

# 平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 3 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。本年度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 2024 年 03 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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	8
3.3 其他指标 .....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	11
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.9 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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	19
7.3 净资产变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	50

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	51
8.3 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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	65
8.6 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 .....	65
8.7 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 .....	65
8.8 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 .....	65
8.9 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 .....	65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.14 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>66</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
9.3 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 .....	67
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	67
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
11.2 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 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4 基金投资策略的改变 .....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
11.8 其他重大事件 .....	72
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>74</b>
12.1 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 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>74</b>
13.1 备查文件目录 .....	74
13.2 存放地点 .....	75
13.3 查阅方式 .....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	平安安盈灵活配置混合	
基金主代码	002537	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 4 月 26 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	50,050,004.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安安盈灵活配置混合 A	平安安盈灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	002537	014051
报告期末下属分级基金的份额总额	49,737,687.45 份	312,316.83 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对宏观经济和股票市场、债券市场发展趋势的分析，力求把握在不同行情中可行的投资机会，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析，结合经济周期理论，形成对不同市场周期的预测和判断，进行积极、灵活的资产配置，确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，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	陈特正	潘琦
	联系电话	0755-22626828	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年		2022 年		2021 年	2021 年 11 月 2 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日
	平安安盈灵活配置混合 A	平安安盈灵活配置混合 C	平安安盈灵活配置混合 A	平安安盈灵活配置混合 C	平安安盈灵活配置混合 A	平安安盈灵活配置混合 C
本期已实现收益	- 33,955,563.91	- 564,404.07	- 91,509,784.88	- 455,936.22	108,508,774.33	2,830.19
本期利润	- 28,187,040.23	- 646,985.51	- 107,604,766.61	- 2,345,162.30	80,076,929.77	-1,299.01
加权平均基金份额本期利润	-0.2987	-0.4721	-0.7861	-0.2940	0.6192	-0.0044

本期加权平均净值利润率	-13.25%	-20.77%	-31.33%	-11.54%	23.48%	-0.15%
本期基金份额净值增长率	-14.89%	-15.28%	-24.35%	-24.68%	36.29%	3.92%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	33,196,227.03	220,778.49	125,477,073.56	754,648.73	297,187,110.47	796,832.47
期末可供分配基金份额利润	0.6674	0.7069	1.1709	1.2161	1.8287	1.8830
期末基金资产净值	94,614,591.73	588,461.65	239,513,976.53	1,380,221.61	480,123,271.41	1,249,539.92
期末基金份额净值	1.9023	1.8842	2.2350	2.2241	2.9543	2.9528
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值	81.17%	-33.69%	112.86%	-21.73%	181.36%	3.92%

增长率						
-----	--	--	--	--	--	--

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安安盈灵活配置混合 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
过去三个月	-7.57%	0.79%	-2.83%	0.40%	-4.74%	0.39%
过去六个月	-19.41%	0.74%	-4.36%	0.42%	-15.05%	0.32%
过去一年	-14.89%	1.10%	-3.21%	0.42%	-11.68%	0.68%
过去三年	-12.24%	1.40%	-11.96%	0.55%	-0.28%	0.85%
自基金合同生效起至今	81.17%	1.41%	5.95%	0.59%	75.22%	0.82%

平安安盈灵活配置混合 C

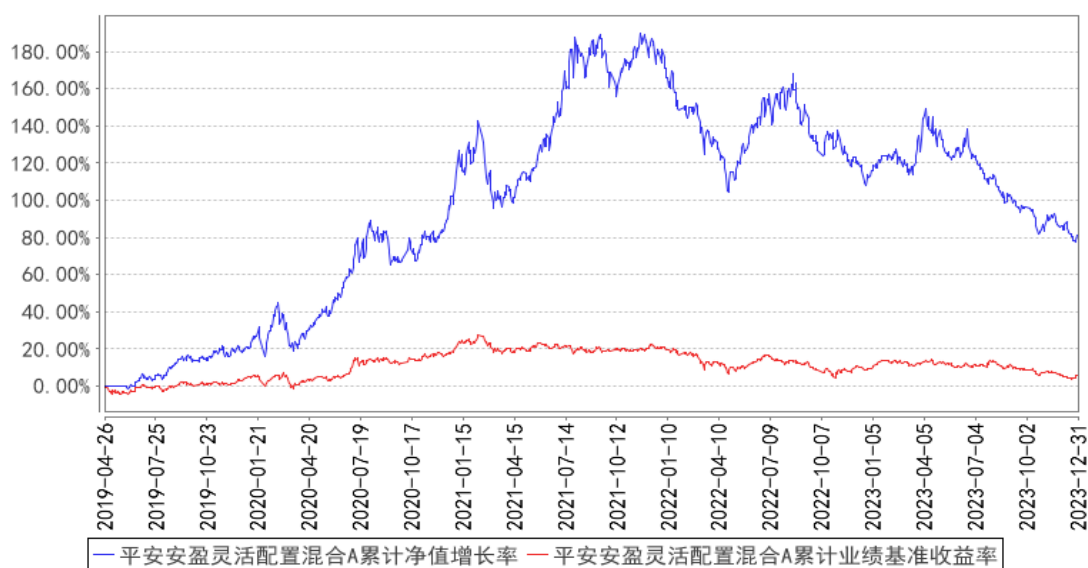
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.66%	0.79%	-2.83%	0.40%	-4.83%	0.39%
过去六个月	-19.63%	0.74%	-4.36%	0.42%	-15.27%	0.32%



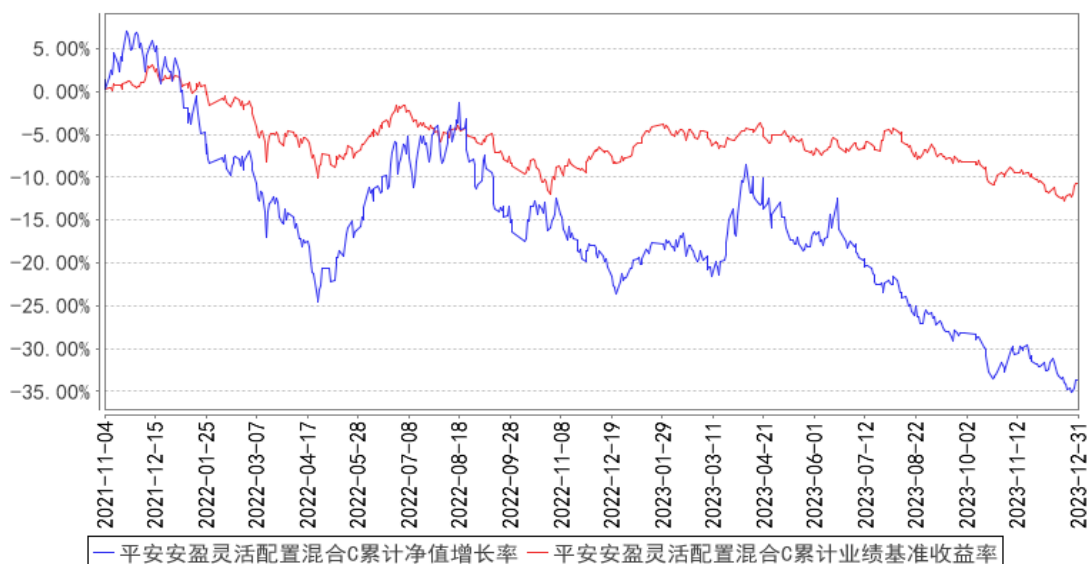
过去一年	-15.28%	1.10%	-3.21%	0.42%	-	0.68%
自基金合同生效起至今	-33.69%	1.23%	-10.73%	0.53%	-	0.70%

### 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

平安安盈灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安安盈灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 4 月 26 日正式生效；

