

# 平安优质企业混合型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	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	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	11
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	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
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 .....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
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 .....	63
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 .....	63
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>69</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 .....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
13.1 备查文件目录 .....	69
13.2 存放地点 .....	70
13.3 查阅方式 .....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安优质企业混合型证券投资基金	
基金简称	平安优质企业混合	
基金主代码	012475	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 19 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	1,902,308,598.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C
下属分级基金的交 易代码	012475	012476
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,818,338,522.39 份	83,970,076.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选基本面良好，符合产业趋势、竞争力突出的公司，在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、股票期权投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、信用衍生品投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×25%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金若投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李海波	许俊
	联系电话	0755-88622632	010-66596688
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	罗春风	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	fund.pingan.com
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	2024 年		2023 年		2022 年	
	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C
本期已实现收益	42,083,280.32	1,409,211.87	219,749,798.70	9,564,069.18	714,130,928.90	28,626,421.17
本期利润	32,858,821.07	1,286,036.25	199,743,181.23	8,714,820.70	685,465,454.59	27,450,935.08
加权平均基金份额本期利润	0.0167	0.0155	-0.0865	-0.0914	-0.2505	-0.2558
本期加权平均净值利润率	2.82%	2.67%	-12.61%	-13.55%	-30.48%	-31.37%
本期基金份额净值增长率	3.77%	2.94%	-12.55%	-13.25%	-25.94%	-26.52%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	

期末可供分配利润	- 646,966,159.28	- 31,355,325.66	- 802,400,686.28	- 34,618,949.78	- 723,332,064.68	- 29,744,257.41
期末可供分配基金份额利润	-0.3558	-0.3734	-0.3792	-0.3913	-0.2901	-0.2983
期末基金资产净值	1,171,372,363.11	52,614,750.49	1,313,436,249.51	53,849,868.84	1,770,348,230.12	69,975,003.09
期末基金份额净值	0.6442	0.6266	0.6208	0.6087	0.7099	0.7017
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-35.58%	-37.34%	-37.92%	-39.13%	-29.01%	-29.83%

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

平安优质企业混合 A

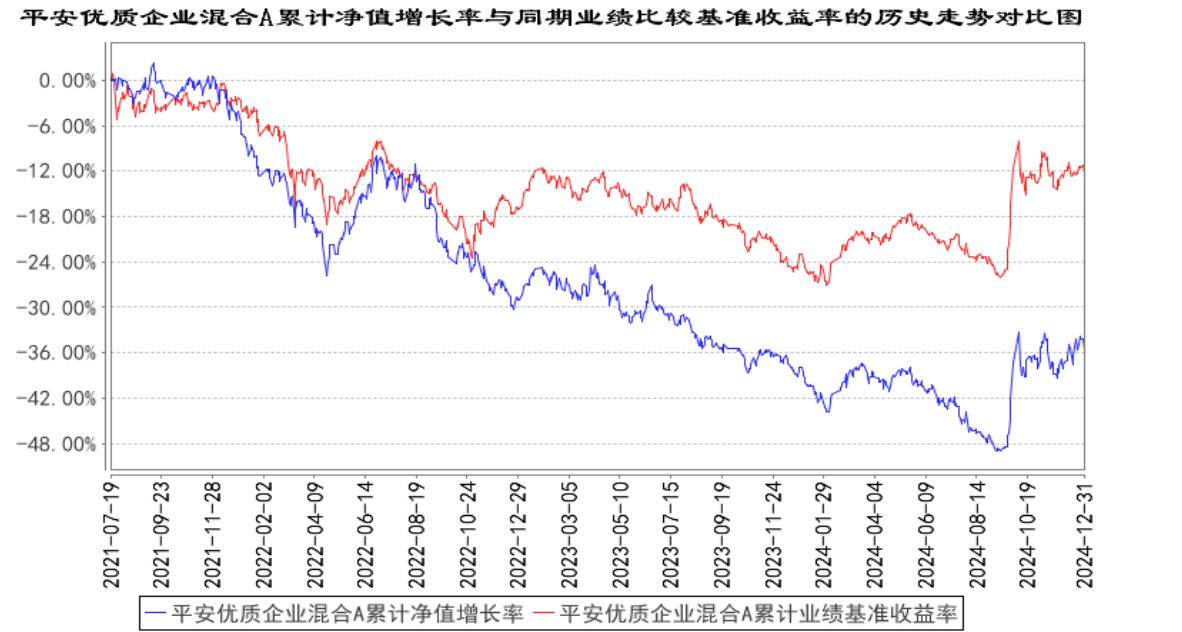
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.91%	1.82%	-0.64%	1.25%	3.55%	0.57%
过去六个月	11.82%	1.71%	11.72%	1.20%	0.10%	0.51%
过去一年	3.77%	1.38%	14.02%	0.97%	-10.25%	0.41%
过去三年	-32.79%	1.13%	-10.07%	0.87%	-22.72%	0.26%

自基金合同生效 起至今	-35.58%	1.08%	-12.22%	0.86%	- 23.36%	0.22%
----------------	---------	-------	---------	-------	-------------	-------

平安优质企业混合 C

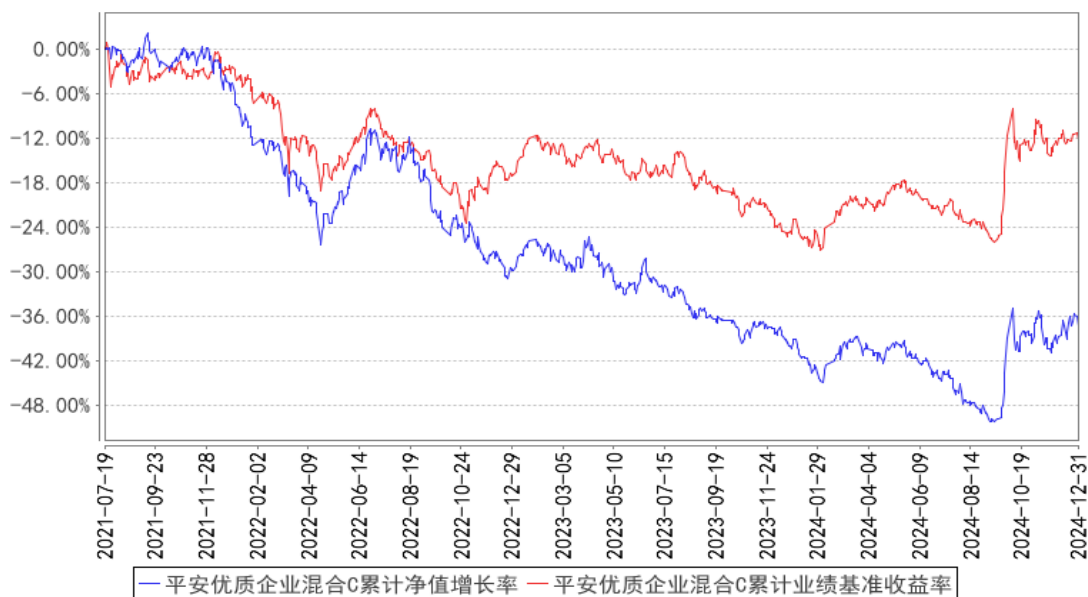
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	2.69%	1.82%	-0.64%	1.25%	3.33%	0.57%
过去六个月	11.36%	1.71%	11.72%	1.20%	-0.36%	0.51%
过去一年	2.94%	1.38%	14.02%	0.97%	- 11.08%	0.41%
过去三年	-34.39%	1.13%	-10.07%	0.87%	- 24.32%	0.26%
自基金合同生效 起至今	-37.34%	1.08%	-12.22%	0.86%	- 25.12%	0.22%

