

平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 31 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 2024 年 08 月 30 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 2024 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	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45

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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 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	46,392,953.52 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	46,095,863.24 份	297,090.28 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	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	353,670.72	-311.19
本期利润	-5,869,736.68	-38,633.23
加权平均基金份 额本期利润	-0.1233	-0.1320
本期加权平均净 值利润率	-6.75%	-7.30%
本期基金份额净 值增长率	-6.31%	-6.50%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	31,195,166.32	211,664.36
期末可供分配基 金份额利润	0.6767	0.7125
期末基金资产净 值	82,158,616.19	523,424.77
期末基金份额净 值	1.7823	1.7618

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	69.74%	-38.00%

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
过去一个月	-2.95%	0.74%	-1.17%	0.24%	-1.78%	0.50%
过去三个月	-4.38%	0.86%	-0.08%	0.36%	-4.30%	0.50%
过去六个月	-6.31%	1.00%	2.71%	0.44%	-9.02%	0.56%
过去一年	-24.49%	0.87%	-1.77%	0.43%	-	0.44%
					22.72%	
过去三年	-32.96%	1.28%	-10.93%	0.52%	-	0.76%
					22.03%	
自基金合同生效起至今	69.74%	1.38%	8.82%	0.57%	60.92%	0.81%

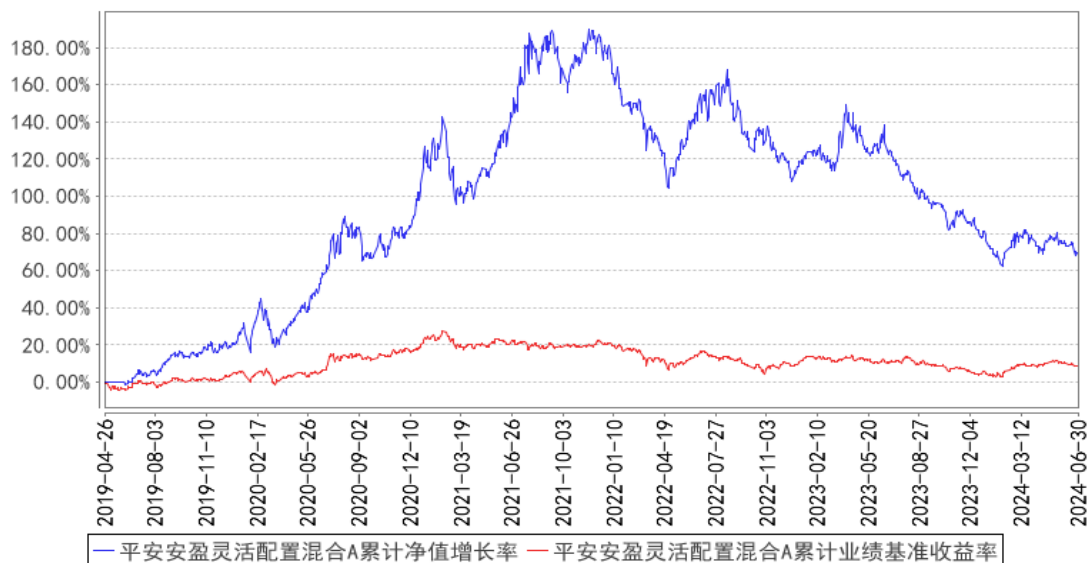
平安安盈灵活配置混合 C

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
过去一个月	-2.98%	0.74%	-1.17%	0.24%	-1.81%	0.50%
过去三个月	-4.48%	0.86%	-0.08%	0.36%	-4.40%	0.50%
过去六个月	-6.50%	1.00%	2.71%	0.44%	-9.21%	0.56%
过去一年	-24.85%	0.87%	-1.77%	0.43%	-	0.44%