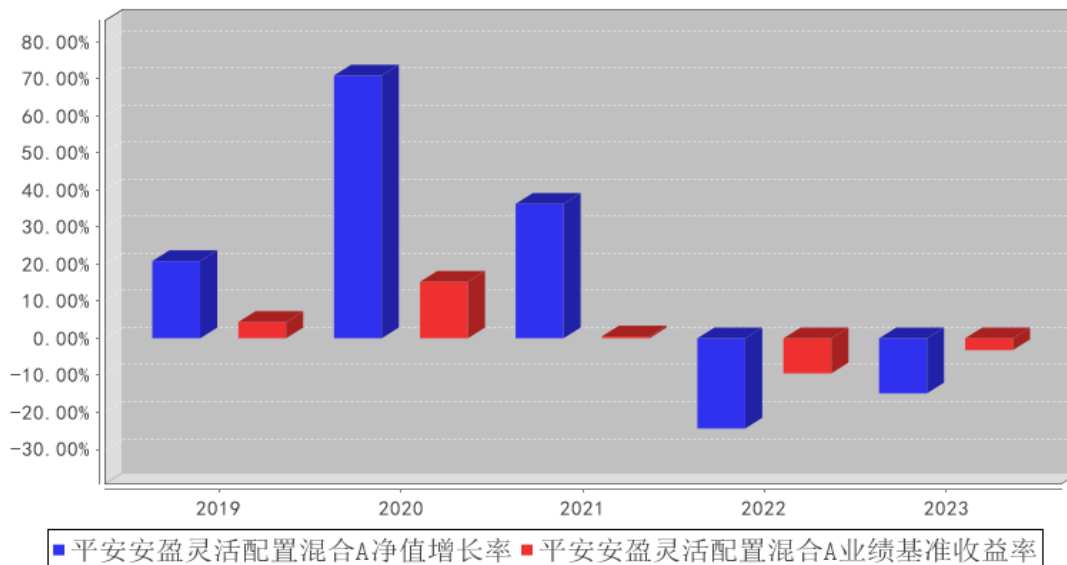
2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置

比例符合基金合同约定；

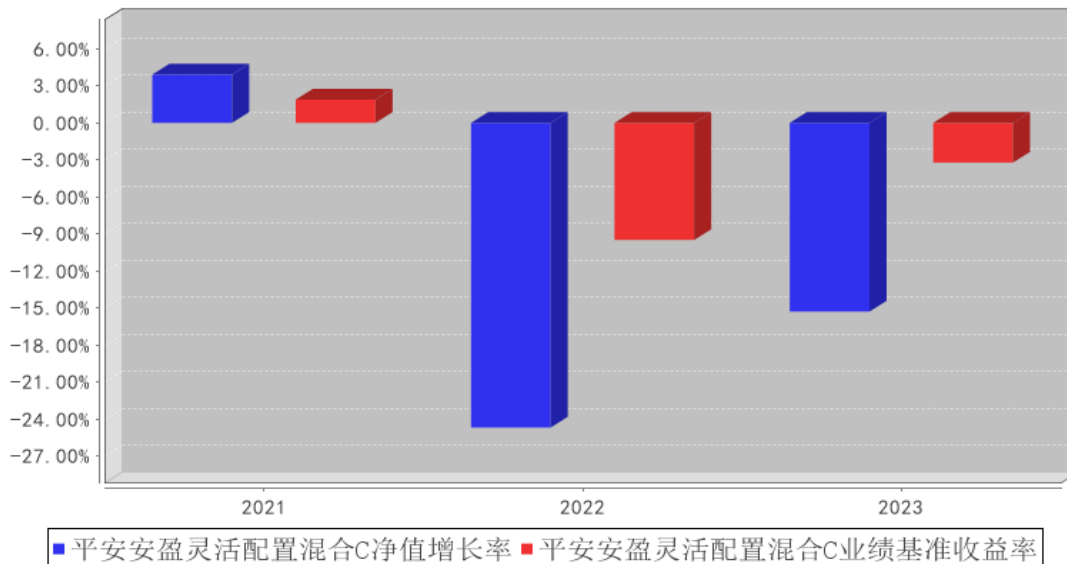
3、本基金于 2021 年 11 月 02 日增设 C 类份额，C 类份额从 2021 年 11 月 04 日开始有份额，所以以上 C 类份额走势图从 2021 年 11 月 04 日开始；

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安安盈灵活配置混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



平安安盈灵活配置混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2019 年 04 月 26 日正式生效，合同生效当年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过往三年无利润分配情况。

## § 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、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。截至 2023 年 12 月 31 日，平安基金共管理 194 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5668 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	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020 年 11 月 3 日	-	12 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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2023 年整体市场有一定下跌，其中上证指数下跌 3.7%，创业板指下跌 19.41%，沪深 300 下跌 11.38%，总体来看高股息相关个股表现较好。一季度初本基金适当减仓了新能源板块，主要在于新能源车、光伏、风电等领域边际景气度都有一定弱化，如竞争加剧、行业增幅放缓等，叠加资金结构较为拥挤，因此预计这些方向有超额收益的个股机会在减少；同时适当加仓了科技板块，在计算机、传媒、通信、电子等领域都有一定加仓，一方面在于这些行业过去几年景气度都较低，23 年有望出现向上的拐点，另一方面在于看好人工智能这个方向，人工智能发展到目前阶段，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，因此判断人工智能这次的表现不是主题投资，而是较明确的产业趋势，会带来较多行业深刻变革，值得去挖掘相应的标的。二季度本基金在行业上基本维持一季度末的配置，主要在行业内进行了结构和个股调整，比如在电子和通信行业，更集中于跟人工智能算力相关的标的。三季度因为市场风险偏好明显下降，因此适当在行业配置上均衡了一些，在成长方向上的配置仍然偏向科技方向，四季度因市场风险偏好继续下降，因此在行业配置上进一步均衡，不过仍适当偏向成长方向。总体而言本基金上半年在科技板块特别是人工智能方向取得了较明显超额收益，但因下半年市场风险偏好大幅下降，净值回撤幅度也较大。目前持仓相对均衡，择机加仓成长方向上的优质个股。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安安盈灵活配置混合 A 的基金份额净值 1.9023 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.89%，同期业绩比较基准收益率为-3.21%；截至本报告期末平安安盈灵活配置混合 C 的基金份额净值 1.8842 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.28%，同期业绩比较基准收益率为-3.21%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过较长时间的调整，目前 a 股较多优质公司的估值水平处于历史低位，长期来看具备较好的配置价值，目前主要在于市场信心不足，如果积极的因素持续出现，市场信心有望逐渐恢复。目前宏观方面已经有一些积极因素，美联储加息已经进入尾声，今年上半年大概率开始降息，国内也出台了较多推动经济发展的政策，因此值得积极寻找长期来看有较大发展潜力的公司。因宏观经济仍有一定压力，相关的金融地产、周期以及消费板块都受到一定程度的影响，市场对这些板块中的公司的未来业绩有一定担心，不过在大幅下跌后，风险已经得到一定释放，如果宏观经济逐渐企稳回升，跟经济相关的较多标的盈利有望出现拐点，往后看估值也有望修复。相对而言，在整体市场企稳后，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，受宏观经济影响相对较小，行业的成长性较为确定，相对而言结构性机会多一些。比如人工智能这个方向，预计是接下来较长时间内最值得重视的方向之一，人工智能是一个重要的科技革命，对人类生产力和生活方式的改变不亚于互联网，人工智能并不是很新的事物，但到了目前阶段到了一个爆发的时点，从海外的进展来看，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，因此判断人工智能这次的表现不是主题投资，而是较明确的产业趋势，会带来较多行业深刻变革，值得去挖局相应的标的。目前来看行业机会主要在算力和应用两方面，算力方面最为确定，而且 a 股相关公司在全球也有较强的竞争力，是目前少数能够确定在盈利上兑现的公司，另外应用端也值得挖掘公司，如果借助大模型开发出较好的应用，收入和利润的弹性相对较大，不过应用方向现在很多公司还在探索阶段，需要持续跟踪和验证。另外有一些成长领域之前下跌幅度较大，也值得在其中挑选优质个股。比如半导体板块在大幅下跌之后也值得关注，半导体行业长期来看是具备持续成长性的，因为在消费终端智能化大趋势下，各类终端的半导体用量和价值量一直在持续提升，另外对于国内半导体公司来看，行业增长和企业业绩的增速是更快的，近几年国内的半导体产业链各个环节更是在快速崛起，很多公司的竞争力在持续提升，实现进口替代，这是一个相对比较确定的产业趋势。因行业的景气波动，过去两年很多半导体公司的股价调整幅度比较大，长期来看一些优质公司目前位置已经具有一定的配置价值。还有新能源这个领域，无论是光伏还是新能源车，过去两年跌幅都比较大，主要在于行业景气度有所下降，同时竞争格局有一定恶化，但同向比较，新能源行业的景气度还是相对较高的，并且在价格大幅下行、行业优胜劣汰后，行业产能也有望逐渐出清，因此一些竞争力较强的优质公司在大幅调整之后，有望出现较好的配置时机。除此之外，像人形机器人、自动驾驶等方向也值得关注。总体而言，因宏观环境的不确定性，尽量要多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。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，

