

平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金
(LOF)
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 30 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41

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	42
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	42
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末上市基金前十名持有人	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.4 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	43
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	平安鼎泰混合
场内简称	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
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	179,873,192.34 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016 年 10 月 18 日

2.2 基金产品说明

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的各类事件，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李海波	潘琦
	联系电话	0755-88622632	0755-22168257
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		518048	518001

法定代表人	罗春风	谢永林
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	8,924,536.27
本期利润	19,989,913.11
加权平均基金份额本期利润	0.1080
本期加权平均净值利润率	7.86%
本期基金份额净值增长率	8.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	20,046,390.17
期末可供分配基金份额利润	0.1114
期末基金资产净值	252,310,616.40
期末基金份额净值	1.4027
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	40.27%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.71%	0.63%	1.52%	0.28%	3.19%	0.35%
过去三个月	0.64%	1.10%	1.61%	0.52%	-0.97%	0.58%
过去六个月	8.16%	1.49%	0.73%	0.49%	7.43%	1.00%
过去一年	11.14%	1.73%	9.93%	0.68%	1.21%	1.05%
过去三年	-22.81%	1.51%	2.07%	0.54%	-24.88%	0.97%
自基金合同生效起至今	40.27%	1.60%	38.00%	0.58%	2.27%	1.02%

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



注：1、本基金合同于 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：本基金本报告期无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个

人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、海外、专户七大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2025 年 6 月 30 日，平安基金共管理 230 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6600 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛冀颖	平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2022 年 8 月 11 日	-	14 年	薛冀颖先生，清华大学信息科学技术专业博士研究生，曾担任鹏华基金管理有限公司研究员、融通基金管理有限公司基金经理。2020 年 6 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安优质企业混合型证券投资基金、平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

下管理的所有基金和投资组合。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年市场震荡上行，其中上证指数上涨 2.76%，创业板指上涨 0.53%，沪深 300 上涨 0.03%。上半年基本维持之前组合结构，整体提升了一定仓位，主要在于一些优质公司的估值水平仍具有一定吸引力，政策方面持续有利好，预计市场风险偏好能够维持高位，而且随着无风险收益率的持续下降，预计持续会有增量资金入市，带来结构性的机会。

4.4.2 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 1.4027 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.16%，业绩比较基准收益率为 0.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	18,052,368.98	60,858,509.57
结算备付金		11,170.35	11,170.35
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	234,627,608.11	186,653,254.87
其中：股票投资		234,627,608.11	186,653,254.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		757,372.20	998,200.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		253,448,519.64	248,521,135.76
负 债 和 净 资 产			
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		739,777.78	258,965.79
应付管理人报酬		248,688.43	262,755.99
应付托管费		41,448.05	43,792.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	107,988.98	166,461.10
负债合计		1,137,903.24	731,975.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	179,873,192.34	191,069,423.14
未分配利润	6.4.7.12	72,437,424.06	56,719,737.10
净资产合计		252,310,616.40	247,789,160.24
负债和净资产总计		253,448,519.64	248,521,135.76

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4027 元，基金份额总额 179,873,192.34 份。

6.2 利润表

会计主体：平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		21,848,241.49	-26,550,393.65
1. 利息收入		134,270.76	109,823.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	134,270.76	98,225.80
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	11,597.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		9,982,868.51	-13,365,532.82
其中：股票投资收益	6.4.7.14	8,576,636.73	-15,162,954.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-173,063.57	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,579,295.35	1,797,421.84
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损	6.4.7.20	11,065,376.84	-13,353,709.66

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 21	665, 725. 38	59, 025. 29
减: 二、营业总支出		1, 858, 328. 38	2, 065, 172. 60
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 510, 171. 80	1, 681, 746. 18
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	251, 695. 24	280, 291. 06
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		6. 00	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	96, 455. 34	103, 135. 36
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		19, 989, 913. 11	-28, 615, 566. 25
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		19, 989, 913. 11	-28, 615, 566. 25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19, 989, 913. 11	-28, 615, 566. 25

6.3 净资产变动表

会计主体: 平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	191, 069, 423. 14	56, 719, 737. 10	247, 789, 160. 24
二、本期期初净资产	191, 069, 423. 14	56, 719, 737. 10	247, 789, 160. 24
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-11, 196, 230. 80	15, 717, 686. 96	4, 521, 456. 16
(一)、综合收益总额	-	19, 989, 913. 11	19, 989, 913. 11
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减	-11, 196, 230. 80	-4, 272, 226. 15	-15, 468, 456. 95

