

平安估值优势灵活配置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	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	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	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	平安估值优势混合	
基金主代码	006457	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 5 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	248,515,342.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安估值优势混合 A	平安估值优势混合 C
下属分级基金的交易代码	006457	006458
报告期末下属分级基金的份额总额	130,624,074.03 份	117,891,267.98 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，通过股票与债券等资产的合理配置、充分利用研究投资优势，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×15%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	许俊
	联系电话	0755-22626828	010-66594319
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

注册地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 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	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	平安估值优势混合 A	平安估值优势混合 C
本期已实现收益	10,870,675.36	13,952,198.03
本期利润	8,946,373.59	7,665,811.51
加权平均基金份额本期利润	0.0691	0.0439
本期加权平均净值利润率	3.98%	2.55%
本期基金份额净值增长率	4.08%	3.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	平安估值优势混合 A	平安估值优势混合 C
期末可供分配利润	25,040,036.34	21,315,834.15

期末可供分配基金份额利润	0.1917	0.1808
期末基金资产净值	232,676,151.40	208,492,064.80
期末基金份额净值	1.7813	1.7685
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	78.13%	76.85%

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

平安估值优势混合 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	1.23%	0.21%	-1.38%	0.56%	2.61%	-0.35%
过去三个月	3.94%	0.25%	2.69%	0.68%	1.25%	-0.43%
过去六个月	4.08%	0.34%	1.72%	0.94%	2.36%	-0.60%
过去一年	22.33%	0.90%	20.18%	0.94%	2.15%	-0.04%
自基金合同生效起至今	78.13%	0.80%	42.30%	0.94%	35.83%	-0.14%

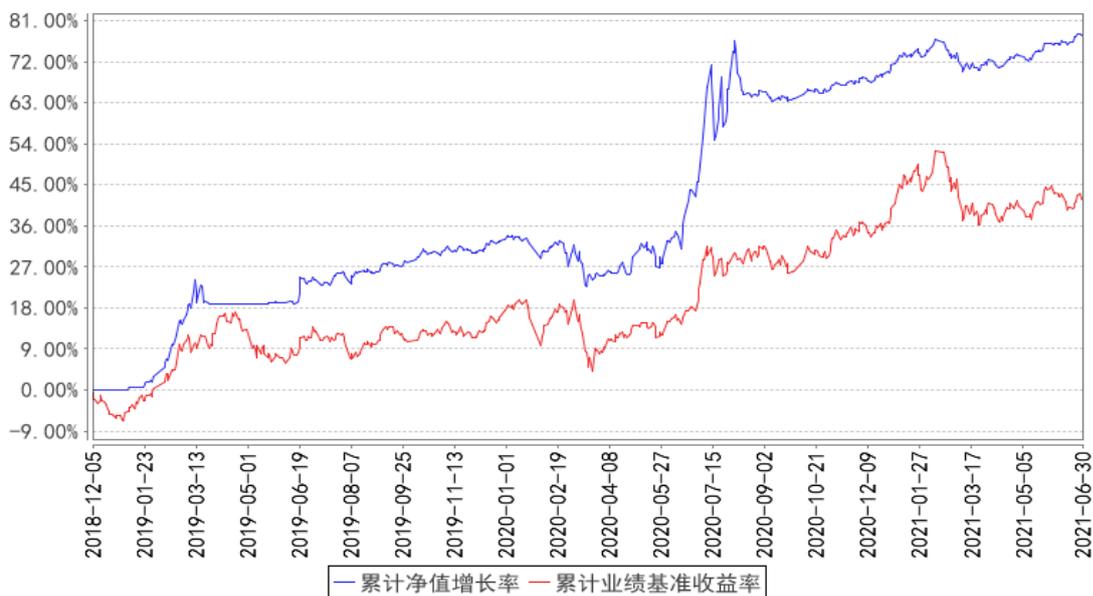
平安估值优势混合 C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	1.21%	0.21%	-1.38%	0.56%	2.59%	-0.35%
过去三个月	3.86%	0.25%	2.69%	0.68%	1.17%	-0.43%
过去六个月	3.93%	0.34%	1.72%	0.94%	2.21%	-0.60%
过去一年	21.96%	0.90%	20.18%	0.94%	1.78%	-0.04%
自基金合同生效起至今	76.85%	0.80%	42.30%	0.94%	34.55%	-0.14%

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

平安估值优势混合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





注：1、本基金基金合同于 2018 年 12 月 05 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		
张 晓 泉	研究中心 研究执行 总经理， 平安估值 优势灵活 配置混合 型证券投 资基金基 金经理	2020 年 4 月 15 日	2021 年 4 月 27 日	10 年	张晓泉先生，清华大学材料科学与工程专业硕士研究生。先后担任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员、招商基金管理有限公司研究员、国投瑞银基金管理有限公司基金经理、研究总监助理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，现任研究中心研究执行总经理，同时担任平安新鑫先锋混合型证券投资基金、平安研究精选混合型证券投资基金基金经理。
毛 时 超	平安估值 优势灵活 配置混合 型证券投 资基金基 金经理	2020 年 8 月 17 日	-	4 年	毛时超先生，中山大学硕士。2016 年 7 月加入平安基金管理有限公司，曾任衍生品投资中心衍生品研究员、基金经理助理。现担任平安安享灵活配置混合型证券投资基金、平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安量化精选混合型发起式证券投资基金、平安估值优势灵活配置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