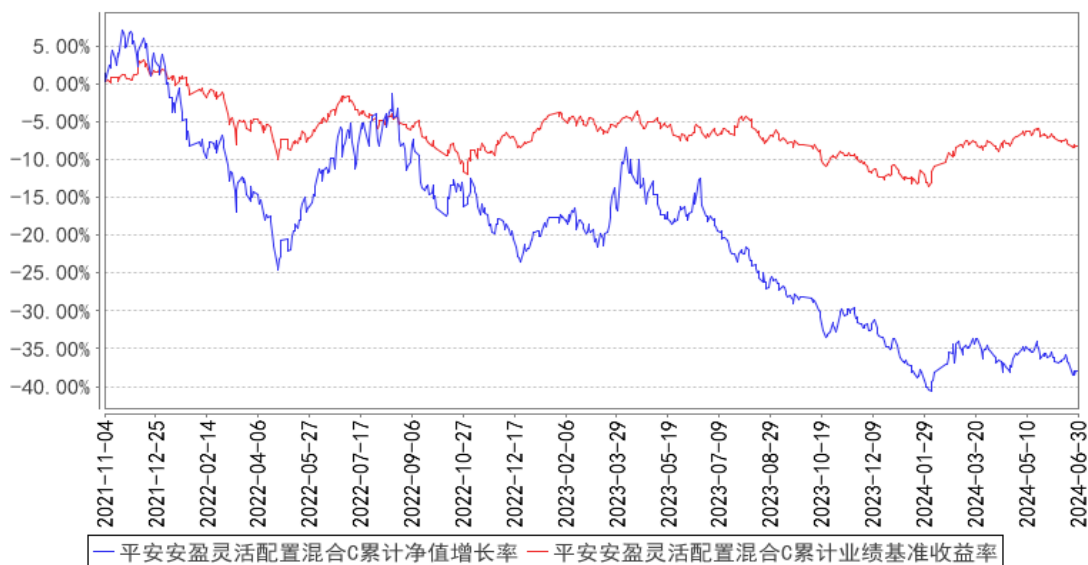
					23.08%	
自基金合同生效起至今	-38.00%	1.19%	-8.31%	0.51%	-	0.68%
					29.69%	

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；

3.3 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、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）。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 2024 年 6 月 30 日，平安基金共管理 206 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6655 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	-	13 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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年上证指数下跌 0.25%，创业板指下跌 10.99%，沪深 300 上涨 0.89%。年初在组合结构上适当做了调整，增加了估值相对较低同时有较高股息率的标的，因此市场调整过程中一定程度上控制了组合回撤，不过这样在市场快速反弹时涨幅也不够明显，二季度适当加仓了一些成长股，目前组合在行业配置上相对均衡，适当偏向成长方向，主要认为一些方向有自身的产业逻辑，成长潜力较大，比如人工智能，今年有一些公司在业绩上已经能明显体现。二季度适当增配了苹果产业链公司的配置，主要在于认为人工智能能够与手机相结合，带来新的换机需求，以及硬件结构的改变也能够带来相应公司产品价值量的提升。另外美国临近降息，也配置了一些供给受限的资源品对应的相关优质公司。

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 1.7823 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.31%，同期业绩比较基准收益率为 2.71%；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 1.7618 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.50%，同期业绩比较基准收益率为 2.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过较长时间调整后目前 a 股较多优质公司的估值水平处于较低位置，长期来看具备较好的配置价值。目前宏观方面已经有一些积极因素，如预计美联储年内就将开始降息，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，如果相关标的业绩或者预期有一定改善，估值有望修复。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，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，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，这一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。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，产业链各个环节更是在快速发展，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。还有新能源这个领域，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股价在大幅调整之后，有望出现较好的配置时机。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、自身有较强竞争力并且业绩稳健增长的优质公司进行配置。

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。

4.7 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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安安盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
货币资金	6.4.7.1	28,588,400.91	30,607,242.16
结算备付金		-	0.01
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	54,334,151.02	65,046,826.07
其中：股票投资		54,334,151.02	65,046,826.07
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,894.06	1,925.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		82,930,445.99	95,655,993.48
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		31,728.98	150,454.69
应付管理人报酬		83,352.46	107,078.74
应付托管费		13,892.10	17,846.43
应付销售服务费		172.95	250.54
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.90	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	119,256.64	177,309.70
负债合计		248,405.03	452,940.10

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	46,392,953.52	50,050,004.28
未分配利润	6.4.7.12	36,289,087.44	45,153,049.10
净资产合计		82,682,040.96	95,203,053.38
负债和净资产总计		82,930,445.99	95,655,993.48

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 46,392,953.52 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.7823 元，基金份额 46,095,863.24 份；C 类基金份额净值 1.7618 元，基金份额 297,090.28 份。