少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	80,256,785.98	32,186,177.75	112,442,963.73
2. 基金赎回款	-91,453,016.78	-36,458,403.90	-127,911,420.68
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	179,873,192.34	72,437,424.06	252,310,616.40
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	214,915,397.17	83,688,418.00	298,603,815.17
二、本期期初净资产	214,915,397.17	83,688,418.00	298,603,815.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,817,438.14	-26,880,736.63	-25,063,298.49
(一)、综合收益总额	-	-28,615,566.25	-28,615,566.25
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,817,438.14	1,734,829.62	3,552,267.76
其中：1. 基金申购款	26,364,084.22	8,938,144.89	35,302,229.11
2. 基金赎回款	-24,546,646.08	-7,203,315.27	-31,749,961.35
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	216,732,835.31	56,807,681.37	273,540,516.68

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
基金管理人负责人

林婉文
主管会计工作负责人

张南南
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (原名为平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、平安大华鼎泰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[2016]1208 号《关于准予平安大华鼎泰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 (原平安大华基金管理有限公司, 已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记) 依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鼎泰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基金, 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 1,318,599,857.89 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(2016)第 868 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 21 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 1,318,879,411.68 份基金份额, 其中认购资金利息折合 279,553.79 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, 基金托管人为平安银行股份有限公司, 登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定, 本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)至 18 个月(含第 18 个月)后的对应日止, 若该日为非工作日或无该对应日, 则为该日之前的最后一个工作日。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务, 但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所(以下简称“深交所”)转让基金份额。封闭期届满后, 本基金转换为上市开放式基金(LOF)。本基金封闭期自 2016 年 7 月 21 日(基金合同生效日)起至 2018 年 1 月 19 日止, 封闭运作期届满, 自 2018 年 1 月 20 日起基金运作方式转为“上市契约型开放式”, 并更名为平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。于 2018 年 1 月 22 日起开放本基金申购、赎回及定期定额投资业务。

经深交所深证上[2016]696 号文审核同意, 本基金 519,058,725.00 份基金份额于 2016 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

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》, 平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(权证、股指期货

货、国债期货等)、债券资产(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金资产等货币市场工具,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%;非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例为 0%-100%;公开发行股票资产占非现金基金资产的比例为 0%-20%;债券资产占基金资产的比例范围为 0%-100%;转换为上市开放式基金(LOF)后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 50%+中证综合债指数收益率 $\times$ 50%。

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》、《平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。
根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	2,085,872.95
等于：本金	2,085,625.63
加：应计利息	247.32
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	15,966,496.03
等于：本金	15,960,433.27
加：应计利息	6,062.76
合计	18,052,368.98

注：本基金持有的其他存款为存放在证券经纪商基金专用账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	233,627,185.35	-	234,627,608.11	1,000,422.76
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	233,627,185.35	-	234,627,608.11	1,000,422.76
----	----------------	---	----------------	--------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	598.44
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,155.34
其他	20,235.20
合计	107,988.98

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	191,069,423.14	191,069,423.14
本期申购	80,256,785.98	80,256,785.98
本期赎回（以“-”号填列）	-91,453,016.78	-91,453,016.78
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	179,873,192.34	179,873,192.34

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,579,888.67	45,139,848.43	56,719,737.10
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	11,579,888.67	45,139,848.43	56,719,737.10

本期利润	8,924,536.27	11,065,376.84	19,989,913.11
本期基金份额交易产生的变动数	-458,034.77	-3,814,191.38	-4,272,226.15
其中：基金申购款	9,837,148.97	22,349,028.78	32,186,177.75
基金赎回款	-10,295,183.74	-26,163,220.16	-36,458,403.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,046,390.17	52,391,033.89	72,437,424.06

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,979.39
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	127,291.37
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	134,270.76

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,576,636.73
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	8,576,636.73

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,008,834,585.76
减：卖出股票成本总额	999,226,523.15
减：交易费用	1,031,425.88
买卖股票差价收入	8,576,636.73

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,668.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-174,731.66
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	-173,063.57

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,052,630.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,124,148.98
减：应计利息总额	102,801.86
减：交易费用	411.13
买卖债券差价收入	-174,731.66

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,579,295.35
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	1,579,295.35

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	11,065,376.84
股票投资	11,065,376.84
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	11,065,376.84

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	665,725.38
合计	665,725.38

注：本基金的赎回费率按持有期间递减。赎回费计入基金财产的比例根据《平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》确认。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	18,347.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	96,455.34