基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理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。

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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2024)审字第 70039114_H10 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了平安安盈灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的平安安盈灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安安盈灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>平安安盈灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>



<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估平安安盈灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督平安安盈灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对平安安盈灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安安盈灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>高鹤   黄拥璇</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12</p>

	室
审计报告日期	2024 年 3 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安安盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	30,607,242.16	42,994,134.56
结算备付金		0.01	30,997.17
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	65,046,826.07	198,969,276.55
其中：股票投资		65,046,826.07	198,969,276.55
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,925.24	109,102.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		95,655,993.48	242,103,511.04
<b>负债和净资产</b>			
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		150,454.69	651,587.30
应付管理人报酬		107,078.74	319,874.89
应付托管费		17,846.43	53,312.49
应付销售服务费		250.54	448.82
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	7.4.7.9	177,309.70	184,089.40
负债合计		452,940.10	1,209,312.90
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	50,050,004.28	107,786,769.69
未分配利润	7.4.7.12	45,153,049.10	133,107,428.45
净资产合计		95,203,053.38	240,894,198.14
负债和净资产总计		95,655,993.48	242,103,511.04

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 50,050,004.28 份，其中，下属 A 类基金份额净值人民币 1.9023 元，基金份额总额 49,737,687.45 份；下属 C 类基金份额净值人民币 1.8842 元，基金份额总额 312,316.83 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安安盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-24,983,066.45	-103,267,336.32
1. 利息收入		362,943.24	475,630.70
其中：存款利息收入	7.4.7.13	235,078.44	299,561.69
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		127,864.80	176,069.01
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-31,088,186.19	-86,063,188.20
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-32,185,078.98	-88,105,869.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	67,620.40	-

资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,029,272.39	2,042,681.77
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.20	5,685,942.24	-17,984,207.81
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.21	56,234.26	304,428.99
<b>减：二、营业总支出</b>		3,850,959.29	6,682,592.59
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,113,748.88	5,477,374.54
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	518,958.13	912,895.74
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	12,352.01	80,122.31
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.27	-
8. 其他费用	7.4.7.23	205,900.00	212,200.00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-28,834,025.74	-109,949,928.91
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-28,834,025.74	-109,949,928.91
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-28,834,025.74	-109,949,928.91

### 7.3 净资产变动表

会计主体：平安安盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	107,786,769.69	-	133,107,428.45	240,894,198.14

二、本期期初净资产	107,786,769.69	-	133,107,428.45	240,894,198.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-57,736,765.41	-	-87,954,379.35	-145,691,144.76
(一)、综合收益总额	-	-	-28,834,025.74	-28,834,025.74
(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)	-57,736,765.41	-	-59,120,353.61	-116,857,119.02
其中：1. 基金申购款	14,037,870.60	-	19,470,523.62	33,508,394.22
2. 基金赎回款	-71,774,636.01	-	-78,590,877.23	-150,365,513.24
(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	50,050,004.28	-	45,153,049.10	95,203,053.38
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	162,939,358.84	-	318,433,452.49	481,372,811.33
二、本期期初净资产	162,939,358.84	-	318,433,452.49	481,372,811.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-55,152,589.15	-	185,326,024.04	-240,478,613.19
(一)、综合收益总额	-	-	109,949,928.91	-109,949,928.91
(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)	-55,152,589.15	-	-75,376,095.13	-130,528,684.28
其中：1. 基金申购款	61,909,253.89	-	98,812,888.65	160,722,142.54

2. 基金赎回款	- 117,061,843.04	-	- 174,188,983.78	-291,250,826.82
(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	107,786,769.69	-	133,107,428.45	240,894,198.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>张南南</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

平安安盈灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）是根据原平安安盈保本混合型证券投资基金（以下简称“平安安盈保本混合”）《平安安盈保本混合型证券投资基金合同》的约定，由原平安安盈保本混合转型而来。原平安安盈保本混合为契约型开放式基金，存续期限不定，原平安安盈保本混合第一个保本期于 2019 年 4 月 22 日到期，但基金管理人无法为本基金转入下一保本期确定保证人或保本义务人，原平安安盈保本混合将不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件，基金管理人经与托管人协商一致，自 2019 年 4 月 26 日起，平安安盈保本混合更名为平安安盈灵活配置混合型证券投资基金，《平安安盈灵活配置混合型证券投资基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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。

根据《平安安盈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/申购费用的基金份额，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《平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、央行票据、短期融资券、超级短期融资券、商业银行次级债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、定期存款等银行存款以及法律法规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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权

益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变



化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重

新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利

得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配

基准日的任一类基金份额净值减去每单位相应类别的基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业

有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	2,812,692.87	4,550,982.40
等于：本金	2,812,448.81	4,550,535.39
加：应计利息	244.06	447.01
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	27,794,549.29	38,443,152.16
等于：本金	27,791,240.01	38,438,234.29
加：应计利息	3,309.28	4,917.87
减：坏账准备	-	-
合计	30,607,242.16	42,994,134.56

注：本基金持有的其他存款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。

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		64,743,761.24	-	65,046,826.07	303,064.83
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		64,743,761.24	-	65,046,826.07	303,064.83
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		204,352,153.96	-	198,969,276.55	-5,382,877.41
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		204,352,153.96	-	198,969,276.55	-5,382,877.41

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有期货合约。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**7.4.7.5 债权投资**

**7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

**7.4.7.6 其他债权投资**

**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

**7.4.7.7 其他权益工具投资**

**7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	9.70	89.40
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	177,300.00	184,000.00
合计	177,309.70	184,089.40



## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 平安安盈灵活配置混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	107,166,204.19	107,166,204.19
本期申购	9,356,448.92	9,356,448.92
本期赎回（以“-”号填列）	-66,784,965.66	-66,784,965.66
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	49,737,687.45	49,737,687.45

## 平安安盈灵活配置混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	620,565.50	620,565.50
本期申购	4,681,421.68	4,681,421.68
本期赎回（以“-”号填列）	-4,989,670.35	-4,989,670.35
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	312,316.83	312,316.83

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末无其他综合收益。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 平安安盈灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	125,477,073.56	6,870,698.78	132,347,772.34
本期期初	125,477,073.56	6,870,698.78	132,347,772.34
本期利润	-33,955,563.91	5,768,523.68	-28,187,040.23
本期基金份额交易产生的变动数	-58,325,282.62	-958,545.21	-59,283,827.83
其中：基金申购款	11,798,690.73	1,419,776.89	13,218,467.62
基金赎回款	-70,123,973.35	-2,378,322.10	-72,502,295.45
本期已分配利润	-	-	-

本期末	33,196,227.03	11,680,677.25	44,876,904.28
-----	---------------	---------------	---------------

平安安盈灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	754,648.73	5,007.38	759,656.11
本期期初	754,648.73	5,007.38	759,656.11
本期利润	-564,404.07	-82,581.44	-646,985.51
本期基金份额交易产生的变动数	30,533.83	132,940.39	163,474.22
其中：基金申购款	6,033,243.43	218,812.57	6,252,056.00
基金赎回款	-6,002,709.60	-85,872.18	-6,088,581.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	220,778.49	55,366.33	276,144.82

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	15,282.08	185,135.04
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	219,669.35	41,021.25
结算备付金利息收入	127.01	62,485.71
其他	-	10,919.69
合计	235,078.44	299,561.69

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。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-32,185,078.98	-88,105,869.97
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	-32,185,078.98	-88,105,869.97
----	----------------	----------------

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	4,537,003,450.92	6,253,340,803.25
减：卖出股票成本总额	4,557,838,159.67	6,325,208,208.94
减：交易费用	11,350,370.23	16,238,464.28
买卖股票差价收入	-32,185,078.98	-88,105,869.97

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	68.46	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	67,551.94	-
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	67,620.40	-

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,835,762.35	-

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,767,606.51	-
减：应计利息总额	332.49	-
减：交易费用	271.41	-
买卖债券差价收入	67,551.94	-

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,029,272.39	2,042,681.77
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	1,029,272.39	2,042,681.77

