

平安匠心优选混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 27 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 2021 年 08 月 26 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	11
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安匠心优选混合型证券投资基金	
基金简称	平安匠心优选混合	
基金主代码	008949	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 2 月 21 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	973,758,658.71 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C
下属分级基金的交易代码	008949	008950
报告期末下属分级基金的份额总额	811,664,179.62 份	162,094,479.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越基金业绩比较基准的资本增值。
投资策略	本基金通过定量、定性相结合的方法分析宏观经济、财政及货币政策、市场情绪、行业周期、资金供需情况等因素综合分析以及对资本市场发展趋势的判断，在评价未来一段时间各类的预期风险收益率、相关性的基础上，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	平安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正
	联系电话	0755-22626828
	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 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	518048	100818
法定代表人	罗春风	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)		
	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C	
本期已实现收益	356,071,760.87	64,017,396.04	
本期利润	118,991,928.96	9,741,934.89	
加权平均基金份额本期利润	0.1202	0.0528	
本期加权平均净值利润率	9.24%	4.11%	
本期基金份额净值增长率	5.78%	5.37%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)		
	期末可供分配利润	307,432,536.20	59,093,532.89
	期末可供分配基金份额利润	0.3788	0.3646
	期末基金资产净值	1,119,096,715.82	221,188,011.98

期末基金份额净值	1.3788	1.3646
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	67.12%	65.32%

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

平安匠心优选混合 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	4.50%	1.34%	-1.46%	0.60%	5.96%	0.74%
过去三个月	15.24%	1.38%	2.99%	0.73%	12.25%	0.65%
过去六个月	5.78%	2.03%	0.95%	0.99%	4.83%	1.04%
过去一年	41.01%	1.89%	19.87%	1.00%	21.14%	0.89%
自基金合同生效起至今	67.12%	1.79%	20.73%	1.00%	46.39%	0.79%