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、基金销售机构
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东

平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
上海陆金所基金销售有限公司（“陆基金”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,510,171.80	1,681,746.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	597,353.45	647,343.12
应支付基金管理人的净管理费	912,818.35	1,034,403.06

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	251,695.24	280,291.06

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

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		上年度可比期间	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		2024 年 1 月 1 日至 2024 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
平安银行-活期	2,085,872.95	6,979.39	2,358,078.99	5,402.30

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股锁定	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-

301501	恒鑫生活	2025年3月11日	6个月	新股锁定	27.52	45.22	235	6,467.04	10,626.70	-
301535	浙江华远	2025年3月18日	6个月	新股锁定	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股锁定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股锁定	89.60	139.48	59	5,286.40	8,229.32	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股锁定	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股锁定	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股锁定	26.50	32.68	131	3,471.50	4,281.08	-
603049	中策橡胶	2025年5月27日	6个月	新股锁定	46.50	42.85	119	5,533.50	5,099.15	-
603120	肯特催化	2025年4月9日	6个月	新股锁定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-

603124	江南新材	2025年3月12日	6个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025年4月16日	6个月	新股锁定	93.50	90.66	41	3,833.50	3,717.06	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股锁定	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新股锁定	24.18	33.32	99	2,393.82	3,298.68	-
688192	迪哲医药	2025年4月22日	5个月	新股锁定	43.00	55.11	46,512	2,000,016.00	2,563,276.32	-

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

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、风控负责人、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	18,052,368.98	-	-	-	18,052,368.98
结算备付金	11,170.35	-	-	-	11,170.35
交易性金融资产	-	-	-	234,627,608.11	234,627,608.11
应收申购款	-	-	-	757,372.20	757,372.20
资产总计	18,063,539.33	-	-	235,384,980.31	253,448,519.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	739,777.78	739,777.78
应付管理人报酬	-	-	-	248,688.43	248,688.43
应付托管费	-	-	-	41,448.05	41,448.05
其他负债	-	-	-	107,988.98	107,988.98
负债总计	-	-	-	1,137,903.24	1,137,903.24
利率敏感度缺口	18,063,539.33	-	-	234,247,077.07	252,310,616.40
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	60,858,509.57	-	-	-	60,858,509.57
结算备付金	11,170.35	-	-	-	11,170.35
交易性金融资产	-	-	-	186,653,254.87	186,653,254.87
应收申购款	-	-	-	998,200.97	998,200.97
资产总计	60,869,679.92	-	-	187,651,455.84	248,521,135.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	258,965.79	258,965.79
应付管理人报酬	-	-	-	262,755.99	262,755.99
应付托管费	-	-	-	43,792.64	43,792.64
其他负债	-	-	-	166,461.10	166,461.10
负债总计	-	-	-	731,975.52	731,975.52
利率敏感度缺口	60,869,679.92	-	-	186,919,480.32	247,789,160.24

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有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。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	234,627,608.11	92.99	186,653,254.87	75.33
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	234,627,608.11	92.99	186,653,254.87	75.33

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	13,267,730.20	12,182,605.55
	沪深 300 指数下降 5%	-13,267,730.20	-12,182,605.55

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	231,926,168.84	186,469,538.31
第二层次	15,385.54	-
第三层次	2,686,053.73	183,716.56
合计	234,627,608.11	186,653,254.87

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于

交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	234,627,608.11	92.57
	其中：股票	234,627,608.11	92.57
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	18,063,539.33	7.13
8	其他各项资产	757,372.20	0.30
9	合计	253,448,519.64	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	-	-
B	采矿业	28,622,667.00	11.34
C	制造业	95,597,817.43	37.89

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	2,589,156.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,914,580.68	3.53
J	金融业	91,984,642.00	36.46
K	房地产业	4,982,921.00	1.97
L	租赁和商务服务业	1,933,580.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	234,627,608.11	92.99

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	601288	农业银行	2,139,700	12,581,436.00	4.99
2	601988	中国银行	2,188,900	12,301,618.00	4.88
3	601825	沪农商行	1,244,800	12,074,560.00	4.79
4	300502	新易盛	73,900	9,386,778.00	3.72
5	000333	美的集团	104,900	7,573,780.00	3.00
6	300750	宁德时代	25,900	6,532,498.00	2.59
7	600988	赤峰黄金	261,400	6,503,632.00	2.58
8	603308	应流股份	280,600	6,476,248.00	2.57
9	603606	东方电缆	106,100	5,486,431.00	2.17
10	300274	阳光电源	80,600	5,462,262.00	2.16
11	601601	中国太保	125,600	4,711,256.00	1.87
12	600030	中信证券	169,100	4,670,542.00	1.85
13	601688	华泰证券	261,500	4,657,315.00	1.85
14	600999	招商证券	264,000	4,643,760.00	1.84
15	300059	东方财富	200,000	4,626,000.00	1.83
16	000166	申万宏源	873,600	4,385,472.00	1.74
17	600489	中金黄金	298,900	4,372,907.00	1.73

