

# 平安优质企业混合型证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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 2025 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>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	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
<b>§ 4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
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>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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>	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安优质企业混合型证券投资基金	
基金简称	平安优质企业混合	
基金主代码	012475	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 19 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,763,842,237.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C
下属分级基金的交易代码	012475	012476
报告期末下属分级基金的份额总额	1,692,413,537.23 份	71,428,699.84 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选基本面良好，符合产业趋势、竞争力突出的公司，在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、股票期权投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、信用衍生品投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 × 70%+ 中证全债指数收益率 × 25%+ 恒生指数收益率（经汇率调整）× 5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金若投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	平安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李海波
	联系电话	0755-88622632
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn
客户服务电话	400-800-4800	95566
传真	0755-23997878	010-66594942
注册地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路	北京市西城区复兴门内大街 1 号

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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(2025年1月1日-2025年6月30日)	
	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C
本期已实现收益	79,480,768.77	2,979,482.95
本期利润	46,303,050.01	1,752,288.44
加权平均基金份额本期利润	0.0263	0.0240
本期加权平均净值利润率	4.08%	3.83%
本期基金份额净值增长率	4.25%	3.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)	
期末可供分配利润	-555,722,891.79	-24,951,275.08
期末可供分配基金份额利润	-0.3284	-0.3493
期末基金资产净值	1,136,690,645.44	46,477,424.76
期末基金份额净值	0.6716	0.6507

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-32.84%	-34.93%

- 注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；
3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安优质企业混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.47%	1.10%	2.04%	0.44%	5.43%	0.66%
过去三个月	3.85%	1.73%	1.62%	0.84%	2.23%	0.89%
过去六个月	4.25%	1.57%	1.33%	0.78%	2.92%	0.79%
过去一年	16.58%	1.64%	13.21%	1.01%	3.37%	0.63%
过去三年	-24.78%	1.20%	-3.12%	0.82%	-21.66%	0.38%
自基金合同生效起至今	-32.84%	1.15%	-11.05%	0.85%	-21.79%	0.30%

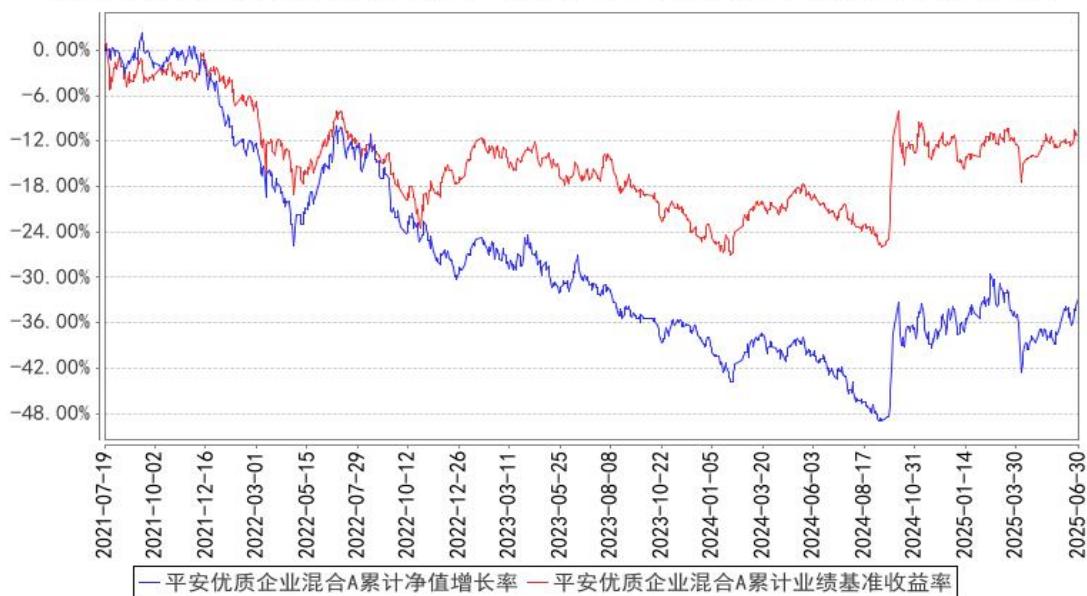
平安优质企业混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.41%	1.10%	2.04%	0.44%	5.37%	0.66%
过去三个月	3.65%	1.73%	1.62%	0.84%	2.03%	0.89%
过去六个月	3.85%	1.57%	1.33%	0.78%	2.52%	0.79%
过去一年	15.64%	1.64%	13.21%	1.01%	2.43%	0.63%
过去三年	-26.57%	1.20%	-3.12%	0.82%	-23.45%	0.38%

自基金合同 生效起至今	-34.93%	1.15%	-11.05%	0.85%	-23.88%	0.30%
----------------	---------	-------	---------	-------	---------	-------

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

平安优质企业混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安优质企业混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2021 年 07 月 19 日正式生效；

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

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、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 2025 年 6 月 30 日，平安基金共管理 230 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6600 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛冀颖	平安优质企业混合型证券投资基金基金经理	2021 年 7 月 19 日	-	14 年	薛冀颖先生，清华大学信息科学技术专业博士研究生，曾担任鹏华基金管理有限公司研究员、融通基金管理有限公司基金经理。2020 年 6 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安优质企业混合型证券投资基金、平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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