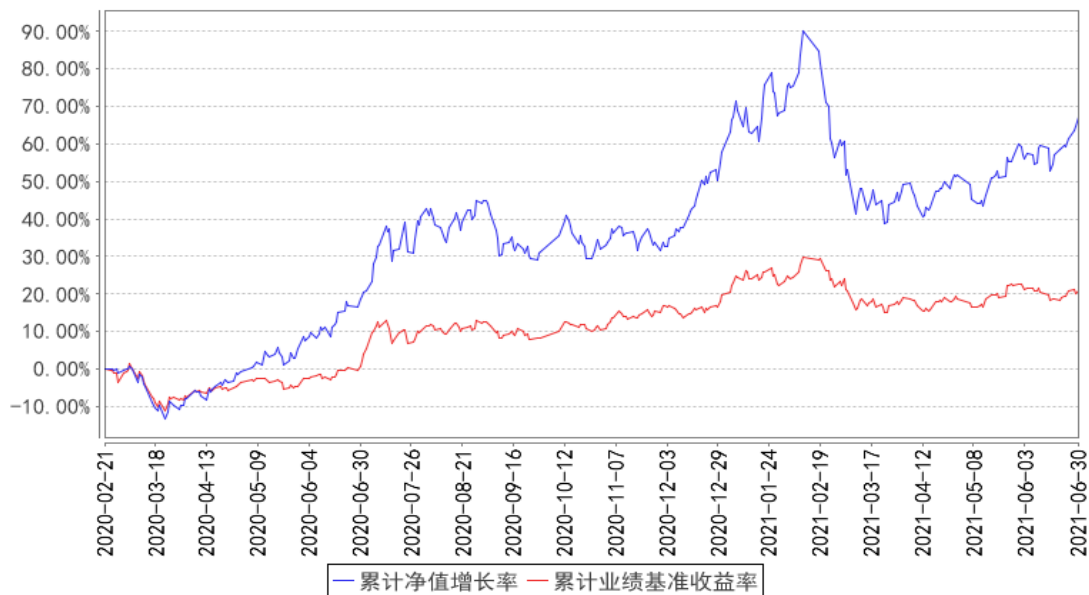
平安匠心优选混合 C

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

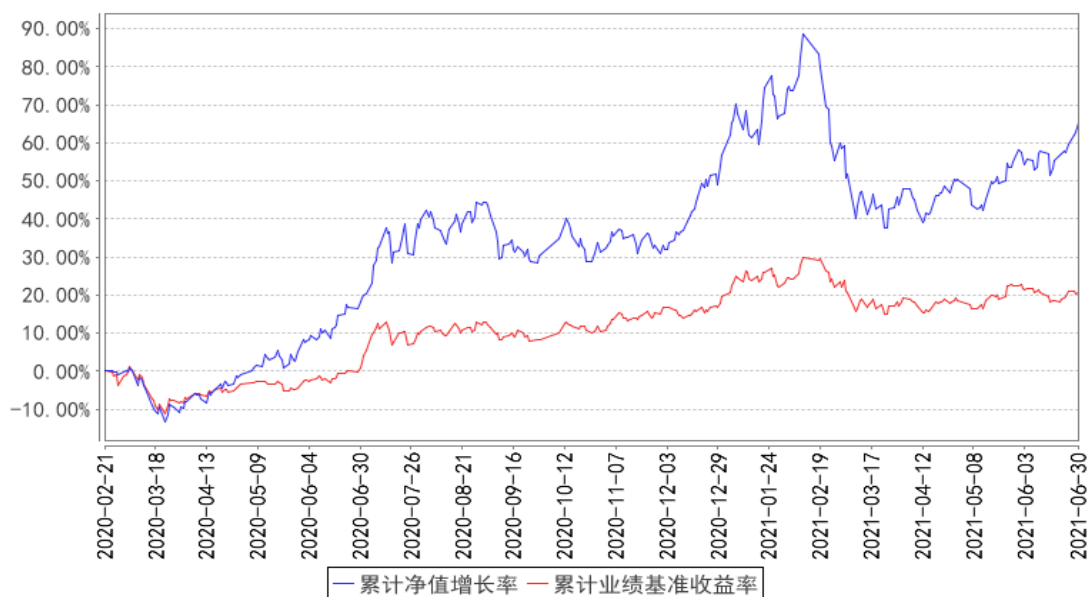
过去一个月	4.43%	1.34%	-1.46%	0.60%	5.89%	0.74%
过去三个月	15.01%	1.38%	2.99%	0.73%	12.02%	0.65%
过去六个月	5.37%	2.03%	0.95%	0.99%	4.42%	1.04%
过去一年	39.90%	1.89%	19.87%	1.00%	20.03%	0.89%
自基金合同生效起 至今	65.32%	1.79%	20.73%	1.00%	44.59%	0.79%

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

平安匠心优选混合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



平安匠心优选混合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、本基金合同于 2020 年 02 月 21 日生效；

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合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2021 年 6 月 30 日，平安基金共管理 138 只公募基金，公募资产管理总规模约为 3,831 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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
黄维	权益投资中心投资副总监, 平安匠心优选混合型证券投资基金基金经理	2020年2月21日	2021年6月7日	10年	黄维先生, 北京大学微电子学硕士。曾先后任广发证券股份有限公司研究员、广发证券资产管理(广东)有限公司投资经理。2016年5月加入平安基金管理有限公司, 现任权益投资中心投资副总监, 同时担任平安睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金、平安优势产业灵活配置混合型证券投资基金、平安估值精选混合型证券投资基金、平安价值成长混合型证券投资基金基金经理。
李化松	公司总经理助理兼权益投资副总监, 平安匠心优选混合型证券投资基金基金经理	2020年2月25日	-	15年	李化松先生, 北京大学硕士。先后担任国信证券有限责任公司经济研究所分析师、华宝兴业基金管理有限公司研究部分析师、嘉实基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公司, 现任公司总经理助理兼权益投资副总监, 同时担任平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安高端制造混合型证券投资基金、平安匠心优选混合型证券投资基金、平安科技创新混合型证券投资基金、平安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、平安研究睿选混合型证券投资基金、平安低碳经济混合型证券投资基金、平安稳健增长混合型证券投资基金、平安兴鑫回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。

注: 1、对基金的首任基金经理, 其“任职日期”为基金合同生效日, “离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期; 对此后的非首任基金经理, “任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注: 无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来，各种创新机会持续出现，很多优秀公司在引领创新，业绩超出预期。

另一方面，面临新的经济周期和创新周期，一些老的优质公司，基本面也出现了问题，估值水平有较大调整。

面对市场的变化，我们保持谦卑的心态，敬畏市场，相信企业家和技术创新的力量。

积极学习消费升级和技术创新的投资机会，同时价值成长里优中选优，努力排除创新风险、经济周期风险。

在上半年里，找到了一批有较大成长空间的股票，也排除了一些风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安匠心优选混合 A 的基金份额净值 1.3788 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.78%，同期业绩比较基准收益率为 0.95%；截至本报告期末平安匠心优选混合 C 的基金份额净值 1.3646 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.37%，同期业绩比较基准收益率为 0.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中长期依然看好资本市场的投资价值。

一方面技术创新带来的新兴成长机会仍会持续出现，虽然短期估值可能略贵。另一方面，前期估值较贵的长期优质资产——以消费为代表的价值成长类公司，估值水平逐渐进入合理范围。

下一阶段，本基金将在维持目前权益仓位的基础上，结合经济、政策基本面的情况，以更加开放的心态，对于企业质地去伪存真，继续放眼长远，寻找竞争优势明显，长期空间较大的优质公司。

