

平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2

1.2 目录 3

§ 2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5

2.2 基金产品说明 5

2.3 基金管理人和基金托管人 5

2.4 信息披露方式 6

2.5 其他相关资料 6

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6

3.2 基金净值表现 7

3.3 其他指标 9

3.4 过去三年基金的利润分配情况 9

§ 4 管理人报告 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 10

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 12

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13

§ 5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 14

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 14

§ 6 审计报告 14

6.1 审计报告基本信息 14

6.2 审计报告的基本内容 14

§ 7 年度财务报表 16

7.1 资产负债表 16

7.2 利润表 17

7.3 净资产变动表 19

7.4 报表附注 20

§ 8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 投资组合报告附注	62
§ 9 基金份额持有人信息	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	63
§ 10 开放式基金份额变动	64
§ 11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	68
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	69
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	70
13.3 查阅方式	70

§ 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	27,041,504.04 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	399,946.85 份	26,641,557.19 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	李海波	潘琦
	联系电话	0755-88622632	0755-22168257
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	PANQI003@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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	平安鑫利混 合 A	平安鑫利混 合 C	平安鑫利混 合 A	平安鑫利混 合 C	平安鑫利混 合 A	平安鑫利混 合 C
本期已实现收益	35,411.32	1,309,917.47	-499,892.36	-1,735,242.85	-408,785.98	-585,123.49
本期利润	14,421.12	741,661.73	-486,862.38	-1,381,294.85	-744,897.21	-1,392,450.81
加权平均基金份额本期利润	0.0718	0.0227	-0.0394	-0.0525	-0.0562	-0.0632
本期加权平均净值利润率	6.71%	2.12%	-3.42%	-4.62%	-4.79%	-5.41%
本期基金份额净值增长率	1.11%	1.00%	-3.26%	-3.34%	-4.65%	-4.75%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	49,621.15	3,066,003.38	6,894.98	2,846,156.19	1,906,847.68	2,708,389.47
期末可供分配基金份额利润	0.1241	0.1151	0.0956	0.0878	0.1439	0.1368
期末基金资产净值	449,568.00	29,707,560.57	80,215.50	35,773,545.27	15,225,940.15	22,612,241.22
期末基金份	1.1241	1.1151	1.1118	1.1041	1.1493	1.1422

额净值						
3.1.3 累计 期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累 计净值增长 率	15.74%	7.41%	14.47%	6.35%	18.33%	10.02%

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

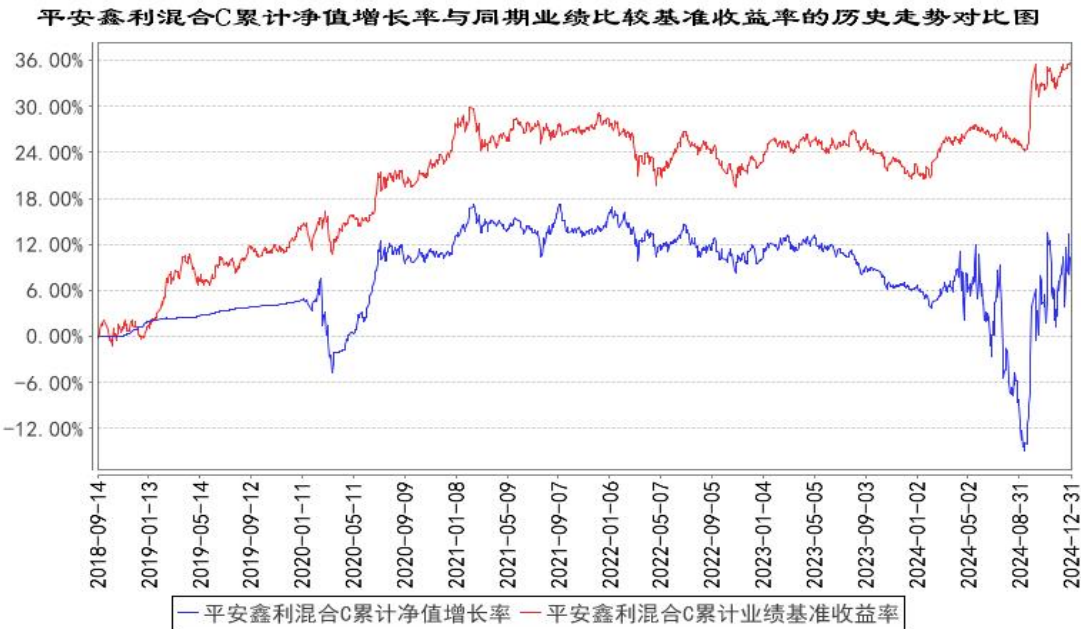
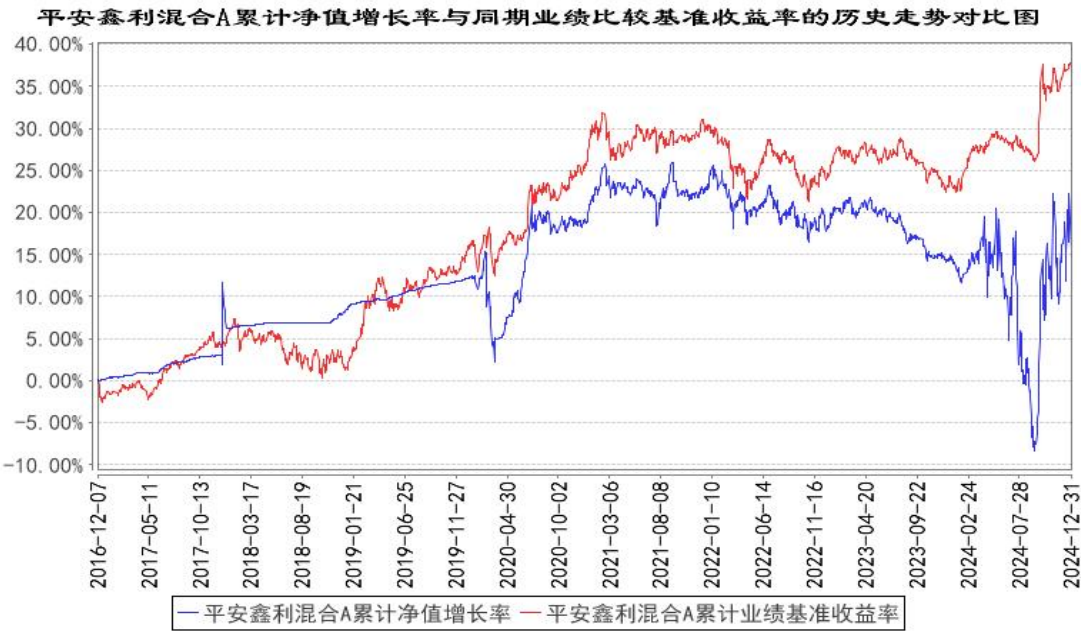
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.44%	2.23%	1.45%	0.52%	1.99%	1.71%
过去六个月	7.28%	2.08%	7.11%	0.48%	0.17%	1.60%
过去一年	1.11%	1.70%	10.41%	0.39%	-9.30%	1.31%
过去三年	-6.74%	1.02%	5.29%	0.35%	-12.03%	0.67%
过去五年	3.19%	0.84%	18.88%	0.36%	-15.69%	0.48%
自基金合同生效 起至今	15.74%	0.68%	37.29%	0.35%	-21.55%	0.33%