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	5,685,942.24	-17,984,207.81
股票投资	5,685,942.24	-17,984,207.81
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	5,685,942.24	-17,984,207.81

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	40,073.60	299,356.71
基金转换费收入	16,160.66	5,072.28
合计	56,234.26	304,428.99

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减。赎回费计入基金财产的比例根据《平安安盈灵活配置

混合型证券投资基金招募说明书》确定。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费按注 1 中约定的比例计入基金财产。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	48,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	36,300.00
其他	1,900.00	900.00
合计	205,900.00	212,200.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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
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
中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安”）	基金管理人的最终控股母公司

安集团”)

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
平安证券	-	-	265,507,108.94	2.15

## 7.4.10.1.2 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。

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例 (%)
平安证券	-	-	30,609,000.00	1.34

## 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	191,509.57	2.15	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结

算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,113,748.88	5,477,374.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	728,067.78	1,023,273.36
应支付基金管理人的净管理费	2,385,681.10	4,454,101.18

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 31 日，支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。根据本基金的基金管理人于 2023 年 9 月 1 日发布的《平安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 9 月 1 日起，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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	518,958.13	912,895.74

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 31 日，支付基金托管行中国银行人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。根据本基金的基金管理人于 2023 年 9 月 1 日发布的《平安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 9 月 1 日起，支付基金托管人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。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	本期



获得销售服务费的各关联方名称	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安安盈灵活配置混合 A	平安安盈灵活配置混合 C	合计
平安基金	-	70.58	70.58
平安人寿	-	1,949.36	1,949.36
平安证券	-	1,236.10	1,236.10
合计	-	3,256.04	3,256.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安安盈灵活配置混合 A	平安安盈灵活配置混合 C	合计
平安基金	-	88.00	88.00
平安人寿	-	3,135.49	3,135.49
平安证券	-	112.17	112.17
合计	-	3,335.66	3,335.66

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40% 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 × 0.40% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

平安安盈灵活配置混合 A

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
平安人寿	-	-	31,097,904.24	29.0184

7.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	2,812,692.87	15,282.08	4,550,982.40	185,135.04

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
603107	上海汽 配	2023年 10月25 日	6个月	新股锁定	14.23	18.19	83	1,181.09	1,509.77	-

603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定	9.50	18.97	109	1,035.50	2,067.73	-
--------	------	------------------------	------	------	------	-------	-----	----------	----------	---

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

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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）。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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 7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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，并按照合约规定的重新定价日或到期日进行了分类。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	30,607,242.16	-	-	-	30,607,242.16
结算备付金	0.01	-	-	-	0.01
交易性金融资产	-	-	-	65,046,826.07	65,046,826.07
应收申购款	-	-	-	1,925.24	1,925.24
资产总计	30,607,242.17	-	-	65,048,751.31	95,655,993.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	150,454.69	150,454.69
应付管理人报酬	-	-	-	107,078.74	107,078.74
应付托管费	-	-	-	17,846.43	17,846.43
应付销售服务费	-	-	-	250.54	250.54
其他负债	-	-	-	177,309.70	177,309.70
负债总计	-	-	-	452,940.10	452,940.10
利率敏感度缺口	30,607,242.17	-	-	64,595,811.21	95,203,053.38
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	42,994,134.56	-	-	-	42,994,134.56
结算备付金	30,997.17	-	-	-	30,997.17
交易性金融资产	-	-	-	198,969,276.55	198,969,276.55
应收申购款	-	-	-	109,102.76	109,102.76
资产总计	43,025,131.73	-	-	199,078,379.31	242,103,511.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	651,587.30	651,587.30
应付管理人报酬	-	-	-	319,874.89	319,874.89
应付托管费	-	-	-	53,312.49	53,312.49
应付销售服务费	-	-	-	448.82	448.82
其他负债	-	-	-	184,089.40	184,089.40
负债总计	-	-	-	1,209,312.90	1,209,312.90
利率敏感度缺口	43,025,131.73	-	-	-197,869,066.41	240,894,198.14

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。

## 7.4.13.4.1.2 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）。

## 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

#### 7.4.13.4.3 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：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	65,046,826.07	68.32	198,969,276.55	82.60
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	65,046,826.07	68.32	198,969,276.55	82.60

##### 7.4.13.4.3.2 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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	沪深300指数上升	3,107,203.69	8,639,419.84

	5%		
	沪深 300 指数下降	-3, 107, 203. 69	-8, 639, 419. 84
	5%		

#### 7. 4. 13. 4. 4 采用风险价值法管理风险

注：无

#### 7. 4. 14 公允价值

##### 7. 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。

##### 7. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7. 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	65, 043, 248. 57	198, 462, 138. 40
第二层次	-	-
第三层次	3, 577. 50	507, 138. 15
合计	65, 046, 826. 07	198, 969, 276. 55

###### 7. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的会计政策在前后各会计期间保持一致。

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。

###### 7. 4. 14. 2. 3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7. 4. 14. 2. 3. 1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元



项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	507,138.15	507,138.15
当期购买	-	2,216.59	2,216.59
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	507,138.15	507,138.15
当期利得或损失总额	-	1,360.91	1,360.91
其中：计入损益的利得或损失	-	1,360.91	1,360.91
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,577.50	3,577.50
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,360.91	1,360.91
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,423,940.09	2,423,940.09
当期购买	-	518,418.97	518,418.97
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,423,940.09	2,423,940.09
当期利得或损失总额	-	-11,280.82	-11,280.82
其中：计入损益的利得或损失	-	-11,280.82	-11,280.82
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	507,138.15	507,138.15
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-11,280.82	-11,280.82

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	3,577.50	平均价格亚式期权模型	预期波动率	1.8307-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	507,138.15	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2319-2.4756	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	65,046,826.07	68.00
	其中：股票	65,046,826.07	68.00
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	30,607,242.17	32.00
8	其他各项资产	1,925.24	0.00
9	合计	95,655,993.48	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	1,767,286.00	1.86
B	采矿业	4,539,246.00	4.77
C	制造业	43,718,947.79	45.92
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,333,685.28	11.90
J	金融业	795,432.00	0.84
K	房地产业	951,026.00	1.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,941,203.00	2.04
S	综合	-	-
	合计	65,046,826.07	68.32

### 8.2.2 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。

## 8.3 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	600941	中国移动	43,609	4,338,223.32	4.56
2	002475	立讯精密	98,100	3,379,545.00	3.55
3	601088	中国神华	84,900	2,661,615.00	2.80

4	601728	中国电信	439,700	2,378,777.00	2.50
5	300750	宁德时代	12,700	2,073,402.00	2.18
6	600519	贵州茅台	1,200	2,071,200.00	2.18
7	300308	中际旭创	18,300	2,066,253.00	2.17
8	300394	天孚通信	22,000	2,013,440.00	2.11
9	002517	恺英网络	176,400	1,970,388.00	2.07
10	603596	伯特利	28,272	1,959,249.60	2.06
11	300498	温氏股份	88,100	1,767,286.00	1.86
12	605117	德业股份	20,100	1,686,390.00	1.77
13	688328	深科达	35,931	1,611,505.35	1.69
14	300232	洲明科技	181,300	1,595,440.00	1.68
15	603297	永新光学	14,800	1,470,380.00	1.54
16	300115	长盈精密	104,300	1,381,975.00	1.45
17	600114	东睦股份	86,000	1,332,140.00	1.40
18	300031	宝通科技	60,800	1,127,232.00	1.18
19	300748	金力永磁	55,400	1,120,188.00	1.18
20	688017	绿的谐波	6,899	1,058,996.50	1.11
21	688025	杰普特	11,346	1,050,072.30	1.10
22	300580	贝斯特	34,300	1,038,604.00	1.09
23	000810	创维数字	62,400	980,304.00	1.03
24	601595	上海电影	37,700	973,791.00	1.02
25	600373	中文传媒	73,400	967,412.00	1.02
26	601225	陕西煤业	46,200	965,118.00	1.01
27	600641	万业企业	55,100	951,026.00	1.00
28	688390	固德威	7,279	950,491.82	1.00
29	300693	盛弘股份	31,600	945,156.00	0.99
30	000333	美的集团	17,300	945,099.00	0.99
31	688630	芯碁微装	10,973	936,765.01	0.98
32	300757	罗博特科	11,400	927,846.00	0.97
33	600547	山东黄金	39,900	912,513.00	0.96
34	300765	新诺威	22,700	831,274.00	0.87
35	300803	指南针	13,200	795,432.00	0.84
36	300769	德方纳米	11,700	714,051.00	0.75
37	002156	通富微电	30,700	709,784.00	0.75
38	301312	智立方	6,500	704,210.00	0.74
39	688556	高测股份	14,565	567,889.35	0.60
40	688260	昀冢科技	16,356	495,586.80	0.52
41	688279	峰昭科技	3,883	489,723.96	0.51
42	301261	恒工精密	9,400	485,228.00	0.51
43	300763	锦浪科技	6,900	482,310.00	0.51
44	688408	中信博	6,696	480,438.00	0.50
45	688097	博众精工	14,266	479,337.60	0.50
46	688472	阿特斯	36,585	462,068.55	0.49