行业方面，结合估值，适度均衡，积极寻找消费升级（智能硬件、消费服务、品牌消费）、科技创新（新能源+消费硬件创新）、制造业升级等领域的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 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”）在平安匠心优选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合规守信、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：平安匠心优选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	144,797,136.12	224,898,693.78
结算备付金		2,717,798.81	10,920,794.45
存出保证金		811,425.38	998,289.90
交易性金融资产	6.4.7.2	1,178,768,241.26	2,130,718,656.43
其中：股票投资		1,178,768,241.26	2,130,718,656.43
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		34,878,210.38	51,567,673.31
应收利息	6.4.7.5	19,729.62	24,028.29
应收股利		-	-
应收申购款		1,043,592.69	2,740,237.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,363,036,134.26	2,421,868,373.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,893,338.97	3,117,894.02
应付赎回款		15,194,069.08	14,129,395.18
应付管理人报酬		1,626,822.59	2,978,833.75
应付托管费		271,137.10	496,472.31
应付销售服务费		144,979.18	182,081.64
应付交易费用	6.4.7.7	1,501,950.80	2,876,565.36
应交税费		-	0.11
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	119,108.74	100,806.01
负债合计		22,751,406.46	23,882,048.38
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	973,758,658.71	1,841,160,415.62
未分配利润	6.4.7.10	366,526,069.09	556,825,909.55
所有者权益合计		1,340,284,727.80	2,397,986,325.17
负债和所有者权益总计		1,363,036,134.26	2,421,868,373.55

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 973,758,658.71 份，其中平安匠心优选混合 A 基金份额总额 811,664,179.62 份，基金份额净值 1.3788。平安匠心优选混合 C 基金份额总额 162,094,479.09 份，基金份额净值 1.3646。

6.2 利润表

会计主体：平安匠心优选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 21 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		148,722,427.86	734,454,799.04
1. 利息收入		342,642.92	4,164,045.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	342,642.92	2,435,418.84
债券利息收入		-	3,187.54
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	1,725,439.47

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		436,104,222.58	134,691,721.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	432,585,826.20	117,401,198.93
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-1,412,475.29
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,518,396.38	18,702,997.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-291,355,293.06	586,788,683.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,630,855.42	8,810,347.92
减：二、费用		19,988,564.01	44,367,236.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,441,664.59	25,167,096.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,906,944.11	4,194,516.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	947,721.76	571,027.66
4. 交易费用	6.4.7.19	5,558,405.21	14,372,633.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	11.48
7. 其他费用	6.4.7.20	133,828.34	61,950.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		128,733,863.85	690,087,562.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		128,733,863.85	690,087,562.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安匠心优选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,841,160,415.62	556,825,909.55	2,397,986,325.17

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	128,733,863.85	128,733,863.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-867,401,756.91	-319,033,704.31	-1,186,435,461.22
其中：1. 基金申购款	344,589,691.38	117,527,719.44	462,117,410.82
2. 基金赎回款	-1,211,991,448.29	-436,561,423.75	-1,648,552,872.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	973,758,658.71	366,526,069.09	1,340,284,727.80
项目	上年度可比期间 2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,344,719,094.15	-	5,344,719,094.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	690,087,562.97	690,087,562.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,010,744,939.52	-258,742,176.43	-3,269,487,115.95
其中：1. 基金申购款	141,871,296.78	14,741,797.64	156,613,094.42
2. 基金赎回款	-3,152,616,236.30	-273,483,974.07	-3,426,100,210.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填	-	-	-

列)			
五、期末所有者 权益(基金净值)	2,333,974,154.63	431,345,386.54	2,765,319,541.17

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

平安匠心优选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[2019]1894 号《关于准予平安匠心优选混合型证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安匠心优选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 5,343,782,789.97 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(2020)第 0026 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安匠心优选混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,344,719,094.15 份基金份额,其中认购资金利息折合 936,304.18 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《平安匠心优选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《平安匠心优选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)、港股通标的股票、衍生工具(股指期货、国债期货、股票期权等)、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、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券等)、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、现金等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金可以根据有关法律法规的规定进行转融通证券出借业务交易。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。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 75%+中证全债指数收益率 \times 25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	144,797,136.12
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	144,797,136.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	923,053,537.13	1,178,768,241.26	255,714,704.13
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	923,053,537.13	1,178,768,241.26	255,714,704.13

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	16,043.62
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,332.78
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	353.22
合计	19,729.62

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,501,950.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,501,950.80

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,512.80
应付证券出借违约金	-
预提费用	113,595.94
合计	119,108.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安匠心优选混合 A

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,635,823,509.85	1,635,823,509.85
本期申购	186,113,684.45	186,113,684.45
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,010,273,014.68	-1,010,273,014.68
-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	811,664,179.62	811,664,179.62

平安匠心优选混合 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	205,336,905.77	205,336,905.77
本期申购	158,476,006.93	158,476,006.93
本期赎回 (以“-”号填列)	-201,718,433.61	-201,718,433.61
-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	162,094,479.09	162,094,479.09