2025 年上半年市场震荡上行，其中上证指数上涨 2.76%，创业板指上涨 0.53%，沪深 300 上涨 0.03%。上半年基本维持之前组合结构，整体提升了一定仓位，主要在于一些优质公司的估值水平仍具有一定吸引力，政策方面持续有利好，预计市场风险偏好能够维持高位，而且随着无风险收益率的持续下降，预计持续会有增量资金入市，带来结构性的机会。上半年加仓的个股主要是人工智能算力和创新药方向的优质标的，主要在于产业趋势确定，相关公司的成长潜力较大。另外二季度增加的个股配置偏向于港股，主要在于港股较多优质标的过去几年因为资金持续流出，估值处于较低位置，随着宏观环境的变化，国内外资金都逐渐增加港股的配置，以及较多科技和创新药公司业务取得了明显突破，估值有较大的修复空间。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安优质企业混合 A 的基金份额净值 0.6716 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.25%，同期业绩比较基准收益率为 1.33%；截至本报告期末平安优质企业混合 C 的基金份额净值 0.6507 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.85%，同期业绩比较基准收益率为 1.33%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前位置来看 a 股较多优质公司的估值水平仍然相对较低，长期来看具备较好的配置价值。随着推动经济的政策持续出台，市场信心逐渐增强，市场风险偏好维持在较高水平，叠加无风险收益率持续下降，带来了持续的新增资金入市。因此判断市场较长时间内会震荡上行，值得去积极寻找结构性的机会。不过也应看到前期较多公司股价上涨主要是估值提升，还是需要紧密跟踪个股的业绩，在普涨行情过后，对个股需要仔细筛选，积极寻找所在行业符合产业趋势、行业景气度较高以及有较强竞争力的优质公司进行配置。相对而言，成长领域的一些方向相对更有吸引力，主要在于一些成长领域有自身的产业趋势，行业的成长性较为确定，其中人工智能这个方向最值得重视，从国内外的进展来看，人工智能迭代和更新的速度在不断加快，往后有越来越多超预期的应用和创新，这一产业趋势会带来较多行业深刻变革，值得去挖掘相应的标的。根据年初以来业绩公告情况，较多优质算力公司的业绩超市场预期，值得重视。另外创新药方向也值得重点关注，经过多年积累，国内创新药企业的竞争力明显提升，近两年很多公司的业务都有望取得突破性的进展，在业绩上也有明显体现，因此值得积极挖掘个股标的。

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

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：平安优质企业混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	70,417,354.33	173,334,179.25
结算备付金		3,141,260.68	34,426,490.81
存出保证金		625,816.86	655,562.84
交易性金融资产	6.4.7.2	1,100,955,761.72	837,107,976.50
其中：股票投资		1,100,955,761.72	837,107,976.50
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—

衍生金融资产	6. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	-	244, 980, 620. 40
应收清算款		11, 376, 444. 90	-
应收股利		748, 427. 42	-
应收申购款		13, 250. 14	5, 950. 25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		1, 187, 278, 316. 05	1, 290, 510, 780. 05
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 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		-	58, 755, 396. 70
应付赎回款		1, 294, 807. 58	2, 938, 976. 69
应付管理人报酬		1, 132, 435. 53	1, 246, 729. 48
应付托管费		188, 739. 24	207, 788. 24
应付销售服务费		29, 653. 08	37, 019. 86
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	1, 464, 610. 42	3, 337, 755. 48
负债合计		4, 110, 245. 85	66, 523, 666. 45
<b>净资产:</b>			
实收基金	6. 4. 7. 10	1, 763, 842, 237. 07	1, 902, 308, 598. 54
未分配利润	6. 4. 7. 12	-580, 674, 166. 87	-678, 321, 484. 94
净资产合计		1, 183, 168, 070. 20	1, 223, 987, 113. 60
负债和净资产总计		1, 187, 278, 316. 05	1, 290, 510, 780. 05

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 1, 763, 842, 237. 07 份，其中下属 A 类基金份额净值 0. 6716 元，基金份额总额 1, 692, 413, 537. 23 份；下属 C 类基金份额净值 0. 6507 元，基金份额总额 71, 428, 699. 84 份。

## 6. 2 利润表

会计主体：平安优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	-----	--	---

<b>一、营业总收入</b>		56,572,682.07	-85,887,425.43
1. 利息收入		488,878.51	2,644,474.12
其中：存款利息收入	6.4.7.13	274,582.18	531,138.30
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		214,296.33	2,113,335.82
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”号填列)		90,485,855.70	-23,476,217.99
其中：股票投资收益	6.4.7.14	83,725,777.67	-33,393,687.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	6,760,078.03	9,917,469.40
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	-34,404,913.27	-65,056,442.52
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	2,861.13	760.96
<b>减：二、营业总支出</b>		8,517,343.62	9,181,902.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,036,635.94	7,589,879.75
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,172,772.61	1,264,979.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	181,688.39	198,846.09
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	126,246.68	128,196.53
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		48,055,338.45	-95,069,327.79
<b>减：所得税费用</b>		-	-

<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		48,055,338.45	-95,069,327.79
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		48,055,338.45	-95,069,327.79