6.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-5,196,133.47	15,376,182.70
1. 利息收入		36,475.77	140,893.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	35,000.32	133,710.49
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		1,475.45	7,182.56
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,028,801.39	12,222,581.43
其中：股票投资收益	6.4.7.14	575,556.91	11,573,561.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-139,284.98	40,765.25
资产支持证券投资	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	592,529.46	608,255.15
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-6,261,729.44	2,985,120.22
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	318. 81	27, 588. 00
减：二、营业总支出		712, 236. 44	2, 385, 280. 97
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	522, 035. 31	1, 948, 298. 19
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	87, 005. 85	324, 716. 36
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	1, 051. 05	6, 185. 77
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		2. 59	0. 20
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	102, 141. 64	106, 080. 45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5, 908, 369. 91	12, 990, 901. 73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5, 908, 369. 91	12, 990, 901. 73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5, 908, 369. 91	12, 990, 901. 73

6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	50, 050, 004. 28	-	45, 153, 049. 10	95, 203, 053. 38
二、本期期初净资产	50, 050, 004. 28	-	45, 153, 049. 10	95, 203, 053. 38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3, 657, 050. 76	-	-8, 863, 961. 66	-12, 521, 012. 42
（一）、综合收益总额	-	-	-5, 908, 369. 91	-5, 908, 369. 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）	-3, 657, 050. 76	-	-2, 955, 591. 75	-6, 612, 642. 51

其中：1. 基金申购款	432,568.42	-	361,403.19	793,971.61
2. 基金赎回款	-4,089,619.18	-	-3,316,994.94	-7,406,614.12
(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	46,392,953.52	-	36,289,087.44	82,682,040.96
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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）	6,244,737.95	-	21,950,724.73	28,195,462.68
(一)、综合收益总额	-	-	12,990,901.73	12,990,901.73
(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）	6,244,737.95	-	8,959,823.00	15,204,560.95
其中：1. 基金申购款	13,221,444.62	-	18,544,189.52	31,765,634.14
2. 基金赎回款	-6,976,706.67	-	-9,584,366.52	-16,561,073.19
(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	114,031,507.64	-	155,058,153.18	269,089,660.82

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%。

6.4.2 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 3 号《半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。

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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 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

(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。

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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,255,480.99
等于：本金	2,255,270.61
加：应计利息	210.38
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	26,332,919.92
等于：本金	26,331,432.97
加：应计利息	1,486.95
减：坏账准备	-
合计	28,588,400.91

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 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	60,292,815.63	-	54,334,151.02	-5,958,664.61
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	60,292,815.63	-	54,334,151.02	-5,958,664.61

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：本基金本报告期末无衍生金融资产/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：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	92,841.64
其他	26,415.00
合计	119,256.64

6.4.7.10 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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,737,687.45	49,737,687.45
本期申购	409,202.16	409,202.16
本期赎回（以“-”号填列）	-4,051,026.37	-4,051,026.37

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	46,095,863.24	46,095,863.24

平安安盈灵活配置混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	312,316.83	312,316.83
本期申购	23,366.26	23,366.26
本期赎回(以“-”号填列)	-38,592.81	-38,592.81
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	297,090.28	297,090.28

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

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	33,196,227.03	11,680,677.25	44,876,904.28
本期期初	33,196,227.03	11,680,677.25	44,876,904.28
本期利润	353,670.72	-6,223,407.40	-5,869,736.68
本期基金份额交易产生的变动数	-2,354,731.43	-589,683.22	-2,944,414.65
其中：基金申购款	272,384.02	70,388.11	342,772.13
基金赎回款	-2,627,115.45	-660,071.33	-3,287,186.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,195,166.32	4,867,586.63	36,062,752.95

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	220,778.49	55,366.33	276,144.82
本期期初	220,778.49	55,366.33	276,144.82
本期利润	-311.19	-38,322.04	-38,633.23
本期基金份额交易产生的变动数	-8,802.94	-2,374.16	-11,177.10
其中：基金申购款	16,482.75	2,148.31	18,631.06
基金赎回款	-25,285.69	-4,522.47	-29,808.16
本期已分配利润	-	-	-

本期末	211,664.36	14,670.13	226,334.49
-----	------------	-----------	------------

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	4,288.83	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	30,711.50	
结算备付金利息收入	-0.01	
其他	-	
合计	35,000.32	

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

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	575,556.91	
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	575,556.91	

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	648,368,252.87	
减：卖出股票成本总额	646,442,717.09	
减：交易费用	1,349,978.87	
买卖股票差价收入	575,556.91	

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
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	730.64
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-140,015.62
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	-139,284.98