报告期内，随着全球经济回归正常，A 股历经一季度大涨大跌调整之后，不同行业个股呈现分化的走势。其中以锂电池、新能源汽车、光伏、创新药等新经济成长型产业，由于营收盈利景气度不断提升，并且具有很大的预期发展空间，从底部大幅反弹领涨全市场。去年表现较好的大盘龙头股，估值处于历史相对高位，受制于经济复苏与通胀上行预期，部分个股因为原材料成本上升，导致增速下滑业绩压力较大，在反弹行情中相比去年表现较差。煤炭、钢铁、有色金属、石油等周期股，受益于产品价格和销量大幅上涨，业绩得到释放股价表现较佳。至于低估值的金融地产、建筑等行业，由于悲观预期股价处于下跌状态。

本基金股票部分的投资策略，基于上证 50 和深证 100 指数的行业权重分布，从估值、ROE、波动率、股息率、波动率、陆股通持股等维度，精选基本面良好的沪深两市的大市值优质股票，除非个股基本面发生较大变化，不然将会长期持有不做短期调整，降低组合的交易换手率。本基金债券部分的投资策略，是买入到期时间一年以内、到期收益率在 3%左右、信用评级较高的债券，持有到期后获取稳定的票息收益。此外本基金积极参与沪深两市新股询价申购，增厚基金的投资收益表现。本基金的整体投资策略，是通过股票底仓、债券票息和新股收益，控制股票仓位和波动率处于较低水平，降低基金的业绩波动和回撤，获取长期较为稳健的投资收益表现。

报告期内，本基金持有的部分大盘股票，虽然在此轮反弹行情中，相比去年表现较差，而且短期来看具有一定的业绩压力，但是公司经营管理基本面没有出现大的变化，营收利润增长确定性依然很强，经历此轮大幅上涨、快速下跌与横盘震荡之后，估值回到较为合理的水平，长期来看随着业绩不断释放，依然具有较好的预期收益空间，所以报告期内继续持有，持仓股票没有进行大的调整。

本报告期内，本基金通过卖出沪深 300 股指期货合约，避免来回交易费用较高的股票，维持股票实际仓位在合理的水平，降低基金整体的净值波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安估值优势混合 A 的基金份额净值 1.7813 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.08%，同期业绩比较基准收益率为 1.72%；截至本报告期末平安估值优势混合 C 的基金份额净值 1.7685 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.93%，同期业绩比较基准收益率为 1.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，大盘股票在过去两年大幅上涨、今年出现一定的调整之后，估值水平已经具有一定的吸引力，加上公司经营基本面良好、长期来看业绩保持增长，所以继续看好未来的收益表现。本基金主要配置沪深两市较大市值、基本面优良的股票，整体呈现估值较低、波动较小的特征，随着中国经济稳步向前发展，依然具有较大的上涨空间，长期来看具有较好的投资价值。

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”）在平安估值优势灵活配置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：平安估值优势灵活配置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	13,405,590.10	22,543,991.79
结算备付金		2,404,993.91	7,805.36
存出保证金		2,811,153.72	45,957.47
交易性金融资产	6.4.7.2	420,197,679.16	624,960,072.25
其中：股票投资		132,243,977.68	132,350,074.98
基金投资		-	-
债券投资		287,953,701.48	492,609,997.27
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	6,000,000.00	32,000,000.00
应收证券清算款		-	2,640,291.86
应收利息	6.4.7.5	3,870,680.86	8,214,666.67
应收股利		-	-
应收申购款		40,227.63	10,809.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		448,730,325.38	690,423,594.59
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		6,044,215.33	21,912,863.27
应付赎回款		977,748.24	1,267,402.17
应付管理人报酬		293,178.04	402,246.51
应付托管费		43,976.71	60,336.94
应付销售服务费		53,085.94	98,566.12
应付交易费用	6.4.7.7	31,879.14	31,347.78
应交税费		19,765.35	30,085.33
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,260.43	189,003.27
负债合计		7,562,109.18	23,991,851.39
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	248,515,342.01	390,947,632.95
未分配利润	6.4.7.10	192,652,874.19	275,484,110.25
所有者权益合计		441,168,216.20	666,431,743.20
负债和所有者权益总计		448,730,325.38	690,423,594.59

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 248,515,342.01 份，其中平安估值优势混合 A 基金份额总额 130,624,074.03 份，基金份额净值 1.7813 元。平安估值优势混合 C 基金份额总额 117,891,267.98 份，基金份额净值 1.7685 元。

6.2 利润表

会计主体：平安估值优势灵活配置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	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年	2020 年 1 月 1 日至 2020 年