### 6.3 净资产变动表

会计主体：平安优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2025年1月1日至2025年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,902,308,598.54	-678,321,484.94	1,223,987,113.60
二、本期期初净资产	1,902,308,598.54	-678,321,484.94	1,223,987,113.60
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-138,466,361.47	97,647,318.07	-40,819,043.40
(一)、综合收益总额	-	48,055,338.45	48,055,338.45
(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)	-138,466,361.47	49,591,979.62	-88,874,381.85
其中：1. 基金申购款	8,717,989.47	-3,127,662.14	5,590,327.33
2. 基金赎回款	-147,184,350.94	52,719,641.76	-94,464,709.18
(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	1,763,842,237.07	-580,674,166.87	1,183,168,070.20
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,204,305,754.41	-837,019,636.06	1,367,286,118.35
二、本期期初净资产	2,204,305,754.41	-837,019,636.06	1,367,286,118.35
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-145,130,635.02	-36,972,743.31	-182,103,378.33

(一)、综合收益总额	-	-95,069,327.79	-95,069,327.79
(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)	-145,130,635.02	58,096,584.48	-87,034,050.54
其中: 1. 基金申购款	8,289,740.37	-3,359,089.88	4,930,650.49
2. 基金赎回款	-153,420,375.39	61,455,674.36	-91,964,701.03
(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	2,059,175,119.39	-873,992,379.37	1,185,182,740.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安优质企业混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]957 号《关于准予平安优质企业混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安优质企业混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,339,569,136.50 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2021）第 0737 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安优质企业混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 7 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,340,949,620.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,380,484.05 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《平安优质企业混合型证券投资基金基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安优质企业混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券）、资产支持证券、信用衍生品、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、现金等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。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为 60%-95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权合约的投资比例遵循国家相关法律法规。如果法律法规或中国证监会允许基金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×70%+中证全债指数收益率×25%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本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管理业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金管理信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 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。

#### (5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	70,417,354.33
等于：本金	70,406,815.19
加：应计利息	10,539.14
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	70,417,354.33

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,174,856,993.44	-	1,100,955,761.72	-73,901,231.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

合计	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,174,856,993.44	-	1,100,955,761.72	-73,901,231.72

### 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：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金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：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	173.18
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,372,697.39
其中：交易所市场	1,372,697.39
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,739.85
合计	1,464,610.42

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

#### 平安优质企业混合 A

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,818,338,522.39	1,818,338,522.39
本期申购	5,313,874.24	5,313,874.24
本期赎回(以“-”号填列)	-131,238,859.40	-131,238,859.40
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	1,692,413,537.23	1,692,413,537.23

#### 平安优质企业混合 C

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	83,970,076.15	83,970,076.15
本期申购	3,404,115.23	3,404,115.23

本期赎回(以“-”号填列)	-15,945,491.54	-15,945,491.54
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	71,428,699.84	71,428,699.84

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 平安优质企业混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-639,561,473.94	-7,404,685.34	-646,966,159.28
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-639,561,473.94	-7,404,685.34	-646,966,159.28
本期利润	79,480,768.77	-33,177,718.76	46,303,050.01
本期基金份额交易产生的变动数	40,302,020.19	4,638,197.29	44,940,217.48
其中：基金申购款	-1,670,376.49	-179,290.68	-1,849,667.17
基金赎回款	41,972,396.68	4,817,487.97	46,789,884.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-519,778,684.98	-35,944,206.81	-555,722,891.79

##### 平安优质企业混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-30,976,080.93	-379,244.73	-31,355,325.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-30,976,080.93	-379,244.73	-31,355,325.66
本期利润	2,979,482.95	-1,227,194.51	1,752,288.44
本期基金份额交易产生的变动数	4,563,627.22	88,134.92	4,651,762.14
其中：基金申购款	-1,144,466.82	-133,528.15	-1,277,994.97
基金赎回款	5,708,094.04	221,663.07	5,929,757.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,432,970.76	-1,518,304.32	-24,951,275.08

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	236,520.62
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	36,434.50
其他	1,627.06
合计	274,582.18

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	83,725,777.67
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	83,725,777.67

##### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	3,409,644,300.17
减：卖出股票成本总额	3,319,470,591.15
减：交易费用	6,447,931.35
买卖股票差价收入	83,725,777.67

##### 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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

##### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,760,078.03
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	6,760,078.03

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	-34,404,913.27
股票投资	-34,404,913.27
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-34,404,913.27

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	2,678.91
基金转换费收入	182.22
合计	2,861.13

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《平安优质企业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。

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	27,898.85
其他	6,607.98
合计	126,246.68

## 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
上海陆金所基金销售有限公司（“陆基金”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”）	基金管理人的最终控股母公司
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 2025年1月1日至2025年6 月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30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	48,363,764.65	0.69	179,836,413.88	1.97
------	---------------	------	----------------	------

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30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	-	-	269,190,000.00	1.18

#### 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 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
方正证券	21,081.61	0.70	21,081.61	1.54
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日				
关联方名称	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	144,088.54	2.04	-	-

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管理费用管理规定》，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。

### 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 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,036,635.94	7,589,879.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,412,492.33	3,663,631.68
应支付基金管理人的净管理费	3,624,143.61	3,926,248.07