18	600919	江苏银行	359,300	4,290,042.00	1.70
19	600000	浦发银行	290,700	4,034,916.00	1.60
20	601059	信达证券	229,500	3,924,450.00	1.56
21	601088	中国神华	94,400	3,826,976.00	1.52
22	601838	成都银行	187,700	3,772,770.00	1.50
23	600547	山东黄金	117,900	3,764,547.00	1.49
24	601658	邮储银行	681,500	3,727,805.00	1.48
25	601818	光大银行	892,200	3,702,630.00	1.47
26	601225	陕西煤业	183,300	3,526,692.00	1.40
27	300308	中际旭创	19,000	2,771,340.00	1.10
28	688510	航亚科技	108,773	2,630,131.14	1.04
29	600383	金地集团	683,500	2,590,465.00	1.03
30	002352	顺丰控股	53,100	2,589,156.00	1.03
31	000997	新大陆	79,200	2,564,496.00	1.02
32	688192	迪哲医药	46,512	2,563,276.32	1.02
33	002648	卫星化学	146,100	2,531,913.00	1.00
34	000617	中油资本	346,400	2,528,720.00	1.00
35	002463	沪电股份	58,900	2,507,962.00	0.99
36	688386	泛亚微透	45,808	2,487,832.48	0.99
37	688981	中芯国际	28,164	2,483,219.88	0.98
38	600577	精达股份	329,500	2,451,480.00	0.97
39	600938	中国海油	93,100	2,430,841.00	0.96
40	001979	招商蛇口	272,800	2,392,456.00	0.95
41	600259	广晟有色	44,900	2,385,088.00	0.95
42	600415	小商品城	93,500	1,933,580.00	0.77
43	603993	洛阳钼业	215,200	1,811,984.00	0.72
44	300693	盛弘股份	54,500	1,632,820.00	0.65
45	605333	沪光股份	58,600	1,608,570.00	0.64
46	002558	巨人网络	64,200	1,511,910.00	0.60
47	002531	天顺风能	191,900	1,370,166.00	0.54
48	601336	新华保险	23,100	1,351,350.00	0.54
49	603019	中科曙光	18,500	1,302,400.00	0.52
50	002149	西部材料	65,500	1,300,175.00	0.52
51	603067	振华股份	84,800	1,292,352.00	0.51
52	603227	雪峰科技	153,700	1,288,006.00	0.51
53	002472	双环传动	38,400	1,286,016.00	0.51
54	300470	中密控股	34,600	1,272,242.00	0.50
55	600276	恒瑞医药	24,500	1,271,550.00	0.50
56	300383	光环新网	88,200	1,261,260.00	0.50
57	002487	大金重工	38,300	1,260,070.00	0.50
58	300450	先导智能	50,200	1,247,470.00	0.49
59	603659	璞泰来	65,900	1,237,602.00	0.49
60	603688	石英股份	35,100	1,236,222.00	0.49

61	002475	立讯精密	35,600	1,234,964.00	0.49
62	300738	奥飞数据	59,000	1,234,870.00	0.49
63	603697	有友食品	89,500	1,180,505.00	0.47
64	600660	福耀玻璃	20,700	1,180,107.00	0.47
65	300682	朗新集团	50,100	1,177,350.00	0.47
66	301606	绿联科技	22,800	1,172,604.00	0.46
67	688213	思特威	11,394	1,164,694.68	0.46
68	688010	福光股份	37,310	1,158,102.40	0.46
69	688656	浩欧博	8,403	1,141,127.40	0.45
70	002436	兴森科技	84,000	1,112,160.00	0.44
71	001288	运机集团	53,200	1,108,156.00	0.44
72	601058	赛轮轮胎	82,800	1,086,336.00	0.43
73	605080	浙江自然	38,900	1,081,420.00	0.43
74	300910	瑞丰新材	18,700	1,079,925.00	0.43
75	002262	恩华药业	51,100	1,061,858.00	0.42
76	688625	呈和科技	33,467	1,023,420.86	0.41
77	301479	弘景光电	10,782	904,572.34	0.36
78	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
79	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
80	301501	恒鑫生活	235	10,626.70	0.00
81	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
82	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
83	301590	优优绿能	59	8,229.32	0.00
84	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
85	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
86	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
87	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
88	603049	中策橡胶	119	5,099.15	0.00
89	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
90	603014	威高血净	131	4,281.08	0.00
91	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
92	603202	天有为	41	3,717.06	0.00
93	603409	汇通控股	99	3,298.68	0.00
94	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
95	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
96	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603308	应流股份	20,984,812.00	8.47
2	601288	农业银行	17,290,714.00	6.98
3	688382	益方生物	13,583,064.49	5.48