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
过去三个月	3.41%	2.23%	1.45%	0.52%	1.96%	1.71%
过去六个月	7.22%	2.08%	7.11%	0.48%	0.11%	1.60%
过去一年	1.00%	1.70%	10.41%	0.39%	-9.41%	1.31%

过去三年	-7.01%	1.02%	5.29%	0.35%	-12.30%	0.67%
过去五年	2.68%	0.84%	18.88%	0.36%	-16.20%	0.48%
自基金合同生效 起至今	7.41%	0.75%	35.21%	0.37%	-27.80%	0.38%

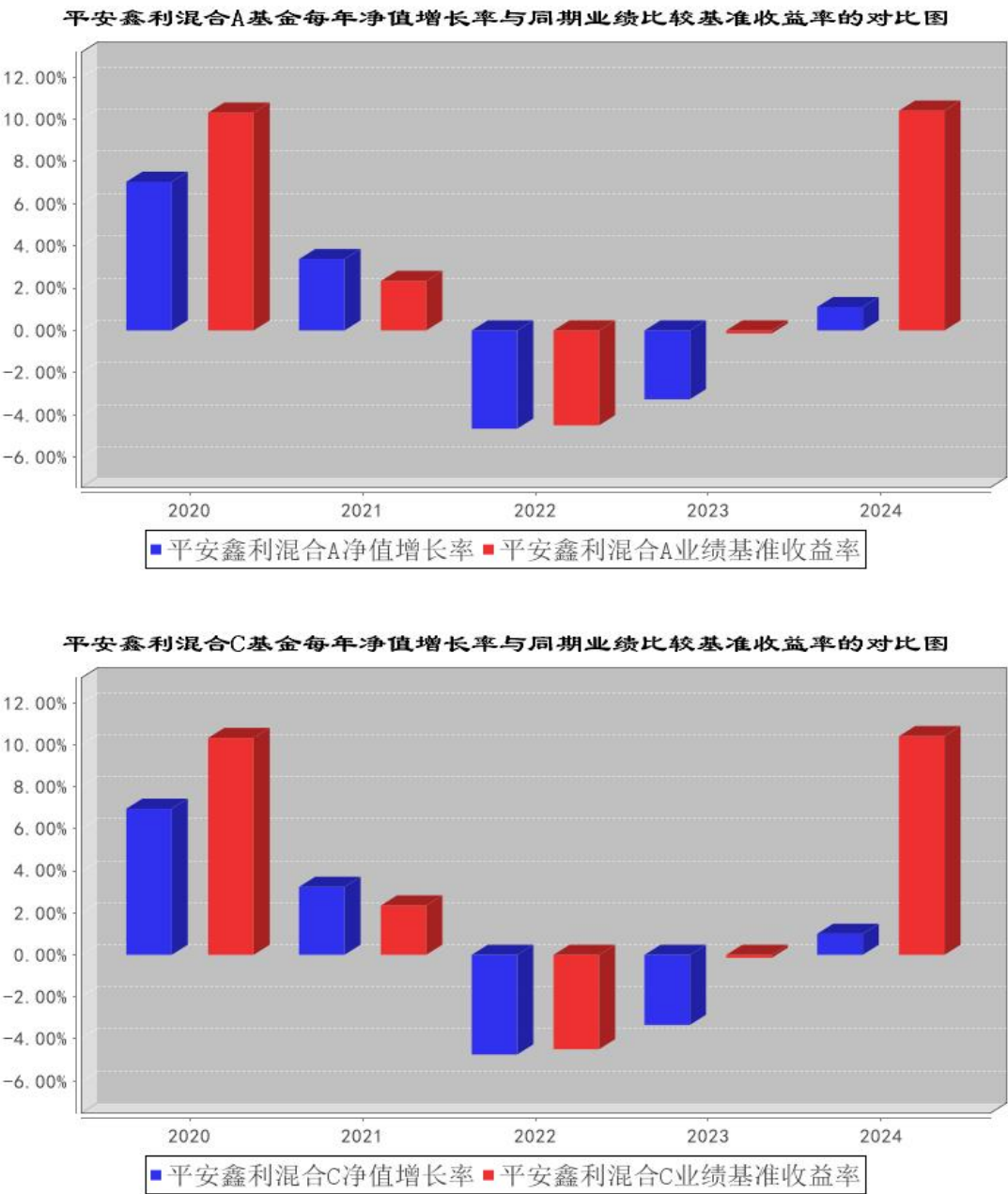
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



- 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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于 2016 年 12 月 07 日正式生效。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过往三年无利润分配情况。

§ 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。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 2024 年 12 月 31 日，平安基金共管理 215 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6371 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		
王华	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2023 年 12 月 25 日	-	14 年	王华先生，哈尔滨工业大学金融学专业硕士，曾担任招商基金管理有限公司风险管理部资深经理、深圳睿泉毅信投资管理有限公司研究部高级研究员、招商基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理、天弘基金管理有限公司基金经理助理、基金经理。2023 年 3 月加入平安基金管理有限公司，现任平安兴鑫回报一年定期开放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、平安均衡成长 2 年持有期混合型证券投资基金、平安策略回报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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、

中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年 GDP 完成了 5%目标。房地产销售和投资持续下滑，给经济造成了压力，依靠逆周期调节的政策托底，尤其是进入下半年后各种消费补贴政策陆续出台，起到了稳定宏观经济走势的作用，全年增长呈现了 U 型走势。从结构上看，出口和投资较强，而内需依然偏弱，PPI 数据连续负增长，反映了供给端产能过剩的情况依然严重。

A 股市场宽幅震荡，走出了“N”型走势。本产品的投资结构，主要以周期资源和科技成长为配置方向。上半年，本产品主要把握住了贵金属和有色金属的行情，以及生猪周期的行情。二季度和三季度，参与了 AI 算力，以及部分低空、汽车、电子等板块，整体未能取得明显的超额收益。三季度末，重点参与了大金融板块包括券商保险等板块。四季度末，参与了部分 AI 的应用，但计算机和电子板块的个股波动较大，导致了净值波动较大。

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 1.1241 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.11%，同期业绩比较基准收益率为 10.41%；截至本报告期末平安鑫利混合 C 的基金份额净值 1.1151 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.00%，同期业绩比较基准收益率为 10.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年，国内经济将会呈现弱复苏态势，机会大于风险。首先，观察基本面，地产的拖累效应降低，房地产市场可能“止跌企稳”，出口依然保持较好趋势，另外，去年四季度各种稳定政策的逐步落地推进中，内生经济增长的动能落实到盈利端，有望见到拐点。其次，在实际利率偏高的情况下，货币有望持续宽松，流动性依然友好。最后，AI 引领的科技浪潮持续催化，不断改善市场的风险偏好回升。所以，总体上我们对 2025 年的市场保持乐观。

2025 年，我们将围绕国内 AI 的基础建设和国内 AI 行业应用重点研究和布局。国内互联网大厂加快布局 AI 大模型，资本开支不断提升，将带来上游基础设施建设包括算力、数据中心的景气爆发。其次，互联网行业以及传统行业不断接入大模型，对 AI Agent 的广泛引用，提升了生产效率，尤其是在广告、医疗、教育等行业的快速落地。我们将在这些行业中保持紧密研究，做适当的配置。DeepSeek 拉平了我们和美国科技的差距，中国科技资产的估值依然偏低，有望得到持续修复。

此外，我们继续保持对经济复苏节奏的观察，等待拐点出现，适当时候对顺周期以及资源品进行配置。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，

