 (%) | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 (%) |
| 方正证券  | 5,028,459.37               | 5.71                     | -                               | -                        |

## 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

## 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日      |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 方正证券  | 3,626.90                        | 5.70               | 3,626.90     | 10.54                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| -     | -                               | -                  | -            | -                    |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 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  | 113,978.71                      | 134,242.14                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,206.32                        | 6,503.21                        |

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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 | 18,996.45                             | 22,373.67                                  |

注：支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日      |           |           |
|----------------|--|-----------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |           |           |
|                | 平安鑫利混合 A                                   | 平安鑫利混合 C  | 合计        |
| 陆基金            | -  | 735.27    | 735.27    |
| 平安基金           | -  | 10,278.81 | 10,278.81 |
| 平安人寿           | -  | 207.28    | 207.28    |
| 平安银行           | -  | 1.81      | 1.81      |
| 合计             | -  | 11,223.17 | 11,223.17 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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                           |           |           |
|                | 平安鑫利混合 A                                   | 平安鑫利混合 C  | 合计        |
| 陆基金            | -  | 1,669.43  | 1,669.43  |
| 平安基金           | -  | 12,437.00 | 12,437.00 |
| 平安人寿           | -  | 274.64    | 274.64    |

|      |   |           |           |
|------|---|-----------|-----------|
| 平安银行 | - | 57.92     | 57.92     |
| 合计   | - | 14,438.99 | 14,438.99 |

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 0.1% 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 × 0.1% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>6 月 30 日 | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月<br>30 日 |
|---------------------------------|--|--|
|                                 | 平安鑫利混合 A                                 | 平安鑫利混合 C                                 |
| 基金合同生效日（2016 年 12 月 7 日）持有的基金份额 | -  | -  |
| 报告期初持有的基金份额                     | -  | 0.00                                     |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -  | 8,666,262.24                             |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -  | 0.00                                     |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | -  | 0.00                                     |
| 报告期末持有的基金份额                     | -  | 8,666,262.24                             |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | -  | 26.6348%                                 |
| 项目                              | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年        | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月    |



|                            | 6月30日    | 30日      |
|----------------------------|----------|----------|
|                            | 平安鑫利混合 A | 平安鑫利混合 C |
| 基金合同生效日（2016年12月7日）持有的基金份额 | -        | -        |
| 报告期初持有的基金份额                | -        | -        |
| 报告期间申购/买入总份额               | -        | -        |
| 报告期间因拆分变动份额                | -        | -        |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额             | -        | -        |
| 报告期末持有的基金份额                | -        | -        |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | -        | -        |

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

##### 平安鑫利混合 C

| 关联方名称 | 本期末<br>2023年6月30日 |                             | 上年度末<br>2022年12月31日 |                             |
|-------|-------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额       | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例（%） | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例（%） |
| 平安汇通  | 22,104,134.89     | 67.9346                     | 17,746,001.60       | 89.6387                     |

#### 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |           |
|---------|----------------------------|----------|---------------------------------|-----------|
|         | 期末余额                       | 当期利息收入   | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 平安银行-活期 | 16,467,703.29              | 8,019.21 | 3,040,919.25                    | 11,431.56 |

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用

风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

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<br>2023 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                   | 16,467,703.29 | -     | -     | -   | 16,467,703.29 |
| 结算备付金                  | 362,845.14    | -     | -     | -   | 362,845.14    |

