

平安新锐量化选股混合型发起式证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 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：国信证券股份有限公司

送出日期：2026 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）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	8
§ 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	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50

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	50
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	54
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金	
基金简称	平安新锐量化选股混合发起式	
基金主代码	026257	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 2 月 10 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	国信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	17,645,713.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安新锐量化选股混合发起式 A	平安新锐量化选股混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	026257	026258
报告期末下属分级基金的份额总额	13,976,164.58 份	3,669,549.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期增值。
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；9、融资投资策略。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中证港股通综合指数收益率（人民币）*5%+中债综合全价指数收益率*15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险和收益均低于股票型基金，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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李海波	薛璐
	联系电话	0755-88622632	0755-22940163
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	0755-61897778
传真		0755-23997878	0755-22940165
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	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六

		层
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	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
邮政编码	518048	518000
法定代表人	罗春风	张纳沙

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	fund.pingan.com
基金中期报告置备地点	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	2026年2月10日（基金合同生效日）-2026年6月30日	
	平安新锐量化选股混合发起式A	平安新锐量化选股混合发起式C
本期已实现收益	-2,578,084.70	-450,867.44
本期利润	-4,381,728.40	-1,011,572.29
加权平均基金份额 本期利润	-0.2210	-0.2529
本期加权平均净 值利润率	-23.30%	-26.42%
本期基金份额净 值增长率	-22.53%	-22.65%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026年6月30日)	
期末可供分配利 润	-3,148,194.33	-830,981.69
期末可供分配基 金份额利润	-0.2253	-0.2265
期末基金资产净 值	10,827,970.25	2,838,567.31

期末基金份额净值	0.7747	0.7735
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-22.53%	-22.65%

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。

4. 本基金基金合同于 2026 年 02 月 10 日正式生效。

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

平安新锐量化选股混合发起式 A

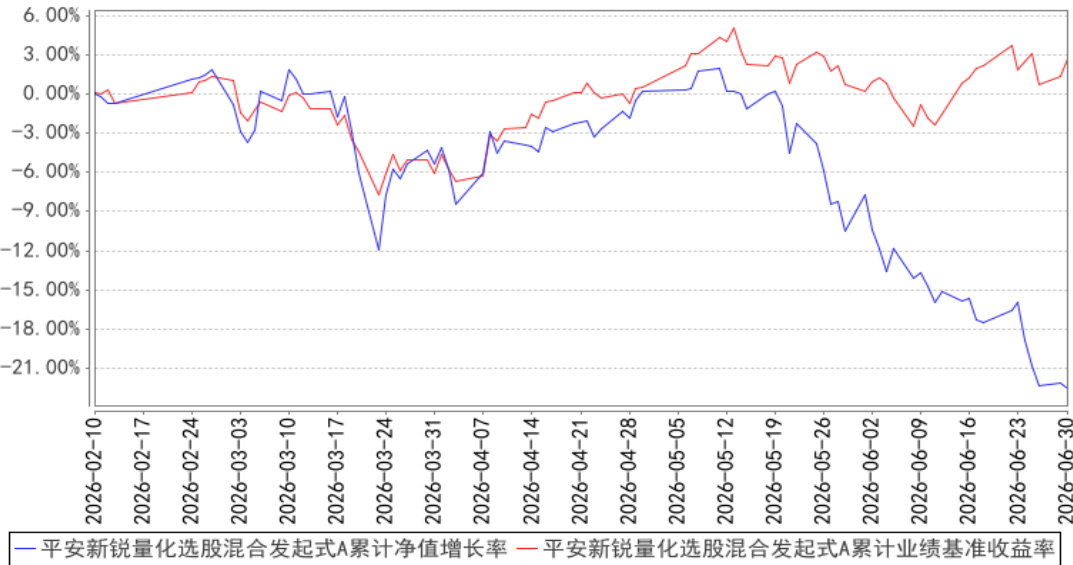
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-18.16%	1.62%	9.29%	1.13%	-27.45%	0.49%
自基金合同生效起至今	-22.53%	1.79%	2.62%	1.15%	-25.15%	0.64%