严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时,确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序,通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法,对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核,发现问题及时提出改进建议,并督促相关部门进行整改,同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训,开展了多次培训活动,加强对员工行为的管理,增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内,本基金管理人所管理的基金运作合法合规,基金合同得到严格履行,有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配,符合基金合同的约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人的情形。本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末,以上情况未消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定,予以披露,且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70039114_H15 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—

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

	用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	黄拥璇
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室	
审计报告日期	2025年3月24日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	1,028,615.53	6,991.10
结算备付金		315,864.57	402,833.76
存出保证金		69,243.15	15,882.15
交易性金融资产	7.4.7.2	16,183,924.51	23,697,737.53
其中：股票投资		14,663,773.55	7,176,844.05
基金投资		-	-
债券投资		1,520,150.96	16,520,893.48
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	11,828,626.02
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		12,752,395.95	551,432.62
应收股利		-	-

应收申购款		409.92	10.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		30,350,453.63	36,503,513.18
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	484,213.72
应付赎回款		1,406.24	6,853.97
应付管理人报酬		15,535.24	20,924.08
应付托管费		2,589.22	3,487.31
应付销售服务费		2,553.12	3,041.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	5.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	171,241.24	131,226.86
负债合计		193,325.06	649,752.41
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	27,041,504.04	32,473,613.88
未分配利润	7.4.7.12	3,115,624.53	3,380,146.89
净资产合计		30,157,128.57	35,853,760.77
负债和净资产总计		30,350,453.63	36,503,513.18

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 27,041,504.04 份，其中，下属 A 类基金份额净值 1.1241 元，基金份额总额 399,946.85 份；下属 C 类基金份额净值 1.1151 元，基金份额总额 26,641,557.19 份。

7.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,079,583.20	-1,406,197.84
1. 利息收入		59,800.86	306,516.36
其中：存款利息收入	7.4.7.13	32,856.50	24,327.78
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		26,944.36	282,188.58
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,596,718.42	-2,080,310.14
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,013,709.95	-2,668,576.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	142,493.74	336,252.80
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	440,514.73	252,013.33
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-589,245.94	366,977.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	12,309.86	617.96
减：二、营业总支出		323,500.35	461,959.39
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	211,689.38	264,611.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	35,281.65	44,101.92
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	35,067.36	29,745.45
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		23.30	0.53
8. 其他费用	7.4.7.23	41,438.66	123,500.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		756,082.85	-1,868,157.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		756,082.85	-1,868,157.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		756,082.85	-1,868,157.23

7.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	32,473,613.88	-	3,380,146.89	35,853,760.77
二、本期期初净资产	32,473,613.88	-	3,380,146.89	35,853,760.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,432,109.84	-	-264,522.36	-5,696,632.20
（一）、综合收益总额	-	-	756,082.85	756,082.85
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-5,432,109.84	-	-1,020,605.21	-6,452,715.05
其中：1. 基金申购款	17,155,762.23	-	1,492,592.37	18,648,354.60
2. 基金赎回款	-22,587,872.07	-	-2,513,197.58	-25,101,069.65
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	27,041,504.04	-	3,115,624.53	30,157,128.57
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	33,045,397.67	-	4,792,783.70	37,838,181.37
二、本期期初净资产	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)	-571,783.79	-	-1,412,636.81	-1,984,420.60

(一)、综合收益总额	-	-	-1,868,157.23	-1,868,157.23
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-571,783.79	-	455,520.42	-116,263.37
其中：1. 基金申购款	13,270,926.14	-	2,042,734.54	15,313,660.68
2. 基金赎回款	-13,842,709.93	-	-1,587,214.12	-15,429,924.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	32,473,613.88	-	3,380,146.89	35,853,760.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风
基金管理人负责人

林婉文
主管会计工作负责人

张南南
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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《关于平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金增设 C 类份额分类及相关事项的公

告》，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人平安基金管理有限公司决定自 2018 年 9 月 15 日起对本基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。两类基金份额分别设置代码，并分别计算基金份额净值。投资人在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。

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《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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金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%。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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金参与股指期货、国债期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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%。

7.4.2 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、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有

公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据

具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。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的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经

确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要说明的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 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‰，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、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税及附加

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征增值税试点的通知》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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

(3) 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[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。

(4) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,028,615.53	6,991.10
等于：本金	1,028,503.51	6,924.39
加：应计利息	112.02	66.71

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	1,028,615.53	6,991.10

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		15,081,381.58	-	14,663,773.55	-417,608.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,502,241.00	16,400.96	1,520,150.96	1,509.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,502,241.00	16,400.96	1,520,150.96	1,509.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		16,583,622.58	16,400.96	16,183,924.51	-416,099.03
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		7,004,455.99	-	7,176,844.05	172,388.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,104,073.85	80,795.85	6,226,608.55	41,738.85
	银行间市场	10,042,980.00	292,284.93	10,294,284.93	-40,980.00
	合计	16,147,053.85	373,080.78	16,520,893.48	758.85
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		23,151,509.84	373,080.78	23,697,737.53	173,146.91

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 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。

7.4.7.3.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	11,828,626.02	-
银行间市场	-	-
合计	11,828,626.02	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.43	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	148,402.15	35,926.86
其中：交易所市场	148,402.15	35,926.86
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	22,838.66	95,300.00
合计	171,241.24	131,226.86

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安鑫利混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,146.49	72,146.49
本期申购	741,056.83	741,056.83
本期赎回（以“-”号填列）	-413,256.47	-413,256.47
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	399,946.85	399,946.85

平安鑫利混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
----	--

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,401,467.39	32,401,467.39
本期申购	16,414,705.40	16,414,705.40
本期赎回（以“-”号填列）	-22,174,615.60	-22,174,615.60
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	26,641,557.19	26,641,557.19

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他综合收益。

7.4.7.12 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	6,894.98	1,174.03	8,069.01
本期期初	6,894.98	1,174.03	8,069.01
本期利润	35,411.32	-20,990.20	14,421.12
本期基金份额交易产生的变动数	20,319.95	6,811.07	27,131.02
其中：基金申购款	37,264.09	-1,854.37	35,409.72
基金赎回款	-16,944.14	8,665.44	-8,278.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,626.25	-13,005.10	49,621.15

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	2,846,156.19	525,921.69	3,372,077.88
本期期初	2,846,156.19	525,921.69	3,372,077.88
本期利润	1,309,917.47	-568,255.74	741,661.73
本期基金份额交易产生的变动数	-232,777.55	-814,958.68	-1,047,736.23
其中：基金申购款	1,285,116.78	172,065.87	1,457,182.65
基金赎回款	-1,517,894.33	-987,024.55	-2,504,918.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,923,296.11	-857,292.73	3,066,003.38

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	--	---

活期存款利息收入	27,260.70	18,742.16
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	4,676.11	5,316.94
其他	919.69	268.68
合计	32,856.50	24,327.78

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,013,709.95	-2,668,576.27
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	1,013,709.95	-2,668,576.27

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	441,524,513.10	105,925,252.39
减：卖出股票成本总额	439,722,943.17	108,338,302.75
减：交易费用	787,859.98	255,525.91
买卖股票差价收入	1,013,709.95	-2,668,576.27

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	52,834.27	343,618.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	89,659.47	-7,365.67
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	142,493.74	336,252.80

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	35,736,049.82	21,879,917.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,143,466.14	21,504,205.00
减：应计利息总额	502,314.34	382,627.81
减：交易费用	609.87	450.67
买卖债券差价收入	89,659.47	-7,365.67