|                          |               |       |       |               |               |
|--------------------------|---------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 存出保证金                    | 15,242.37     | -     | -     | -             | 15,242.37     |
| 交易性金融资产                  | 10,189,060.27 | -     | -     | 11,897,785.23 | 22,086,845.50 |
| 买入返售金融资产                 | 14,860,101.04 | -     | -     | -             | 14,860,101.04 |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 10.00         | 10.00         |
| 资产总计                     | 41,894,952.11 | -     | -     | 11,897,795.23 | 53,792,747.34 |
| 负债                       |               |       |       |               |               |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 117.79        | 117.79        |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 18,946.00     | 18,946.00     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 3,157.64      | 3,157.64      |
| 应付清算款                    | -             | -     | -     | 813,597.00    | 813,597.00    |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 1,897.89      | 1,897.89      |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 86,222.81     | 86,222.81     |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 923,939.13    | 923,939.13    |
| 利率敏感度缺口                  | 41,894,952.11 | -     | -     | 10,973,856.10 | 52,868,808.21 |
| 上年度末<br>2022 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                     | 3,619,074.23  | -     | -     | -             | 3,619,074.23  |
| 结算备付金                    | 94,912.64     | -     | -     | -             | 94,912.64     |
| 存出保证金                    | 17,049.61     | -     | -     | -             | 17,049.61     |
| 交易性金融资产                  | 20,235,865.75 | -     | -     | 10,179,322.67 | 30,415,188.42 |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 9,338.88      | 9,338.88      |
| 应收清算款                    | -             | -     | -     | 3,855,316.43  | 3,855,316.43  |
| 资产总计                     | 23,966,902.23 | -     | -     | 14,043,977.98 | 38,010,880.21 |
| 负债                       |               |       |       |               |               |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 10,122.77     | 10,122.77     |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 19,412.74     | 19,412.74     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 3,235.47      | 3,235.47      |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 1,933.37      | 1,933.37      |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 137,994.49    | 137,994.49    |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 172,698.84    | 172,698.84    |
| 利率敏感度缺口                  | 23,966,902.23 | -     | -     | 13,871,279.14 | 37,838,181.37 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 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（2023 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |

|                  |   |            |
|------------------|---|------------|
| 市场利率上升 25<br>个基点 | - | -16,706.88 |
| 市场利率下降 25<br>个基点 | - | 16,735.37  |

注：于本期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为：19.27%（上年末：53.48%），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：敏感性见上表数据）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 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<br>2023年6月30日 |                  | 上年度末<br>2022年12月31日 |                  |
|---------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 11,897,785.23     | 22.50            | 10,179,322.67       | 26.90            |
| 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 | 11,897,785.23 | 22.50 | 10,179,322.67 | 26.90 |

#### 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（2023 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 沪深 300 指数上升<br>5%         | 602,691.90                  | 508,845.48             |
|    | 沪深 300 指数下降<br>5%         | -602,691.90                 | -508,845.48            |

#### 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<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 11,897,785.23          | 10,179,322.67            |
| 第二层次          | 10,189,060.27          | 20,235,865.75            |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 22,086,845.50          | 30,415,188.42            |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于

交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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              | 11,897,785.23 | 22.12         |
|    | 其中：股票             | 11,897,785.23 | 22.12         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 10,189,060.27 | 18.94         |
|    | 其中：债券             | 10,189,060.27 | 18.94         |
|    | 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          | 14,860,101.04 | 27.62         |
|    | 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      | 16,830,548.43 | 31.29         |
| 8  | 其他各项资产            | 15,252.37     | 0.03          |
| 9  | 合计                | 53,792,747.34 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别     | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | 253,230.00 | 0.48          |