		6 月 30 日	6 月 30 日
一、收入		19,982,565.55	-8,954,342.55
1. 利息收入		6,088,027.02	927,327.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	60,994.77	20,194.59
债券利息收入		5,983,561.79	907,132.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		43,470.46	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,096,704.71	-3,887,263.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,239,977.27	-3,112,386.40
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	11,079.74	-780,282.50
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	-1,163,460.00	-
股利收益	6.4.7.16	1,009,107.70	5,405.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,210,688.29	-6,116,953.08
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	8,522.11	122,547.04
减：二、费用		3,370,380.45	1,071,786.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,108,825.43	386,125.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	316,323.82	57,918.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	456,091.66	25,704.50
4. 交易费用	6.4.7.19	348,244.72	362,446.36
5. 利息支出		-	127,696.94
其中：卖出回购金融资产支出		-	127,696.94
6. 税金及附加		20,162.93	10.04
7. 其他费用	6.4.7.20	120,731.89	111,885.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,612,185.10	-10,026,129.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,612,185.10	-10,026,129.49

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安估值优势灵活配置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）	390,947,632.95	275,484,110.25	666,431,743.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,612,185.10	16,612,185.10
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）	-142,432,290.94	-99,443,421.16	-241,875,712.10
其中：1. 基金申购款	206,258,973.20	149,699,845.76	355,958,818.96
2. 基金赎回款	-348,691,264.14	-249,143,266.92	-597,834,531.06
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）	248,515,342.01	192,652,874.19	441,168,216.20
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 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）	170,293,411.01	55,967,332.05	226,260,743.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,026,129.49	-10,026,129.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-162,790,680.16	-42,562,564.41	-205,353,244.57

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	4,625,439.59	1,183,767.73	5,809,207.32
2. 基金赎回款	-167,416,119.75	-43,746,332.14	-211,162,451.89
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）	7,502,730.85	3,378,638.15	10,881,369.00

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

平安估值优势灵活配置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[2018]709号《关于准予平安大华估值优势灵活配置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《平安大华估值优势灵活配置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225,344,439.80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(2018)第0036号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年12月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为225,376,947.14份基金份额,其中认购资金利息折合32,507.34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《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华估值优势灵活配置混合型证券投资基金于2019年2月13日起更名为平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金。

根据《平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申

购费，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《平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等)、债券资产(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、证券公司短期公司债、中小企业私募债、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)、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。本基金股票资产占基金资产的比例为 0-95%，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和国债期货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。现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×15%+中证全债指数收益率×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》、《平安估值优势灵活配置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[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。

(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。

(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	13,405,590.10
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	13,405,590.10

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	125,436,158.47	132,243,977.68	6,807,819.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,804,701.48	4,316.10
	银行间市场	281,149,000.00	156,438.92
	合计	287,953,701.48	160,755.02
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	413,229,104.93	420,197,679.16	6,968,574.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	合同/名义	公允价值	备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-23,104,860.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-23,104,860.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-23,104,860.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,000.00	-

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	1,118.46
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	803.53
应收债券利息	3,868,744.47
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	14.40
合计	3,870,680.86

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	29,429.14
银行间市场应付交易费用	2,450.00
合计	31,879.14

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	0.28
应付证券出借违约金	-
预提费用	98,260.15
合计	98,260.43

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安估值优势混合 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	122,016,315.91	122,016,315.91
本期申购	8,963,217.29	8,963,217.29
本期赎回(以“-”号填列)	-355,459.17	-355,459.17
-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	130,624,074.03	130,624,074.03

平安估值优势混合 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	268,931,317.04	268,931,317.04

本期申购	197,295,755.91	197,295,755.91
本期赎回（以“-”号填列）	-348,335,804.97	-348,335,804.97
-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	117,891,267.98	117,891,267.98

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安估值优势混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,977,805.54	73,821,705.99	86,799,511.53
本期利润	10,870,675.36	-1,924,301.77	8,946,373.59
本期基金份额交易产生的变动数	1,191,555.44	5,114,636.81	6,306,192.25
其中：基金申购款	1,243,125.10	5,325,952.13	6,569,077.23
基金赎回款	-51,569.66	-211,315.32	-262,884.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,040,036.34	77,012,041.03	102,052,077.37

平安估值优势混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,505,627.58	162,178,971.14	188,684,598.72
本期利润	13,952,198.03	-6,286,386.52	7,665,811.51
本期基金份额交易产生的变动数	-19,141,991.46	-86,607,621.95	-105,749,613.41
其中：基金申购款	25,594,338.44	117,536,430.09	143,130,768.53
基金赎回款	-44,736,329.90	-204,144,052.04	-248,880,381.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,315,834.15	69,284,962.67	90,600,796.82

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	39,205.57
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	21,445.72
其他	343.48
合计	60,994.77

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	22,239,977.27
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	22,239,977.27

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	118,134,615.73
减：卖出股票成本总额	95,894,638.46
买卖股票差价收入	22,239,977.27

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借差价收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	11,079.74
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	11,079.74
----	-----------

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	805,467,956.09
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	793,073,563.57
减：应收利息总额	12,383,312.78
买卖债券差价收入	11,079.74

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买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-1,163,460.00

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	1,009,107.70
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	1,009,107.70