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





平安优质企业混合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

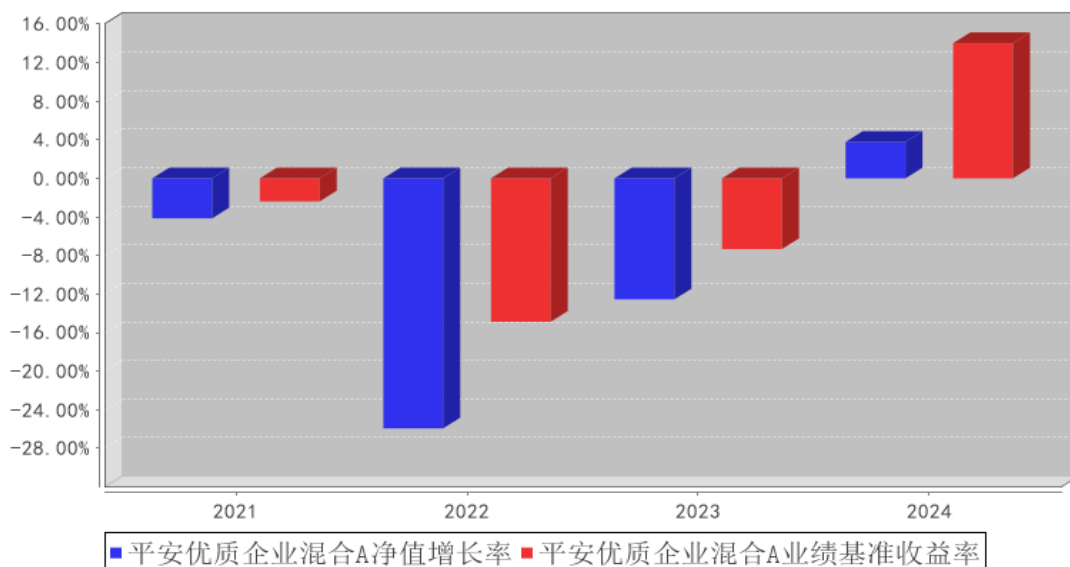


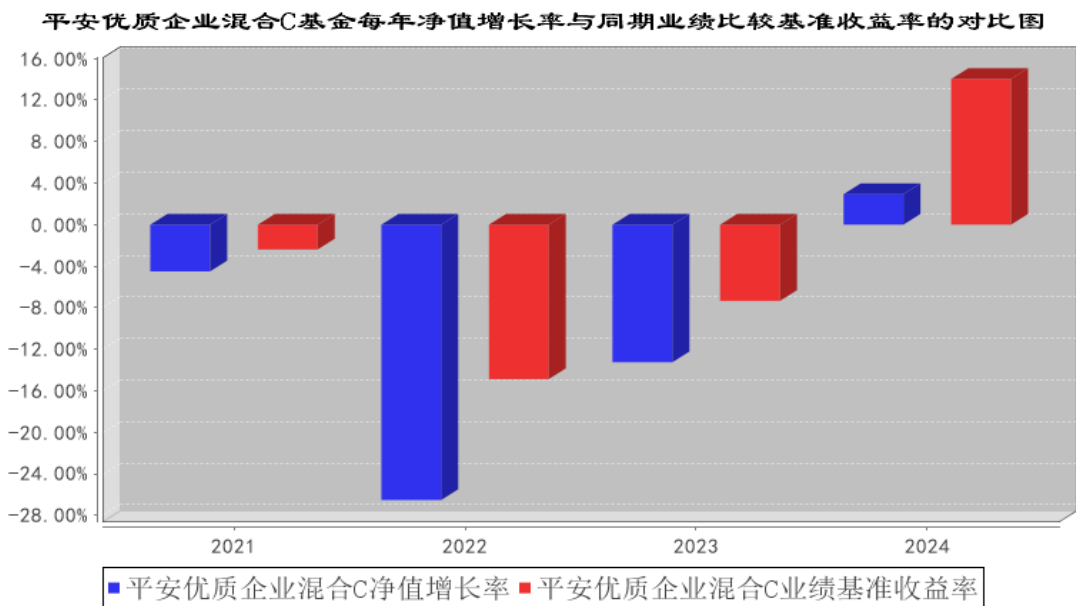
注：1、本基金基金合同于 2021 年 07 月 19 日正式生效；

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。

### 3.2.3 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

平安优质企业混合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





注：本基金基金合同于 2021 年 07 月 19 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、海外、专户七大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2024 年 12 月 31 日，平安基金共管理 215 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6371 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
薛 冀颖	平安优质企业混合型证券投资基金基金经理	2021 年 7 月 19 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

2024 年市场探底回升，各指数均有一定上涨，其中上证指数上涨 12.67%，创业板指上涨 13.23%，沪深 300 上涨 14.68%。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，因此在市场调整过程中一定程度上控制了组合回撤，不过在市场急跌之后加仓和调整结构不够及时，净值的反弹幅度相对有限，二季度组合基本维持一季度末的配置，逐渐加仓了一些之前调整幅度较大的成长股，在行业配置上相对均衡，适当偏向成长方向，三季度在整体仓位上有一定提升，主要在于有较多的利好政策出台，特别是 9 月末的中央政治局会议的表述让市场信心明显恢复，市场风险偏好快速提升，带来了增量资金入市，叠加美国已经开启降息周期，市场经过三年的下跌后较多公司的估值水平具备一定的吸引力，因此预计市场已经见底。四季度基本维持之前的组合结构，适当减仓了一些短期估值提升较快而业绩改善还不明显的个股，因看好人工智能的发展和国产算力需求的提升，适当加仓了一些电子和通信行业的相关公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安优质企业混合 A 的基金份额净值 0.6442 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.77%，同期业绩比较基准收益率为 14.02%；截至本报告期末平安优质企业混合 C 的基金份