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安匠心优选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	407,936,084.29	88,304,285.77	496,240,370.06
本期利润	356,071,760.87	-237,079,831.91	118,991,928.96
本期基金份额交易产生的变动数	-278,012,739.93	-29,787,022.89	-307,799,762.82
其中：基金申购款	76,646,002.65	-12,853,194.40	63,792,808.25
基金赎回款	-354,658,742.58	-16,933,828.49	-371,592,571.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	485,995,105.23	-178,562,569.03	307,432,536.20

平安匠心优选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	49,480,321.07	11,105,218.42	60,585,539.49

本期利润	64,017,396.04	-54,275,461.15	9,741,934.89
本期基金份额交易产生的变动数	-19,084,711.04	7,850,769.55	-11,233,941.49
其中：基金申购款	63,593,522.31	-9,858,611.12	53,734,911.19
基金赎回款	-82,678,233.35	17,709,380.67	-64,968,852.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	94,413,006.07	-35,319,473.18	59,093,532.89

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入		311,535.04
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		24,718.55
其他		6,389.33
合计		342,642.92

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		432,585,826.20
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		432,585,826.20

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		2,286,639,861.77
减：卖出股票成本总额		1,854,054,035.57
买卖股票差价收入		432,585,826.20

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于股票投资产生的证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,518,396.38
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	3,518,396.38

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-291,355,293.06
股票投资	-291,355,293.06
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	-291,355,293.06

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	3,615,197.58
基金转换费收入	15,657.84
合计	3,630,855.42

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,558,405.21
银行间市场交易费用	-
合计	5,558,405.21

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	15,732.40
账户维护费	9,000.00
合计	133,828.34

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无须作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司(“平安基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
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
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安保险”)	基金管理人的最终控股母公司

安集团”)	
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
上海陆金所基金销售有限公司(“陆金所”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
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
中国平安财产保险股份有限公司(“平安财险”)	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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年2月21日(基金合同生效日) 至2020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 (%)
平安证券	24,181,161.17	0.70	323,035,579.86	2.92

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年2月21日(基金合同生效日) 至2020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 (%)
平安证券	-	-	2,656,100,000.00	33.05

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 2021年1月1日至2021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 (%)
平安证券	12,090.71	0.42	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年2月21日（基金合同生效日）至2020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 (%)
平安证券	300,844.86	3.42	-	-

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年2月21日（基金合 同生效日）至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,441,664.59	25,167,096.81
其中：支付销售机构的客户维护费	4,801,432.44	16,190,641.23

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 1.50%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年2月21日（基金合 同生效日）至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,906,944.11	4,194,516.16

注：支付基金托管行中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C	合计
陆金所	-	117,481.07	117,481.07
平安基金	-	44,606.43	44,606.43
平安人寿	-	456,038.43	456,038.43
平安银行	-	60,873.53	60,873.53
平安证券	-	6,726.10	6,726.10
中国银行	-	86,575.93	86,575.93
合计	-	772,301.49	772,301.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 2 月 21 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C	合计
陆金所	-	112,232.37	112,232.37
平安基金	-	255.54	255.54
平安人寿	-	227,638.34	227,638.34
平安银行	-	9,389.70	9,389.70
平安证券	-	119.52	119.52
中国银行	-	140,174.19	140,174.19
合计	-	489,809.66	489,809.66

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C
基金合同生效日（2020年2月21日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日	2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日
	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C
基金合同生效日（2020年2月21日）持有的基金份额	10,000,900.09	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,900.09	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.4635%	-

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

平安匠心优选混合 A

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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 (%)
平安人寿	-	-	448,698,025.73	27.4295

份额单位：份

平安匠心优选混合 C

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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 (%)
平安财险	-	-	21,829,294.91	10.6310

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年2月21日（基金合同生效日）至2020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	144,797,136.12	311,535.04	184,664,042.48	1,826,398.19

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

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额

平安证券股份有限公司	605011	杭州热电	公开发行	525	3,239.25
平安证券股份有限公司	605162	新中港	公开发行	1,377	8,358.39
上年度可比期间 2020年2月21日（基金合同生效日）至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
-	-	-	-	-	-

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(2021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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股锁定	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月	2021年7月	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

		20 日	27 日							
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-

300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德	2021	2021	新股锁	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-

	新材	年 5 月 17 日	年 11 月 26 日	定						
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁 定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁 定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁 定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301006	迈拓股份	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁 定	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁 定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁 定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁 定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁 定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁 定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁 定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁 定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔	2021	2021	新股锁	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