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
 日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,172,772.61	1,264,979.99

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C	合计
陆基金	-	1,837.45	1,837.45
平安基金	-	210.45	210.45
平安人寿	-	22,481.66	22,481.66
平安银行	-	5,592.96	5,592.96
中国银行	-	76,014.39	76,014.39
合计	-	106,136.91	106,136.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		

方名称	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C	合计
陆基金	-	2,054.10	2,054.10
平安基金	-	199.24	199.24
平安人寿	-	22,041.08	22,041.08
平安银行	-	5,388.54	5,388.54
中国银行	-	83,987.37	83,987.37
合计	-	113,670.33	113,670.33

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 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 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×0.80%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期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。

#### 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

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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
中国银行-活期	70,417,354.33	236,520.62	82,616,299.95	202,952.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期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（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025年4月2日	6个月	新股锁定	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001382	新亚电缆	2025年3月13日	6个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001388	信通电子	2025年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001390	古麒绒	2025年5月21日	6个月	新股锁定	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-

	材	日		定						
301479	弘景光电	2025年3月6日	6个月	新股锁定	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股锁定	27.57	45.22	349	9,620.72	15,781.78	-
301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股锁定	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股锁定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股锁定	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股锁定	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股锁定	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股锁定	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡	2025年5月27日	6个月	新股锁	46.50	42.85	543	25,249.50	23,267.55	-

	胶 日		定						
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46
688192	迪哲医药	2025 年 4 月 22 日	6 个月	非公开发行	43.00	55.11	162,791	7,000,013.00	8,971,412.01

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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、风控负责人、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，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：同）。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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，并按照合约规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 2025年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	70,417,354.33	-	-	-	70,417,354.33
结算备付金	3,141,260.68	-	-	-	3,141,260.68
存出保证金	625,816.86	-	-	-	625,816.86
交易性金融资产	-	-	-	1,100,955,761. 72	1,100,955,761.72
应收股利	-	-	-	748,427.42	748,427.42
应收申购款	-	-	-	13,250.14	13,250.14
应收清算款	-	-	-	11,376,444.90	11,376,444.90
资产总计	74,184,431.87	-	-	1,113,093,884. 18	1,187,278,316.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,294,807.58	1,294,807.58
应付管理人报酬	-	-	-	1,132,435.53	1,132,435.53
应付托管费	-	-	-	188,739.24	188,739.24
应付销售服务费	-	-	-	29,653.08	29,653.08
其他负债	-	-	-	1,464,610.42	1,464,610.42
负债总计	-	-	-	4,110,245.85	4,110,245.85
利率敏感度缺口	74,184,431.87	-	-	-1,108,983,638.	1,183,168,070.20

				33	
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	173,334,179.25	-	-	-	173,334,179.25
结算备付金	34,426,490.81	-	-	-	34,426,490.81
存出保证金	655,562.84	-	-	-	655,562.84
交易性金融资产	-	-	-837,107,976.50	837,107,976.50	837,107,976.50
买入返售金融资产	244,980,620.40	-	-	-	244,980,620.40
应收申购款	-	-	-	5,950.25	5,950.25
<b>资产总计</b>	<b>453,396,853.30</b>	-	-837,113,926.75	<b>1,290,510,780.05</b>	
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	2,938,976.69	2,938,976.69
应付管理人报酬	-	-	-	1,246,729.48	1,246,729.48
应付托管费	-	-	-	207,788.24	207,788.24
应付清算款	-	-	-	58,755,396.70	58,755,396.70
应付销售服务费	-	-	-	37,019.86	37,019.86
其他负债	-	-	-	3,337,755.48	3,337,755.48
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	-	-	<b>66,523,666.45</b>	<b>66,523,666.45</b>
利率敏感度缺口	453,396,853.30	-	-770,590,260.30	1,223,987,113.60	

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本报告期末，本基金未持有交易性债券资产投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资	-	239,730,579.85	-	239,730,579.85

产				
资产合计	-	239,730,579.85	-	239,730,579.85
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	239,730,579.85	-	239,730,579.85
项目	上年度末 2024年12月31日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	59,644,027.80	-	59,644,027.80
资产合计	-	59,644,027.80	-	59,644,027.80
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	59,644,027.80	-	59,644,027.80

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变 动		对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)
		本期末 (2025年6月30日)	上年度末 (2024年12月 31日)
分析	所有外币相对于人 民币升值 5%	11,986,528.99	2,982,201.39
	所有外币相对于人 民币贬值 5%	-11,986,528.99	-2,982,201.39

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 2025年6月30日		上年度末 2024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	1,100,955,761.72	93.05	837,107,976.50	68.39
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	1,100,955,761.72	93.05	837,107,976.50	68.39

#### 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		
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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	76,401,237.41	54,906,749.96
	沪深 300 指数下降 5%	-76,401,237.41	-54,906,749.96

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

## 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	1,091,810,458.42	836,919,819.39
第二层次	15,385.54	-
第三层次	9,129,917.76	188,157.11
合计	1,100,955,761.72	837,107,976.50