额净值 0.6266 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.94%，同期业绩比较基准收益率为 14.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前位置来看 a 股较多优质公司的估值水平仍然相对较低，长期来看具备较好的配置价值。市场从 24 年 9 月中旬开始有明显上涨，主要在于宏观环境有明显变化，9 月下旬的中央政治局会议的表述让市场信心明显恢复，随后推动经济的政策持续出台，相应的宏观数据也有一定改善，市场风险偏好已经明显回升，而且无风险收益率持续下降，对股市也是有利的，因此判断市场较长时间会比较平稳，值得去积极选择结构性的机会。不过也应看到前期较多公司股价上涨主要是估值提升，需紧密跟踪接下来几个季度的业绩情况。在普涨行情过后，对个股需要仔细筛选，积极寻找所在行业符合产业趋势、行业景气度较高以及有较强竞争力的优质公司进行配置。相对而言，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，行业的成长性较为确定，其中人工智能这个方向最值得重视，从国内外的进展来看，人工智能迭代和更新的速度在不断加快，往后有越来越多超预期的应用和创新，这一产业趋势会带来较多行业深刻变革，值得去挖掘相应的标的。目前来看算力相关的标的业绩兑现的确定性较高，应用相关的标的在业绩兑现上还需要时间，不过如果业务有突破，业绩和估值的提升都有较大弹性，值得去仔细筛选。另外跟人工智能相关的机器人和自动驾驶方向也值得去挖掘有竞争力的标的。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安优质企业混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 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（2025）审字第 70039114_H99 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	平安优质企业混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了平安优质企业混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 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，后附的平安优质企业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，公允反映了平安优质企业混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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，我们独立于平安优质企业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>平安优质企业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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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优质企业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、</p>

	<p>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优质企业混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>	
注册会计师对财务报表审计的责任	<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，就可能导致对平安优质企业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优质企业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>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	黄拥璇
会计师事务所的地址	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	
审计报告日期	2025 年 3 月 24 日	



§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安优质企业混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	173,334,179.25	110,475,061.44
结算备付金		34,426,490.81	45,761,720.37
存出保证金		655,562.84	683,133.89
交易性金融资产	7.4.7.2	837,107,976.50	895,381,624.70
其中：股票投资		837,107,976.50	895,381,624.70
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	244,980,620.40	273,382,462.85
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		-	73,196,394.66
应收股利		-	-
应收申购款		5,950.25	16,741.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,290,510,780.05	1,398,897,139.42
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		58,755,396.70	17,568,007.56
应付赎回款		2,938,976.69	6,820,199.71

应付管理人报酬		1,246,729.48	1,418,437.19
应付托管费		207,788.24	236,406.19
应付销售服务费		37,019.86	37,365.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.54
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	3,337,755.48	5,530,604.73
负债合计		66,523,666.45	31,611,021.07
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	1,902,308,598.54	2,204,305,754.41
未分配利润	7.4.7.12	-678,321,484.94	-837,019,636.06
净资产合计		1,223,987,113.60	1,367,286,118.35
负债和净资产总计		1,290,510,780.05	1,398,897,139.42

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,902,308,598.54 份，其中，下属 A 类基金份额净值 0.6442 元，基金份额总额 1,818,338,522.39 份；下属 C 类基金份额净值 0.6266 元，基金份额总额 83,970,076.15 份。

7.2 利润表

会计主体：平安优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		51,772,957.17	-180,431,431.14
1. 利息收入		4,107,307.00	7,768,975.73
其中：存款利息收入	7.4.7.13	957,702.65	1,403,339.41
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		3,149,604.35	6,365,636.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		57,009,591.46	-209,060,500.07
其中：股票投资收益	7.4.7.14	40,267,709.31	-225,896,190.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	217,128.39	207,501.91
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
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	16,524,753.76	16,628,188.43
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	-9,347,634.87	20,855,865.95
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	3,693.58	4,227.25
减：二、营业总支出		17,628,099.85	28,026,570.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	14,569,591.31	23,353,535.68
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,428,265.23	3,892,255.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	385,913.69	516,148.40
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		1.85	1.05
8. 其他费用	7.4.7.23	244,327.77	264,629.71
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		34,144,857.32	-208,458,001.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		34,144,857.32	-208,458,001.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		34,144,857.32	-208,458,001.93

7.3 净资产变动表

会计主体：平安优质企业混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	2,204,305,754.41	-	-837,019,636.06	1,367,286,118.35
二、本期期初净资产	2,204,305,754.41	-	-837,019,636.06	1,367,286,118.35

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 301,997,155.87	-	158,698,151.12	-143,299,004.75
(一)、综合收益总额	-	-	34,144,857.32	34,144,857.32
(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)	- 301,997,155.87	-	124,553,293.80	-177,443,862.07
其中：1. 基金申购款	26,136,589.54	-	-10,456,502.04	15,680,087.50
2. 基金赎回款	- 328,133,745.41	-	135,009,795.84	-193,123,949.57
(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	1,902,308,598. 54	-	- 678,321,484.94	1,223,987,113.6 0
项目	上年度可比期间 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	2,593,399,555. 30	-	- 753,076,322.09	1,840,323,233.2 1
二、本期期初净资产	2,593,399,555. 30	-	- 753,076,322.09	1,840,323,233.2 1
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 389,093,800.89	-	-83,943,313.97	-473,037,114.86
(一)、综合收益总额	-	-	- 208,458,001.93	-208,458,001.93
(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)	- 389,093,800.89	-	124,514,687.96	-264,579,112.93

其中：1. 基金申购款	18,648,795.67	-	-5,662,998.18	12,985,797.49
2. 基金赎回款	- 407,742,596.56	-	130,177,686.14	-277,564,910.42
（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	2,204,305,754.41	-	- 837,019,636.06	1,367,286,118.35

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

平安优质企业混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]957 号《关于准予平安优质企业混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安优质企业混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,339,569,136.50 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2021）第 0737 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安优质企业混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 7 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,340,949,620.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,380,484.05 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《平安优质企业混合型证券投资基金基金招募说明书》，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，但不从本类别资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中

计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安优质企业混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券）、资产支持证券、信用衍生品、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、现金等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权合约的投资比例遵循国家相关法律法规。如果法律法规或中国证监会允许基金变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×25%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%。

#### 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、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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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的有关过去事项、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务工具投资的，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）本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本基金；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。基金收益分配后任一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该类每单位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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要说明的重要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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，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征增值税试点的通知》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[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[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。

### （5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税

[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	173,334,179.25	110,475,061.44
等于：本金	173,317,863.39	110,449,770.37
加：应计利息	16,315.86	25,291.07
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	173,334,179.25	110,475,061.44

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		876,604,294.95	-	837,107,976.50	-39,496,318.45
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		876,604,294.95	-	837,107,976.50	-39,496,318.45

项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		925,530,308.28	-	895,381,624.70	-30,148,683.58
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		925,530,308.28	-	895,381,624.70	-30,148,683.58