	伟	年 6 月 23 日	年 12 月 30 日	定						
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁 定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁 定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁 定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021 年 6 月 2 日	2021 年 12 月 10 日	新股锁 定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688083	中望软件	2021 年 3 月 4 日	2021 年 9 月 13 日	新股锁 定	150.50	524.08	1,837	276,468.50	962,734.96	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688097	博众精工	2021 年 4 月 29 日	2021 年 11 月 12 日	新股锁 定	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-

688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	新股锁定	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688276	百克生物	2021年6月17日	2021年12月27日	新股锁定	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688345	博力威	2021年6月3日	2021年12月13日	新股锁定	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2022年1月3日	新股锁定	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688575	亚辉龙	2021年5月10日	2021年11月17日	新股锁定	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15	-
688606	奥泰生物	2021年3月17日	2021年9月27日	新股锁定	133.67	139.31	2,703	361,310.01	376,554.93	-
688607	康众医疗	2021年1月25日	2021年8月2日	新股锁定	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年7月7日	新股锁定	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52	-
688633	星球石墨	2021年3月17日	2021年9月24日	新股锁定	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12	-
688636	智明达	2021年3月30日	2021年10月8日	新股锁定	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688639	华恒生物	2021年4月14日	2021年10月22日	新股锁定	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-
688655	迅捷兴	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-

			日							
688661	和林微纳	2021年3月19日	2021年9月29日	新股锁定	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688681	科汇股份	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	118,600	4,634,134.51	6,683,110.00	-

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市场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从事转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的准入管理，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此违约风险可能性很小。

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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	144,797,136.12	-	-	-	144,797,136.12
结算备付金	2,717,798.81	-	-	-	2,717,798.81
存出保证金	811,425.38	-	-	-	811,425.38
交易性金融资产	-	-	-	1,178,768,241.26	1,178,768,241.26
应收利息	-	-	-	19,729.62	19,729.62
应收申购款	-	-	-	1,043,592.69	1,043,592.69
应收证券清算款	-	-	-	34,878,210.38	34,878,210.38
资产总计	148,326,360.31	-	-	1,214,709,773.95	1,363,036,134.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,194,069.08	15,194,069.08
应付管理人报酬	-	-	-	1,626,822.59	1,626,822.59
应付托管费	-	-	-	271,137.10	271,137.10
应付证券清算款	-	-	-	3,893,338.97	3,893,338.97
应付销售服务费	-	-	-	144,979.18	144,979.18
应付交易费用	-	-	-	1,501,950.80	1,501,950.80

其他负债	-	-	-	119,108.74	119,108.74
负债总计	-	-	-	22,751,406.46	22,751,406.46
利率敏感度缺口	148,326,360.31	-	-	-1,191,958,367.49	1,340,284,727.80
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	224,898,693.78	-	-	-	224,898,693.78
结算备付金	10,920,794.45	-	-	-	10,920,794.45
存出保证金	998,289.90	-	-	-	998,289.90
交易性金融资产	-	-	-	-2,130,718,656.43	2,130,718,656.43
应收利息	-	-	-	24,028.29	24,028.29
应收申购款	-	-	-	2,740,237.39	2,740,237.39
应收证券清算款	-	-	-	51,567,673.31	51,567,673.31
资产总计	236,817,778.13	-	-	-2,185,050,595.42	2,421,868,373.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,129,395.18	14,129,395.18
应付管理人报酬	-	-	-	2,978,833.75	2,978,833.75
应付托管费	-	-	-	496,472.31	496,472.31
应付证券清算款	-	-	-	3,117,894.02	3,117,894.02
应付销售服务费	-	-	-	182,081.64	182,081.64
应付交易费用	-	-	-	2,876,565.36	2,876,565.36
应交税费	-	-	-	0.11	0.11
其他负债	-	-	-	100,806.01	100,806.01
负债总计	-	-	-	23,882,048.38	23,882,048.38
利率敏感度缺口	236,817,778.13	-	-	-2,161,168,547.04	2,397,986,325.17

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于报告期末，本基金未持有交易性债券(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
----	-----

	2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	70,217,816.67	-	70,217,816.67
资产合计	-	70,217,816.67	-	70,217,816.67
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	-	70,217,816.67	-	70,217,816.67
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	98,175,387.06	-	98,175,387.06
资产合计	-	98,175,387.06	-	98,175,387.06
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	-	98,175,387.06	-	98,175,387.06

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	所有外币相对于人 民币升值 5%	3,510,890.83	4,908,769.35

	所有外币相对于人民币贬值 5%	-3,510,890.83	-4,908,769.35
--	-----------------	---------------	---------------

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	1,178,768,241.26	87.95	2,130,718,656.43	88.85
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	1,178,768,241.26	87.95	2,130,718,656.43	88.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深300指数”以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	沪深300指数上升5%	61,196,768.99	81,399,786.74
	沪深300指数下降5%	-61,196,768.99	-81,399,786.74