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	1,433,773.23
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	1,568,625.90
减：应计利息总额	5,033.09
减：交易费用	129.86
买卖债券差价收入	-140,015.62

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	592,529.46
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	592,529.46

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,261,729.44
股票投资	-6,261,729.44
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	-6,261,729.44

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	291.71
基金转换费收入	27.10
合计	318.81

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	23,869.30
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	102,141.64

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、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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	522,035.31	1,948,298.19
其中：应支付销售机构的客户维护费	216,041.50	425,695.25
应支付基金管理人的净管理费	305,993.81	1,522,602.94

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	87,005.85	324,716.36

注：支付基金托管行平安银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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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
平安人寿	-	526.00	526.00
平安证券	-	3.79	3.79
合计	-	529.79	529.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	-	1,209.45	1,209.45
平安证券	-	725.79	725.79
合计	-	2,005.82	2,005.82

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。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	2,255,480.99	4,288.83	4,151,352.99	8,121.83

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（2024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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

证券，不得超过该证券余额的 10%。（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时间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 个工作日内可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日内可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿

透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	28,588,400.91	-	-	-	28,588,400.91
交易性金融资产	-	-	-	54,334,151.02	54,334,151.02
应收申购款	-	-	-	7,894.06	7,894.06
资产总计	28,588,400.91	-	-	54,342,045.08	82,930,445.99
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,728.98	31,728.98
应付管理人报酬	-	-	-	83,352.46	83,352.46
应付托管费	-	-	-	13,892.10	13,892.10
应付销售服务费	-	-	-	172.95	172.95
应交税费	-	-	-	1.90	1.90
其他负债	-	-	-	119,256.64	119,256.64
负债总计	-	-	-	248,405.03	248,405.03
利率敏感度缺口	28,588,400.91	-	-	54,093,640.05	82,682,040.96

上年度末 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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	54,334,151.02	65.71	65,046,826.07	68.32
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	54,334,151.02	65.71	65,046,826.07	68.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深300指数”以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
分析	沪深300指数上升5%	3,441,413.68	3,107,203.69
	沪深300指数下降5%	-3,441,413.68	-3,107,203.69

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	54,334,151.02	65,043,248.57
第二层次	-	-
第三层次	-	3,577.50
合计	54,334,151.02	65,046,826.07

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	54,334,151.02	65.52
	其中：股票	54,334,151.02	65.52
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	28,588,400.91	34.47
8	其他各项资产	7,894.06	0.01
9	合计	82,930,445.99	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	7,811,139.00	9.45
C	制造业	37,743,962.62	45.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,062,973.00	1.29
E	建筑业	247,230.00	0.30
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	1,074,366.40	1.30
J	金融业	2,208,213.00	2.67
K	房地产业	412,557.00	0.50
L	租赁和商务服务业	247,338.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	789,660.00	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	156,240.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	682,152.00	0.83
R	文化、体育和娱乐业	1,898,320.00	2.30
S	综合	-	-
	合计	54,334,151.02	65.71

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	002475	立讯精密	42,100	1,654,951.00	2.00
2	300308	中际旭创	11,920	1,643,529.60	1.99
3	600938	中国海油	49,500	1,633,500.00	1.98
4	600584	长电科技	51,400	1,629,894.00	1.97
5	600519	贵州茅台	1,100	1,614,129.00	1.95
6	000975	山金国际	94,900	1,545,921.00	1.87
7	601088	中国神华	30,100	1,335,537.00	1.62
8	603283	赛腾股份	16,800	1,283,520.00	1.55
9	603993	洛阳钼业	151,000	1,283,500.00	1.55
10	300750	宁德时代	7,000	1,260,210.00	1.52
11	002384	东山精密	59,600	1,233,720.00	1.49
12	002155	湖南黄金	64,900	1,174,690.00	1.42
13	603228	景旺电子	36,000	1,144,800.00	1.38
14	600030	中信证券	61,100	1,113,853.00	1.35
15	300856	科思股份	30,900	989,109.00	1.20
16	300433	蓝思科技	53,700	980,025.00	1.19
17	300476	胜宏科技	29,500	951,670.00	1.15
18	688676	金盘科技	18,098	943,810.70	1.14
19	601567	三星医疗	23,900	836,500.00	1.01
20	600373	中文传媒	52,600	780,584.00	0.94
21	300457	赢合科技	43,500	775,605.00	0.94
22	300552	万集科技	20,500	766,290.00	0.93
23	600977	中国电影	69,100	743,516.00	0.90
24	688608	恒玄科技	4,782	699,989.16	0.85
25	301391	卡莱特	15,960	698,728.80	0.85
26	600114	东睦股份	47,700	686,403.00	0.83
27	601058	赛轮轮胎	49,000	686,000.00	0.83
28	300015	爱尔眼科	66,100	682,152.00	0.83
29	603977	国泰集团	66,300	674,271.00	0.82
30	002438	江苏神通	58,100	628,061.00	0.76
31	300298	三诺生物	23,800	603,092.00	0.73
32	600522	中天科技	37,100	588,035.00	0.71
33	601600	中国铝业	74,500	568,435.00	0.69
34	002281	光迅科技	15,100	564,287.00	0.68
35	688326	经纬恒润	9,310	533,742.30	0.65
36	601963	重庆银行	66,800	517,700.00	0.63
37	300604	长川科技	19,000	516,230.00	0.62
38	000690	宝新能源	98,400	501,840.00	0.61
39	002459	晶澳科技	44,500	498,400.00	0.60
40	603556	海兴电力	10,600	496,398.00	0.60
41	002984	森麒麟	19,920	479,872.80	0.58
42	300049	福瑞股份	9,400	473,196.00	0.57