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	244,980,620.40	-
银行间市场	-	-
合计	244,980,620.40	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	273,382,462.85	-
银行间市场	-	-
合计	273,382,462.85	-

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均无其他债权投资。

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均无其他债权投资。

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均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均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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	3,152,755.48	5,330,604.73
其中：交易所市场	3,152,755.48	5,330,604.73
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	185,000.00	200,000.00
合计	3,337,755.48	5,530,604.73

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元



平安优质企业混合 A

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,115,836,935.79	2,115,836,935.79
本期申购	6,723,367.52	6,723,367.52
本期赎回（以“-”号填列）	-304,221,780.92	-304,221,780.92
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	1,818,338,522.39	1,818,338,522.39

平安优质企业混合 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,468,818.62	88,468,818.62
本期申购	19,413,222.02	19,413,222.02
本期赎回（以“-”号填列）	-23,911,964.49	-23,911,964.49
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	83,970,076.15	83,970,076.15

注：申购含转换入份额，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均无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

平安优质企业混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-797,869,166.41	-4,531,519.87	-802,400,686.28
本期期初	-797,869,166.41	-4,531,519.87	-802,400,686.28
本期利润	42,083,280.32	-9,224,459.25	32,858,821.07
本期基金份额交易产生的变动数	116,224,412.15	6,351,293.78	122,575,705.93
其中：基金申购款	-2,666,196.17	677.05	-2,665,519.12
基金赎回款	118,890,608.32	6,350,616.73	125,241,225.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-639,561,473.94	-7,404,685.34	-646,966,159.28

平安优质企业混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-34,399,605.16	-219,344.62	-34,618,949.78
本期期初	-34,399,605.16	-219,344.62	-34,618,949.78
本期利润	1,409,211.87	-123,175.62	1,286,036.25
本期基金份额交易产生的变动数	2,014,312.36	-36,724.49	1,977,587.87
其中：基金申购款	-7,493,376.81	-297,606.11	-7,790,982.92
基金赎回款	9,507,689.17	260,881.62	9,768,570.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-30,976,080.93	-379,244.73	-31,355,325.66

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	426,294.34	626,246.34
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	519,823.24	747,949.61
其他	11,585.07	29,143.46
合计	957,702.65	1,403,339.41

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	40,267,709.31	-225,896,190.41
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	40,267,709.31	-225,896,190.41

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	9,715,360,755.21	18,123,140,882.53
减：卖出股票成本总额	9,656,072,191.51	18,300,423,647.65
减：交易费用	19,020,854.39	48,613,425.29
买卖股票差价收入	40,267,709.31	-225,896,190.41

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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	513.57	294.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	216,614.82	207,206.98
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	217,128.39	207,501.91

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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,243,134.78	11,304,591.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,017,433.68	11,091,354.72
减：应计利息总额	8,595.81	5,177.81
减：交易费用	490.47	852.09
买卖债券差价收入	216,614.82	207,206.98

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月

	31 日	月 31 日
股票投资产生的股利收益	16,524,753.76	16,628,188.43
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	16,524,753.76	16,628,188.43

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-9,347,634.87	20,855,865.95
股票投资	-9,347,634.87	20,855,865.95
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	-9,347,634.87	20,855,865.95

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,939.18	4,120.75
基金转换费收入	754.40	106.50
合计	3,693.58	4,227.25

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依据《平安优质企业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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	65,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	53,689.33	58,997.63
其他	5,638.44	5,632.08
合计	244,327.77	264,629.71

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，本基金无需作披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	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
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

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。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 (%)
方正证券	179,836,413.88	0.93	904,725,027.51	2.53
平安证券	-	-	781,368,514.70	2.18

7.4.10.1.2 债券交易

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 (%)
方正证券	269,190,000.00	0.73	4,574,006,000.00	6.79
平安证券	-	-	1,568,069,000.00	2.33

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 2024年1月1日至2024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 (%)
方正证券	144,088.54	1.25	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)

方正证券	749,063.93	2.68	140,374.84	2.63
平安证券	730,334.11	2.62	730,334.11	13.70

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

（2）该类佣金协议的服务范围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。

（3）根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,569,591.31	23,353,535.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,040,666.92	11,226,097.00
应支付基金管理人的净管理费	7,528,924.39	12,127,438.68

注：（1）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。

（2）本基金自 2023 年 9 月 1 日起，基金管理费的年费率由 1.5%调整为 1.2%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,428,265.23	3,892,255.95

注：（1）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。

（2）本基金自 2023 年 9 月 1 日起，基金托管费的年费率由 0.25%调整为 0.2%。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C	合计
陆基金	-	3,846.12	3,846.12
平安基金	-	396.07	396.07
平安人寿	-	43,269.93	43,269.93
平安银行	-	10,507.83	10,507.83
中国银行	-	160,647.82	160,647.82
合计	-	218,667.77	218,667.77
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C	合计
陆基金	-	7,873.50	7,873.50
平安基金	-	460.29	460.29
平安人寿	-	60,537.55	60,537.55
平安银行	-	17,207.83	17,207.83
中国银行	-	207,155.58	207,155.58
合计	-	293,234.75	293,234.75

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给 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：

C 类基金日销售服务费=C 类基金前一日基金资产净值 × 0.80%/ 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

注：无。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
中国银行-活期	173,334,179.25	426,294.34	110,475,061.44	626,246.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业存款利率计息。

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

本报告期内，本基金参与了无锡盛景微电子股份有限公司（证券名称：盛景微，证券代码：603375）首次公开发行股票网下申购，本次发行的主承销商光大证券股份有限公司为基金托管人中国银行的关联方，基金获配数量 714 股，获配总金额 27,260.52 元。

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（2024 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
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股锁定	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-

301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	新股锁定	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股锁定	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股锁定	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股锁定	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁定	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股锁定	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股锁定	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股锁定	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-

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公司发行的

证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年末：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组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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。

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，并按照合同约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 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	173,334,179.25	-	-	-	173,334,179.25
结算备付金	34,426,490.81	-	-	-	34,426,490.81
存出保证金	655,562.84	-	-	-	655,562.84
交易性金融资产	-	-	-	837,107,976.50	837,107,976.50
买入返售金融资产	244,980,620.40	-	-	-	244,980,620.40
应收申购款	-	-	-	5,950.25	5,950.25
资产总计	453,396,853.30	-	-	837,113,926.75	1,290,510,780.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,938,976.69	2,938,976.69
应付管理人报酬	-	-	-	1,246,729.48	1,246,729.48
应付托管费	-	-	-	207,788.24	207,788.24
应付清算款	-	-	-	58,755,396.70	58,755,396.70
应付销售服务费	-	-	-	37,019.86	37,019.86