6.4.14 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	1,178,768,241.26	86.48
	其中：股票	1,178,768,241.26	86.48
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	147,514,934.93	10.82
8	其他各项资产	36,752,958.07	2.70
9	合计	1,363,036,134.26	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	60,055.50	0.00
B	采矿业	87,263.74	0.01
C	制造业	960,600,533.04	71.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,292,421.34	0.39
E	建筑业	207,169.38	0.02
F	批发和零售业	363,526.98	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	9,014.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,101,376.44	3.59
J	金融业	225,556.76	0.02
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	16,991,104.36	1.27
M	科学研究和技术服务业	60,591,673.24	4.52

N	水利、环境和公共设施管理业	238,656.60	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	15,755,714.52	1.18
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,108,550,424.59	82.71

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	11,129,902.08	0.83
非周期性消费品	22,514,021.25	1.68
能源	-	-
金融	-	-
医疗	-	-
工业	-	-
地产业	-	-
信息技术	10,965,133.60	0.82
电信服务	25,608,759.74	1.91
公用事业	-	-
合计	70,217,816.67	5.24

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	300750	宁德时代	130,500	69,791,400.00	5.21
2	000858	五粮液	218,372	65,050,835.08	4.85
3	300014	亿纬锂能	594,271	61,762,585.03	4.61
4	600519	贵州茅台	28,514	58,644,743.80	4.38
5	002415	海康威视	770,500	49,697,250.00	3.71
6	603259	药明康德	313,114	49,030,521.26	3.66
7	601012	隆基股份	533,040	47,355,273.60	3.53
8	002271	东方雨虹	753,934	41,707,628.88	3.11
9	300124	汇川技术	558,438	41,469,605.88	3.09
10	300782	卓胜微	76,880	41,323,000.00	3.08
11	002812	恩捷股份	170,650	39,949,165.00	2.98
12	601799	星宇股份	175,021	39,505,740.12	2.95
13	002709	天赐材料	356,878	38,036,057.24	2.84
14	000568	泸州老窖	147,314	34,757,265.16	2.59
15	300763	锦浪科技	189,890	34,294,134.00	2.56

16	688408	中信博	167,838	33,701,870.40	2.51
17	002706	良信股份	1,483,152	33,430,246.08	2.49
18	688116	天奈科技	228,436	26,955,448.00	2.01
19	300496	中科创达	170,200	26,731,612.00	1.99
20	00700	腾讯控股	52,700	25,608,759.74	1.91
21	688680	海优新材	87,816	22,568,712.00	1.68
22	002475	立讯精密	382,179	17,580,234.00	1.31
23	601888	中国中免	56,400	16,925,640.00	1.26
24	603799	华友钴业	147,900	16,890,180.00	1.26
25	300015	爱尔眼科	221,974	15,755,714.52	1.18
26	688390	固德威	46,980	15,691,320.00	1.17
27	300035	中科电气	621,200	15,188,340.00	1.13
28	688169	石头科技	12,032	15,172,352.00	1.13
29	300207	欣旺达	398,100	12,962,136.00	0.97
30	300628	亿联网络	140,000	11,732,000.00	0.88
31	300450	先导智能	193,428	11,632,759.92	0.87
32	00168	青岛啤酒股份	160,000	11,129,902.08	0.83
33	02382	舜宇光学科技	53,700	10,965,133.60	0.82
34	688099	晶晨股份	97,443	10,933,104.60	0.82
35	603986	兆易创新	57,835	10,867,196.50	0.81
36	300012	华测检测	340,100	10,842,388.00	0.81
37	03606	福耀玻璃	229,600	10,450,192.57	0.78
38	600060	海信视像	565,700	9,560,330.00	0.71
39	300671	富满电子	69,360	9,130,550.40	0.68
40	688007	光峰科技	216,080	9,049,430.40	0.68
41	002979	雷赛智能	255,115	7,314,147.05	0.55
42	600460	士兰微	118,600	6,683,110.00	0.50
43	03690	美团-W	23,000	6,131,763.94	0.46
44	02020	安踏体育	39,000	5,932,064.74	0.44
45	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.38
46	300568	星源材质	113,885	4,711,422.45	0.35
47	600436	片仔癀	5,900	2,644,970.00	0.20
48	603345	安井食品	8,500	2,159,170.00	0.16
49	688083	中望软件	1,837	962,734.96	0.07
50	300896	爱美客	851	671,336.88	0.05
51	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.05
52	688179	阿拉丁	3,944	553,106.56	0.04
53	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.03
54	688606	奥泰生物	2,703	376,554.93	0.03
55	688578	艾力斯	10,734	353,899.98	0.03
56	688221	前沿生物	16,148	341,045.76	0.03
57	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.02