平安新锐量化选股混合发起式 C

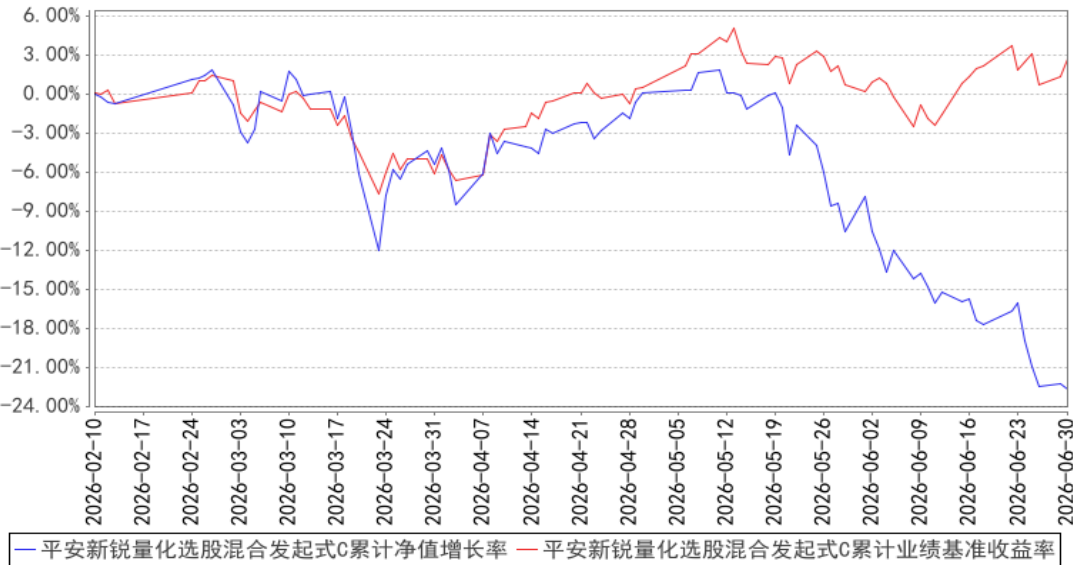
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-18.23%	1.62%	9.29%	1.13%	-27.52%	0.49%
自基金合同生效起至今	-22.65%	1.79%	2.62%	1.15%	-25.27%	0.64%

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

平安新锐量化选股混合发起式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



平安新锐量化选股混合发起式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 2026 年 02 月 10 日正式生效，截至报告期末未满半年；

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。

3.3 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，总部位于深圳，是中国平安集团投资板块的重要成员。公司业务范围涵盖公募基金管理业务、资本市场专户管理业务，具有受托管理保险资金资产管理人资格、合格境内机构投资者（QDII）资格。截至 2026 年上半年末，公司综合管理规模超 9500 亿元，公募管理规模 7900 亿元，累计服务客户数超 1.7 亿人，产品线涵盖货币、债券、混合、股票、指数、FOF、MOM、REITs 等各类产品。公司以“为持有人创造价值”为使命，打造了一支人才梯队完善、长期业绩优异的近 170 人投研团队，构建起“业绩可归因、策略可复制、人才可持续”的专业投研平台，为投资者创造长期稳健的投资回报，致力成为受投资者信赖、行业领先的综合型资产管理公司。

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		
王瑞炮	平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理	2026 年 2 月 10 日	-	6 年	王瑞炮先生，上海交通大学应用统计专业硕士研究生。曾担任平安科技有限责任公司智能投研部算法研究员。2020 年 6 月加入平安基金管理有限公司，担任 MOM 研究员，现担任平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。
王海畅	平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理	2026 年 5 月 20 日	-	9 年	王海畅先生，中央财经大学数学与应用数学专业本科、哥伦比亚大学统计学硕士。曾担任诺安基金管理有限公司研究员、基金经理。2025 年 11 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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《基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，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的规定及基金合同的约定。

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

本报告期内，本管理人管理的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超过该证券当日成交量的5%的交易共有5次，为公司旗下的指数量化投资组合与其他组合因投资策略需要而发生的同日反向交易，或为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

今年二季度，中大盘市值的宽基指数表现整体上好于小、微盘市值宽基指数，“财报期结束后风险偏好上升利好小、微盘相对表现”的历史长期规律并未应验。重要风格因子方面，长期动量因子的表现持续强劲，暂未呈现均值回复迹象。短期反转类因子的回撤超出历史正常水平。从长期复合收益期望的角度出发，本基金在小、微市值域坚持较高仓位的配置，二季度和上半年起始运作以来的表现承压。从2026年以前的较长期限历史记录看，小、微市值域指数的历次回调最终大概率会以创新高的形式修复，风格阶段性承压的局面也很可能意味着左侧布局的窗口逐步开启。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安新锐量化选股混合发起式A的基金份额净值0.7747元，本报告期基金份额净值增长率为-22.53%，同期业绩比较基准收益率为2.62%；截至本报告期末平安新锐量化选股