47	301413	安培龙	6,200	460,040.00	0.48
48	688072	拓荆科技	1,984	458,899.20	0.48
49	300122	智飞生物	7,500	458,325.00	0.48
50	603773	沃格光电	12,900	436,923.00	0.46
51	688037	芯源微	3,120	416,863.20	0.44
52	301236	软通动力	8,600	397,320.00	0.42
53	002843	泰嘉股份	13,100	347,150.00	0.36
54	301153	中科江南	4,300	336,561.00	0.35
55	688192	迪哲医药	6,976	333,801.60	0.35
56	688799	华纳药厂	6,400	313,216.00	0.33
57	603890	春秋电子	26,200	299,990.00	0.32
58	300418	昆仑万维	7,900	295,460.00	0.31
59	002429	兆驰股份	50,800	283,464.00	0.30
60	300705	九典制药	8,100	269,163.00	0.28
61	688336	三生国健	9,991	224,897.41	0.24
62	603278	大业股份	17,500	220,500.00	0.23
63	600535	天士力	10,900	185,518.00	0.19
64	603273	天元智能	109	2,067.73	0.00
65	603107	上海汽配	83	1,509.77	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	300394	天孚通信	92,448,109.09	38.38
2	300418	昆仑万维	91,644,334.93	38.04
3	300308	中际旭创	72,119,030.97	29.94
4	300502	新易盛	67,828,886.16	28.16
5	600941	中国移动	65,326,417.14	27.12
6	300494	盛天网络	65,193,899.32	27.06
7	002517	恺英网络	57,279,471.00	23.78
8	688111	金山办公	52,362,257.98	21.74
9	002555	三七互娱	41,933,939.45	17.41
10	300624	万兴科技	41,296,512.15	17.14
11	002230	科大讯飞	39,773,415.15	16.51
12	688256	寒武纪	38,649,733.26	16.04
13	300476	胜宏科技	38,260,549.44	15.88
14	300130	新国都	37,537,501.00	15.58
15	300364	中文在线	36,997,241.67	15.36
16	603019	中科曙光	36,753,473.00	15.26
17	603596	伯特利	36,522,392.84	15.16
18	601138	工业富联	34,085,339.85	14.15
19	688041	海光信息	32,734,569.68	13.59

20	300033	同花顺	32,151,474.07	13.35
21	000032	深桑达 A	31,959,740.88	13.27
22	300002	神州泰岳	31,411,137.33	13.04
23	600373	中文传媒	30,015,157.45	12.46
24	000719	中原传媒	27,854,823.67	11.56
25	688981	中芯国际	27,470,834.13	11.40
26	002475	立讯精密	26,662,860.80	11.07
27	300212	易华录	26,404,162.74	10.96
28	300766	每日互动	26,347,835.00	10.94
29	300058	蓝色光标	25,923,975.00	10.76
30	600602	云赛智联	25,782,442.03	10.70
31	300634	彩讯股份	25,690,293.00	10.66
32	688498	源杰科技	25,642,501.24	10.64
33	002236	大华股份	24,994,902.97	10.38
34	002463	沪电股份	24,625,615.00	10.22
35	002558	巨人网络	24,550,525.66	10.19
36	000977	浪潮信息	24,505,091.00	10.17
37	000063	中兴通讯	24,051,439.45	9.98
38	300750	宁德时代	24,026,367.11	9.97
39	300459	汤姆猫	23,543,398.08	9.77
40	300672	国科微	23,511,609.23	9.76
41	600519	贵州茅台	23,326,996.00	9.68
42	002624	完美世界	23,128,359.10	9.60
43	601360	三六零	23,028,499.59	9.56
44	688036	传音控股	22,887,966.47	9.50
45	601006	大秦铁路	22,631,460.00	9.39
46	688262	国芯科技	22,580,798.29	9.37
47	300533	冰川网络	21,854,578.00	9.07
48	688037	芯源微	21,569,101.69	8.95
49	603444	吉比特	21,095,017.00	8.76
50	601728	中国电信	20,966,745.72	8.70
51	600030	中信证券	20,920,848.55	8.68
52	688590	新致软件	20,850,109.97	8.66
53	601858	中国科传	20,199,053.34	8.39
54	300229	拓尔思	20,121,477.40	8.35
55	300280	紫天科技	20,071,968.69	8.33
56	002605	姚记科技	19,909,741.80	8.26
57	603997	继峰股份	19,804,606.05	8.22
58	601921	浙版传媒	19,303,048.51	8.01
59	300299	富春股份	18,700,575.73	7.76
60	603000	人民网	18,641,228.00	7.74
61	601688	华泰证券	18,432,440.00	7.65
62	300803	指南针	18,226,617.08	7.57

63	000617	中油资本	18,035,397.65	7.49
64	300558	贝达药业	17,531,826.10	7.28
65	300474	景嘉微	17,461,611.50	7.25
66	300148	天舟文化	17,198,361.00	7.14
67	601689	拓普集团	16,789,278.50	6.97
68	002466	天齐锂业	16,372,834.09	6.80
69	300059	东方财富	16,233,362.50	6.74
70	600498	烽火通信	16,192,270.13	6.72
71	601928	凤凰传媒	16,095,752.98	6.68
72	002599	盛通股份	15,896,022.92	6.60
73	002129	TCL 中环	15,553,088.69	6.46
74	002368	太极股份	15,542,257.53	6.45
75	002371	北方华创	15,480,806.00	6.43
76	300031	宝通科技	15,109,590.00	6.27
77	300570	太辰光	14,932,433.00	6.20
78	603208	江山欧派	14,820,051.60	6.15
79	300251	光线传媒	14,585,476.00	6.05
80	601658	邮储银行	14,494,835.00	6.02
81	600363	联创光电	14,285,614.52	5.93
82	002472	双环传动	14,247,838.00	5.91
83	688521	芯原股份	14,140,987.66	5.87
84	601595	上海电影	14,097,258.20	5.85
85	600633	浙数文化	13,977,441.01	5.80
86	688400	凌云光	13,869,220.19	5.76
87	300693	盛弘股份	13,843,678.28	5.75
88	002602	世纪华通	13,578,912.00	5.64
89	601699	潞安环能	13,418,651.67	5.57
90	601628	中国人寿	13,250,210.55	5.50
91	688533	上声电子	12,934,370.16	5.37
92	301236	软通动力	12,757,294.55	5.30
93	300049	福瑞股份	12,745,100.92	5.29
94	300688	创业黑马	12,689,076.50	5.27
95	002459	晶澳科技	12,491,529.45	5.19
96	601019	山东出版	12,426,810.00	5.16
97	000060	中金岭南	12,379,710.50	5.14
98	603230	内蒙新华	12,302,844.60	5.11
99	000938	紫光股份	12,300,974.69	5.11
100	688095	福昕软件	12,127,336.96	5.03
101	600732	爱旭股份	12,059,756.00	5.01
102	603008	喜临门	11,951,874.00	4.96
103	003032	传智教育	11,915,592.20	4.95
104	300811	铂科新材	11,874,132.63	4.93
105	002965	祥鑫科技	11,713,479.00	4.86