|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| B | 采矿业              | -             | -     |
| C | 制造业              | 6,806,126.83  | 12.87 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 607,869.00    | 1.15  |
| E | 建筑业              | -             | -     |
| F | 批发和零售业           | -             | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 402,157.00    | 0.76  |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 248,452.00    | 0.47  |
| J | 金融业              | 976,374.40    | 1.85  |
| K | 房地产业             | 353,615.00    | 0.67  |
| L | 租赁和商务服务业         | 581,802.00    | 1.10  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 123,904.00    | 0.23  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 477,371.00    | 0.90  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -     |
| P | 教育               | 170,237.00    | 0.32  |
| Q | 卫生和社会工作          | 182,727.00    | 0.35  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 713,920.00    | 1.35  |
| S | 综合               | -             | -     |
|   | 合计               | 11,897,785.23 | 22.50 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量<br>(股) | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-----------|------------|------------------|
| 1  | 000651 | 格力电器 | 16,200    | 591,462.00 | 1.12             |
| 2  | 603518 | 锦泓集团 | 44,100    | 500,535.00 | 0.95             |
| 3  | 600027 | 华电国际 | 73,100    | 489,039.00 | 0.93             |
| 4  | 601601 | 中国太保 | 17,700    | 459,846.00 | 0.87             |
| 5  | 300181 | 佐力药业 | 34,300    | 418,803.00 | 0.79             |
| 6  | 600079 | 人福医药 | 13,700    | 369,078.00 | 0.70             |
| 7  | 002867 | 周大生  | 20,500    | 364,490.00 | 0.69             |
| 8  | 002027 | 分众传媒 | 52,000    | 354,120.00 | 0.67             |
| 9  | 600325 | 华发股份 | 35,900    | 353,615.00 | 0.67             |
| 10 | 600004 | 白云机场 | 24,000    | 344,160.00 | 0.65             |
| 11 | 002345 | 潮宏基  | 43,400    | 341,124.00 | 0.65             |
| 12 | 688626 | 翔宇医疗 | 7,383     | 336,000.33 | 0.64             |
| 13 | 002422 | 科伦药业 | 11,300    | 335,384.00 | 0.63             |
| 14 | 603208 | 江山欧派 | 8,970     | 326,687.40 | 0.62             |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 15 | 601577 | 长沙银行 | 38,100 | 295,656.00 | 0.56 |
| 16 | 600419 | 天润乳业 | 18,100 | 293,582.00 | 0.56 |
| 17 | 002959 | 小熊电器 | 3,200  | 267,200.00 | 0.51 |
| 18 | 300498 | 温氏股份 | 13,800 | 253,230.00 | 0.48 |
| 19 | 002007 | 华兰生物 | 11,200 | 250,992.00 | 0.47 |
| 20 | 603466 | 风语筑  | 18,000 | 250,200.00 | 0.47 |
| 21 | 000528 | 柳工   | 31,600 | 249,640.00 | 0.47 |
| 22 | 300349 | 金卡智能 | 17,900 | 248,452.00 | 0.47 |
| 23 | 601827 | 三峰环境 | 32,800 | 242,720.00 | 0.46 |
| 24 | 605499 | 东鹏饮料 | 1,400  | 242,060.00 | 0.46 |
| 25 | 300294 | 博雅生物 | 6,600  | 239,448.00 | 0.45 |
| 26 | 600572 | 康恩贝  | 34,700 | 237,695.00 | 0.45 |
| 27 | 002159 | 三特索道 | 12,900 | 234,651.00 | 0.44 |
| 28 | 601098 | 中南传媒 | 20,200 | 234,320.00 | 0.44 |
| 29 | 300144 | 宋城演艺 | 18,500 | 229,400.00 | 0.43 |
| 30 | 600138 | 中青旅  | 18,200 | 227,682.00 | 0.43 |
| 31 | 600901 | 江苏金租 | 53,480 | 220,872.40 | 0.42 |
| 32 | 603508 | 思维列控 | 12,100 | 206,305.00 | 0.39 |
| 33 | 603439 | 贵州三力 | 10,800 | 184,248.00 | 0.35 |
| 34 | 002044 | 美年健康 | 25,700 | 182,727.00 | 0.35 |
| 35 | 605098 | 行动教育 | 4,300  | 170,237.00 | 0.32 |
| 36 | 600573 | 惠泉啤酒 | 14,300 | 169,455.00 | 0.32 |
| 37 | 603102 | 百合股份 | 3,900  | 168,441.00 | 0.32 |
| 38 | 300452 | 山河药辅 | 9,500  | 165,680.00 | 0.31 |
| 39 | 688793 | 倍轻松  | 2,331  | 125,640.90 | 0.24 |
| 40 | 605167 | 利柏特  | 12,800 | 123,904.00 | 0.23 |
| 41 | 002997 | 瑞鹄模具 | 4,000  | 118,920.00 | 0.22 |
| 42 | 600642 | 申能股份 | 17,000 | 118,830.00 | 0.22 |
| 43 | 600285 | 羚锐制药 | 7,200  | 115,632.00 | 0.22 |
| 44 | 688488 | 艾迪药业 | 8,685  | 106,999.20 | 0.20 |
| 45 | 003011 | 海象新材 | 2,500  | 80,625.00  | 0.15 |
| 46 | 600377 | 宁沪高速 | 5,900  | 57,997.00  | 0.11 |