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	-8,184,648.29
股票投资	-7,749,177.12
债券投资	-435,471.17
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-26,040.00
权证投资	-
期货投资	-26,040.00
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	-8,210,688.29

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	7,867.55
基金转换费收入	654.56
合计	8,522.11

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	338,444.72
银行间市场交易费用	9,800.00
合计	348,244.72

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	12,871.74
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	120,731.89

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(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
上海陆金所基金销售有限公司(“陆金所”)	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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年
----	------------------------	----------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,108,825.43	386,125.31
其中：支付销售机构的客户维护费	239,640.13	20,412.77

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 ×0.80%/ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	316,323.82	57,918.78

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 0.12%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 ×0.12%/ 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		
	平安估值优势混合 A	平安估值优势混合 C	合计
陆金所	-	173,907.82	173,907.82
平安基金	-	182,911.00	182,911.00
平安人寿	-	625.11	625.11
平安银行	-	716.95	716.95
平安证券	-	15.08	15.08
中国银行	-	303.46	303.46
合计	-	358,479.42	358,479.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安估值优势混合 A	平安估值优势混合 C	合计

陆金所	-	247.42	247.42
平安基金	-	7,246.07	7,246.07
平安银行	-	16,854.13	16,854.13
中国银行	-	211.50	211.50
合计	-	24,559.12	24,559.12

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 0.30% 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 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1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	13,405,590.10	39,205.57	906,176.86	18,583.04

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 1 月 1 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 07 月 12 日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300931	通用	2021	2021	新股锁	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-

	电梯	年 1 月 13 日	年 7 月 21 日	定							
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	-	
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	461	21,819.13	116,153.56	-	
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	2021	2021	新股锁	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-	

	食品	年 4 月 8 日	年 10 月 15 日	定							
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	740	24,582.80	64,750.00	-	
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	468	22,740.12	42,302.52	-	
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	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
300997	欢乐家	2021 年 5 月	2021 年 12	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-	

		26日	月2日							
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	-
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	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
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	2022年1月	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-

		28 日	7 日							
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	-
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	-
688113	联测科技	2021 年 4 月 26 日	2021 年 11 月 8 日	新股锁定	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
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	-
688355	明志科技	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 12 日	新股锁定	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688538	和辉光电	2021 年 5 月	2021 年 11	新股锁定	2.65	3.38	138,282	366,447.30	467,393.16	-

		20 日	月 29 日							
688659	元琛科技	2021 年 3 月 24 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁定	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-
688662	富信科技	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁定	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
688682	霍莱沃	2021 年 4 月 13 日	2021 年 10 月 20 日	新股锁定	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10	-
688689	银河微电	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁定	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新债未上市	100.00	100.00	1,280	127,998.32	127,998.32	-
123117	健帆转债	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 12 日	新债未上市	100.00	100.00	47	4,700.00	4,700.00	-
127038	国微转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 14 日	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

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

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 59.21%（上年末：64.91%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的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 个工作日内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 个工作日内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	13,405,590.10	-	-	-	13,405,590.10
结算备付金	2,404,993.91	-	-	-	2,404,993.91
存出保证金	35,445.72	-	-	2,775,708.00	2,811,153.72
交易性金融资产	287,953,701.48	-	-	132,243,977.68	420,197,679.16
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收利息	-	-	-	3,870,680.86	3,870,680.86

应收申购款	-	-	-	40,227.63	40,227.63
资产总计	309,799,731.21	-	-	-138,930,594.17	448,730,325.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	977,748.24	977,748.24
应付管理人报酬	-	-	-	293,178.04	293,178.04
应付托管费	-	-	-	43,976.71	43,976.71
应付证券清算款	-	-	-	6,044,215.33	6,044,215.33
应付销售服务费	-	-	-	53,085.94	53,085.94
应付交易费用	-	-	-	31,879.14	31,879.14
应交税费	-	-	-	19,765.35	19,765.35
其他负债	-	-	-	98,260.43	98,260.43
负债总计	-	-	-	7,562,109.18	7,562,109.18
利率敏感度缺口	309,799,731.21	-	-	-131,368,484.99	441,168,216.20
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	22,543,991.79	-	-	-	22,543,991.79
结算备付金	7,805.36	-	-	-	7,805.36
存出保证金	45,957.47	-	-	-	45,957.47
交易性金融资产	482,742,997.27	9,867,000.00	-	-132,350,074.98	624,960,072.25
买入返售金融资产	32,000,000.00	-	-	-	32,000,000.00
应收利息	-	-	-	8,214,666.67	8,214,666.67
应收申购款	-	-	-	10,809.19	10,809.19
应收证券清算款	-	-	-	2,640,291.86	2,640,291.86
资产总计	537,340,751.89	9,867,000.00	-	-143,215,842.70	690,423,594.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,267,402.17	1,267,402.17
应付管理人报酬	-	-	-	402,246.51	402,246.51
应付托管费	-	-	-	60,336.94	60,336.94
应付证券清算款	-	-	-	21,912,863.27	21,912,863.27
应付销售服务费	-	-	-	98,566.12	98,566.12
应付交易费用	-	-	-	31,347.78	31,347.78
应交税费	-	-	-	30,085.33	30,085.33
其他负债	-	-	-	189,003.27	189,003.27
负债总计	-	-	-	23,991,851.39	23,991,851.39
利率敏感度缺口	537,340,751.89	9,867,000.00	-	-119,223,991.31	666,431,743.20