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	440,514.73	252,013.33
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	440,514.73	252,013.33

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-589,245.94	366,977.98
股票投资	-589,996.09	349,549.13
债券投资	750.15	17,428.85

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	-589,245.94	366,977.98

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	12,306.39	617.96
基金转换费收入	3.47	-
合计	12,309.86	617.96

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减。赎回费计入基金财产的比例依据《平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》确定。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费按注 1 中约定的比例计入基金财产。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未计提信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	2,541.20	36,000.00
信息披露费	20,297.46	50,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	36,000.00
其他	600.00	1,500.00
合计	41,438.66	123,500.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
方正证券	-	-	9,958,637.37	4.72

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日

	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）
方正证券	-	-	39,710,000.00	6.13

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
方正证券	7,255.29	4.73	-	-

注：1、上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

2、该类佣金协议的服务范围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。

3、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	211,689.38	264,611.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,394.42	5,974.66
应支付基金管理人的净管理费	206,294.96	258,636.83

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	35,281.65	44,101.92

注：支付基金托管人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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	—	1,086.90	1,086.90
平安基金	—	33,253.59	33,253.59
平安人寿	—	350.39	350.39
平安银行	—	3.71	3.71
合计	—	34,694.59	34,694.59
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	—	1,378.09	1,378.09
平安基金	—	27,734.30	27,734.30
平安人寿	—	404.92	404.92
平安银行	—	3.65	3.65
合计	—	29,520.96	29,520.96

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内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。

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

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	-	0.00
报告期初持有的基金份额	-	8,666,262.24
报告期间申购/买入总份额	-	0.00
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	-	32.5291%
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
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	-	26.7465%

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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

平安鑫利混合 C

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
平安汇通	16,604,134.89	62.3242	22,104,134.89	68.2195

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	1,028,615.53	27,260.70	6,991.10	18,742.16

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易

所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，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（上年度末：本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 7.13%）。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,028,615.53	-	-	-	1,028,615.53
结算备付金	315,864.57	-	-	-	315,864.57
存出保证金	69,243.15	-	-	-	69,243.15

交易性金融资产	1,520,150.96	-	-	14,663,773.55	16,183,924.51
应收申购款	-	-	-	409.92	409.92
应收清算款	-	-	-	12,752,395.95	12,752,395.95
资产总计	2,933,874.21	-	-	27,416,579.42	30,350,453.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,406.24	1,406.24
应付管理人报酬	-	-	-	15,535.24	15,535.24
应付托管费	-	-	-	2,589.22	2,589.22
应付销售服务费	-	-	-	2,553.12	2,553.12
其他负债	-	-	-	171,241.24	171,241.24
负债总计	-	-	-	193,325.06	193,325.06
利率敏感度缺口	2,933,874.21	-	-	27,223,254.36	30,157,128.57
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,991.10	-	-	-	6,991.10
结算备付金	402,833.76	-	-	-	402,833.76
存出保证金	15,882.15	-	-	-	15,882.15
交易性金融资产	16,520,893.48	-	-	7,176,844.05	23,697,737.53
买入返售金融资产	11,828,626.02	-	-	-	11,828,626.02
应收申购款	-	-	-	10.00	10.00
应收清算款	-	-	-	551,432.62	551,432.62
资产总计	28,775,226.51	-	-	7,728,286.67	36,503,513.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,853.97	6,853.97
应付管理人报酬	-	-	-	20,924.08	20,924.08
应付托管费	-	-	-	3,487.31	3,487.31
应付清算款	-	-	-	484,213.72	484,213.72
应付销售服务费	-	-	-	3,041.47	3,041.47
应交税费	-	-	-	5.00	5.00
其他负债	-	-	-	131,226.86	131,226.86
负债总计	-	-	-	649,752.41	649,752.41
利率敏感度缺口	28,775,226.51	-	-	7,078,534.26	35,853,760.77

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）

	市场利率上升 25 个基点	-1, 184. 38	-983. 56
	市场利率下降 25 个基点	1, 186. 31	984. 17

7. 4. 13. 4. 2 外汇风险

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

7. 4. 13. 4. 2. 1 外汇风险敞口

注:无

7. 4. 13. 4. 2. 2 外汇风险的敏感性分析

注：无

7. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

7. 4. 13. 4. 3. 1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023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	14, 663, 773. 55	48. 62	7, 176, 844. 05	20. 02
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	14, 663, 773. 55	48. 62	7, 176, 844. 05	20. 02

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	1,158,839.65	347,755.70
	沪深 300 指数下降 5%	-1,158,839.65	-347,755.70

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	14,663,773.55	9,733,148.05
第二层次	1,520,150.96	13,964,589.48
第三层次	-	-
合计	16,183,924.51	23,697,737.53

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：于本报告期末及上年度报告期末，本基金无属于第三层次的金融资产。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：于本报告期末及上年度报告期末，本基金未使用不可观察输入值。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如审计费、信息披露费等。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	14,663,773.55	48.31
	其中：股票	14,663,773.55	48.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,520,150.96	5.01
	其中：债券	1,520,150.96	5.01
	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	1,344,480.10	4.43
8	其他各项资产	12,822,049.02	42.25
9	合计	30,350,453.63	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,075,937.83	36.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,377,795.72	7.88
J	金融业	1,210,040.00	4.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,663,773.55	48.62

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600104	上汽集团	63,900	1,326,564.00	4.40
2	600066	宇通客车	48,500	1,279,430.00	4.24
3	000063	中兴通讯	31,100	1,256,440.00	4.17
4	601456	国联证券	89,500	1,210,040.00	4.01
5	688981	中芯国际	12,696	1,201,295.52	3.98
6	002241	歌尔股份	45,600	1,176,936.00	3.90
7	300563	神宇股份	16,600	915,656.00	3.04
8	000651	格力电器	19,800	899,910.00	2.98
9	600941	中国移动	7,600	898,016.00	2.98

10	002384	东山精密	30,400	887,680.00	2.94
11	688256	寒武纪	797	524,426.00	1.74
12	300638	广和通	17,900	360,685.00	1.20
13	688318	财富趋势	2,038	348,498.00	1.16
14	300470	中密控股	8,400	316,680.00	1.05
15	688691	灿芯股份	4,020	309,540.00	1.03
16	688099	晶晨股份	4,329	297,315.72	0.99
17	002335	科华数据	8,700	251,604.00	0.83
18	600577	精达股份	34,200	249,318.00	0.83
19	688041	海光信息	1,649	247,003.71	0.82
20	300870	欧陆通	2,200	234,916.00	0.78
21	603236	移远通信	3,000	205,320.00	0.68
22	688127	蓝特光学	5,876	159,239.60	0.53
23	000880	潍柴重机	6,200	107,260.00	0.36

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	002155	湖南黄金	9,146,964.75	25.51
2	000975	山金国际	7,089,692.40	19.77
3	000426	兴业银锡	6,606,631.00	18.43
4	603993	洛阳钼业	6,347,646.00	17.70
5	000603	盛达资源	5,899,666.73	16.45
6	600988	赤峰黄金	5,574,280.00	15.55
7	600489	中金黄金	5,102,561.00	14.23
8	600547	山东黄金	4,929,703.00	13.75
9	688318	财富趋势	4,504,784.37	12.56
10	688522	纳睿雷达	4,425,574.03	12.34
11	601028	玉龙股份	4,066,497.00	11.34
12	300308	中际旭创	4,049,580.00	11.29
13	001696	宗申动力	3,924,153.05	10.94
14	300857	协创数据	3,887,026.00	10.84
15	603979	金诚信	3,366,389.00	9.39
16	601899	紫金矿业	3,364,909.00	9.39
17	002384	东山精密	3,355,138.00	9.36
18	601020	华钰矿业	3,280,755.00	9.15
19	000408	藏格矿业	3,260,160.00	9.09
20	300502	新易盛	3,239,972.00	9.04
21	300803	指南针	3,049,523.00	8.51
22	300394	天孚通信	3,043,844.44	8.49
23	600580	卧龙电驱	2,979,145.00	8.31
24	002428	云南锗业	2,977,237.00	8.30