其他负债	-	-	-	3,337,755.48	3,337,755.48
负债总计	-	-	-	66,523,666.45	66,523,666.45
利率敏感度缺口	453,396,853.30	-	-	-770,590,260.30	1,223,987,113.60
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	110,475,061.44	-	-	-	110,475,061.44
结算备付金	45,761,720.37	-	-	-	45,761,720.37
存出保证金	683,133.89	-	-	-	683,133.89
交易性金融资产	-	-	-	-895,381,624.70	895,381,624.70
买入返售金融资产	273,382,462.85	-	-	-	273,382,462.85
应收申购款	-	-	-	16,741.51	16,741.51
应收清算款	-	-	-	73,196,394.66	73,196,394.66
资产总计	430,302,378.55	-	-	-968,594,760.87	1,398,897,139.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,820,199.71	6,820,199.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,418,437.19	1,418,437.19
应付托管费	-	-	-	236,406.19	236,406.19
应付清算款	-	-	-	17,568,007.56	17,568,007.56
应付销售服务费	-	-	-	37,365.15	37,365.15
应交税费	-	-	-	0.54	0.54
其他负债	-	-	-	5,530,604.73	5,530,604.73
负债总计	-	-	-	31,611,021.07	31,611,021.07
利率敏感度缺口	430,302,378.55	-	-	-936,983,739.80	1,367,286,118.35

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。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

	币			
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	59,644,027.80	-	59,644,027.80
资产合计	-	59,644,027.80	-	59,644,027.80
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	59,644,027.80	-	59,644,027.80
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	56,844,758.10	-	56,844,758.10
资产合计	-	56,844,758.10	-	56,844,758.10
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	56,844,758.10	-	56,844,758.10

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对于人民币贬值 5%	-2,982,201.39	-2,842,237.91
	所有外币相对于人民币升值 5%	2,982,201.39	2,842,237.91



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 2024 年 12 月 31 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	837,107,976.50	68.39	895,381,624.70	65.49
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	837,107,976.50	68.39	895,381,624.70	65.49

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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	54,906,749.96	49,403,523.93
	沪深 300 指数下降 5%	-54,906,749.96	-49,403,523.93

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	836,919,819.39	895,189,086.03
第二层次	-	-
第三层次	188,157.11	192,538.67
合计	837,107,976.50	895,381,624.70

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相关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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	0.00	192,538.67	192,538.67
当期购买	0.00	78,935.70	78,935.70

当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	192,538.67	192,538.67
当期利得或损失总额	0.00	109,221.41	109,221.41
其中：计入损益的利得或损失	0.00	109,221.41	109,221.41
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	188,157.11	188,157.11
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	0.00	109,221.41	109,221.41
项目	上年度可比期间 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	0.00	1,115,249.17	1,115,249.17
当期购买	0.00	130,335.46	130,335.46
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	1,115,249.17	1,115,249.17
当期利得或损失总额	0.00	62,203.21	62,203.21
其中：计入损益的利得或损失	0.00	62,203.21	62,203.21
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	192,538.67	192,538.67
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	0.00	62,203.21	62,203.21

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	188,157.11	亚式期权模型	预期波动率	0.2665-4.2559	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
流通受限股票	192,538.67	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.5141-2.1988	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	837,107,976.50	64.87
	其中：股票	837,107,976.50	64.87
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	244,980,620.40	18.98
	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	207,760,670.06	16.10
8	其他各项资产	661,513.09	0.05
9	合计	1,290,510,780.05	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 59,644,027.80 元，占净值比例 4.87%。

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	-	-
B	采矿业	61,221,842.00	5.00
C	制造业	557,471,276.63	45.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,218,804.00	1.33
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,131,360.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	3,597,292.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,508,969.07	5.11
J	金融业	64,855,157.00	5.30
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,027,023.00	0.33
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	5,432,225.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	777,463,948.70	63.52

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	3,629,743.43	0.30
非周期性消费品	7,951,604.52	0.65
能源	-	-
金融	12,428,679.17	1.02
医疗	11,778,099.03	0.96
工业	1,617,199.21	0.13
地产业	-	-
信息科技	20,377,417.60	1.66
电信服务	1,861,284.84	0.15
公用事业	-	-
合计	59,644,027.80	4.87

注：以上分类采用全球行业分类标准。

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	002851	麦格米特	778,900	47,871,194.00	3.91
2	601288	农业银行	7,990,400	42,668,736.00	3.49
3	000651	格力电器	799,500	36,337,275.00	2.97
4	002384	东山精密	1,227,800	35,851,760.00	2.93
5	600519	贵州茅台	23,400	35,661,600.00	2.91
6	688256	寒武纪	42,352	27,867,616.00	2.28
7	300750	宁德时代	92,532	24,613,512.00	2.01
8	002475	立讯精密	598,500	24,394,860.00	1.99
9	002130	沃尔核材	947,300	23,919,325.00	1.95
10	300274	阳光电源	316,080	23,336,186.40	1.91
11	601825	沪农商行	2,607,100	22,186,421.00	1.81
12	600028	中国石化	3,252,900	21,729,372.00	1.78
13	600941	中国移动	157,300	18,586,568.00	1.52
14	601088	中国神华	422,900	18,387,692.00	1.50
15	603296	华勤技术	252,000	17,879,400.00	1.46
16	601857	中国石油	1,811,300	16,193,022.00	1.32
17	688981	中芯国际	99,978	9,459,918.36	0.77
17	00981	中芯国际	210,000	6,184,095.12	0.51
18	300476	胜宏科技	298,400	12,559,656.00	1.03
19	601985	中国核电	1,202,800	12,545,204.00	1.02
20	01336	新华保险	568,700	12,428,679.17	1.02
21	002463	沪电股份	306,200	12,140,830.00	0.99
22	002371	北方华创	31,000	12,121,000.00	0.99
23	300502	新易盛	104,520	12,080,421.60	0.99
24	688696	极米科技	117,347	11,502,352.94	0.94
25	300394	天孚通信	117,927	10,773,810.72	0.88
26	600150	中国船舶	256,300	9,216,548.00	0.75
27	601058	赛轮轮胎	634,400	9,090,952.00	0.74
28	06855	亚盛医药-B	214,400	9,023,778.26	0.74
29	002317	众生药业	728,300	8,848,845.00	0.72
30	600760	中航沈飞	167,800	8,510,816.00	0.70
31	688361	中科飞测	94,078	8,236,528.90	0.67
32	00285	比亚迪电子	210,000	8,177,396.22	0.67
33	301155	海力风电	153,200	8,167,092.00	0.67
34	002230	科大讯飞	166,900	8,064,608.00	0.66
35	688008	澜起科技	118,036	8,014,644.40	0.65
36	600129	太极集团	314,940	7,785,316.80	0.64