## 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  | 601601 | 中国太保 | 914,938.00 | 2.42           |
| 2  | 000951 | 中国重汽 | 795,152.00 | 2.10           |
| 3  | 002027 | 分众传媒 | 774,469.00 | 2.05           |
| 4  | 002867 | 周大生  | 760,085.00 | 2.01           |
| 5  | 600079 | 人福医药 | 757,248.00 | 2.00           |
| 6  | 603518 | 锦泓集团 | 692,220.00 | 1.83           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 7  | 600325 | 华发股份 | 680,469.00 | 1.80 |
| 8  | 002154 | 报喜鸟  | 652,156.00 | 1.72 |
| 9  | 600027 | 华电国际 | 628,954.00 | 1.66 |
| 10 | 600419 | 天润乳业 | 626,084.00 | 1.65 |
| 11 | 601628 | 中国人寿 | 618,774.15 | 1.64 |
| 12 | 000651 | 格力电器 | 613,205.00 | 1.62 |
| 13 | 600258 | 首旅酒店 | 613,133.82 | 1.62 |
| 14 | 002304 | 洋河股份 | 603,958.00 | 1.60 |
| 15 | 002422 | 科伦药业 | 600,921.00 | 1.59 |
| 16 | 001979 | 招商蛇口 | 561,253.00 | 1.48 |
| 17 | 601336 | 新华保险 | 540,110.00 | 1.43 |
| 18 | 600901 | 江苏金租 | 524,026.00 | 1.38 |
| 19 | 002959 | 小熊电器 | 521,013.00 | 1.38 |
| 20 | 603208 | 江山欧派 | 520,413.70 | 1.38 |

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额   | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|
| 1  | 002304 | 洋河股份 | 980,046.00 | 2.59           |
| 2  | 601628 | 中国人寿 | 978,360.88 | 2.59           |
| 3  | 001979 | 招商蛇口 | 917,901.00 | 2.43           |
| 4  | 600079 | 人福医药 | 865,289.00 | 2.29           |
| 5  | 600258 | 首旅酒店 | 827,924.00 | 2.19           |
| 6  | 601601 | 中国太保 | 824,306.00 | 2.18           |
| 7  | 000951 | 中国重汽 | 772,854.00 | 2.04           |
| 8  | 603233 | 大参林  | 737,370.00 | 1.95           |
| 9  | 002154 | 报喜鸟  | 726,239.00 | 1.92           |
| 10 | 601111 | 中国国航 | 697,609.00 | 1.84           |
| 11 | 002690 | 美亚光电 | 677,013.40 | 1.79           |
| 12 | 600557 | 康缘药业 | 647,824.00 | 1.71           |
| 13 | 000002 | 万科 A | 641,107.00 | 1.69           |
| 14 | 002959 | 小熊电器 | 589,092.00 | 1.56           |
| 15 | 600161 | 天坛生物 | 585,769.00 | 1.55           |
| 16 | 600419 | 天润乳业 | 569,074.00 | 1.50           |
| 17 | 600612 | 老凤祥  | 560,947.00 | 1.48           |
| 18 | 002352 | 顺丰控股 | 521,846.00 | 1.38           |
| 19 | 601336 | 新华保险 | 511,925.00 | 1.35           |
| 20 | 002908 | 德生科技 | 484,784.00 | 1.28           |

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 | 44,746,485.10 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 43,342,530.32 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,189,060.27 | 19.27        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,189,060.27 | 19.27        |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 10,189,060.27 | 19.27        |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 210202 | 21 国开 02 | 100,000 | 10,189,060.27 | 19.27        |

## 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

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，人福医药集团股份公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

#### 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 | 15,242.37 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 10.00     |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 15,252.37 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

#### 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 | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |       |
|------|-------|-----------|-------|-------|
|      |       |           | 机构投资者 | 个人投资者 |
|      |       |           |       |       |

|              | (户)   |           | 持有份额          | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额         | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
|--------------|-------|-----------|---------------|-------------------|--------------|-----------------------|
| 平安鑫利<br>混合 A | 221   | 59,536.05 | 13,059,643.01 | 99.26             | 97,823.44    | 0.74                  |
| 平安鑫利<br>混合 C | 899   | 36,192.87 | 30,770,397.13 | 94.57             | 1,766,989.94 | 5.43                  |
| 合计           | 1,100 | 41,540.78 | 43,830,040.14 | 95.92             | 1,864,813.38 | 4.08                  |