25	000960	锡业股份	2,909,550.00	8.12
26	688036	传音控股	2,906,248.51	8.11
27	002840	华统股份	2,801,398.00	7.81
28	688668	鼎通科技	2,774,148.14	7.74
29	600256	广汇能源	2,739,792.00	7.64
30	688183	生益电子	2,714,378.49	7.57
31	300476	胜宏科技	2,610,112.00	7.28
32	600418	江淮汽车	2,610,088.00	7.28
33	002714	牧原股份	2,559,601.00	7.14
34	002130	沃尔核材	2,549,146.00	7.11
35	601138	工业富联	2,487,582.00	6.94
36	600066	宇通客车	2,477,266.00	6.91
37	601688	华泰证券	2,456,059.00	6.85
38	601601	中国太保	2,452,655.00	6.84
39	600104	上汽集团	2,435,960.00	6.79
40	600938	中国海油	2,399,777.00	6.69
41	601628	中国人寿	2,365,472.00	6.60
42	603067	振华股份	2,336,146.00	6.52
43	601838	成都银行	2,335,121.57	6.51
44	300033	同花顺	2,279,551.00	6.36
45	301061	匠心家居	2,237,903.40	6.24
46	601958	金钼股份	2,218,133.00	6.19
47	688484	南芯科技	2,210,847.06	6.17
48	300563	神宇股份	2,178,391.00	6.08
49	300827	上能电气	2,163,710.29	6.03
50	603357	设计总院	2,154,753.44	6.01
51	002475	立讯精密	2,120,669.00	5.91
52	301004	嘉益股份	2,068,525.00	5.77
53	603876	鼎胜新材	2,041,510.00	5.69
54	601963	重庆银行	2,028,154.00	5.66
55	600985	淮北矿业	2,013,112.00	5.61
56	688676	金盘科技	1,955,784.12	5.45
57	600941	中国移动	1,943,564.00	5.42
58	000657	中钨高新	1,905,157.00	5.31
59	601168	西部矿业	1,899,082.00	5.30
60	688256	寒武纪	1,888,237.48	5.27
61	301291	明阳电气	1,875,351.00	5.23
62	603799	华友钴业	1,808,870.00	5.05
63	301219	腾远钴业	1,798,918.00	5.02
64	002572	索菲亚	1,783,954.00	4.98
65	000630	铜陵有色	1,781,054.00	4.97
66	301091	深城交	1,778,159.00	4.96
67	000425	徐工机械	1,746,739.00	4.87

68	000776	广发证券	1,738,735.00	4.85
69	600188	兖矿能源	1,734,172.50	4.84
70	688608	恒玄科技	1,730,606.11	4.83
71	603801	志邦家居	1,727,064.00	4.82
72	002532	天山铝业	1,722,385.00	4.80
73	601225	陕西煤业	1,714,214.00	4.78
74	600584	长电科技	1,704,209.00	4.75
75	301301	川宁生物	1,690,555.00	4.72
76	002043	兔宝宝	1,667,277.00	4.65
77	002452	长高电新	1,660,649.00	4.63
78	600497	驰宏锌锗	1,660,494.00	4.63
79	002281	光迅科技	1,624,517.00	4.53
80	688100	威胜信息	1,608,838.92	4.49
81	000977	浪潮信息	1,563,978.00	4.36
82	600366	宁波韵升	1,549,228.00	4.32
83	000568	泸州老窖	1,546,140.00	4.31
84	000628	高新发展	1,544,721.00	4.31
85	300383	光环新网	1,544,393.00	4.31
86	000688	国城矿业	1,536,543.00	4.29
87	603619	中曼石油	1,524,237.00	4.25
88	600546	山煤国际	1,524,057.00	4.25
89	605599	菜百股份	1,523,915.00	4.25
90	688609	九联科技	1,517,830.21	4.23
91	300442	润泽科技	1,509,063.00	4.21
92	300870	欧陆通	1,499,451.00	4.18
93	300900	广联航空	1,498,351.00	4.18
94	002438	江苏神通	1,483,680.00	4.14
95	603201	常润股份	1,467,909.00	4.09
96	300763	锦浪科技	1,452,751.00	4.05
97	601567	三星医疗	1,451,726.00	4.05
98	002378	章源钨业	1,444,016.00	4.03
99	605319	无锡振华	1,435,462.00	4.00
100	603100	川仪股份	1,412,293.00	3.94
101	603199	九华旅游	1,408,382.00	3.93
102	002916	深南电路	1,402,415.00	3.91
103	002922	伊戈尔	1,398,035.00	3.90
104	603018	华设集团	1,397,988.00	3.90
105	300415	伊之密	1,397,691.00	3.90
106	300638	广和通	1,397,119.00	3.90
107	603225	新凤鸣	1,368,159.00	3.82
108	601233	桐昆股份	1,365,998.00	3.81
109	688568	中科星图	1,342,788.09	3.75
110	002185	华天科技	1,326,715.00	3.70

111	600000	浦发银行	1,326,143.00	3.70
112	688691	灿芯股份	1,315,559.62	3.67
113	603606	东方电缆	1,292,480.00	3.60
114	002601	龙佰集团	1,290,205.00	3.60
115	300059	东方财富	1,283,335.00	3.58
116	002605	姚记科技	1,276,874.00	3.56
117	688099	晶晨股份	1,266,067.16	3.53
118	600326	西藏天路	1,261,999.00	3.52
119	688766	普冉股份	1,259,406.70	3.51
120	300470	中密控股	1,258,984.00	3.51
121	688981	中芯国际	1,257,897.43	3.51
122	601456	国联证券	1,248,607.00	3.48
123	301383	天键股份	1,245,931.00	3.48
124	300793	佳禾智能	1,242,489.00	3.47
125	000524	岭南控股	1,235,272.00	3.45
126	603236	移远通信	1,230,427.00	3.43
127	300859	西域旅游	1,227,928.00	3.42
128	000090	天健集团	1,225,822.00	3.42
129	000063	中兴通讯	1,224,558.00	3.42
130	601077	渝农商行	1,221,103.00	3.41
131	601101	昊华能源	1,220,733.00	3.40
132	300855	图南股份	1,220,573.00	3.40
133	688800	瑞可达	1,217,725.08	3.40
134	601633	长城汽车	1,217,284.00	3.40
135	002241	歌尔股份	1,208,854.80	3.37
136	600577	精达股份	1,208,544.00	3.37
137	601336	新华保险	1,205,040.00	3.36
138	688213	思特威	1,197,590.26	3.34
139	000988	华工科技	1,196,328.00	3.34
140	601878	浙商证券	1,186,920.00	3.31
141	600999	招商证券	1,185,702.00	3.31
142	601288	农业银行	1,184,641.00	3.30
143	603323	苏农银行	1,184,634.00	3.30
144	600745	闻泰科技	1,179,642.00	3.29
145	600016	民生银行	1,179,619.00	3.29
146	300623	捷捷微电	1,172,158.46	3.27
147	300862	蓝盾光电	1,171,922.60	3.27
148	688362	甬矽电子	1,168,094.71	3.26
149	300602	飞荣达	1,163,097.00	3.24
150	002465	海格通信	1,159,332.00	3.23
151	000157	中联重科	1,155,486.00	3.22
152	601577	长沙银行	1,152,250.00	3.21
153	688252	天德钰	1,140,013.38	3.18