#### 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。

#### 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

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。

## 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	1,100,955,761.72	92.73
	其中：股票	1,100,955,761.72	92.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	73,558,615.01	6.20
8	其他各项资产	12,763,939.32	1.08
9	合计	1,187,278,316.05	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 239,730,579.85 元，占净值比例 20.26%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,015,928.00	0.93
C	制造业	666,283,973.81	56.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,120,901.00	0.60
E	建筑业	2,913,120.00	0.25
F	批发和零售业	9,927,965.00	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	3,513,112.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,832,424.06	7.09
J	金融业	61,772,458.00	5.22
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	14,845,300.00	1.25
S	综合	-	-
	合计	861,225,181.87	72.79

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
原材料	-	-
周期性消费品	13,799,034.63	1.17
非周期性消费品	17,668,721.19	1.49
能源	-	-
金融	13,098,921.50	1.11
医疗	124,409,655.33	10.51
工业	1,957,737.78	0.17
地产业	6,895,062.44	0.58
信息科技	26,694,687.04	2.26
电信服务	35,206,759.94	2.98
公用事业	-	-
合计	239,730,579.85	20.26

注：以上分类采用全球行业分类标准。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	405,608	51,520,328.16	4.35
2	01530	三生制药	1,897,500	40,924,554.21	3.46
3	01093	石药集团	5,294,000	37,174,547.41	3.14
4	600030	中信证券	1,228,600	33,933,932.00	2.87
5	002463	沪电股份	738,300	31,436,814.00	2.66
6	00728	中国电信	4,010,000	20,405,610.81	1.72
7	603606	东方电缆	378,400	19,567,064.00	1.65
8	002126	银轮股份	789,000	19,156,920.00	1.62
9	300750	宁德时代	74,800	18,866,056.00	1.59
10	601288	农业银行	3,165,100	18,610,788.00	1.57
11	688800	瑞可达	360,164	17,720,068.80	1.50
12	01177	中国生物制药	3,605,000	17,292,669.49	1.46
13	002384	东山精密	457,300	17,272,221.00	1.46
14	600521	华海药业	877,800	16,353,414.00	1.38
15	300364	中文在线	560,200	14,845,300.00	1.25
16	603228	景旺电子	352,700	14,756,968.00	1.25

17	603986	兆易创新	104, 200	13, 184, 426. 00		1. 11
18	00966	中国太平	938, 800	13, 098, 921. 50		1. 11
19	300274	阳光电源	182, 580	12, 373, 446. 60		1. 05
20	002558	巨人网络	513, 900	12, 102, 345. 00		1. 02
21	688608	恒玄科技	32, 444	11, 289, 863. 12		0. 95
22	301600	慧翰股份	113, 240	11, 092, 990. 40		0. 94
23	06855	亚盛医药—B	158, 400	11, 050, 645. 32		0. 93
24	600577	精达股份	1, 483, 500	11, 037, 240. 00		0. 93
25	01801	信达生物	150, 500	10, 760, 280. 44		0. 91
26	601100	恒立液压	149, 000	10, 728, 000. 00		0. 91
27	688205	德科立	164, 104	10, 287, 679. 76		0. 87
28	688200	华峰测控	69, 546	10, 028, 533. 20		0. 85
29	300679	电连技术	219, 300	9, 951, 834. 00		0. 84
30	002475	立讯精密	277, 000	9, 609, 130. 00		0. 81
31	688536	思瑞浦	68, 661	9, 524, 653. 92		0. 81
32	688337	普源精电	264, 903	9, 449, 090. 01		0. 80
33	01024	快手—W	162, 200	9, 363, 227. 76		0. 79
34	300033	同花顺	33, 800	9, 227, 738. 00		0. 78
35	300153	科泰电源	271, 200	9, 180, 120. 00		0. 78
36	688192	迪哲医药	162, 791	8, 971, 412. 01		0. 76
37	300204	舒泰神	235, 900	8, 794, 352. 00		0. 74
38	09992	泡泡玛特	36, 000	8, 752, 531. 32		0. 74
39	688213	思特威	84, 427	8, 630, 127. 94		0. 73
40	688433	华曙高科	234, 612	8, 621, 991. 00		0. 73
41	300378	鼎捷数智	234, 122	8, 568, 865. 20		0. 72
42	601058	赛轮轮胎	634, 400	8, 323, 328. 00		0. 70
43	300115	长盈精密	385, 254	8, 244, 435. 60		0. 70
44	06181	老铺黄金	8, 600	7, 905, 512. 16		0. 67
45	300476	胜宏科技	58, 000	7, 794, 040. 00		0. 66
46	688111	金山办公	27, 792	7, 783, 149. 60		0. 66
47	688333	铂力特	128, 941	7, 679, 725. 96		0. 65
48	300443	金雷股份	339, 800	7, 679, 480. 00		0. 65
49	688629	华丰科技	127, 563	7, 296, 603. 60		0. 62
50	02556	迈富时	162, 200	7, 188, 828. 89		0. 61
51	00960	龙湖集团	816, 500	6, 895, 062. 44		0. 58
52	300454	深信服	72, 100	6, 790, 378. 00		0. 57
53	300638	广和通	236, 100	6, 759, 543. 00		0. 57
54	600570	恒生电子	200, 600	6, 728, 124. 00		0. 57
55	688776	国光电气	63, 731	6, 722, 345. 88		0. 57
56	600129	太极集团	314, 940	6, 711, 371. 40		0. 57
57	01112	H & H 国际控股	634, 500	6, 607, 980. 58		0. 56
58	688041	海光信息	45, 295	6, 399, 730. 55		0. 54
59	300980	祥源新材	267, 659	6, 268, 573. 78		0. 53