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
分析	市场利率下降 25 个基点	141,837.99	324,985.79
	市场利率上升 25 个基点	-141,319.90	-323,471.01

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的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	132,243,977.68	29.98	132,350,074.98	19.86
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	132,243,977.68	29.98	132,350,074.98	19.86

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%	5,502,836.08	18,326,741.64
	沪深 300 指数下降 5%	-5,502,836.08	-18,326,741.64

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	132,243,977.68	29.47
	其中：股票	132,243,977.68	29.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	287,953,701.48	64.17
	其中：债券	287,953,701.48	64.17
	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	6,000,000.00	1.34
	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	15,810,584.01	3.52
8	其他各项资产	6,722,062.21	1.50
9	合计	448,730,325.38	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	891,389.98	0.20
B	采矿业	1,434,325.00	0.33
C	制造业	75,406,117.98	17.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	1.17
E	建筑业	1,506,396.37	0.34
F	批发和零售业	541,131.64	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	1,496,378.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,652,170.31	0.60
J	金融业	29,473,152.26	6.68
K	房地产业	3,327,006.00	0.75
L	租赁和商务服务业	3,141,084.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	3,181,317.60	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	21,980.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	169,209.00	0.04
Q	卫生和社会工作	3,554,162.34	0.81
R	文化、体育和娱乐业	288,120.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	132,243,977.68	29.98

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,600	9,460,820.00	2.14
2	600036	招商银行	114,000	6,177,660.00	1.40
3	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	1.17
4	000858	五粮液	16,500	4,915,185.00	1.11
5	601166	兴业银行	175,600	3,608,580.00	0.82
6	000333	美的集团	48,811	3,483,641.07	0.79
7	002142	宁波银行	82,200	3,203,334.00	0.73

8	600276	恒瑞医药	43,440	2,952,616.80	0.67
9	002475	立讯精密	63,800	2,934,800.00	0.67
10	601888	中国中免	9,200	2,760,920.00	0.63
11	601601	中国太保	82,888	2,401,265.36	0.54
12	600030	中信证券	95,300	2,376,782.00	0.54
13	601012	隆基股份	26,740	2,375,581.60	0.54
14	000651	格力电器	45,400	2,365,340.00	0.54
15	300015	爱尔眼科	32,933	2,337,584.34	0.53
16	002415	海康威视	35,000	2,257,500.00	0.51
17	000568	泸州老窖	8,900	2,099,866.00	0.48
18	300760	迈瑞医疗	4,300	2,064,215.00	0.47
19	603259	药明康德	12,840	2,010,615.60	0.46
20	000002	万科A	83,100	1,978,611.00	0.45
21	600887	伊利股份	45,700	1,683,131.00	0.38
22	002594	比亚迪	6,500	1,631,500.00	0.37
23	601336	新华保险	34,900	1,602,259.00	0.36
24	300124	汇川技术	21,177	1,572,604.02	0.36
25	600031	三一重工	52,400	1,523,268.00	0.35
26	600309	万华化学	13,700	1,490,834.00	0.34
27	300750	宁德时代	2,700	1,443,960.00	0.33
28	300014	亿纬锂能	12,457	1,294,656.01	0.29
29	000776	广发证券	81,600	1,235,424.00	0.28
30	601688	华泰证券	74,400	1,175,520.00	0.27
31	002352	顺丰控股	16,700	1,130,590.00	0.26
32	000661	长春高新	2,900	1,122,300.00	0.25
33	601668	中国建筑	238,900	1,110,885.00	0.25
34	601818	光大银行	289,200	1,093,176.00	0.25
35	600926	杭州银行	73,100	1,078,225.00	0.24
36	601628	中国人寿	31,000	1,050,590.00	0.24
37	601009	南京银行	97,800	1,028,856.00	0.23
38	300347	泰格医药	4,900	947,170.00	0.21
39	600585	海螺水泥	22,600	927,730.00	0.21
40	600048	保利地产	74,200	893,368.00	0.20
41	002714	牧原股份	14,560	885,539.20	0.20
42	600690	海尔智家	31,200	808,392.00	0.18
43	000338	潍柴动力	43,600	779,132.00	0.18
44	000625	长安汽车	29,500	775,260.00	0.18
45	603288	海天味业	5,900	760,805.00	0.17
46	300122	智飞生物	4,000	746,920.00	0.17
47	600837	海通证券	64,200	738,300.00	0.17
48	300408	三环集团	17,400	738,108.00	0.17
49	300059	东方财富	22,320	731,872.80	0.17