37	600536	中国软件	166,360	7,767,348.40	0.63
38	002782	可立克	613,800	7,764,570.00	0.63
39	002179	中航光电	192,300	7,557,390.00	0.62
40	300776	帝尔激光	106,500	6,771,270.00	0.55
41	300443	金雷股份	339,800	6,768,816.00	0.55
42	000338	潍柴动力	452,100	6,193,770.00	0.51
43	000528	柳 工	506,600	6,109,596.00	0.50
44	002335	科华数据	208,400	6,026,928.00	0.49
45	03896	金山云	1,090,000	6,015,926.26	0.49
46	601138	工业富联	270,300	5,811,450.00	0.47
47	600686	金龙汽车	412,500	5,799,750.00	0.47
48	300558	贝达药业	107,200	5,781,296.00	0.47
49	688608	恒玄科技	17,286	5,624,345.82	0.46
50	603103	横店影视	377,500	5,432,225.00	0.44
51	601028	玉龙股份	428,600	4,911,756.00	0.40
52	09868	小鹏汽车-W	111,500	4,816,773.91	0.39
53	300014	亿纬锂能	100,600	4,702,044.00	0.38
54	600438	通威股份	200,500	4,433,055.00	0.36
55	600031	三一重工	258,400	4,258,432.00	0.35
56	600415	小商品城	300,300	4,027,023.00	0.33
57	002281	光迅科技	76,400	3,985,788.00	0.33
58	002156	通富微电	132,000	3,900,600.00	0.32
59	000063	中兴通讯	95,300	3,850,120.00	0.31
60	000831	中国稀土	133,400	3,741,870.00	0.31
61	688169	石头科技	16,935	3,713,676.15	0.30
62	000690	宝新能源	820,000	3,673,600.00	0.30
63	600566	济川药业	125,400	3,646,632.00	0.30
64	01797	东方甄选	218,000	3,629,743.43	0.30
65	601872	招商轮船	561,200	3,597,292.00	0.29
66	601615	明阳智能	277,900	3,504,319.00	0.29
67	688578	艾力斯	58,278	3,490,852.20	0.29
68	002531	天顺风能	440,600	3,485,146.00	0.28
69	002922	伊戈尔	194,700	3,469,554.00	0.28
70	600893	航发动力	81,600	3,382,320.00	0.28
71	00489	东风集团股份	910,000	3,134,830.61	0.26
72	002465	海格通信	281,600	3,091,968.00	0.25
73	688522	纳睿雷达	52,087	2,934,581.58	0.24
74	09926	康方生物	49,000	2,754,320.77	0.23
75	603556	海兴电力	65,800	2,433,942.00	0.20
76	603986	兆易创新	22,700	2,424,360.00	0.20
77	603166	福达股份	323,700	2,353,299.00	0.19
78	000963	华东医药	61,600	2,131,360.00	0.17
79	300073	当升科技	47,500	1,913,300.00	0.16

80	01860	汇量科技	241,000	1,861,284.84	0.15
81	00317	中船防务	154,000	1,617,199.21	0.13
82	301556	托普云农	2,663	222,828.67	0.02
83	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
84	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
85	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
86	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
87	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
88	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
89	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
90	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
91	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
92	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
93	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
94	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
95	603285	键邦股份	129	2,916.69	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	601288	农业银行	167,484,289.00	12.25
2	300394	天孚通信	149,993,159.69	10.97
3	00941	中国移动	79,751,610.71	5.83
3	600941	中国移动	56,429,127.12	4.13
4	300308	中际旭创	133,249,240.86	9.75
5	000651	格力电器	129,776,254.70	9.49
6	300476	胜宏科技	105,856,005.34	7.74
7	601088	中国神华	102,290,831.00	7.48
8	002384	东山精密	99,810,825.95	7.30
9	601398	工商银行	99,663,563.27	7.29
10	300502	新易盛	97,931,501.48	7.16
11	00883	中国海洋石油	47,080,746.55	3.44
11	600938	中国海油	46,777,277.00	3.42
12	603986	兆易创新	87,751,595.00	6.42
13	300750	宁德时代	81,739,457.58	5.98
14	601138	工业富联	78,371,986.24	5.73
15	000063	中兴通讯	78,195,943.38	5.72
16	002966	苏州银行	77,990,403.81	5.70
17	300274	阳光电源	76,470,435.44	5.59
18	600519	贵州茅台	75,419,029.00	5.52
19	300442	润泽科技	74,150,063.36	5.42



20	300014	亿纬锂能	71,471,996.05	5.23
21	688608	恒玄科技	69,671,189.75	5.10
22	300418	昆仑万维	67,735,344.13	4.95
23	002475	立讯精密	65,657,444.00	4.80
24	688041	海光信息	65,627,663.03	4.80
25	300679	电连技术	64,570,436.80	4.72
26	002463	沪电股份	62,484,867.35	4.57
27	688256	寒武纪	61,554,762.72	4.50
28	601225	陕西煤业	59,977,279.00	4.39
29	688018	乐鑫科技	57,456,155.46	4.20
30	002351	漫步者	57,199,470.00	4.18
31	00700	腾讯控股	56,692,150.21	4.15
32	002281	光迅科技	56,333,562.00	4.12
33	09926	康方生物	55,300,599.73	4.04
34	600030	中信证券	54,556,310.92	3.99
35	002714	牧原股份	54,510,483.35	3.99
36	688049	炬芯科技	53,994,955.66	3.95
37	688766	普冉股份	53,320,967.05	3.90
38	600028	中国石化	52,704,528.90	3.85
39	600577	精达股份	51,972,643.00	3.80
40	000977	浪潮信息	50,816,385.50	3.72
41	002130	沃尔核材	49,390,711.46	3.61
42	688111	金山办公	48,949,268.61	3.58
43	002851	麦格米特	48,227,852.51	3.53
44	600489	中金黄金	47,498,660.82	3.47
45	600036	招商银行	45,241,478.78	3.31
46	002315	焦点科技	45,186,674.30	3.30
47	000858	五 粮 液	45,144,161.00	3.30
48	688332	中科蓝讯	44,766,558.88	3.27
49	002273	水晶光电	44,010,637.02	3.22
50	300364	中文在线	43,253,069.69	3.16
51	00981	中芯国际	26,621,656.11	1.95
51	688981	中芯国际	16,318,318.68	1.19
52	601615	明阳智能	42,760,831.00	3.13
53	002517	恺英网络	42,612,054.46	3.12
54	001309	德明利	42,101,436.00	3.08
55	600584	长电科技	40,354,077.00	2.95
56	03690	美团-W	39,972,649.12	2.92
57	603019	中科曙光	38,816,535.92	2.84
58	000002	万 科 A	33,766,014.20	2.47
58	02202	万科企业	4,854,634.30	0.36
59	600276	恒瑞医药	38,322,510.84	2.80
60	601899	紫金矿业	37,631,027.00	2.75