60	603019	中科曙光	88,800	6,251,520.00	0.53
61	300383	光环新网	426,300	6,096,090.00	0.52
62	002080	中材科技	311,800	6,080,100.00	0.51
63	300394	天孚通信	75,500	6,027,920.00	0.51
64	688519	南亚新材	133,864	5,997,107.20	0.51
65	688300	联瑞新材	128,049	5,960,680.95	0.50
66	600835	上海机电	280,300	5,956,375.00	0.50
67	300870	欧陆通	47,077	5,955,240.50	0.50
68	300433	蓝思科技	266,700	5,947,410.00	0.50
69	300395	菲利华	116,300	5,942,930.00	0.50
70	301263	泰恩康	164,300	5,814,577.00	0.49
71	002230	科大讯飞	120,100	5,750,388.00	0.49
72	601689	拓普集团	120,845	5,709,926.25	0.48
73	301301	川宁生物	473,100	5,696,124.00	0.48
74	300073	当升科技	129,200	5,668,004.00	0.48
75	300223	北京君正	81,900	5,667,480.00	0.48
76	600150	中国船舶	172,780	5,622,261.20	0.48
77	300776	帝尔激光	104,200	5,544,482.00	0.47
78	03896	金山云	910,000	5,510,366.68	0.47
79	301018	申菱环境	139,000	5,273,660.00	0.45
80	688362	甬矽电子	176,109	5,244,526.02	0.44
81	002110	三钢闽光	1,486,200	5,216,562.00	0.44
82	603890	春秋电子	445,100	5,163,160.00	0.44
83	600686	金龙汽车	412,500	5,115,000.00	0.43
84	06969	思摩尔国际	302,000	5,023,458.34	0.42
85	603005	晶方科技	176,600	5,013,674.00	0.42
86	02498	速腾聚创	169,500	4,985,060.68	0.42
87	300661	圣邦股份	67,015	4,876,681.55	0.41
88	000528	柳工	506,600	4,868,426.00	0.41
89	300910	瑞丰新材	83,900	4,845,225.00	0.41
90	603063	禾望电气	138,500	4,689,610.00	0.40
91	300693	盛弘股份	156,056	4,675,437.76	0.40
92	601088	中国神华	111,000	4,499,940.00	0.38
93	300525	博思软件	299,100	4,354,896.00	0.37
94	09626	哔哩哔哩-W	28,300	4,328,032.62	0.37
95	600547	山东黄金	133,200	4,253,076.00	0.36
96	002025	航天电器	80,600	4,143,646.00	0.35
97	603305	旭升集团	317,400	4,142,070.00	0.35
98	002727	一心堂	251,600	4,111,144.00	0.35
99	301004	嘉益股份	60,000	3,973,800.00	0.34
100	02269	药明生物	165,000	3,859,600.39	0.33
101	002851	麦格米特	75,800	3,800,612.00	0.32
102	000690	宝新能源	820,000	3,731,000.00	0.32

103	688244	永信至诚	137, 570	3, 620, 842. 40	0. 31
104	688625	呈和科技	117, 096	3, 580, 795. 68	0. 30
105	002837	英维克	120, 100	3, 568, 171. 00	0. 30
106	002050	三花智控	134, 900	3, 558, 662. 00	0. 30
107	601872	招商轮船	561, 200	3, 513, 112. 00	0. 30
108	300763	锦浪科技	60, 500	3, 472, 095. 00	0. 29
109	600031	三一重工	192, 900	3, 462, 555. 00	0. 29
110	002034	旺能环境	201, 900	3, 389, 901. 00	0. 29
111	002156	通富微电	132, 000	3, 381, 840. 00	0. 29
112	600566	济川药业	125, 400	3, 301, 782. 00	0. 28
113	600398	海澜之家	467, 100	3, 251, 016. 00	0. 27
114	601615	明阳智能	277, 900	3, 193, 071. 00	0. 27
115	002531	天顺风能	441, 400	3, 151, 596. 00	0. 27
116	688072	拓荆科技	20, 178	3, 101, 560. 38	0. 26
117	002335	科华数据	68, 900	2, 940, 652. 00	0. 25
118	688297	中无人机	55, 058	2, 940, 097. 20	0. 25
119	000032	深桑达A	144, 000	2, 913, 120. 00	0. 25
120	600592	龙溪股份	120, 600	2, 912, 490. 00	0. 25
121	002850	科达利	25, 400	2, 874, 518. 00	0. 24
122	603227	雪峰科技	341, 700	2, 863, 446. 00	0. 24
123	002922	伊戈尔	180, 400	2, 837, 692. 00	0. 24
124	688220	翱捷科技	35, 942	2, 814, 258. 60	0. 24
125	00268	金蝶国际	195, 000	2, 745, 699. 06	0. 23
126	01385	上海复旦	97, 000	2, 644, 928. 59	0. 22
127	06088	FIT HON TENG	1, 184, 000	2, 537, 409. 68	0. 21
128	600259	广晟有色	42, 600	2, 262, 912. 00	0. 19
129	02268	药明合联	59, 500	2, 257, 258. 64	0. 19
130	000811	冰轮环境	226, 331	2, 218, 043. 80	0. 19
131	000938	紫光股份	87, 600	2, 101, 524. 00	0. 18
132	00317	中船防务	154, 000	1, 957, 737. 78	0. 17
133	600609	金杯汽车	335, 300	1, 773, 737. 00	0. 15
134	002779	中坚科技	19, 880	1, 496, 367. 60	0. 13
135	300687	赛意信息	51, 600	1, 433, 448. 00	0. 12
136	603039	泛微网络	23, 800	1, 325, 660. 00	0. 11
137	01797	东方甄选	112, 000	1, 211, 361. 42	0. 10
138	300017	网宿科技	104, 800	1, 123, 456. 00	0. 09
139	300203	聚光科技	50, 500	1, 117, 565. 00	0. 09
140	09899	网易云音乐	5, 050	1, 109, 888. 75	0. 09
141	09926	康方生物	13, 000	1, 090, 099. 43	0. 09
142	01478	丘钛科技	143, 000	1, 082, 393. 46	0. 09
143	02331	李宁	65, 500	1, 010, 677. 71	0. 09
144	06683	巨星传奇	204, 000	956, 234. 29	0. 08
145	603049	中策橡胶	543	23, 267. 55	0. 00