43	300347	泰格医药	9,600	466,560.00	0.56
44	002317	众生药业	39,900	456,057.00	0.55
45	000063	中兴通讯	16,200	453,114.00	0.55
46	600256	广汇能源	66,500	445,550.00	0.54
47	688166	博瑞医药	11,788	412,580.00	0.50
48	603279	景津装备	18,200	394,758.00	0.48
49	688197	首药控股	9,010	393,376.60	0.48
50	600150	中国船舶	9,600	390,816.00	0.47
51	601801	皖新传媒	54,000	374,220.00	0.45
52	605196	华通线缆	35,500	373,460.00	0.45
53	300529	健帆生物	13,700	372,777.00	0.45
54	600435	北方导航	41,700	359,454.00	0.43
55	002517	恺英网络	35,600	339,980.00	0.41
56	688196	卓越新能	14,034	325,729.14	0.39
57	002840	华统股份	19,600	325,164.00	0.39
58	601398	工商银行	56,500	322,050.00	0.39
59	688569	铁科轨道	15,311	316,478.37	0.38
60	603383	顶点软件	9,480	304,023.60	0.37
61	002130	沃尔核材	20,500	289,460.00	0.35
62	600021	上海电力	28,700	283,843.00	0.34
63	600023	浙能电力	39,000	277,290.00	0.34
64	600875	东方电气	14,400	265,680.00	0.32
65	600685	中船防务	9,300	259,470.00	0.31
66	688772	珠海冠宇	17,250	257,025.00	0.31
67	002371	北方华创	800	255,912.00	0.31
68	601127	赛力斯	2,800	255,136.00	0.31
69	601628	中国人寿	8,200	254,610.00	0.31
70	002444	巨星科技	10,300	254,410.00	0.31
71	603300	华铁应急	45,300	247,338.00	0.30
72	600970	中材国际	20,500	247,230.00	0.30
73	002429	兆驰股份	51,200	246,272.00	0.30
74	688019	安集科技	1,915	240,907.00	0.29
75	600418	江淮汽车	15,200	240,768.00	0.29
76	000603	盛达资源	20,300	240,149.00	0.29
77	301101	明月镜片	9,500	212,230.00	0.26
78	601865	福莱特	10,300	207,030.00	0.25
79	600048	保利发展	23,600	206,736.00	0.25
80	000002	万科 A	29,700	205,821.00	0.25
81	300769	德方纳米	6,800	191,760.00	0.23
82	300395	菲利华	6,200	190,650.00	0.23
83	300759	康龙化成	10,200	189,516.00	0.23
84	002111	威海广泰	18,100	188,602.00	0.23
85	688535	华海诚科	2,655	181,920.60	0.22