58	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.02
59	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
60	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.02
61	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.02
62	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.01
63	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.01
64	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.01
65	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.01
66	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.01
67	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.01
68	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.01
69	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.01
70	688510	航亚科技	5,991	157,563.30	0.01
71	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.01
72	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.01
73	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.01
74	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.01
75	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.01
76	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.01
77	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.01
78	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.01
79	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
80	688682	霍莱沃	946	121,277.20	0.01
81	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
82	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.01
83	300987	川网传媒	3,004	113,378.69	0.01
84	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.01
85	688551	科威尔	2,211	110,726.88	0.01
86	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.01
87	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.01
88	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.01
89	300993	玉马遮阳	4,097	99,899.55	0.01
90	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
91	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.01
92	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.01
93	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.01
94	003022	联泓新科	2,995	91,946.50	0.01
95	688533	上声电子	3,493	91,865.90	0.01
96	300991	创益通	2,535	89,214.50	0.01
97	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.01
98	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.01
99	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.01

100	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
101	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.01
102	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
103	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.01
104	605117	德业股份	627	80,005.20	0.01
105	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.01
106	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.01
107	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.01
108	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
109	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.01
110	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.01
111	688191	智洋创新	3,203	69,184.80	0.01
112	688611	杭州柯林	1,400	68,726.00	0.01
113	688685	迈信林	2,612	67,781.40	0.01
114	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
115	000636	风华高科	2,100	63,462.00	0.00
116	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.00
117	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.00
118	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.00
119	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
120	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.00
121	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
122	688683	莱尔科技	3,296	56,757.12	0.00
123	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
124	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
125	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
126	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.00
127	688585	上纬新材	4,922	52,173.20	0.00
128	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
129	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
130	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.00
131	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.00
132	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
133	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.00
134	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.00
135	003026	中晶科技	460	43,290.60	0.00
136	003039	顺控发展	1,024	42,813.44	0.00
137	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
138	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
139	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
140	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
141	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.00

142	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
143	600032	浙江新能	3,045	37,027.20	0.00
144	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
145	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
146	300887	谱尼测试	378	33,789.42	0.00
147	003040	楚天龙	1,101	33,470.40	0.00
148	300900	广联航空	879	32,857.02	0.00
149	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
150	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.00
151	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
152	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.00
153	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
154	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
155	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
156	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
157	605378	野马电池	473	21,729.62	0.00
158	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
159	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
160	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.00
161	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
162	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
163	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
164	003020	立方制药	374	19,148.80	0.00
165	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
166	300898	熊猫乳品	496	17,984.96	0.00
167	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
168	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
169	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00
170	003037	三和管桩	1,274	16,765.84	0.00
171	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
172	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
173	605377	华旺科技	1,050	16,212.00	0.00
174	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
175	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
176	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
177	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
178	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
179	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
180	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
181	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
182	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
183	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00

184	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
185	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
186	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
187	003025	思进智能	427	12,959.45	0.00
188	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
189	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
190	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
191	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
192	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
193	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
194	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
195	300895	铜牛信息	339	11,529.39	0.00
196	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
197	605007	五洲特纸	598	11,260.34	0.00
198	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
199	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
200	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
201	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
202	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
203	605055	迎丰股份	1,146	10,909.92	0.00
204	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
205	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
206	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
207	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
208	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
209	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
210	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
211	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
212	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
213	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
214	003033	征和工业	301	9,538.69	0.00
215	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
216	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
217	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
218	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
219	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
220	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
221	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
222	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
223	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
224	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
225	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00

226	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
227	605155	西大门	350	7,696.50	0.00
228	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
229	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
230	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
231	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
232	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	55,699,548.73	2.32
2	000661	长春高新	53,375,697.65	2.23
3	002415	海康威视	45,340,140.66	1.89
4	601166	兴业银行	43,469,038.85	1.81
5	002812	恩捷股份	36,100,506.91	1.51
6	300782	卓胜微	36,075,339.25	1.50
7	603259	药明康德	34,203,108.71	1.43
8	601012	隆基股份	33,598,258.59	1.40
9	300015	爱尔眼科	33,350,254.07	1.39
10	002706	良信股份	32,324,705.97	1.35
11	000002	万科A	31,767,378.28	1.32
12	000858	五粮液	26,027,849.00	1.09
13	601888	中国中免	26,025,990.00	1.09
14	300763	锦浪科技	25,141,925.00	1.05
15	600919	江苏银行	25,009,025.42	1.04
16	300496	中科创达	24,326,151.55	1.01
17	688116	天奈科技	23,073,670.18	0.96
18	002557	洽洽食品	22,317,602.64	0.93
19	002709	天赐材料	22,231,175.56	0.93
20	000550	江铃汽车	20,251,821.70	0.84

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	159,761,728.72	6.66
2	300450	先导智能	134,921,737.82	5.63
3	601012	隆基股份	124,265,160.43	5.18
4	300014	亿纬锂能	114,087,592.98	4.76
5	600031	三一重工	109,054,137.27	4.55