146	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
147	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
148	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
149	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
150	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
151	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
152	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
153	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
154	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
155	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
156	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
157	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
158	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
159	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
160	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
161	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
162	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
163	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	01530	三生制药	62,676,488.89	5.12
2	300502	新易盛	61,902,786.64	5.06
3	09988	阿里巴巴－W	61,765,677.74	5.05
4	688382	益方生物	58,850,419.50	4.81
5	603308	应流股份	56,926,351.60	4.65
6	688200	华峰测控	56,232,487.03	4.59
7	01801	信达生物	55,765,670.05	4.56
8	688799	华纳药厂	54,881,057.99	4.48
9	601100	恒立液压	54,056,961.80	4.42
10	01093	石药集团	53,510,324.56	4.37
11	06855	亚盛医药－B	49,470,753.57	4.04
12	00700	腾讯控股	46,347,900.35	3.79
13	603986	兆易创新	45,663,892.20	3.73
14	300115	长盈精密	45,336,000.06	3.70
15	601288	农业银行	41,798,895.00	3.41
16	300308	中际旭创	37,857,588.00	3.09
17	00981	中芯国际	36,846,087.32	3.01
18	09926	康方生物	35,877,547.13	2.93
19	002463	沪电股份	35,064,669.00	2.86
20	000811	冰轮环境	35,037,940.20	2.86
21	002126	银轮股份	34,049,644.05	2.78

22	600030	中信证券	33,608,692.00	2.75
23	002335	科华数据	33,388,434.20	2.73
24	03896	金山云	32,086,623.45	2.62
25	002517	恺英网络	31,576,647.50	2.58
26	300750	宁德时代	31,531,895.00	2.58
27	600519	贵州茅台	29,507,726.00	2.41
28	300723	一品红	29,422,830.50	2.40
29	300454	深信服	28,362,443.36	2.32
30	688333	铂力特	28,030,516.46	2.29
31	00728	中国电信	21,755,409.53	1.78
31	601728	中国电信	6,262,857.00	0.51
32	300680	隆盛科技	27,634,572.60	2.26
33	688426	康为世纪	26,583,132.13	2.17
34	300364	中文在线	26,204,849.00	2.14
35	603606	东方电缆	24,839,407.00	2.03

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	688799	华纳药厂	70,404,288.83	5.75
2	09988	阿里巴巴－W	67,507,527.90	5.52
3	688382	益方生物	66,717,621.97	5.45
4	603308	应流股份	66,248,307.40	5.41
5	601288	农业银行	64,551,028.00	5.27
6	600519	贵州茅台	63,634,680.00	5.20
7	00981	中芯国际	51,623,762.90	4.22
7	688981	中芯国际	10,216,579.51	0.83
8	002851	麦格米特	51,745,855.80	4.23
9	00700	腾讯控股	51,100,812.48	4.17
10	601100	恒立液压	49,601,866.00	4.05
11	06855	亚盛医药－B	48,569,761.48	3.97
12	01801	信达生物	45,135,401.80	3.69
13	688200	华峰测控	44,724,521.03	3.65
14	300308	中际旭创	40,715,682.20	3.33
15	000651	格力电器	39,144,263.22	3.20
16	002384	东山精密	38,428,976.00	3.14
17	002335	科华数据	37,727,107.56	3.08
18	300502	新易盛	37,429,826.80	3.06
19	300750	宁德时代	36,490,857.40	2.98
20	000811	冰轮环境	35,128,023.00	2.87
21	03896	金山云	34,335,097.07	2.81
22	300723	一品红	34,305,284.10	2.80
23	300115	长盈精密	33,161,365.20	2.71