86	603986	兆易创新	1,900	181,678.00	0.22
87	688155	先惠技术	4,480	177,139.20	0.21
88	300705	九典制药	6,580	175,949.20	0.21
89	002028	思源电气	2,500	167,250.00	0.20
90	002266	浙富控股	56,000	156,240.00	0.19
91	601699	潞安环能	8,400	152,292.00	0.18
92	600363	联创光电	5,500	151,360.00	0.18
93	600486	扬农化工	2,600	146,770.00	0.18
94	688037	芯源微	1,628	144,892.00	0.18
95	688192	迪哲医药	3,844	141,612.96	0.17
96	000893	亚钾国际	8,600	138,976.00	0.17
97	688052	纳芯微	1,310	134,641.80	0.16
98	301096	百诚医药	2,300	133,584.00	0.16
99	688443	智翔金泰	4,253	126,484.22	0.15
100	600216	浙江医药	11,400	125,172.00	0.15
101	300580	贝斯特	8,443	124,112.10	0.15
102	301117	佳缘科技	4,600	118,680.00	0.14
103	000657	中钨高新	12,000	109,680.00	0.13
104	301261	恒工精密	2,600	96,382.00	0.12
105	688159	有方科技	2,467	93,400.62	0.11
106	600986	浙文互联	21,700	91,140.00	0.11
107	300454	深信服	1,700	85,901.00	0.10
108	688322	奥比中光	3,075	82,133.25	0.10
109	000049	德赛电池	3,500	82,075.00	0.10
110	002601	龙佰集团	3,500	64,995.00	0.08

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	300308	中际旭创	16,370,542.52	17.20
2	300394	天孚通信	14,409,277.16	15.14
3	300502	新易盛	11,822,202.41	12.42
4	600938	中国海油	9,435,567.00	9.91
5	300750	宁德时代	9,240,661.81	9.71
6	301391	卡莱特	8,867,611.26	9.31
7	300476	胜宏科技	8,672,208.21	9.11
8	600114	东睦股份	7,756,938.00	8.15
9	000063	中兴通讯	7,252,156.79	7.62
10	300494	盛天网络	7,054,615.00	7.41
11	300857	协创数据	6,678,260.00	7.01
12	002273	水晶光电	6,324,865.04	6.64
13	601088	中国神华	6,261,829.00	6.58

14	002475	立讯精密	5,945,121.00	6.24
15	000977	浪潮信息	5,714,069.00	6.00
16	688498	源杰科技	5,462,575.64	5.74
17	300274	阳光电源	5,270,357.00	5.54
18	601138	工业富联	5,063,382.00	5.32
19	300364	中文在线	4,996,067.00	5.25
20	301205	联特科技	4,547,212.00	4.78
21	002463	沪电股份	4,538,990.96	4.77
22	600519	贵州茅台	4,383,511.25	4.60
23	300418	昆仑万维	4,354,149.05	4.57
24	601398	工商银行	4,284,631.00	4.50
25	300757	罗博特科	4,137,375.00	4.35
26	601857	中国石油	4,069,763.00	4.27
27	000858	五粮液	3,966,039.00	4.17
28	600941	中国移动	3,790,773.00	3.98
29	601225	陕西煤业	3,764,867.00	3.95
30	688037	芯源微	3,752,566.16	3.94
31	688166	博瑞医药	3,736,617.15	3.92
32	600961	株冶集团	3,734,385.00	3.92
33	601288	农业银行	3,630,832.00	3.81
34	300475	香农芯创	3,575,255.00	3.76
35	600048	保利发展	3,562,909.00	3.74
36	601058	赛轮轮胎	3,531,778.00	3.71
37	300033	同花顺	3,487,919.70	3.66
38	603993	洛阳钼业	3,455,008.00	3.63
39	300570	太辰光	3,420,728.00	3.59
40	688025	杰普特	3,404,186.29	3.58
41	688609	九联科技	3,262,649.64	3.43
42	000002	万科A	3,228,297.00	3.39
43	688525	佰维存储	3,207,255.34	3.37
44	688072	拓荆科技	3,149,931.63	3.31
45	001309	德明利	3,143,902.00	3.30
46	601728	中国电信	3,115,202.00	3.27
47	603019	中科曙光	3,105,853.57	3.26
48	603108	润达医疗	3,061,970.00	3.22
49	601595	上海电影	3,039,908.00	3.19
50	001979	招商蛇口	3,027,299.00	3.18
51	601009	南京银行	3,000,315.00	3.15
52	601918	新集能源	2,925,956.60	3.07
53	601168	西部矿业	2,908,944.00	3.06
54	002517	恺英网络	2,887,507.00	3.03
55	600028	中国石化	2,883,049.00	3.03
56	300842	帝科股份	2,682,432.00	2.82