4	601100	恒立液压	12,940,601.00	5.22
5	601988	中国银行	12,930,108.00	5.22
6	601825	沪农商行	11,772,531.00	4.75
7	002517	恺英网络	11,499,995.50	4.64
8	301600	慧翰股份	11,270,972.00	4.55
9	300454	深信服	11,120,505.82	4.49
10	688200	华峰测控	11,045,194.27	4.46
11	601728	中国电信	10,285,077.00	4.15
12	688333	铂力特	9,251,921.72	3.73
13	603063	禾望电气	9,241,690.00	3.73
14	603606	东方电缆	9,159,686.00	3.70
15	000997	新大陆	8,729,698.00	3.52
16	300153	科泰电源	8,659,286.00	3.49
17	300017	网宿科技	8,648,118.00	3.49
18	002126	银轮股份	8,578,719.00	3.46
19	300980	祥源新材	8,340,674.00	3.37
20	300502	新易盛	8,173,867.40	3.30
21	301018	申菱环境	8,163,436.00	3.29
22	000333	美的集团	7,787,053.00	3.14
23	688256	寒武纪	7,782,126.03	3.14
24	000034	神州数码	7,763,062.00	3.13
25	002463	沪电股份	7,588,213.00	3.06
26	300687	赛意信息	7,585,857.49	3.06
27	600489	中金黄金	7,582,391.00	3.06
28	600988	赤峰黄金	7,504,498.00	3.03
29	603416	信捷电气	7,342,473.00	2.96
30	300682	朗新集团	7,201,013.00	2.91
31	601601	中国太保	7,169,768.00	2.89
32	300059	东方财富	7,136,415.00	2.88
33	000032	深桑达A	7,115,755.28	2.87
34	002891	中宠股份	7,104,334.00	2.87
35	600030	中信证券	7,063,516.00	2.85
36	002335	科华数据	6,835,109.00	2.76
37	600259	广晟有色	6,497,876.08	2.62
38	300394	天孚通信	6,447,830.00	2.60
39	300115	长盈精密	6,420,354.00	2.59
40	000811	冰轮环境	6,402,680.00	2.58
41	001309	德明利	6,380,092.00	2.57
42	300308	中际旭创	6,321,161.00	2.55
43	600592	龙溪股份	6,280,407.00	2.53
44	688426	康为世纪	6,230,682.36	2.51
45	300383	光环新网	6,204,771.00	2.50
46	002896	中大力德	6,167,854.00	2.49

47	600919	江苏银行	6,152,014.00	2.48
48	300442	润泽科技	5,719,214.00	2.31
49	601077	渝农商行	5,566,223.00	2.25
50	300274	阳光电源	5,248,869.00	2.12
51	300347	泰格医药	5,124,267.00	2.07
52	002851	麦格米特	5,104,652.19	2.06
53	688800	瑞可达	5,038,840.24	2.03
54	688981	中芯国际	4,994,792.89	2.02
55	301398	星源卓镁	4,967,895.00	2.00