24	603986	兆易创新	32,798,124.00	2.68
25	09926	康方生物	32,239,835.56	2.63
26	01530	三生制药	31,978,166.06	2.61
27	002517	恺英网络	31,172,518.00	2.55
28	300680	隆盛科技	30,282,359.00	2.47
29	688256	寒武纪	29,297,605.24	2.39
30	002130	沃尔核材	28,667,867.00	2.34
31	688322	奥比中光	27,369,352.31	2.24
32	000034	神州数码	26,015,456.35	2.13
33	601138	工业富联	25,578,079.20	2.09
34	603119	浙江荣泰	24,711,654.20	2.02
35	002463	沪电股份	24,643,402.90	2.01

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	3,617,723,289.64
卖出股票收入（成交）总额	3,409,644,300.17

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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，中国农业银行股份有限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	625,816.86
2	应收清算款	11,376,444.90
3	应收股利	748,427.42
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,250.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,763,939.32

#### 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	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
平安优质企业混合 A	12,089	139,996.16	11,464,208.34	0.68	1,680,949,328.89	99.32
平安优质企业混合 C	5,242	13,626.23	0.00	0.00	71,428,699.84	100.00
合计	17,228	102,382.30	11,464,208.34	0.65	1,752,378,028.73	99.35

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安优质企业混合 A	242,518.48	0.0143
	平安优质企业混合 C	50.00	0.0001
	合计	242,568.48	0.0138

注：上述从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C
基金合同生效日	3,196,560,278.64	144,389,341.91

(2021年7月19日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份 额总额	1,818,338,522.39	83,970,076.15
本报告期基金总申购 份额	5,313,874.24	3,404,115.23
减：本报告期基金总 赎回份额	131,238,859.40	15,945,491.54
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	1,692,413,537.23	71,428,699.84

## § 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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

报告期内，李海波先生新任公司督察长，原督察长陈特正先生转任风控负责人；游自强先生新任公司信息技术负责人，副总经理林婉文女士不再兼任信息技术负责人。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

### 10.4 基金投资策略的改变

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：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。

### 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 (%)	
国联民生 证券	2	1,308,710,79 0.24	18.64	570,460.61	18.99	
中金公司	2	1,041,402,34 1.84	14.84	425,256.23	14.15	
浙商证券	2	636,489,874. 79	9.07	270,401.61	9.00	
华福证券	2	586,305,291. 60	8.35	255,565.36	8.51	
国海证券	1	369,609,513. 20	5.27	161,112.75	5.36	
国泰海通 证券	2	364,647,034. 79	5.19	153,199.08	5.10	
招商证券	2	354,236,868. 97	5.05	151,972.01	5.06	
华泰证券	3	280,912,911. 68	4.00	122,449.61	4.08	
西南证券	1	279,190,366. 88	3.98	121,698.59	4.05	
长江证券	1	247,312,428. 15	3.52	107,799.44	3.59	
天风证券	1	209,179,937. 87	2.98	91,181.97	3.03	
东方证券	3	205,977,576. 12	2.93	83,529.41	2.78	
财通证券	1	199,746,263. 59	2.85	87,069.27	2.90	
中信证券	2	159,845,436. 44	2.28	69,676.04	2.32	
国盛证券	1	145,833,544. 90	2.08	61,779.04	2.06	
国信证券	2	135,038,850. 87	1.92	58,862.12	1.96	
华西证券	1	113,631,230.	1.62	49,531.80	1.65	

		64				
广发证券	3	102,346,678.07	1.46	43,935.52	1.46	
兴业证券	2	81,337,824.70	1.16	33,037.79	1.10	
国金证券	1	67,664,677.50	0.96	29,493.29	0.98	
国投证券	3	50,734,815.65	0.72	22,115.19	0.74	
方正证券	2	48,363,764.65	0.69	21,081.61	0.70	
德邦证券	2	12,276,313.58	0.17	5,351.07	0.18	
中邮证券	2	10,638,698.29	0.15	4,637.51	0.15	
长城证券	1	7,905,016.00	0.11	3,445.69	0.11	
诚通证券	1	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	2	-	-	-	-	
银河证券	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投证券	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。

3、报告期内新增交易单元的情况：无。

4、报告期内退租交易单元的情况：减少方正证券交易单元 1 个。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)

						例(%)
国联民生 证券	-	-	807,289,000. 00	32.42	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	339,136,000. 00	13.62	-	-
华福证券	-	-	125,240,000. 00	5.03	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	239,924,000. 00	9.63	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	435,835,000. 00	17.50	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	542,994,000. 00	21.80	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
------------	---	---	---	---	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年01月15日
2	平安优质企业混合型证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025年01月21日
3	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	2025年02月08日
4	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年02月28日
5	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月11日
6	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华创证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月12日
7	平安优质企业混合型证券投资基金2024年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月27日
8	平安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月31日
9	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金获配迪哲医药(688192)非公开发行A股公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年04月19日
10	平安优质企业混合型证券投资基金2025年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025年04月21日
11	平安优质企业混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025年05月30日
12	平安优质企业混合型证券投资基金招募说明书(更新)	中国证监会规定报刊及网站	2025年05月30日
13	平安基金管理有限公司关于新增上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年06月18日
14	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金2025年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年06月30日
15	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	2025年06月30日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安优质企业混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安优质企业混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安优质企业混合型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 12.3 查阅方式

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

平安基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日