57	002180	纳思达	2,672,334.00	2.81
58	000975	山金国际	2,657,611.00	2.79
59	300552	万集科技	2,651,333.00	2.78
60	603259	药明康德	2,636,691.00	2.77
61	603596	伯特利	2,625,510.00	2.76
62	600036	招商银行	2,620,824.00	2.75
63	300232	洲明科技	2,597,788.83	2.73
64	002966	苏州银行	2,574,095.00	2.70
65	688260	昀冢科技	2,552,497.28	2.68
66	300133	华策影视	2,545,217.74	2.67
67	002599	盛通股份	2,538,498.00	2.67
68	601699	潞安环能	2,537,893.00	2.67
69	300049	福瑞股份	2,489,158.00	2.61
70	000425	徐工机械	2,448,562.00	2.57
71	300900	广联航空	2,291,275.66	2.41
72	603283	赛腾股份	2,264,621.00	2.38
73	600188	兖矿能源	2,255,253.00	2.37
74	300762	上海瀚讯	2,251,784.92	2.37
75	301261	恒工精密	2,251,316.50	2.36
76	603588	高能环境	2,236,189.09	2.35
77	603278	大业股份	2,198,468.00	2.31
78	000625	长安汽车	2,182,474.00	2.29
79	600986	浙文互联	2,174,470.00	2.28
80	603986	兆易创新	2,157,099.00	2.27
81	300624	万兴科技	2,144,497.00	2.25
82	300182	捷成股份	2,113,902.00	2.22
83	300604	长川科技	2,026,185.00	2.13
84	688522	纳睿雷达	2,023,560.72	2.13
85	300785	值得买	2,005,844.00	2.11
86	301029	怡合达	1,985,757.00	2.09
87	603890	春秋电子	1,928,293.00	2.03
88	002555	三七互娱	1,918,571.00	2.02
89	002558	巨人网络	1,917,778.00	2.01
90	300122	智飞生物	1,911,699.00	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	16,833,510.00	17.68
2	300394	天孚通信	16,772,993.90	17.62
3	300502	新易盛	11,472,992.00	12.05
4	300750	宁德时代	10,187,308.99	10.70

5	600114	东睦股份	8,402,541.50	8.83
6	600941	中国移动	8,100,307.00	8.51
7	600938	中国海油	8,066,361.00	8.47
8	300476	胜宏科技	7,929,941.00	8.33
9	601088	中国神华	7,901,568.00	8.30
10	301391	卡莱特	7,516,238.94	7.89
11	300494	盛天网络	7,393,137.80	7.77
12	002475	立讯精密	7,285,504.00	7.65
13	300857	协创数据	6,981,478.00	7.33
14	000063	中兴通讯	6,699,886.00	7.04
15	002273	水晶光电	6,517,999.00	6.85
16	000977	浪潮信息	6,091,983.00	6.40
17	688498	源杰科技	5,777,355.33	6.07
18	601728	中国电信	5,509,636.00	5.79
19	300274	阳光电源	5,363,581.00	5.63
20	300757	罗博特科	5,349,398.00	5.62
21	601138	工业富联	5,246,898.00	5.51
22	002463	沪电股份	5,071,546.00	5.33
23	601225	陕西煤业	4,872,567.00	5.12
24	300364	中文在线	4,688,536.00	4.92
25	301205	联特科技	4,638,314.00	4.87
26	300418	昆仑万维	4,537,569.00	4.77
27	002517	恺英网络	4,454,528.00	4.68
28	600519	贵州茅台	4,437,629.00	4.66
29	688025	杰普特	4,200,609.53	4.41
30	601398	工商银行	4,182,080.00	4.39
31	601857	中国石油	4,179,718.00	4.39
32	601595	上海电影	4,098,924.00	4.31
33	300232	洲明科技	4,068,192.00	4.27
34	603596	伯特利	4,036,538.00	4.24
35	688037	芯源微	3,938,220.61	4.14
36	601288	农业银行	3,770,704.00	3.96
37	000858	五粮液	3,764,462.00	3.95
38	600961	株冶集团	3,732,408.00	3.92
39	300033	同花顺	3,590,507.35	3.77
40	300475	香农芯创	3,569,501.00	3.75
41	600048	保利发展	3,494,276.00	3.67
42	688166	博瑞医药	3,399,878.75	3.57
43	688072	拓荆科技	3,371,657.82	3.54
44	688609	九联科技	3,368,672.21	3.54
45	300570	太辰光	3,360,378.00	3.53
46	688525	佰维存储	3,359,951.83	3.53
47	603019	中科曙光	3,239,978.00	3.40