61	000333	美的集团	36,475,637.76	2.67
62	601006	大秦铁路	36,300,426.33	2.65
63	600325	华发股份	35,702,210.61	2.61
64	600418	江淮汽车	35,281,589.00	2.58
65	301155	海力风电	34,715,770.00	2.54
66	01818	招金矿业	33,487,148.72	2.45
67	01952	云顶新耀-B	33,443,010.62	2.45
68	002180	纳思达	32,978,001.51	2.41
69	09690	途虎-W	32,962,212.00	2.41
70	300347	泰格医药	32,961,314.00	2.41
71	300033	同花顺	32,723,307.95	2.39
72	300475	香农芯创	32,678,108.07	2.39
73	601918	新集能源	32,601,734.68	2.38
74	002371	北方华创	32,487,248.00	2.38
75	000568	泸州老窖	31,980,656.00	2.34
76	301589	诺瓦星云	31,930,106.66	2.34
77	300552	万集科技	31,764,097.00	2.32
78	300133	华策影视	31,600,678.82	2.31
79	600114	东睦股份	31,598,668.00	2.31
80	000975	山金国际	31,102,093.53	2.27
81	300870	欧陆通	31,066,642.90	2.27
82	301391	卡莱特	30,457,118.65	2.23
83	688095	福昕软件	30,244,835.06	2.21
84	300558	贝达药业	30,141,634.10	2.20
85	601390	中国中铁	29,644,547.66	2.17
86	688361	中科飞测	29,459,309.72	2.15
87	300622	博士眼镜	29,142,824.84	2.13
88	601857	中国石油	29,124,159.00	2.13
89	688609	九联科技	29,108,478.20	2.13
90	601595	上海电影	28,295,970.60	2.07
91	300153	科泰电源	28,215,770.00	2.06
92	300757	罗博特科	27,671,717.60	2.02
93	600066	宇通客车	27,476,387.00	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	172,546,758.63	12.62
2	00941	中国移动	86,320,342.57	6.31
2	600941	中国移动	78,576,695.06	5.75
3	300308	中际旭创	142,942,472.94	10.45
4	601288	农业银行	123,922,578.00	9.06

5	601088	中国神华	116,390,004.13	8.51
6	000651	格力电器	110,313,583.03	8.07
7	601138	工业富联	104,198,363.26	7.62
8	601398	工商银行	101,617,380.55	7.43
9	00883	中国海洋石油	51,834,508.72	3.79
9	600938	中国海油	48,614,314.92	3.56
10	300502	新易盛	98,026,788.88	7.17
11	300476	胜宏科技	97,133,614.84	7.10
12	300750	宁德时代	94,889,210.00	6.94
13	603986	兆易创新	91,458,238.32	6.69
14	00700	腾讯控股	88,687,512.52	6.49
15	300442	润泽科技	87,710,956.83	6.41
16	000063	中兴通讯	78,209,291.08	5.72
17	002966	苏州银行	77,808,160.44	5.69
18	000858	五 粮 液	72,509,503.70	5.30
19	002475	立讯精密	70,794,597.00	5.18
20	300418	昆仑万维	70,197,978.20	5.13
21	300014	亿纬锂能	67,524,138.70	4.94
22	688018	乐鑫科技	66,355,916.84	4.85
23	688041	海光信息	66,298,448.28	4.85
24	600519	贵州茅台	65,940,928.00	4.82
25	09926	康方生物	65,384,819.77	4.78
26	688608	恒玄科技	65,328,147.46	4.78
27	300679	电连技术	64,761,363.95	4.74
28	002384	东山精密	62,746,580.78	4.59
29	601225	陕西煤业	60,110,642.85	4.40
30	600489	中金黄金	59,204,484.95	4.33
31	002281	光迅科技	59,179,204.00	4.33
32	600030	中信证券	58,945,100.08	4.31
33	002351	漫步者	58,272,507.31	4.26
34	688766	普冉股份	56,453,065.27	4.13
35	000977	浪潮信息	55,057,010.68	4.03
36	688049	炬芯科技	54,900,021.12	4.02
37	601899	紫金矿业	54,407,578.36	3.98
38	002714	牧原股份	54,343,113.33	3.97
39	603596	伯特利	53,830,833.64	3.94
40	300274	阳光电源	53,694,437.45	3.93
41	600577	精达股份	53,508,823.00	3.91
42	600276	恒瑞医药	53,149,752.82	3.89
43	002463	沪电股份	52,479,344.24	3.84
44	688332	中科蓝讯	52,223,263.18	3.82
45	000333	美的集团	51,240,977.86	3.75
46	688111	金山办公	48,153,681.96	3.52

47	600036	招商银行	46,946,499.00	3.43
48	001309	德明利	46,486,541.80	3.40
49	002517	恺英网络	46,068,446.24	3.37
50	600114	东睦股份	45,903,282.93	3.36
51	300364	中文在线	45,621,906.97	3.34
52	688256	寒武纪	44,690,466.05	3.27
53	002273	水晶光电	43,641,307.62	3.19
54	03690	美团-W	43,071,667.88	3.15
55	002315	焦点科技	42,999,265.20	3.14
56	600418	江淮汽车	41,467,527.00	3.03
57	603019	中科曙光	40,573,564.96	2.97
58	601615	明阳智能	40,173,684.00	2.94
59	600584	长电科技	37,601,380.00	2.75
60	301391	卡莱特	37,432,143.79	2.74
61	300133	华策影视	37,424,381.41	2.74
62	600325	华发股份	36,329,742.43	2.66
63	300870	欧陆通	36,128,613.32	2.64
64	601689	拓普集团	35,639,058.59	2.61
65	603345	安井食品	35,551,404.00	2.60
66	601006	大秦铁路	35,411,283.56	2.59
67	000002	万科 A	31,870,724.00	2.33
67	02202	万科企业	3,398,955.93	0.25
68	688097	博众精工	35,183,557.70	2.57
69	605117	德业股份	34,278,854.04	2.51
70	601595	上海电影	34,044,950.37	2.49
71	002180	纳思达	33,958,533.68	2.48
72	300153	科泰电源	33,869,842.00	2.48
73	301589	诺瓦星云	33,420,954.00	2.44
74	01952	云顶新耀-B	33,279,273.24	2.43
75	300475	香农芯创	33,187,711.52	2.43
76	688012	中微公司	32,818,893.93	2.40
77	09690	途虎-W	32,636,624.25	2.39
78	601918	新集能源	32,464,210.69	2.37
79	00981	中芯国际	21,139,669.08	1.55
79	688981	中芯国际	11,203,812.99	0.82
80	600028	中国石化	32,200,788.00	2.36
81	300347	泰格医药	31,992,144.85	2.34
82	300757	罗博特科	31,668,583.79	2.32
83	300033	同花顺	31,394,572.00	2.30
84	01818	招金矿业	31,314,194.52	2.29
85	600600	青岛啤酒	30,716,916.47	2.25
86	300136	信维通信	30,595,431.00	2.24
87	300552	万集科技	30,316,202.00	2.22

