

平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金  
(LOF)  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	平安鼎泰混合
场内简称	平安鼎泰（扩位证券简称：鼎泰 LOF）
基金主代码	167001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 21 日
报告期末基金份额总额	269,545,787.80 份
投资目标	本基金转为上市开放式基金（LOF）后，积极发掘可能对上市公司当前或未来价值产生重大影响各类事件，通过筛选、鉴别事件信息扩散对资产价格的影响模式，选择最具有竞争优势的标的，在控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金转为上市开放式基金（LOF）后，并更名为平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF），在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件，将事件性因素作为投资的主线，形成以事件驱动为核心的投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	21,265,575.57
2. 本期利润	6,095,022.94
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0404
4. 期末基金资产净值	602,032,668.16
5. 期末基金份额净值	2.2335

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. 所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。

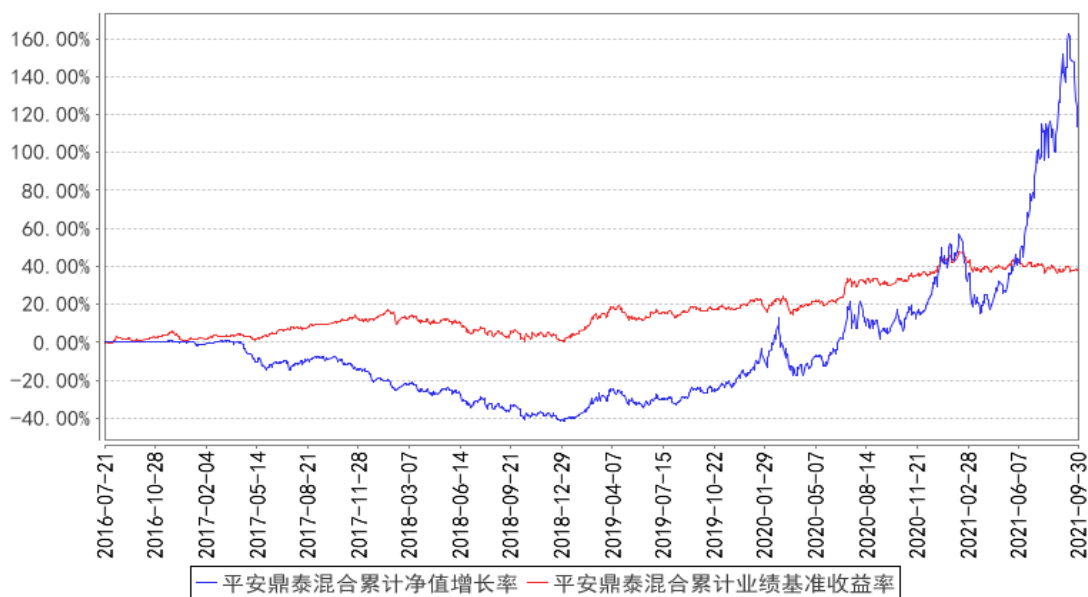
### 3.2 基金净值表现

#### 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

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	25.13%	3.17%	-2.55%	0.60%	27.68%	2.57%
过去六个月	84.92%	2.64%	-0.20%	0.55%	85.12%	2.09%
过去一年	108.31%	2.42%	6.10%	0.61%	102.21%	1.81%
过去三年	233.16%	2.03%	29.72%	0.67%	203.44%	1.36%
过去五年	123.15%	1.66%	36.86%	0.59%	86.29%	1.07%
自基金合同 生效起至今	123.35%	1.63%	38.20%	0.59%	85.15%	1.04%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

平安鼎泰混合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 2016 年 07 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张俊生	权益投资中心投资副总监，平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理	2018年12月4日	-	15年	张俊生先生，中国科学技术大学管理科学与工程专业硕士，曾先后担任广东发展银行政策分析主任、鹏华基金管理有限公司研究员、信达澳银基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理，深圳昱昇富德资产管理有限公司合伙人兼投资总监，上海华信证券有限责任公司权益投资部总经理。2018年10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。同时担任平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安科技创新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。

#### 4.1.1 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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 3 季度, 市场经历了较大幅度的震荡, 市场风格变化剧烈, 行业轮动特征显著. 其中 7-8 月份资源类周期行业大幅上涨. 包括新能源相关产业的锂资源、稀土, 供给短期受限的煤炭、钢铁、化工等周期板块均有大幅上涨。而进入 9 月, 周期类股票又大幅下跌, 市场风格转向防御, 高低切换明显, 低位金融、地产、医药、消费、电力等板块, 9 月则有显著超额收益。

本基金净值在 7-8 月份有较大幅度上涨, 9 月则有明显回撤。3 季度本基金仍主要布局于新能源产业链, 但在具体布局环节有所调整, 增加了上游锂资源、稀土、锂电池相关化工品等板块配置, 兑现 2 季度表现较好的半导体股票。整体在 3 季度仍取得了一定超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.2335 元，本报告期基金份额净值增长率为 25.13%，业绩比较基准收益率为-2.55%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	536,216,427.53	78.93
	其中：股票	536,216,427.53	78.93
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	130,021,865.63	19.14
8	其他资产	13,117,323.12	1.93
9	合计	679,355,616.28	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	84,669,190.50	14.06
C	制造业	407,643,005.79	67.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,788,486.02	7.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	51,276.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.01

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	24,235.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	536,216,427.53	89.07

### 5.2.2 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	69,800	36,695,954.00	6.10
2	002812	恩捷股份	119,000	33,334,280.00	5.54
3	600111	北方稀土	726,900	32,179,863.00	5.35
4	000762	西藏矿业	565,900	31,345,201.00	5.21
5	002326	永太科技	576,531	30,625,326.72	5.09
6	688599	天合光能	534,705	28,638,799.80	4.76
7	300390	天华超净	263,420	28,278,137.00	4.70
8	002192	融捷股份	207,800	27,637,400.00	4.59
9	002176	江特电机	1,179,500	27,600,300.00	4.58
10	002240	盛新锂能	444,500	26,509,980.00	4.40

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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：本基金报告期末未持有贵金属投资。

## 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本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

因未依法履行其他职责，深圳证券交易所于 2020-12-09 依据相关法规给予：对盛新锂能集团股份有限公司监管关注处分决定

因未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责，中国证券监督管理委员会深圳监管局于 2021-05-17 依据相关法规给予：对盛新锂能集团股份有限公司出具警示函处分决定

因信息披露虚假或严重误导性陈述，未及时披露公司重大事项，深圳证券交易所于 2021-09-03 依据相关法规给予：对盛新锂能集团股份有限公司公开批评处分决定

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资严格执行内部投资决策流程，



符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	299,094.84
2	应收证券清算款	7,221,563.22
3	应收股利	-
4	应收利息	18,534.06
5	应收申购款	5,578,131.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,117,323.12

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	47,201,166.27
报告期期间基金总申购份额	386,428,989.94
减：报告期期间基金总赎回份额	164,084,368.41
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	269,545,787.80

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》和相关基金基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对本基金就引入侧袋机制事宜修订基金合同、托管协议等法律文件。修订自 2021 年 7 月 28 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 7 月 28 日发布的《平安基金管理有限公司关于公司旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修改基金合同部分条款的公告》。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）募集注册的文件
- （2）平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同
- （3）平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

### 9.3 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：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日