48	603108	润达医疗	3,219,539.00	3.38
49	001309	德明利	3,163,948.00	3.32
50	601918	新集能源	3,058,563.00	3.21
51	001979	招商蛇口	3,053,852.00	3.21
52	300031	宝通科技	3,042,347.00	3.20
53	601168	西部矿业	3,034,548.00	3.19
54	601009	南京银行	3,019,668.00	3.17
55	688260	昀冢科技	3,008,057.26	3.16
56	600028	中国石化	2,983,803.00	3.13
57	000002	万科A	2,963,496.00	3.11
58	002180	纳思达	2,856,810.70	3.00
59	601058	赛轮轮胎	2,822,854.00	2.97
60	301261	恒工精密	2,763,634.60	2.90
61	300133	华策影视	2,716,495.00	2.85
62	300842	帝科股份	2,672,848.54	2.81
63	605117	德业股份	2,661,573.16	2.80
64	603259	药明康德	2,641,933.00	2.78
65	002599	盛通股份	2,617,212.00	2.75
66	603278	大业股份	2,603,292.00	2.73
67	002966	苏州银行	2,581,291.00	2.71
68	600036	招商银行	2,559,652.00	2.69
69	603993	洛阳钼业	2,531,986.00	2.66
70	603297	永新光学	2,509,478.00	2.64
71	000425	徐工机械	2,466,543.00	2.59
72	300122	智飞生物	2,406,682.00	2.53
73	300762	上海瀚讯	2,353,377.20	2.47
74	603588	高能环境	2,348,302.00	2.47
75	601699	潞安环能	2,346,136.00	2.46
76	300900	广联航空	2,341,432.58	2.46
77	000625	长安汽车	2,269,331.00	2.38
78	603890	春秋电子	2,250,934.00	2.36
79	600188	兖矿能源	2,197,968.50	2.31
80	300115	长盈精密	2,170,169.00	2.28
81	688522	纳睿雷达	2,139,401.67	2.25
82	300182	捷成股份	2,097,548.00	2.20
83	688095	福昕软件	2,088,658.74	2.19
84	301029	怡合达	2,082,502.00	2.19
85	300705	九典制药	2,041,117.00	2.14
86	002558	巨人网络	2,040,439.90	2.14
87	300765	新诺威	2,023,496.00	2.13
88	300049	福瑞股份	2,003,741.00	2.10
89	603986	兆易创新	1,999,453.00	2.10
90	601689	拓普集团	1,952,164.77	2.05

91	688192	迪哲医药	1,937,724.22	2.04
92	600986	浙文互联	1,932,033.00	2.03
93	300785	值得买	1,923,193.00	2.02
94	002555	三七互娱	1,913,237.00	2.01

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	641,991,771.48
卖出股票收入（成交）总额	648,368,252.87

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投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一

年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

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	7,894.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,894.06

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

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	26,553	1,735.99	-	-	46,095,863.24	100.00
平安安盈灵活配置混合 C	242	1,227.65	-	-	297,090.28	100.00
合计	26,769	1,733.09	-	-	46,392,953.52	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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安安盈灵活配置混合 A	156,299.92	0.3391
	平安安盈灵活配置混合 C	7.04	0.0024
	合计	156,306.96	0.3369

注：上述从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安安盈灵活配置混合 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 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	49,737,687.45	312,316.83
本报告期基金总申购份额	409,202.16	23,366.26
减：本报告期基金总赎回份额	4,051,026.37	38,592.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	46,095,863.24	297,090.28

§ 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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用安永华明会计师事务所（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，本基金管理人及其相关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 (%)	
国信证券	4	838,412,715.94	64.98	609,752.33	64.64	-
银河证券	4	451,947,308.41	35.02	333,593.81	35.36	-

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。

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 (%)
国信证券	-	-	27,199,000.00	100.00	-	-
银河证券	3,006,679.90	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	2024 年 01 月 15 日
2	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 22 日
3	平安基金管理有限公司关于旗下基金参与中国平安人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 15 日
4	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 30 日
5	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 22 日
6	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	2024 年 05 月 31 日
7	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	2024 年 05 月 31 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

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

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

平安基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日