154	601818	光大银行	1,139,866.00	3.18
155	300443	金雷股份	1,138,991.00	3.18
156	600926	杭州银行	1,138,818.00	3.18
157	600219	南山铝业	1,137,600.00	3.17
158	000400	许继电气	1,135,723.00	3.17
159	002028	思源电气	1,112,307.00	3.10
160	000937	冀中能源	1,104,046.00	3.08
161	301376	致欧科技	1,103,725.00	3.08
162	603208	江山欧派	1,103,572.82	3.08
163	688631	莱斯信息	1,100,657.76	3.07
164	600426	华鲁恒升	1,098,060.00	3.06
165	601881	中国银河	1,093,549.00	3.05
166	000888	峨眉山 A	1,092,462.00	3.05
167	601666	平煤股份	1,085,848.00	3.03
168	002833	弘亚数控	1,066,681.60	2.98
169	601059	信达证券	1,060,488.00	2.96
170	600612	老凤祥	1,054,698.00	2.94
171	600686	金龙汽车	1,054,225.00	2.94
172	300433	蓝思科技	1,040,794.00	2.90
173	603283	赛腾股份	1,032,239.00	2.88
174	002567	唐人神	1,031,171.00	2.88
175	000933	神火股份	1,023,932.00	2.86
176	300258	精锻科技	1,019,126.00	2.84
177	688248	南网科技	1,016,013.24	2.83
178	000858	五 粮 液	1,011,821.00	2.82
179	603369	今世缘	1,011,062.00	2.82
180	002600	领益智造	1,007,942.00	2.81
181	688063	派能科技	974,108.40	2.72
182	688032	禾迈股份	961,919.57	2.68
183	688041	海光信息	953,772.19	2.66
184	002335	科华数据	951,594.00	2.65
185	600230	沧州大化	950,449.00	2.65
186	300432	富临精工	945,251.00	2.64
187	688037	芯源微	945,062.17	2.64
188	300073	当升科技	941,631.00	2.63
189	002850	科达利	933,830.00	2.60
190	688049	炬芯科技	929,280.35	2.59
191	600325	华发股份	926,867.00	2.59
192	603878	武进不锈	924,345.00	2.58
193	300917	特发服务	919,972.00	2.57
194	300820	英杰电气	918,638.00	2.56
195	300666	江丰电子	914,160.00	2.55
196	603885	吉祥航空	912,678.00	2.55

197	688097	博众精工	909,966.20	2.54
198	000651	格力电器	904,848.00	2.52
199	601128	常熟银行	904,615.00	2.52
200	000528	柳 工	904,368.68	2.52
201	603267	鸿远电子	903,070.00	2.52
202	300953	震裕科技	901,490.00	2.51
203	300548	博创科技	901,059.00	2.51
204	600376	首开股份	899,539.00	2.51
205	002159	三特索道	894,360.00	2.49
206	688017	绿的谐波	893,987.53	2.49
207	002625	光启技术	892,189.00	2.49
208	603859	能科科技	890,635.00	2.48
209	300661	圣邦股份	889,162.00	2.48
210	601319	中国人保	888,296.00	2.48
211	301323	新莱福	886,239.00	2.47
212	688120	华海清科	885,590.62	2.47
213	603698	航天工程	885,208.00	2.47
214	603556	海兴电力	882,647.00	2.46
215	000059	华锦股份	880,058.00	2.45
216	300558	贝达药业	872,087.00	2.43
217	600373	中文传媒	871,545.00	2.43
218	688717	艾罗能源	867,266.29	2.42
219	688378	奥来德	860,787.56	2.40
220	605296	神农集团	859,450.00	2.40
221	600438	通威股份	854,741.00	2.38
222	600919	江苏银行	851,583.00	2.38
223	300680	隆盛科技	805,422.00	2.25
224	688226	威腾电气	778,753.62	2.17
225	300459	汤姆猫	778,438.00	2.17
226	300286	安科瑞	776,314.00	2.17
227	600316	洪都航空	771,228.00	2.15
228	600576	祥源文旅	764,236.00	2.13
229	600603	ST 广物	760,792.00	2.12
230	301129	瑞纳智能	760,245.00	2.12
231	600266	城建发展	741,783.00	2.07
232	000550	江铃汽车	741,037.00	2.07
233	002947	恒铭达	726,264.00	2.03
234	601919	中远海控	720,712.00	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	002155	湖南黄金	9,546,035.00	26.62
2	000975	山金国际	7,353,374.00	20.51
3	603993	洛阳钼业	6,637,139.00	18.51
4	000426	兴业银锡	6,508,847.00	18.15
5	000603	盛达资源	5,738,538.46	16.01
6	600988	赤峰黄金	5,652,049.00	15.76
7	600489	中金黄金	5,104,001.97	14.24
8	688318	财富趋势	4,809,750.01	13.41
9	600547	山东黄金	4,654,343.44	12.98
10	688522	纳睿雷达	4,327,330.55	12.07
11	601028	玉龙股份	4,281,204.00	11.94
12	300857	协创数据	4,002,596.00	11.16
13	001696	宗申动力	3,989,460.06	11.13
14	601020	华钰矿业	3,916,091.00	10.92
15	300308	中际旭创	3,869,696.00	10.79
16	603979	金诚信	3,693,458.00	10.30
17	601899	紫金矿业	3,511,070.47	9.79
18	300502	新易盛	3,333,166.00	9.30
19	000408	藏格矿业	3,301,615.00	9.21
20	002840	华统股份	3,264,578.00	9.11
21	688183	生益电子	3,251,461.92	9.07
22	300803	指南针	3,043,207.00	8.49
23	002428	云南锗业	2,962,878.00	8.26
24	601688	华泰证券	2,905,695.00	8.10
25	002384	东山精密	2,896,204.00	8.08
26	600418	江淮汽车	2,825,627.87	7.88
27	600580	卧龙电驱	2,825,094.00	7.88
28	300033	同花顺	2,804,748.00	7.82
29	300476	胜宏科技	2,741,111.00	7.65
30	600256	广汇能源	2,731,864.00	7.62
31	300394	天孚通信	2,702,627.00	7.54
32	688036	传音控股	2,638,623.68	7.36
33	601138	工业富联	2,625,794.00	7.32
34	601601	中国太保	2,505,494.00	6.99
35	002714	牧原股份	2,497,169.00	6.96
36	002130	沃尔核材	2,493,498.00	6.95
37	601628	中国人寿	2,486,773.00	6.94
38	688668	鼎通科技	2,473,809.17	6.90
39	600938	中国海油	2,427,116.00	6.77
40	000960	锡业股份	2,387,198.00	6.66
41	601838	成都银行	2,362,260.00	6.59
42	603067	振华股份	2,267,070.00	6.32
43	300442	润泽科技	2,243,790.00	6.26