6	600519	贵州茅台	104,335,645.00	4.35
7	000568	泸州老窖	98,886,020.11	4.12
8	000858	五粮液	88,914,123.79	3.71
9	300124	汇川技术	83,551,427.42	3.48
10	002709	天赐材料	75,108,436.76	3.13
11	600809	山西汾酒	64,904,539.20	2.71
12	300015	爱尔眼科	58,789,449.95	2.45
13	300751	迈为股份	53,987,606.81	2.25
14	002410	广联达	53,062,763.56	2.21
15	03690	美团-W	48,720,120.09	2.03
16	002475	立讯精密	47,309,144.95	1.97
17	000661	长春高新	46,092,330.97	1.92
18	601166	兴业银行	40,058,492.22	1.67
19	603596	伯特利	39,855,413.91	1.66
20	300253	卫宁健康	38,736,197.70	1.62

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,193,458,913.46
卖出股票收入（成交）总额	2,286,639,861.77

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本报告期末本基金未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本报告期末本基金未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	811,425.38
2	应收证券清算款	34,878,210.38
3	应收股利	-
4	应收利息	19,729.62
5	应收申购款	1,043,592.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,752,958.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
平安匠心优选混合 A	16,150	50,257.84	74,629,637.91	9.19	737,034,541.71	90.81
平安匠心优选混合 C	13,131	12,344.41	-	-	162,094,479.09	100.00
合计	28,837	33,767.68	74,629,637.91	7.66	899,129,020.80	92.34

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	平安匠心优选混合 A	479,610.28	0.0591
	平安匠心优选混合 C	7,133.97	0.0044
	合计	486,744.25	0.0500

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	平安匠心优选混合 A	0
	平安匠心优选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安匠心优选混合 A	0
	平安匠心优选混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安匠心优选混合 A	平安匠心优选混合 C
基金合同生效日 (2020 年 2 月 21 日) 基金份额总额	5,131,939,904.63	212,779,189.52
本报告期期初基金份额总额	1,635,823,509.85	205,336,905.77
本报告期基金总申购份额	186,113,684.45	158,476,006.93
减：本报告期基金总赎回份额	1,010,273,014.68	201,718,433.61
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	811,664,179.62	162,094,479.09

§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

2021 年 3 月 2 日，王金涛担任平安基金管理有限公司总经理助理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融股份有限公司	2	767,401,310.65	22.14%	714,686.06	25.05%	-
中信建投证券	1	439,149,749.80	12.67%	327,927.00	11.49%	-
招商证券	2	369,968,974.61	10.67%	344,553.88	12.08%	-
安信证券	4	341,017,135.17	9.84%	249,388.70	8.74%	-
华泰证券	3	320,099,529.54	9.24%	227,686.17	7.98%	-
方正证券	2	306,618,622.26	8.85%	285,554.36	10.01%	-
兴业证券	2	272,731,220.55	7.87%	199,159.19	6.98%	-
东方证券	3	263,573,914.91	7.60%	192,751.91	6.76%	-
国泰君安证券	2	117,503,416.51	3.39%	83,583.51	2.93%	-
长江证券	1	97,130,554.25	2.80%	90,457.21	3.17%	-
申万宏源证券	1	49,701,741.10	1.43%	46,287.27	1.62%	-

中泰证券	1	49,517,957.77	1.43%	35,222.42	1.23%	-
广发证券	3	47,203,263.64	1.36%	43,960.45	1.54%	-
平安证券	2	24,181,161.17	0.70%	12,090.71	0.42%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
上海华信证 券	2	-	-	-	-	-
申银万国证 券	1	-	-	-	-	-
西藏东财证 券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内停止租用交易单元：方正证券 1 个，湘财证券 1 个。

2、基金交易单元的选择标准如下：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
上海华信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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 2020 年 12 月 31 日基金净值公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 01 日
2	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 14 日
3	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 14 日
4	平安匠心优选混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 20 日
5	平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
6	平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 05 日
7	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 12 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 16 日
9	平安匠心优选混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 29 日
10	平安匠心优选混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 20 日
11	平安基金管理有限公司关于新增西部证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 28 日
12	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金调整风险等级的通知	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 01 日
13	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 02 日
14	平安匠心优选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	2021 年 06 月 08 日
15	平安匠心优选混合型证券投资基金招	中国证监会规定报刊及	2021 年 06 月 09 日

	募说明书（更新）	网站	
16	平安匠心优选混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 09 日
17	平安基金管理有限公司关于旗下基金所持恩捷股份（股票代码：002812）估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 23 日
18	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 23 日
19	平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 24 日
20	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日
21	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日
22	平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2021/01/01—2021/01/18	448,698,025.73	-	448,698,025.73	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金</p>							

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安匠心优选混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安匠心优选混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安匠心优选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

2021 年 8 月 27 日