106	601555	东吴证券	11,563,008.56	4.80
107	601899	紫金矿业	11,397,811.19	4.73
108	300567	精测电子	11,213,556.64	4.65
109	600809	山西汾酒	11,077,861.80	4.60
110	300687	赛意信息	11,050,304.99	4.59
111	300487	蓝晓科技	11,030,006.50	4.58
112	000625	长安汽车	10,954,442.02	4.55
113	600114	东睦股份	10,911,994.27	4.53
114	688787	海天瑞声	10,894,772.97	4.52
115	603533	掌阅科技	10,867,188.00	4.51
116	300604	长川科技	10,863,721.00	4.51
117	300274	阳光电源	10,474,008.00	4.35
118	601058	赛轮轮胎	10,424,418.99	4.33
119	600266	城建发展	10,375,898.80	4.31
120	300170	汉得信息	10,309,631.16	4.28
121	601995	中金公司	10,276,984.00	4.27
122	000799	酒鬼酒	10,170,817.00	4.22
123	300770	新媒股份	10,085,709.00	4.19
124	601988	中国银行	9,899,565.00	4.11
125	688072	拓荆科技	9,758,002.02	4.05
126	000090	天健集团	9,629,950.83	4.00
127	300638	广和通	9,534,769.40	3.96
128	688012	中微公司	9,250,253.94	3.84
129	688409	富创精密	9,165,534.38	3.80
130	688039	当虹科技	9,130,612.57	3.79
131	301333	诺思格	9,045,637.10	3.76
132	603186	华正新材	8,855,987.00	3.68
133	605020	永和股份	8,763,065.00	3.64
134	600150	中国船舶	8,696,231.00	3.61
135	002276	万马股份	8,695,030.00	3.61
136	600927	永安期货	8,603,098.00	3.57
137	301155	海力风电	8,558,268.00	3.55
138	000002	万科 A	8,546,985.90	3.55
139	688031	星环科技	8,543,332.93	3.55
140	601127	赛力斯	8,476,935.00	3.52
141	603258	电魂网络	8,362,526.00	3.47
142	002410	广联达	8,296,197.40	3.44
143	000988	华工科技	8,281,717.00	3.44
144	688332	中科蓝讯	8,242,774.18	3.42
145	002240	盛新锂能	8,221,492.26	3.41
146	002130	沃尔核材	8,214,210.00	3.41
147	603259	药明康德	8,198,824.00	3.40
148	688066	航天宏图	8,190,603.23	3.40



149	002384	东山精密	8,110,269.00	3.37
150	688197	首药控股	8,071,369.62	3.35
151	002315	焦点科技	7,978,876.00	3.31
152	300769	德方纳米	7,969,455.60	3.31
153	601088	中国神华	7,858,855.00	3.26
154	002484	江海股份	7,857,205.00	3.26
155	300260	新莱应材	7,855,817.68	3.26
156	601900	南方传媒	7,849,342.18	3.26
157	002271	东方雨虹	7,771,476.00	3.23
158	600048	保利发展	7,716,627.00	3.20
159	600325	华发股份	7,652,316.00	3.18
160	301073	君亭酒店	7,559,760.50	3.14
161	002409	雅克科技	7,548,727.00	3.13
162	688579	山大地纬	7,518,379.67	3.12
163	601288	农业银行	7,466,058.00	3.10
164	300613	富瀚微	7,450,467.04	3.09
165	688700	东威科技	7,436,913.36	3.09
166	300475	香农芯创	7,419,349.00	3.08
167	600153	建发股份	7,314,739.00	3.04
168	300788	中信出版	7,301,284.00	3.03
169	002738	中矿资源	7,144,859.60	2.97
170	000069	华侨城 A	7,070,171.00	2.93
171	688292	浩瀚深度	7,049,115.48	2.93
172	002273	水晶光电	7,046,093.00	2.92
173	300559	佳发教育	6,962,734.00	2.89
174	002222	福晶科技	6,962,721.00	2.89
175	300608	思特奇	6,925,570.60	2.87
176	002244	滨江集团	6,889,264.00	2.86
177	000858	五粮液	6,880,118.00	2.86
178	688156	路德环境	6,850,348.31	2.84
179	300705	九典制药	6,829,226.00	2.83
180	600837	海通证券	6,807,569.00	2.83
181	002192	融捷股份	6,790,994.00	2.82
182	600585	海螺水泥	6,782,785.00	2.82
183	603096	新经典	6,709,265.00	2.79
184	300857	协创数据	6,668,324.32	2.77
185	600376	首开股份	6,622,545.00	2.75
186	300054	鼎龙股份	6,528,026.00	2.71
187	688369	致远互联	6,438,299.54	2.67
188	688327	云从科技	6,387,457.40	2.65
189	002929	润建股份	6,373,738.00	2.65
190	002429	兆驰股份	6,368,395.00	2.64
191	600050	中国联通	6,217,859.00	2.58

192	603918	金桥信息	6,215,000.00	2.58
193	601059	信达证券	6,198,978.06	2.57
194	688599	天合光能	6,125,042.53	2.54
195	601336	新华保险	6,075,617.00	2.52
196	600160	巨化股份	5,941,982.02	2.47
197	300347	泰格医药	5,811,651.72	2.41
198	000700	模塑科技	5,802,895.00	2.41
199	688120	华海清科	5,792,422.56	2.40
200	000568	泸州老窖	5,665,650.00	2.35
201	600276	恒瑞医药	5,655,252.80	2.35
202	688176	亚虹医药	5,560,841.30	2.31
203	601098	中南传媒	5,522,021.00	2.29
204	000651	格力电器	5,520,870.00	2.29
205	300232	洲明科技	5,495,796.72	2.28
206	601949	中国出版	5,488,309.00	2.28
207	002920	德赛西威	5,474,771.00	2.27
208	688368	晶丰明源	5,470,102.67	2.27
209	600702	舍得酒业	5,443,249.00	2.26
210	688099	晶晨股份	5,438,424.51	2.26
211	688328	深科达	5,359,905.89	2.23
212	600760	中航沈飞	5,357,619.64	2.22
213	688776	国光电气	5,346,170.55	2.22
214	300166	东方国信	5,331,296.00	2.21
215	688025	杰普特	5,316,340.85	2.21
216	688503	聚和材料	5,251,562.73	2.18
217	301191	菲菱科思	5,181,381.00	2.15
218	000768	中航西飞	5,142,047.00	2.13
219	301026	浩通科技	5,140,492.00	2.13
220	002155	湖南黄金	5,107,637.54	2.12
221	002063	远光软件	5,099,232.63	2.12
222	601666	平煤股份	5,083,647.00	2.11
223	603105	芯能科技	5,046,073.55	2.09
224	002460	赣锋锂业	5,038,818.00	2.09
225	001270	铖昌科技	5,021,216.00	2.08
226	000034	神州数码	5,012,974.50	2.08
227	601600	中国铝业	5,010,018.00	2.08
228	002908	德生科技	5,002,650.60	2.08
229	601615	明阳智能	4,960,650.57	2.06
230	301391	卡莱特	4,950,971.35	2.06
231	000807	云铝股份	4,944,423.00	2.05
232	688636	智明达	4,942,336.47	2.05
233	605589	圣泉集团	4,865,771.00	2.02
234	688366	昊海生科	4,865,473.17	2.02

235	300383	光环新网	4,830,147.00	2.01
-----	--------	------	--------------	------

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300394	天孚通信	98,329,718.38	40.82
2	300418	昆仑万维	97,108,454.02	40.31
3	300502	新易盛	72,841,152.16	30.24
4	300308	中际旭创	69,855,396.75	29.00
5	600941	中国移动	67,992,571.08	28.23
6	300494	盛天网络	64,931,813.00	26.95
7	002517	恺英网络	55,663,538.60	23.11
8	688111	金山办公	51,079,997.45	21.20
9	300624	万兴科技	42,769,287.87	17.75
10	002230	科大讯飞	41,710,042.16	17.31
11	002555	三七互娱	41,279,714.86	17.14
12	603596	伯特利	39,540,953.14	16.41
13	300476	胜宏科技	39,303,618.94	16.32
14	300364	中文在线	37,968,184.84	15.76
15	300130	新国都	37,892,193.48	15.73
16	688256	寒武纪	37,534,590.13	15.58
17	603019	中科曙光	36,134,595.06	15.00
18	601138	工业富联	33,667,138.00	13.98
19	300002	神州泰岳	33,658,299.05	13.97
20	300033	同花顺	32,226,351.20	13.38
21	688041	海光信息	31,890,823.47	13.24
22	000032	深桑达 A	30,834,297.11	12.80
23	600373	中文传媒	30,600,552.44	12.70
24	300750	宁德时代	30,230,032.80	12.55
25	688981	中芯国际	27,925,065.93	11.59
26	600519	贵州茅台	27,392,820.20	11.37
27	000719	中原传媒	27,290,587.31	11.33
28	300058	蓝色光标	27,199,484.18	11.29
29	300212	易华录	27,013,999.80	11.21
30	002236	大华股份	26,571,137.89	11.03
31	300672	国科微	26,269,922.46	10.91
32	300766	每日互动	26,226,723.00	10.89
33	300634	彩讯股份	25,646,086.50	10.65
34	300459	汤姆猫	25,391,766.94	10.54
35	688498	源杰科技	25,094,678.88	10.42
36	688262	国芯科技	24,696,539.02	10.25
37	000977	浪潮信息	24,624,813.54	10.22