50	002271	东方雨虹	12,761	705,938.52	0.16
51	601088	中国神华	34,800	679,296.00	0.15
52	002311	海大集团	8,200	669,120.00	0.15
53	601211	国泰君安	35,600	610,184.00	0.14
54	002007	华兰生物	15,600	572,208.00	0.13
55	600104	上汽集团	24,700	542,659.00	0.12
56	002410	广联达	7,300	497,860.00	0.11
57	600436	片仔癀	1,100	493,130.00	0.11
58	600570	恒生电子	5,100	475,575.00	0.11
59	688538	和辉光电	138,282	467,393.16	0.11
60	000157	中联重科	47,500	438,900.00	0.10
61	002304	洋河股份	2,100	435,120.00	0.10
62	300759	康龙化成	2,000	433,980.00	0.10
63	002557	洽洽食品	10,000	431,000.00	0.10
64	000932	华菱钢铁	65,200	430,320.00	0.10
65	600745	闻泰科技	4,300	416,670.00	0.09
66	300628	亿联网络	4,800	402,240.00	0.09
67	603986	兆易创新	2,100	394,590.00	0.09
68	002027	分众传媒	40,400	380,164.00	0.09
69	000708	中信特钢	18,200	379,288.00	0.09
70	000166	申万宏源	79,500	372,060.00	0.08
71	600009	上海机场	7,600	365,788.00	0.08
72	002736	国信证券	33,800	363,350.00	0.08
73	000703	恒逸石化	30,100	359,695.00	0.08
74	000783	长江证券	49,000	358,680.00	0.08
75	002353	杰瑞股份	8,000	357,600.00	0.08
76	002690	美亚光电	6,200	345,712.00	0.08
77	000786	北新建材	8,700	341,475.00	0.08
78	603899	晨光文具	4,000	338,240.00	0.08
79	002241	歌尔股份	7,800	333,372.00	0.08
80	300529	健帆生物	3,800	328,168.00	0.07
81	688161	威高骨科	3,042	322,604.10	0.07
82	002128	露天煤业	30,400	316,464.00	0.07
83	000596	古井贡酒	1,300	311,350.00	0.07
84	002511	中顺洁柔	11,300	311,315.00	0.07
85	002459	晶澳科技	6,300	308,700.00	0.07
86	600050	中国联通	71,000	306,720.00	0.07
87	000725	京东方 A	48,800	304,512.00	0.07
88	002812	恩捷股份	1,300	304,330.00	0.07
89	002677	浙江美大	16,300	297,964.00	0.07
90	300012	华测检测	9,300	296,484.00	0.07
91	000528	柳工	36,000	295,200.00	0.07

92	300207	欣旺达	9,000	293,040.00	0.07
93	000100	TCL 科技	38,200	292,230.00	0.07
94	300413	芒果超媒	4,200	288,120.00	0.07
95	300454	深信服	1,100	285,428.00	0.06
96	002078	太阳纸业	21,200	283,020.00	0.06
97	002001	新 和 成	9,600	275,328.00	0.06
98	600660	福耀玻璃	4,900	273,665.00	0.06
99	600741	华域汽车	10,200	267,954.00	0.06
100	300433	蓝思科技	8,900	261,749.00	0.06
101	300558	贝达药业	2,400	259,776.00	0.06
102	002601	龙佰集团	7,500	259,350.00	0.06
103	601225	陕西煤业	21,600	255,960.00	0.06
104	601117	中国化学	29,000	254,040.00	0.06
105	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.06
106	001979	招商蛇口	22,100	241,995.00	0.05
107	002050	三花智控	10,000	239,800.00	0.05
108	002949	华阳国际	14,100	238,290.00	0.05
109	002648	卫星石化	6,020	235,923.80	0.05
110	688036	传音控股	1,100	230,450.00	0.05
111	002032	苏 泊 尔	3,600	229,644.00	0.05
112	600588	用友网络	6,800	226,168.00	0.05
113	000895	双汇发展	7,000	222,600.00	0.05
114	300450	先导智能	3,680	221,315.20	0.05
115	600885	宏发股份	3,500	219,450.00	0.05
116	002508	老板电器	4,700	218,550.00	0.05
117	300136	信维通信	6,900	213,072.00	0.05
118	001914	招商积余	12,400	213,032.00	0.05
119	000876	新 希 望	14,500	212,715.00	0.05
120	000063	中兴通讯	6,400	212,672.00	0.05
121	002938	鹏鼎控股	5,800	208,104.00	0.05
122	600763	通策医疗	500	205,500.00	0.05
123	601799	星宇股份	900	203,148.00	0.05
124	002371	北方华创	700	194,166.00	0.04
125	603501	韦尔股份	600	193,200.00	0.04
126	300502	新易盛	6,161	192,531.25	0.04
127	688396	华润微	2,100	191,142.00	0.04
128	300285	国瓷材料	3,900	190,125.00	0.04
129	002049	紫光国微	1,200	185,028.00	0.04
130	600406	国电南瑞	7,800	181,272.00	0.04
131	002709	天赐材料	1,680	179,054.40	0.04
132	002555	三七互娱	7,400	177,748.00	0.04
133	600563	法拉电子	1,100	174,196.00	0.04