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<br>人所有从<br>业人员持<br>有本基金 | 平安鑫利混合 A | 16,656.12 | 0.1266      |
|                              | 平安鑫利混合 C | 27,205.76 | 0.0836      |
|                              | 合计       | 43,861.88 | 0.0960      |

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、<br>基金投资和研<br>究部门负责<br>人持有本开<br>放式基金 | 平安鑫利混合 A | 0                 |
|  | 平安鑫利混合 C | 0                 |
|  | 合计       | 0                 |
| 本基金基金经<br>理持有本开<br>放式基金                        | 平安鑫利混合 A | 0~10              |
|  | 平安鑫利混合 C | 0~10              |
|  | 合计       | 0~10              |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 平安鑫利混合 A       | 平安鑫利混合 C      |
|--|----------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2016 年 12 月 7<br>日) 基金份额总额 | 200,058,990.97 | -             |
| 本报告期期初基<br>金份额总额                       | 13,248,153.94  | 19,797,243.73 |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 本报告期基金总申购份额   | 3,316.06      | 13,259,212.21 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 94,003.55     | 519,068.87    |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -             | -             |
| 本报告期期末基金份额总额  | 13,157,466.45 | 32,537,387.07 |

## § 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

本基金管理人公司董事杨玉萍女士因工作安排不再出任公司第四届董事会董事，公司股东平安信托有限责任公司根据《公司章程》推荐郭晓涛先生接替杨玉萍女士出任公司董事。经公司 2023 年第二次股东会审议，同意郭晓涛先生出任公司董事，杨玉萍女士不再担任公司董事。上述变更自 2023 年 3 月 17 日公司 2023 年第二次股东会做出决议之日起生效。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本基金聘用安永华明会计师事务所（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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 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 (%) |    |
| 天风证券   | 2      | 22,114,061.22 | 25.10            | 15,948.08 | 25.06          | -  |
| 东吴证券   | 2      | 10,925,286.79 | 12.40            | 7,881.21  | 12.38          | -  |
| 恒泰证券   | 2      | 10,415,480.82 | 11.82            | 7,617.21  | 11.97          | -  |
| 东北证券   | 3      | 9,502,779.77  | 10.79            | 6,854.70  | 10.77          | -  |
| 华创证券   | 2      | 6,302,050.20  | 7.15             | 4,545.28  | 7.14           | -  |
| 开源证券   | 2      | 5,934,682.05  | 6.74             | 4,280.63  | 6.73           | -  |
| 方正证券   | 2      | 5,028,459.37  | 5.71             | 3,626.90  | 5.70           | -  |
| 光大证券   | 2      | 3,625,294.08  | 4.12             | 2,615.21  | 4.11           | -  |
| 中信建投证券 | 2      | 2,415,296.00  | 2.74             | 1,742.27  | 2.74           | -  |
| 中信证券   | 3      | 2,311,848.19  | 2.62             | 1,667.44  | 2.62           | -  |
| 国盛证券   | 1      | 2,239,259.27  | 2.54             | 1,615.03  | 2.54           | -  |
| 西南证券   | 1      | 2,094,607.00  | 2.38             | 1,510.92  | 2.37           | -  |
| 西部证券   | 1      | 1,431,820.66  | 1.63             | 1,032.75  | 1.62           | -  |
| 东兴证券   | 2      | 1,325,672.90  | 1.50             | 956.21    | 1.50           | -  |
| 国信证券   | 2      | 1,221,242.10  | 1.39             | 880.82    | 1.38           | -  |
| 华泰证券   | 2      | 1,131,788.00  | 1.28             | 816.32    | 1.28           | -  |
| 申万宏源证券 | 2      | 69,387.00     | 0.08             | 50.05     | 0.08           | -  |
| 安信证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 渤海证券   | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |