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	603308	应流股份	17,317,899.00	6.99
2	002851	麦格米特	15,814,094.00	6.38
3	688382	益方生物	15,269,237.97	6.16
4	002335	科华数据	15,109,461.05	6.10
5	601100	恒立液压	15,049,373.00	6.07
6	688256	寒武纪	14,211,546.58	5.74
7	300153	科泰电源	14,043,254.00	5.67
8	002130	沃尔核材	12,509,333.00	5.05
9	002517	恺英网络	11,770,172.00	4.75
10	688200	华峰测控	11,651,737.26	4.70
11	300454	深信服	11,442,264.00	4.62
12	002463	沪电股份	10,706,471.50	4.32
13	601728	中国电信	10,625,897.00	4.29
14	301600	慧翰股份	10,396,605.00	4.20
15	002371	北方华创	10,178,176.00	4.11
16	000034	神州数码	10,099,027.00	4.08
17	002126	银轮股份	9,750,546.00	3.94
18	002384	东山精密	9,583,769.00	3.87
19	603063	禾望电气	9,555,577.00	3.86
20	300638	广和通	9,102,794.70	3.67
21	688333	铂力特	8,637,983.97	3.49
22	603296	华勤技术	8,619,672.00	3.48
23	601288	农业银行	8,606,784.00	3.47
24	002896	中大力德	8,603,335.00	3.47
25	300017	网宿科技	8,250,539.00	3.33
26	300980	祥源新材	8,226,567.00	3.32
27	002922	伊戈尔	8,216,217.00	3.32
28	300476	胜宏科技	8,099,542.00	3.27
29	300394	天孚通信	7,957,025.60	3.21
30	603416	信捷电气	7,929,212.00	3.20

31	300687	赛意信息	7,654,127.00	3.09
32	002891	中宠股份	7,145,770.00	2.88
33	000811	冰轮环境	6,990,805.00	2.82
34	300870	欧陆通	6,936,023.00	2.80
35	001309	德明利	6,723,319.00	2.71
36	300682	朗新集团	6,658,709.00	2.69
37	301155	海力风电	6,548,518.30	2.64
38	300442	润泽科技	6,546,846.00	2.64
39	688041	海光信息	6,442,209.22	2.60
40	688766	普冉股份	6,329,451.75	2.55
41	002281	光迅科技	6,253,156.00	2.52
42	000997	新大陆	6,247,447.00	2.52
43	300502	新易盛	6,241,543.30	2.52
44	600592	龙溪股份	6,239,914.00	2.52
45	601077	渝农商行	6,228,266.00	2.51
46	301018	申菱环境	6,080,460.00	2.45
47	688372	伟测科技	6,047,641.09	2.44
48	300723	一品红	5,984,121.00	2.42
49	000977	浪潮信息	5,974,628.00	2.41
50	300115	长盈精密	5,963,160.00	2.41
51	301165	锐捷网络	5,953,864.00	2.40
52	603606	东方电缆	5,833,254.00	2.35
53	300347	泰格医药	5,665,086.00	2.29
54	000333	美的集团	5,607,295.66	2.26
55	000032	深桑达A	5,576,313.00	2.25
56	600259	广晟有色	5,460,213.00	2.20
57	600872	中炬高新	5,308,899.98	2.14
58	002315	焦点科技	5,165,540.52	2.08
59	000063	中兴通讯	5,044,801.00	2.04
60	600938	中国海油	5,001,630.00	2.02

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	1,036,135,499.55
卖出股票收入（成交）总额	1,008,834,585.76

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：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海农村商业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	757,372.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	757,372.20
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
16,332	11,013.54	5,432,827.76	3.02	174,440,364.58	96.98

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	廖卓鹏	1,219,440.00	7.20
2	高德荣	698,667.00	4.13
3	胡毅	600,000.00	3.54
4	王俊兰	550,058.00	3.25
5	刁一鸣	528,775.00	3.12
6	谢荣芳	461,200.00	2.72
7	陈玉龙	424,300.00	2.51
8	刘腊妹	368,566.00	2.18
9	梁彪	310,624.00	1.84
10	彭小冰	300,064.00	1.77

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	44,951.02	0.0250

8.4 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 7 月 21 日） 基金份额总额	1,318,879,411.68
本报告期期初基金份额总额	191,069,423.14
本报告期基金总申购份额	80,256,785.98
减：本报告期基金总赎回份额	91,453,016.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	179,873,192.34

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

10.4 基金投资策略的改变

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

本基金聘用容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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 (%)	
中银国际证券	2	2,042,295,945.65	100.00	396,069.39	100.00	

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

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

2、基金管理人根据上述标准，选择具备证券经纪业务资格的证券公司，并签订证券经纪服务协议。

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 (%)
中银国际证券	10,277,863.02	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 15 日
2	平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 22 日
3	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 08 日
4	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 28 日
5	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 11 日

6	平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2024 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 29 日
7	平安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 31 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金获配迪哲医药（688192）非公开发行 A 股公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 19 日
9	平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 22 日
10	平安基金管理有限公司关于新增万家财富基金销售（天津）有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 21 日
11	平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 30 日
12	平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 30 日
13	平安基金管理有限公司关于新增上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 18 日
14	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安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

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
第 46 页 共 47 页

12.3 查阅方式

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

平安基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日