88	000568	泸州老窖	29,911,809.00	2.19
89	300622	博士眼镜	29,837,454.00	2.18
90	601390	中国中铁	29,340,431.00	2.15
91	000975	山金国际	28,576,482.00	2.09
92	688322	奥比中光	28,266,464.90	2.07
93	06682	第四范式	27,843,984.15	2.04
94	600023	浙能电力	27,805,698.58	2.03
95	300705	九典制药	27,569,074.88	2.02

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

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	9,607,146,178.18
卖出股票收入（成交）总额	9,715,360,755.21

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	655,562.84
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,950.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	661,513.09

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 (%)
平安优质	12,828	141,747.62	18,466,658.34	1.02	1,799,871,864.05	98.98

企业混合 A						
平安优质企业混合 C	5,701	14,729.01	8,147,243.31	9.70	75,822,832.84	90.30
合计	18,423	103,257.27	26,613,901.65	1.40	1,875,694,696.89	98.60

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	平安优质企业混合 A	388,431.76	0.0214
	平安优质企业混合 C	50.00	0.0001
	合计	388,481.76	0.0204

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	平安优质企业混合 A	0
	平安优质企业混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安优质企业混合 A	10~50
	平安优质企业混合 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品情况

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	平安优质企业混合 A	平安优质企业混合 C
基金合同生效日（2021 年 7 月 19 日）基金份额总额	3,196,560,278.64	144,389,341.91
本报告期期初基金	2,115,836,935.79	88,468,818.62

份额总额		
本报告期基金总申购份额	6,723,367.52	19,413,222.02
减：本报告期基金总赎回份额	304,221,780.92	23,911,964.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,818,338,522.39	83,970,076.15

§ 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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本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

经基金管理人董事会审议通过，并履行适当程序，聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计机构，报告期内应支付给该事务所的报酬为 65,000.00 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

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
中金公司	2	1,600,765,154.19	8.29	959,740.38	8.36	—
国联证券	1	1,208,363,301.95	6.25	617,190.32	5.37	—
国泰君安证券	2	1,060,591,279.62	5.49	534,415.48	4.65	—
浙商证券	2	1,054,631,077.22	5.46	616,656.91	5.37	—
国盛证券	1	1,040,952,347.14	5.39	570,043.66	4.96	—
国海证券	1	1,016,019,691.97	5.26	571,867.06	4.98	—
中信建投证券	1	970,623,419.55	5.02	740,804.16	6.45	—
中信证券	2	931,457,198.23	4.82	548,351.33	4.77	—
西南证券	1	929,534,328.08	4.81	587,640.02	5.12	—
民生证券	1	898,553,254.64	4.65	531,406.80	4.63	—
东方证券	3	871,380,970.34	4.51	487,216.93	4.24	—
长江证券	1	867,503,455.88	4.49	464,830.65	4.05	—
招商证券	2	864,547,314.68	4.47	666,412.89	5.80	—
国信证券	2	850,535,587.80	4.40	544,303.33	4.74	—
德邦证券	2	744,839,349.83	3.86	477,752.53	4.16	—
国投证券	4	692,784,603.93	3.59	432,583.01	3.77	—
华西证券	1	683,624,431.48	3.54	435,168.80	3.79	—
国金证券	1	583,947,533.46	3.02	386,338.44	3.36	—

兴业证券	2	481,617,951 .96	2.49	249,837.06	2.18	-
申万宏源 证券	2	476,132,848 .73	2.46	250,722.13	2.18	-
天风证券	1	410,571,921 .78	2.13	214,789.68	1.87	-
广发证券	3	334,059,109 .91	1.73	145,616.80	1.27	-
方正证券	3	179,836,413 .88	0.93	144,088.54	1.25	-
财通证券	1	173,132,028 .15	0.90	100,169.65	0.87	-
华泰证券	3	159,858,181 .14	0.83	102,837.51	0.90	-
华福证券	2	156,485,700 .83	0.81	68,209.60	0.59	-
中泰证券	1	65,598,699. 00	0.34	28,594.31	0.25	-
长城证券	2	12,427,880. 00	0.06	9,146.06	0.08	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

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

2、基金管理人根据上述标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议，自 2024 年 7 月 1 日起，按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等相关要求执行。

3、报告期内新增交易单元的情况：新增华福证券交易单元 2 个。

4、报告期内退租交易单元的情况：减少东方财富证券交易单元 2 个，减少上海证券交易单

元 2 个，减少长城证券交易单元 1 个，减少方正证券交易单元 1 个，减少国投证券交易单元 1 个，减少中金财富证券交易单元 1 个。

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 (%)
中金公司	-	-	843,397,000.00	2.27	-	-
国联证券	6,243,134.78	50.89	4,385,677,000.00	11.83	-	-
国泰君安证券	-	-	2,773,887,000.00	7.48	-	-
浙商证券	-	-	1,934,036,000.00	5.22	-	-
国盛证券	-	-	3,907,887,000.00	10.54	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	4,011,326,000.00	10.82	-	-
中信证券	-	-	1,320,536,000.00	3.56	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	6,025,500.52	49.11	3,592,463,000.00	9.69	-	-
东方证券	-	-	615,378,000.00	1.66	-	-
长江证券	-	-	2,857,343,000.00	7.71	-	-
招商证券	-	-	2,116,846,000.00	5.71	-	-
国信证券	-	-	859,599,000.00	2.32	-	-
德邦证券	-	-	360,959,000.00	0.97	-	-
国投证券	-	-	869,341,000.00	2.34	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	2,917,235,000.00	7.87	-	-

			0.00			
兴业证券	-	-	1,197,484,000.00	3.23	-	-
申万宏源证券	-	-	362,285,000.00	0.98	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	269,190,000.00	0.73	-	-
财通证券	-	-	1,639,205,000.00	4.42	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	244,994,000.00	0.66	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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	2024 年 01 月 15 日
2	平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 18 日
3	平安优质企业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 19 日
4	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
5	平安优质企业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 28 日
6	平安优质企业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 19 日

7	平安优质企业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
8	平安优质企业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
9	平安优质企业混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 07 月 18 日
10	平安基金管理有限公司关于终止与喜鹊财富基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 07 月 26 日
11	平安基金管理有限公司关于终止北京中植基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 08 月 02 日
12	平安优质企业混合型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 08 月 29 日
13	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 09 月 14 日
14	平安基金管理有限公司关于新增华源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	2024 年 10 月 14 日
15	平安优质企业混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 10 月 24 日
16	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 1	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 11 月 16 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	2024 年 12 月 20 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

注：无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

§ 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优质企业混合型证券投资基金募集注册的文件
- （2）平安优质企业混合型证券投资基金基金合同
- （3）平安优质企业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

2025 年 3 月 27 日