44	301061	匠心家居	2,231,159.00	6.22
45	601168	西部矿业	2,188,655.00	6.10
46	688676	金盘科技	2,145,901.29	5.99
47	688484	南芯科技	2,099,258.41	5.86
48	002475	立讯精密	2,079,445.00	5.80
49	301004	嘉益股份	2,072,210.00	5.78
50	300827	上能电气	2,056,263.78	5.74
51	601958	金钼股份	2,036,405.00	5.68
52	600985	淮北矿业	2,022,688.00	5.64
53	601963	重庆银行	2,013,899.00	5.62
54	603619	中曼石油	1,984,755.00	5.54
55	600188	兖矿能源	1,942,755.00	5.42
56	000776	广发证券	1,933,226.55	5.39
57	603357	设计总院	1,885,692.00	5.26
58	301291	明阳电气	1,864,323.00	5.20
59	603876	鼎胜新材	1,856,879.00	5.18
60	688608	恒玄科技	1,821,041.12	5.08
61	000977	浪潮信息	1,816,347.00	5.07
62	002532	天山铝业	1,809,768.78	5.05
63	603801	志邦家居	1,791,058.00	5.00
64	688256	寒武纪	1,730,130.70	4.83
65	002572	索菲亚	1,729,196.80	4.82
66	601225	陕西煤业	1,719,485.00	4.80
67	605599	菜百股份	1,705,467.00	4.76
68	301219	腾远钴业	1,699,145.00	4.74
69	000630	铜陵有色	1,693,511.00	4.72
70	000568	泸州老窖	1,688,761.00	4.71
71	603799	华友钴业	1,688,239.00	4.71
72	000425	徐工机械	1,678,152.00	4.68
73	002043	兔宝宝	1,668,094.00	4.65
74	002185	华天科技	1,633,468.00	4.56
75	002922	伊戈尔	1,628,328.00	4.54
76	600326	西藏天路	1,607,364.00	4.48
77	000657	中钨高新	1,593,271.00	4.44
78	301091	深城交	1,590,333.00	4.44
79	688100	威胜信息	1,588,133.43	4.43
80	300383	光环新网	1,585,311.00	4.42
81	002281	光迅科技	1,577,631.00	4.40
82	002605	姚记科技	1,576,381.00	4.40
83	600584	长电科技	1,566,025.00	4.37
84	301301	川宁生物	1,540,821.00	4.30
85	688609	九联科技	1,529,501.47	4.27
86	002452	长高电新	1,525,809.00	4.26

87	300059	东方财富	1,501,125.00	4.19
88	300870	欧陆通	1,491,428.00	4.16
89	300763	锦浪科技	1,474,995.94	4.11
90	000628	高新发展	1,471,590.00	4.10
91	600366	宁波韵升	1,461,862.00	4.08
92	688766	普冉股份	1,453,994.40	4.06
93	300415	伊之密	1,448,541.00	4.04
94	600941	中国移动	1,431,790.00	3.99
95	600546	山煤国际	1,427,492.00	3.98
96	601666	平煤股份	1,424,140.00	3.97
97	603201	常润股份	1,419,851.00	3.96
98	600497	驰宏锌锗	1,419,695.00	3.96
99	002916	深南电路	1,406,519.00	3.92
100	605319	无锡振华	1,397,067.00	3.90
101	000933	神火股份	1,396,976.00	3.90
102	601567	三星医疗	1,385,280.00	3.86
103	300862	蓝盾光电	1,382,672.00	3.86
104	603100	川仪股份	1,375,065.00	3.84
105	603199	九华旅游	1,374,476.00	3.83
106	300548	博创科技	1,362,243.00	3.80
107	603225	新凤鸣	1,342,367.00	3.74
108	000888	峨眉山 A	1,341,732.31	3.74
109	601101	昊华能源	1,340,972.00	3.74
110	000688	国城矿业	1,334,484.00	3.72
111	002378	章源钨业	1,328,994.00	3.71
112	300602	飞荣达	1,322,175.00	3.69
113	300793	佳禾智能	1,317,525.00	3.67
114	000988	华工科技	1,306,310.00	3.64
115	603018	华设集团	1,306,215.00	3.64
116	601233	桐昆股份	1,304,779.00	3.64
117	688800	瑞可达	1,296,269.04	3.62
118	600000	浦发银行	1,286,278.00	3.59
119	002601	龙佰集团	1,285,766.00	3.59
120	688568	中科星图	1,273,343.72	3.55
121	688252	天德钰	1,265,014.76	3.53
122	600745	闻泰科技	1,263,933.00	3.53
123	300855	图南股份	1,257,481.00	3.51
124	600066	宇通客车	1,246,563.00	3.48
125	688362	甬矽电子	1,234,230.26	3.44
126	601077	渝农商行	1,229,079.00	3.43
127	000090	天健集团	1,219,694.00	3.40
128	002600	领益智造	1,218,664.00	3.40
129	002028	思源电气	1,218,371.00	3.40

130	300900	广联航空	1,215,658.00	3.39
131	603606	东方电缆	1,208,132.00	3.37
132	002438	江苏神通	1,203,547.00	3.36
133	603208	江山欧派	1,196,490.04	3.34
134	601336	新华保险	1,187,783.99	3.31
135	000157	中联重科	1,183,228.00	3.30
136	601288	农业银行	1,175,244.00	3.28
137	601577	长沙银行	1,159,427.00	3.23
138	601633	长城汽车	1,158,731.00	3.23
139	600926	杭州银行	1,158,014.59	3.23
140	600104	上汽集团	1,156,079.00	3.22
141	600016	民生银行	1,155,882.00	3.22
142	600999	招商证券	1,153,329.00	3.22
143	601881	中国银河	1,146,801.00	3.20
144	601878	浙商证券	1,146,136.00	3.20
145	688213	思特威	1,143,218.67	3.19
146	603323	苏农银行	1,131,984.00	3.16
147	002465	海格通信	1,131,929.00	3.16
148	000400	许继电气	1,121,461.00	3.13
149	603236	移远通信	1,120,702.00	3.13
150	600230	沧州大化	1,118,229.00	3.12
151	601818	光大银行	1,116,750.00	3.11
152	300917	特发服务	1,113,369.00	3.11
153	300859	西域旅游	1,107,103.00	3.09
154	300443	金雷股份	1,105,088.00	3.08
155	600426	华鲁恒升	1,104,198.00	3.08
156	600612	老凤祥	1,097,805.00	3.06
157	600577	精达股份	1,087,597.00	3.03
158	600219	南山铝业	1,079,812.00	3.01
159	000937	冀中能源	1,074,431.00	3.00
160	000524	岭南控股	1,068,761.00	2.98
161	603369	今世缘	1,066,096.00	2.97
162	300623	捷捷微电	1,056,347.00	2.95
163	301376	致欧科技	1,045,419.00	2.92
164	601059	信达证券	1,042,192.00	2.91
165	002833	弘亚数控	1,039,086.40	2.90
166	301383	天键股份	1,027,735.00	2.87
167	000528	柳 工	1,021,541.00	2.85
168	300638	广和通	1,010,721.00	2.82
169	002625	光启技术	1,005,452.00	2.80
170	300433	蓝思科技	988,443.00	2.76
171	300258	精锻科技	984,041.00	2.74
172	688631	莱斯信息	980,406.25	2.73