134	002439	启明星辰	6,000	174,060.00	0.04
135	002372	伟星新材	8,300	171,561.00	0.04
136	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.04
137	002607	中公教育	8,100	169,209.00	0.04
138	603939	益丰药房	2,990	167,709.10	0.04
139	300115	长盈精密	7,920	163,152.00	0.04
140	002138	顺络电子	4,000	155,080.00	0.04
141	002821	凯莱英	400	149,040.00	0.03
142	688002	睿创微纳	1,300	129,779.00	0.03
143	002957	科瑞技术	5,000	127,300.00	0.03
144	600183	生益科技	5,400	126,414.00	0.03
145	300496	中科创达	800	125,648.00	0.03
146	600298	安琪酵母	2,300	125,074.00	0.03
147	603129	春风动力	1,000	124,080.00	0.03
148	601808	中海油服	8,600	123,496.00	0.03
149	600019	宝钢股份	16,100	123,004.00	0.03
150	002242	九阳股份	3,700	120,213.00	0.03
151	002507	涪陵榨菜	3,100	116,746.00	0.03
152	601066	中信建投	3,700	116,291.00	0.03
153	300957	贝泰妮	461	116,153.56	0.03
154	601669	中国电建	30,000	116,100.00	0.03
155	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.03
156	600999	招商证券	6,100	116,022.00	0.03
157	603883	老百姓	2,200	115,896.00	0.03
158	603018	华设集团	14,400	114,480.00	0.03
159	600346	恒力石化	4,300	112,832.00	0.03
160	603338	浙江鼎力	1,900	111,511.00	0.03
161	600201	生物股份	6,200	108,190.00	0.02
162	601100	恒立液压	1,200	103,104.00	0.02
163	688668	鼎通科技	3,037	99,461.75	0.02
164	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
165	002493	荣盛石化	5,700	98,439.00	0.02
166	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.02
167	600507	方大特钢	13,700	92,886.00	0.02
168	688621	阳光诺和	985	87,468.00	0.02
169	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
170	300037	新宙邦	800	80,080.00	0.02
171	002876	三利谱	1,200	77,640.00	0.02
172	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.02
173	601636	旗滨集团	3,900	72,384.00	0.02
174	603416	信捷电气	1,100	69,817.00	0.02
175	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.02

176	300271	华宇软件	3,500	67,375.00	0.02
177	688390	固德威	200	66,800.00	0.02
178	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
179	300979	华利集团	740	64,750.00	0.01
180	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.01
181	603882	金域医学	400	63,908.00	0.01
182	600176	中国巨石	4,000	62,040.00	0.01
183	300888	稳健医疗	500	61,810.00	0.01
184	002318	久立特材	5,100	61,302.00	0.01
185	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
186	601899	紫金矿业	6,100	59,109.00	0.01
187	603833	欧派家居	400	56,784.00	0.01
188	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
189	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
190	002563	森马服饰	4,500	53,775.00	0.01
191	600809	山西汾酒	100	44,800.00	0.01
192	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
193	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
194	300981	中红医疗	468	42,302.52	0.01
195	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
196	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.01
197	603185	上机数控	200	35,790.00	0.01
198	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
199	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
200	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
201	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
202	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
203	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
204	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
205	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
206	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
207	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
208	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
209	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
210	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
211	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
212	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
213	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
214	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
215	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
216	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
217	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00

218	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
219	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
220	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
221	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
222	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
223	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
224	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
225	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
226	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
227	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
228	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
229	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
230	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
231	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
232	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
233	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
234	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
235	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
236	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
237	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
238	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
239	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
240	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	600519	贵州茅台	5,627,912.00	0.84
2	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.52
3	600036	招商银行	3,418,922.84	0.51
4	000858	五粮液	3,176,421.00	0.48
5	000333	美的集团	3,060,143.42	0.46
6	002142	宁波银行	2,536,726.00	0.38
7	002475	立讯精密	2,517,170.00	0.38
8	601166	兴业银行	2,403,512.00	0.36
9	600276	恒瑞医药	2,297,591.00	0.34
10	601601	中国太保	2,100,938.00	0.32
11	600030	中信证券	1,913,197.00	0.29
12	000002	万科A	1,633,062.00	0.25
13	601012	隆基股份	1,453,454.00	0.22
14	000568	泸州老窖	1,433,630.00	0.22

15	000651	格力电器	1,409,699.98	0.21
16	601888	中国中免	1,383,591.00	0.21
17	300124	汇川技术	1,358,243.02	0.20
18	600031	三一重工	1,333,504.00	0.20
19	002415	海康威视	1,242,976.00	0.19
20	000776	广发证券	1,202,328.00	0.18