38	600602	云赛智联	24,615,783.00	10.22
39	603997	继峰股份	24,575,897.17	10.20
40	601360	三六零	24,176,495.84	10.04
41	002463	沪电股份	24,049,161.24	9.98
42	002475	立讯精密	23,744,603.00	9.86
43	000063	中兴通讯	23,449,117.00	9.73
44	002558	巨人网络	23,059,147.00	9.57
45	300533	冰川网络	22,944,677.30	9.52
46	688036	传音控股	22,658,868.90	9.41
47	601006	大秦铁路	22,287,314.15	9.25
48	002624	完美世界	22,183,255.50	9.21
49	300229	拓尔思	21,358,672.62	8.87
50	600030	中信证券	21,149,378.14	8.78
51	603444	吉比特	21,087,893.36	8.75
52	601858	中国科传	20,858,051.00	8.66
53	688590	新致软件	20,818,179.22	8.64
54	688037	芯源微	20,812,271.72	8.64
55	300280	紫天科技	20,745,194.00	8.61
56	002605	姚记科技	20,653,440.20	8.57
57	601728	中国电信	19,897,257.36	8.26
58	300059	东方财富	19,607,049.40	8.14
59	601921	浙版传媒	19,568,730.00	8.12
60	300299	富春股份	19,250,586.88	7.99
61	603000	人民网	18,738,865.39	7.78
62	300803	指南针	18,523,225.61	7.69
63	300251	光线传媒	18,511,695.15	7.68
64	601688	华泰证券	17,822,658.51	7.40
65	002466	天齐锂业	17,500,117.00	7.26
66	300474	景嘉微	17,072,506.00	7.09
67	300558	贝达药业	17,052,700.81	7.08
68	000617	中油资本	17,026,699.00	7.07
69	688533	上声电子	16,966,312.07	7.04
70	300148	天舟文化	16,669,741.00	6.92
71	002129	TCL 中环	16,088,565.31	6.68
72	601689	拓普集团	16,086,655.00	6.68
73	601928	凤凰传媒	15,946,510.98	6.62
74	600498	烽火通信	15,891,792.85	6.60
75	002371	北方华创	15,534,421.00	6.45
76	002599	盛通股份	15,397,546.00	6.39
77	002368	太极股份	15,181,353.66	6.30
78	603208	江山欧派	15,040,910.50	6.24
79	002459	晶澳科技	14,963,888.80	6.21
80	600732	爱旭股份	14,534,260.00	6.03

81	601595	上海电影	14,273,280.40	5.93
82	300031	宝通科技	14,039,253.30	5.83
83	600363	联创光电	13,918,272.00	5.78
84	300274	阳光电源	13,885,690.00	5.76
85	601658	邮储银行	13,796,126.00	5.73
86	688521	芯原股份	13,689,864.04	5.68
87	600633	浙数文化	13,674,209.69	5.68
88	002472	双环传动	13,666,321.33	5.67
89	002602	世纪华通	13,635,178.01	5.66
90	300570	太辰光	13,630,238.01	5.66
91	688095	福昕软件	13,278,543.23	5.51
92	002271	东方雨虹	13,209,609.24	5.48
93	601699	潞安环能	13,075,719.00	5.43
94	300049	福瑞股份	13,008,088.57	5.40
95	688072	拓荆科技	12,951,938.19	5.38
96	601628	中国人寿	12,941,531.00	5.37
97	002965	祥鑫科技	12,918,567.00	5.36
98	000060	中金岭南	12,816,592.00	5.32
99	300811	铂科新材	12,391,221.05	5.14
100	601019	山东出版	12,327,074.00	5.12
101	300693	盛弘股份	12,255,661.35	5.09
102	603230	内蒙新华	12,165,998.44	5.05
103	301236	软通动力	12,119,732.56	5.03
104	688787	海天瑞声	11,804,477.90	4.90
105	000938	紫光股份	11,602,427.00	4.82
106	300487	蓝晓科技	11,571,956.50	4.80
107	601899	紫金矿业	11,530,515.99	4.79
108	300688	创业黑马	11,524,162.50	4.78
109	688400	凌云光	11,449,065.71	4.75
110	300687	赛意信息	11,148,230.45	4.63
111	000625	长安汽车	11,127,860.40	4.62
112	603008	喜临门	11,070,906.00	4.60
113	300604	长川科技	11,062,880.35	4.59
114	603533	掌阅科技	11,014,812.00	4.57
115	000568	泸州老窖	10,899,564.00	4.52
116	300170	汉得信息	10,807,085.00	4.49
117	601555	东吴证券	10,764,914.60	4.47
118	300567	精测电子	10,755,117.00	4.46
119	600266	城建发展	10,715,739.00	4.45
120	600522	中天科技	10,604,454.21	4.40
121	688031	星环科技	10,492,370.05	4.36
122	600809	山西汾酒	10,270,000.00	4.26
123	003032	传智教育	10,248,454.72	4.25

124	300347	泰格医药	10,237,591.44	4.25
125	000799	酒鬼酒	10,045,306.00	4.17
126	601988	中国银行	9,974,948.00	4.14
127	601995	中金公司	9,962,147.00	4.14
128	002276	万马股份	9,865,571.90	4.10
129	688332	中科蓝讯	9,814,268.58	4.07
130	000090	天健集团	9,800,973.14	4.07
131	601058	赛轮轮胎	9,740,478.48	4.04
132	688012	中微公司	9,727,374.84	4.04
133	603258	电魂网络	9,693,257.00	4.02
134	600114	东睦股份	9,493,849.00	3.94
135	300638	广和通	9,439,559.68	3.92
136	603816	顾家家居	9,289,591.00	3.86
137	300770	新媒股份	9,109,363.00	3.78
138	601888	中国中免	9,072,547.44	3.77
139	301333	诺思格	8,993,078.00	3.73
140	000069	华侨城 A	8,962,934.31	3.72
141	000002	万科 A	8,874,799.00	3.68
142	601615	明阳智能	8,860,488.60	3.68
143	600927	永安期货	8,851,634.00	3.67
144	001270	铖昌科技	8,813,966.75	3.66
145	688409	富创精密	8,771,059.96	3.64
146	603186	华正新材	8,770,238.00	3.64
147	688039	当虹科技	8,740,650.32	3.63
148	600036	招商银行	8,736,689.00	3.63
149	002130	沃尔核材	8,466,051.00	3.51
150	603259	药明康德	8,381,914.12	3.48
151	600150	中国船舶	8,339,778.80	3.46
152	600702	舍得酒业	8,278,963.00	3.44
153	002410	广联达	8,219,634.40	3.41
154	002315	焦点科技	8,177,123.70	3.39
155	000988	华工科技	8,115,951.00	3.37
156	301155	海力风电	8,103,111.00	3.36
157	002240	盛新锂能	7,975,787.58	3.31
158	688197	首药控股	7,866,940.53	3.27
159	300475	香农芯创	7,831,037.20	3.25
160	002409	雅克科技	7,824,240.00	3.25
161	600325	华发股份	7,714,279.00	3.20
162	688700	东威科技	7,688,777.64	3.19
163	301073	君亭酒店	7,637,964.00	3.17
164	300613	富瀚微	7,594,292.14	3.15
165	601127	赛力斯	7,521,907.00	3.12
166	300260	新莱应材	7,480,186.30	3.11