|              |   |   |   |   |   |     |
|--------------|---|---|---|---|---|-----|
| 财通证券         | 2 | - | - | - | - | -   |
| 长江证券         | 1 | - | - | - | - | -   |
| 川财证券         | 1 | - | - | - | - | 已退租 |
| 大通证券         | 2 | - | - | - | - | -   |
| 东方财富证券       | 2 | - | - | - | - | -   |
| 东方证券         | 1 | - | - | - | - | -   |
| 广发证券         | 2 | - | - | - | - | -   |
| 国泰君安证券       | 1 | - | - | - | - | -   |
| 海通证券         | 2 | - | - | - | - | -   |
| 华林证券         | 2 | - | - | - | - | 已退租 |
| 民生证券         | 1 | - | - | - | - | -   |
| 平安证券         | 4 | - | - | - | - | -   |
| 世纪证券         | 2 | - | - | - | - | -   |
| 太平洋证券        | 2 | - | - | - | - | -   |
| 万联证券         | 1 | - | - | - | - | -   |
| 兴业证券         | 1 | - | - | - | - | -   |
| 银河证券         | 2 | - | - | - | - | -   |
| 英大证券         | 1 | - | - | - | - | -   |
| 中国国际金融股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | -   |
| 中泰证券         | 1 | - | - | - | - | -   |
| 中银国际证券       | 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 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 |
|-----|------|--------|------|
|-----|------|--------|------|

| 称      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
|--------|------|------------------|---------------|--------------------|------|------------------|
| 天风证券   | -    | -                | 68,604,000.00 | 36.86              | -    | -                |
| 东吴证券   | -    | -                | 19,032,000.00 | 10.23              | -    | -                |
| 恒泰证券   | -    | -                | 42,602,000.00 | 22.89              | -    | -                |
| 东北证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 华创证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 开源证券   | -    | -                | 23,430,000.00 | 12.59              | -    | -                |
| 方正证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 光大证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 中信建投证券 | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 中信证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 国盛证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 西南证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 西部证券   | -    | -                | 20,963,000.00 | 11.26              | -    | -                |
| 东兴证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 国信证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 华泰证券   | -    | -                | 11,470,000.00 | 6.16               | -    | -                |
| 申万宏源证券 | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 安信证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 渤海证券   | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 财通证    | -    | -                | -             | -                  | -    | -                |

|                          |   |   |   |   |   |   |
|--------------------------|---|---|---|---|---|---|
| 券                        |   |   |   |   |   |   |
| 长江证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 大通证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财<br>富证券               | - | - | - | - | - | - |
| 东方证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君<br>安证券               | - | - | - | - | - | - |
| 海通证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 华林证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋<br>证券                | - | - | - | - | - | - |
| 万联证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 英大证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国<br>际金融<br>股份有<br>限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证<br>券                 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国<br>际证券               | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式       | 法定披露日期           |
|----|---|--------------|------------------|
| 1  | 平安基金管理有限公司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 | 2023 年 01 月 05 日 |
| 2  | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告                        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 01 月 14 日 |
| 3  | 平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 01 月 19 日 |
| 4  | 平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告                    | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 01 月 20 日 |
| 5  | 平安基金管理有限公司关于暂停上海爱建基金销售有限公司办理相关销售业务的公告               | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 02 月 09 日 |
| 6  | 关于暂停浦领基金销售有限公司办理相关销售业务的公告                           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 02 月 13 日 |
| 7  | 平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告                        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 03 月 31 日 |
| 8  | 平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告                    | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 04 月 22 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 | 2023 年 04 月 26 日 |
| 10 | 平安鑫利灵活配置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 | 2023 年 05 月 31 日 |
| 11 | 平安鑫利灵活配置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 | 2023 年 05 月 31 日 |
| 12 | 平安基金管理有限公司关于新增中证金牛(北京)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 | 2023 年 06 月 27 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |              |      | 报告期末持有基金情况    |         |
|-------|----------------|-------------------------|---------------|--------------|------|---------------|---------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额         | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比(%) |
| 机构    | 1              | 2023/01/01-2023/06/30   | 17,746,001.60 | 4,358,133.29 | 0.00 | 22,104,134.89 | 48.37   |

|   |   |                            |                   |      |      |               |       |
|---|---|----------------------------|-------------------|------|------|---------------|-------|
|   | 2 | 2023/01/01-<br>-2023/06/30 | 13,059,64<br>3.01 | 0.00 | 0.00 | 13,059,643.01 | 28.58 |
| 个人  | - | -                          | -                 | -    | -    | -             | -     |
| <b>产品特有风险</b>   |   |                            |                   |      |      |               |       |
| <p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> |   |                            |                   |      |      |               |       |

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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鑫利灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安鑫利灵活配置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

2023 年 8 月 31 日