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	5,954,776.58	0.89
2	600036	招商银行	3,736,626.00	0.56
3	000858	五粮液	3,614,596.00	0.54
4	000333	美的集团	3,267,750.00	0.49
5	600276	恒瑞医药	2,773,491.11	0.42
6	601166	兴业银行	2,254,579.00	0.34
7	601888	中国中免	2,158,186.82	0.32
8	002475	立讯精密	2,141,930.00	0.32
9	000651	格力电器	2,063,033.00	0.31
10	601601	中国太保	1,997,728.07	0.30
11	000568	泸州老窖	1,883,029.38	0.28
12	600905	三峡能源	1,784,978.00	0.27
13	000002	万科A	1,728,676.00	0.26
14	600030	中信证券	1,682,919.00	0.25
15	600887	伊利股份	1,641,151.90	0.25
16	002415	海康威视	1,596,100.00	0.24
17	300760	迈瑞医疗	1,546,754.18	0.23
18	600031	三一重工	1,272,584.00	0.19
19	002594	比亚迪	1,219,230.00	0.18
20	601336	新华保险	1,190,744.00	0.18

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	103,537,718.28
卖出股票收入（成交）总额	118,134,615.73

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	26,722,000.00	6.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	170,245,000.00	38.59
6	中期票据	90,840,000.00	20.59
7	可转债（可交换债）	146,701.48	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	287,953,701.48	65.27

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	101800794	18 国电集 MTN005	300,000	30,261,000.00	6.86
2	012100435	21 浙交投 SCP001	300,000	30,063,000.00	6.81
3	101800736	18 华能 MTN002	200,000	20,178,000.00	4.57
4	101800805	18 苏国信 MTN003	200,000	20,174,000.00	4.57
5	200015	20 付息国债 15	200,000	20,064,000.00	4.55

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2112	IF2112	-15	-23,130,900.00	-26,040.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-26,040.00
股指期货投资本期收益（元）					-1,163,460.00

股指期货投资本期公允价值变动（元）	-26,040.00
-------------------	------------

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金通过卖出沪深 300 股指期货合约，避免来回交易费用较高的股票，维持股票实际仓位在合理的水平，降低基金整体的净值波动。

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	2,811,153.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,870,680.86
5	应收申购款	40,227.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,722,062.21

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	1.17	新股锁定

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 (%)
平安估值优势混合 A	224	583,143.19	129,954,112.16	99.49	669,961.87	0.51
平安估值优势混合 C	5,277	22,340.59	77,955,755.37	66.13	39,935,512.61	33.87
合计	5,480	45,349.51	207,909,867.53	83.66	40,605,474.48	16.34

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	平安估值优势混合 A	-	-

理人所有从业人员持有本基金	平安估值优势混合 C	5,013.33	0.0043
	合计	5,013.33	0.0020

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	平安估值优势混合 A	0
	平安估值优势混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安估值优势混合 A	0
	平安估值优势混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安估值优势混合 A	平安估值优势混合 C
基金合同生效日 (2018 年 12 月 5 日) 基金份额总额	10,060,883.55	215,316,063.59
本报告期期初基金份额总额	122,016,315.91	268,931,317.04
本报告期基金总申购份额	8,963,217.29	197,295,755.91
减：本报告期基金总赎回份额	355,459.17	348,335,804.97
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	130,624,074.03	117,891,267.98

§ 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	
长江证券	1	42,249,242.74	20.10%	39,348.52	22.54%	-
中泰证券	1	34,923,391.12	16.61%	24,840.50	14.23%	-
华泰证券	3	28,359,915.52	13.49%	20,172.57	11.56%	-
方正证券	1	23,906,275.31	11.37%	22,264.09	12.76%	-
中国国际金融股份有限公司	2	19,493,871.95	9.27%	18,154.75	10.40%	-

中信建投证 券	1	16,876,990.09	8.03%	12,342.42	7.07%	-
招商证券	2	13,541,099.01	6.44%	12,609.44	7.22%	-
广发证券	3	12,020,660.83	5.72%	11,195.51	6.41%	-
国泰君安证 券	2	9,855,302.21	4.69%	7,010.13	4.02%	-
安信证券	4	3,994,599.79	1.90%	2,921.33	1.67%	-
东方证券	3	3,903,350.17	1.86%	2,854.49	1.64%	-
兴业证券	2	875,770.76	0.42%	628.98	0.36%	-
申万宏源证 券	1	209,886.16	0.10%	195.48	0.11%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	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
长江证券	33,441,336.80	37.76%	115,000,000.00	29.64%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	4,187.10	0.00%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	32,067,102.00	36.21%	124,000,000.00	31.96%	-	-
中信建投证券	15,959,711.40	18.02%	80,000,000.00	20.62%	-	-
招商证券	2,097,071.48	2.37%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	63,000,000.00	16.24%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	4,999,000.00	5.64%	6,000,000.00	1.55%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
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平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 08 日
3	平安估值优势灵活配置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
4	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
5	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
6	平安估值优势灵活配置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
7	平安估值优势灵活配置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
8	平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 28 日
9	平安估值优势灵活配置混合型证券投	中国证监会规定报刊及	2021 年 04 月 28 日

	资基金基金经理变更公告	网站	
10	平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 28 日
11	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 05 月 21 日
12	平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
13	平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 28 日
20	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--2021/06/30	121,299,733.14	-	-	121,299,733.14	48.81

	2	2021/05/26-- 2021/06/30		57,716,726.31		57,716,726.31	23.22
个人	-	-		-		-	-

产品特有风险

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

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估值优势灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

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

平安基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日