173	002567	唐人神	979,017.00	2.73
174	603556	海兴电力	970,440.00	2.71
175	688691	灿芯股份	957,220.96	2.67
176	600686	金龙汽车	957,156.00	2.67
177	688248	南网科技	954,871.92	2.66
178	688120	华海清科	952,052.28	2.66
179	000858	五 粮 液	950,368.00	2.65
180	603283	赛腾股份	950,073.00	2.65
181	605296	神农集团	941,821.00	2.63
182	300820	英杰电气	936,298.00	2.61
183	688032	禾迈股份	925,714.31	2.58
184	603878	武进不锈	922,523.00	2.57
185	600376	首开股份	917,094.00	2.56
186	600919	江苏银行	916,897.00	2.56
187	688049	炬芯科技	916,488.70	2.56
188	688063	派能科技	912,436.64	2.54
189	688378	奥来德	911,979.12	2.54
190	300432	富临精工	909,705.00	2.54
191	300953	震裕科技	909,313.16	2.54
192	688017	绿的谐波	897,384.40	2.50
193	688037	芯源微	893,217.55	2.49
194	601128	常熟银行	892,718.00	2.49
195	300661	圣邦股份	889,382.00	2.48
196	300666	江丰电子	885,616.00	2.47
197	300558	贝达药业	885,547.00	2.47
198	301323	新莱福	883,474.00	2.46
199	688097	博众精工	866,055.31	2.42
200	300470	中密控股	863,316.00	2.41
201	601319	中国人保	862,677.00	2.41
202	603267	鸿远电子	856,674.00	2.39
203	600325	华发股份	849,448.00	2.37
204	600373	中文传媒	845,894.00	2.36
205	603885	吉祥航空	843,699.00	2.35
206	600266	城建发展	842,812.00	2.35
207	600438	通威股份	840,946.00	2.35
208	002947	恒铭达	840,931.00	2.35
209	600316	洪都航空	832,915.00	2.32
210	688099	晶晨股份	829,573.44	2.31
211	002850	科达利	827,603.00	2.31
212	603859	能科科技	825,585.00	2.30
213	300680	隆盛科技	822,702.00	2.29
214	000059	华锦股份	814,809.00	2.27
215	300073	当升科技	794,523.00	2.22

216	002159	三特索道	791,410.00	2.21
217	603698	航天工程	789,808.00	2.20
218	300459	汤姆猫	787,554.00	2.20
219	300563	神宇股份	784,070.00	2.19
220	601919	中远海控	783,607.00	2.19
221	000550	江铃汽车	778,383.00	2.17
222	688717	艾罗能源	741,034.76	2.07
223	301129	瑞纳智能	735,562.00	2.05
224	600603	ST 广物	734,521.00	2.05

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	447,799,868.76
卖出股票收入（成交）总额	441,524,513.10

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,520,150.96	5.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	1,520,150.96	5.04

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019740	24 国债 09	15,000	1,520,150.96	5.04

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

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

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	69,243.15
2	应收清算款	12,752,395.95
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	409.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,822,049.02

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
平安鑫利 混合 A	232	1,723.91	-	-	399,946.85	100.00
平安鑫利 混合 C	733	36,345.92	25,270,397.13	94.85	1,371,160.06	5.15
合计	942	28,706.48	25,270,397.13	93.45	1,771,106.91	6.55

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安鑫利混合 A	157,808.98	39.4575
	平安鑫利混合 C	-	-
	合计	157,808.98	0.5836

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）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安鑫利混合 A	0
	平安鑫利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安鑫利混合 A	10~50
	平安鑫利混合 C	0
	合计	10~50

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

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C
基金合同生效日 (2016 年 12 月 7 日) 基金份额总额	200,058,990.97	—
本报告期期初基金份 额总额	72,146.49	32,401,467.39
本报告期基金总申购 份额	741,056.83	16,414,705.40
减：本报告期基金总 赎回份额	413,256.47	22,174,615.60
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	399,946.85	26,641,557.19

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

2024 年 12 月 9 日，根据工作安排，宋菁女士不再担任平安银行股份有限公司资产托管部副总经理。

11.3 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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 3 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 5,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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 (%)	
东北证券	3	288,994,109.00	32.50	184,947.72	36.26	-
东吴证券	2	254,901,281.92	28.66	129,513.76	25.39	-
开源证券	2	156,714,022.15	17.62	86,682.18	16.99	-
申万宏源证券	2	60,085,539.95	6.76	39,402.37	7.72	-
国信证券	2	42,278,139.80	4.75	27,120.67	5.32	-
华创证券	2	37,521,364.42	4.22	16,576.55	3.25	-
光大证券	2	17,313,182.38	1.95	7,547.07	1.48	-
民生证券	1	16,356,209.46	1.84	7,130.00	1.40	-
国泰君安证券	2	10,675,745.28	1.20	7,855.52	1.54	-
长江证券	1	3,287,764.00	0.37	2,419.44	0.47	-
西部证券	1	1,197,023.50	0.13	880.86	0.17	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- （1）财务状况良好
- （2）经营行为规范
- （3）合规风控能力较高
- （4）交易、研究等服务能力较强

2、基金管理人根据上述标准，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，自 2024 年 7 月 1 日起，按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等相关要求执行。

3、报告期内新增交易单元的情况：新增国泰君安证券交易单元 1 个。

4、报告期内退租交易单元的情况：减少大通证券交易单元 2 个，减少东方财富证券交易单元 2 个，减少东兴证券交易单元 2 个，减少方正证券交易单元 2 个，减少平安证券交易单元 2 个，减少世纪证券交易单元 2 个，减少银河证券交易单元 2 个，减少中信建投证券交易单元 2 个，减少东北证券交易单元 1 个，减少光大证券交易单元 1 个，减少广发证券交易单元 1 个，减少国投证券交易单元 1 个，减少万联证券交易单元 1 个，减少中泰证券交易单元 1 个，减少中信证券交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东北证券	12,293,900.73	29.24	-	-	-	-
东吴证券	16,833,364.47	40.04	-	-	-	-
开源证券	12,741,241.00	30.31	13,897,000.00	26.73	-	-
申万宏源证券	19,669.64	0.05	38,085,000.00	73.27	-	-
国信证券	151,069.00	0.36	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 02 日
2	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	2024 年 01 月 03 日
3	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	2024 年 01 月 03 日
4	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	2024 年 01 月 15 日
5	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 22 日
6	平安基金管理有限公司关于旗下基金参与中国平安人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 15 日
7	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 30 日
8	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 22 日
9	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	2024 年 05 月 31 日
10	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	2024 年 05 月 31 日
11	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 07 月 19 日
12	平安基金管理有限公司关于终止与喜鹊财富基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 07 月 26 日
13	平安基金管理有限公司关于终止北京中植基金销售有限公司办理旗下基金	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 08 月 02 日

	相关销售业务的公告		
14	平安基金管理有限公司关于终止与中民财富基金销售（上海）有限公司相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 08 月 14 日
15	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 08 月 31 日
16	平安基金管理有限公司关于新增招商银行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	2024 年 09 月 11 日
17	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 09 月 14 日
18	平安基金管理有限公司关于新增华源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	2024 年 10 月 14 日
19	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 10 月 25 日
20	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	2024 年 12 月 20 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	2024 年 01 月 01 日-2024 年 02 月 28 日； 2024 年 04 月 08 日-2024 年 12 月 31 日	8,666,262.24	0.00	0.00	8,666,262.24	32.05
	2	2024 年 01 月 01 日-2024 年 12 月 31 日	22,104,134.89	0.00	5,500,000.00	16,604,134.89	61.40
	3	2024 年 02 月 29 日-2024 年 04 月 07 日	0.00	11,441,647.60	11,441,647.60	0.00	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定							

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安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

13.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

13.3 查阅方式

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

平安基金管理有限公司

2025 年 3 月 29 日