167	601288	农业银行	7,447,925.00	3.09
168	605020	永和股份	7,362,105.00	3.06
169	688599	天合光能	7,341,019.16	3.05
170	600011	华能国际	7,334,198.00	3.04
171	688066	航天宏图	7,329,367.16	3.04
172	300559	佳发教育	7,305,093.00	3.03
173	601900	南方传媒	7,267,235.00	3.02
174	002384	东山精密	7,238,622.00	3.00
175	300857	协创数据	7,224,871.00	3.00
176	300788	中信出版	7,199,044.00	2.99
177	600153	建发股份	7,140,170.00	2.96
178	688156	路德环境	7,139,866.87	2.96
179	600048	保利发展	7,108,035.40	2.95
180	300608	思特奇	7,001,375.60	2.91
181	002273	水晶光电	6,984,122.00	2.90
182	002244	滨江集团	6,967,665.00	2.89
183	000858	五粮液	6,961,648.00	2.89
184	002484	江海股份	6,954,513.00	2.89
185	002738	中矿资源	6,952,740.00	2.89
186	002192	融捷股份	6,831,710.00	2.84
187	300122	智飞生物	6,822,022.00	2.83
188	688579	山大地纬	6,752,082.27	2.80
189	603096	新经典	6,708,389.00	2.78
190	300769	德方纳米	6,698,176.60	2.78
191	600837	海通证券	6,666,306.00	2.77
192	002222	福晶科技	6,524,463.00	2.71
193	688369	致远互联	6,520,292.84	2.71
194	600585	海螺水泥	6,467,228.00	2.68
195	600487	亨通光电	6,462,432.00	2.68
196	300054	鼎龙股份	6,334,976.95	2.63
197	688292	浩瀚深度	6,312,735.38	2.62
198	600376	首开股份	6,302,936.00	2.62
199	300705	九典制药	6,261,189.50	2.60
200	688063	派能科技	6,242,744.93	2.59
201	601059	信达证券	6,180,797.00	2.57
202	600050	中国联通	6,169,292.00	2.56
203	603383	顶点软件	6,133,510.00	2.55
204	002429	兆驰股份	6,065,324.00	2.52
205	002929	润建股份	6,054,842.44	2.51
206	600160	巨化股份	5,995,083.00	2.49
207	000700	模塑科技	5,961,825.00	2.47
208	688327	云从科技	5,958,206.45	2.47
209	603728	鸣志电器	5,918,034.00	2.46

210	601949	中国出版	5,906,111.00	2.45
211	600276	恒瑞医药	5,762,096.80	2.39
212	688120	华海清科	5,750,444.94	2.39
213	601336	新华保险	5,684,073.00	2.36
214	002142	宁波银行	5,581,984.00	2.32
215	000651	格力电器	5,581,473.00	2.32
216	688099	晶晨股份	5,502,041.83	2.28
217	688176	亚虹医药	5,458,295.85	2.27
218	601098	中南传媒	5,450,306.00	2.26
219	601666	平煤股份	5,449,403.00	2.26
220	002920	德赛西威	5,438,305.00	2.26
221	002714	牧原股份	5,412,993.00	2.25
222	688503	聚和材料	5,411,056.32	2.25
223	688368	晶丰明源	5,340,656.74	2.22
224	600760	中航沈飞	5,295,367.04	2.20
225	300166	东方国信	5,284,767.00	2.19
226	002908	德生科技	5,256,925.40	2.18
227	601600	中国铝业	5,232,508.00	2.17
228	000768	中航西飞	5,198,354.00	2.16
229	603105	芯能科技	5,149,212.17	2.14
230	002155	湖南黄金	5,136,181.27	2.13
231	603918	金桥信息	5,108,560.00	2.12
232	688636	智明达	5,069,821.35	2.10
233	688776	国光电气	5,042,728.30	2.09
234	002063	远光软件	5,007,532.44	2.08
235	603986	兆易创新	5,006,925.00	2.08
236	601066	中信建投	4,999,889.00	2.08
237	688167	炬光科技	4,998,849.93	2.08
238	301026	浩通科技	4,995,409.00	2.07
239	601088	中国神华	4,976,420.00	2.07
240	301391	卡莱特	4,968,821.64	2.06
241	301191	菲菱科思	4,896,503.80	2.03
242	605589	圣泉集团	4,893,809.47	2.03
243	300383	光环新网	4,886,821.93	2.03
244	000034	神州数码	4,818,762.00	2.00

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。

### 8.4.3 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	4,418,229,766.95
卖出股票收入（成交）总额	4,537,003,450.92

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。



### 8.5 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。

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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投资。

### 8.10 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	1,925.24
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,925.24

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)
平安安盈灵活配置混合 A	27,554	1,805.10	-	-	49,737,687.45	100.00
平安安盈灵活配置混合 C	276	1,131.58	-	-	312,316.83	100.00
合计	27,804	1,800.10	-	-	50,050,004.28	100.00

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）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安安盈灵活配置混合 A	229,709.77	0.4618
	平安安盈灵活配置混合 C	7.04	0.0023
	合计	229,716.81	0.4590

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）。

### 9.3 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	平安安盈灵活配置混合 A	0~10
	平安安盈灵活配置混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	平安安盈灵活配置混合 A	10~50
	平安安盈灵活配置混合 C	0
	合计	10~50

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安安盈灵活配置混合 A	平安安盈灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2019年4月26日) 基金份额总额	599,241,991.53	-
本报告期期初基金份额总额	107,166,204.19	620,565.50
本报告期基金总申购份额	9,356,448.92	4,681,421.68
减：本报告期基金总赎回份额	66,784,965.66	4,989,670.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	49,737,687.45	312,316.83

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

基金管理人：本报告期内，公司 4 名董事发生变更，董事在最近 12 个月内变更未超过百分之五十。

基金托管人：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。

### 11.3 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，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 48,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	平安基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 12 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	公司管理的两只基金在债券投资过程中，参考外部评级机构的范围不符合监管规定。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改
其他	无

#### 11.6.2 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	4	6,362,552,928.41	71.05	4,614,136.66	70.85	-
银河证券	4	2,592,096,636.19	28.95	1,898,462.72	29.15	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	退租
大通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	退租
华泰证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	退租 2 个
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	退租
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

证券						
----	--	--	--	--	--	--

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

2、基金管理人与证券经纪商不存在关联关系。

3、基金管理人根据监管规定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。

### 11.7.2 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(%)
国信证券	5,082,846.61	94.77	1,324,605,000.00	98.23	-	-
银河证券	280,784.10	5.23	23,927,000.00	1.77	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证	-	-	-	-	-	-

券						
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华林证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
中国国	-	-	-	-	-	-

际金融 股份有 限公司						
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	2023年01月05日
2	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年01月14日
3	平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年01月19日
4	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023年01月20日
5	平安基金管理有限公司关于暂停上海爱建基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年02月09日
6	关于暂停浦领基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年02月13日
7	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富(北京)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	2023年02月13日
8	平安基金管理有限公司关于新增方正证券股份有限公司为平安安盈灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年02月23日
9	平安基金管理有限公司关于新增兴业证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年03月16日
10	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023年03月31日
11	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023年04月22日
12	平安基金管理有限公司关于旗下部	中国证监会规定报刊及	2023年05月29日



	分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告	网站	
13	平安安盈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	2023 年 05 月 31 日
14	平安安盈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	2023 年 05 月 31 日
15	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 06 月 05 日
16	平安基金管理有限公司关于新增中证金牛（北京）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 06 月 27 日
17	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	2023 年 07 月 07 日
18	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 07 月 21 日
19	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 21 日
20	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 08 月 31 日
21	平安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 01 日
22	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 01 日
23	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 01 日
24	平安基金管理有限公司关于新增国金证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 09 月 04 日
25	平安安盈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	2023 年 09 月 05 日
26	平安安盈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	2023 年 09 月 05 日
27	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 10 月 25 日
28	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 01 日
29	平安基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 12 月 05 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2023 年 01 月 01 日-2023 年 09 月 20 日	31,097,904.24	0.00	31,097,904.24	0.00	-
	2	2023 年 09 月 21 日-2023 年 10 月 08 日	20,000,000.00	0.00	20,000,000.00	0.00	-
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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与相关公募基金证券投资基金（以下简称“基金”）的各基金托管人协商一致，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自 2023 年 9 月 1 日起，调低旗下部分基金的管理费率和/或托管费率并对基金合同有关条款进行修订。详细内容可阅读本公司于 2023 年 9 月 1 日发布的《平安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。公告未尽事宜，敬请投资者参见《基金合同》、《托管协议》及其更新等相关的文件。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安安盈灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

- (2) 平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安安盈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

### 13.2 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

### 13.3 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

2024 年 3 月 30 日