混合发起式 C 的基金份额净值 0.7735 元，本报告期基金份额净值增长率为-22.65%，同期业绩比较基准收益率为 2.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为“多数选股因子业务逻辑多头组合超额回撤”的情况有较高概率会逐步缓解（若这个判断被印证，会利好量化指增类产品的超额收益获取，也会促进小、微市值域内部的相对收益结构恢复正常），但长期动量因子的强势未必会发生明显逆转（其中一个关键影响因素是市场对 AI 产业链的高资本开支可持续程度预期是否发生重大变化）。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

不适用。

§ 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

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	2,074,341.50
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	11,626,397.80
其中：股票投资		11,626,397.80
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		206,584.47
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		13,907,323.77
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 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		216,122.16
应付管理人报酬		18,480.17
应付托管费		3,080.01
应付销售服务费		931.05
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	2,172.82
负债合计		240,786.21
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	17,645,713.58
未分配利润	6.4.7.12	-3,979,176.02
净资产合计		13,666,537.56
负债和净资产总计		13,907,323.77

注：（1）报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 17,645,713.58 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.7747 元，基金份额总额 13,976,164.58 份；下属 C 类基金份额净值 0.7735 元，基金份额总额 3,669,549.00 份。

（2）本基金合同于 2026 年 2 月 10 日生效，本报表实际编制期间为 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-5,263,140.48
1. 利息收入		5,113.85
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,979.93
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		133.92
其他利息收入		-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,007,115.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,079,809.66
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	72,694.40
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-2,364,348.55
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	103,209.48
减：二、营业总支出		130,160.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	104,421.59
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,403.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,166.50
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		-
8. 其他费用	6.4.7.23	2,168.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,393,300.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,393,300.69
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-5,393,300.69

6.3 净资产变动表

会计主体：平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	13,688,839.00	-	13,688,839.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	3,956,874.58	-3,979,176.02	-22,301.44
(一)、综合收益总额	-	-5,393,300.69	-5,393,300.69
(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)	3,956,874.58	1,414,124.67	5,370,999.25
其中:1.基金申购款	30,736,719.42	-1,182,019.17	29,554,700.25
2.基金赎回款	-26,779,844.84	2,596,143.84	-24,183,701.00
(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	17,645,713.58	-3,979,176.02	13,666,537.56

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：

<u>罗春风</u>	<u>肖宇鹏</u>	<u>马杰</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金（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[2025]2623 号文《关于准予平安新锐量化选股混合型发起式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《平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）作为发起人向社会公开募集，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2026）验字第 70039114_H07 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2026 年 2 月 10 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金募集期间为 2025 年 12 月 22 日

至 2026 年 2 月 6 日, 设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 13,688,584.76 元, 在募集期间产生的活期存款利息为人民币 254.24 元, 以上实收基金(本息)合计为人民币 13,688,839.00 元, 折合 13,688,839.00 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, 基金托管人为国信证券股份有限公司。

本基金为发起式基金, 发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币 1,000 万元, 且发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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、创业板、科创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、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、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。本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定, 参与融资业务。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: 本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%, 投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。本基金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。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。前述股指期货、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。

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、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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>》, 中国证券投资基金业协会发布的《公开募集

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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 02 月 10 日（基金合同生效日）起至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系自 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《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《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《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。

（4）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。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有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《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《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。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	504,616.78
等于：本金	504,420.65
加：应计利息	196.13
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	1,569,724.72
等于：本金	1,569,715.77
加：应计利息	8.95
合计	2,074,341.50

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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		13,990,746.35	-	11,626,397.80	-2,364,348.55
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		13,990,746.35	-	11,626,397.80	-2,364,348.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4.24

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	2,168.58
合计	2,172.82

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安新锐量化选股混合发起式 A

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	12,265,148.50	12,265,148.50
本期申购	16,526,171.93	16,526,171.93
本期赎回（以“-”号填列）	-14,815,155.85	-14,815,155.85
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	13,976,164.58	13,976,164.58

平安新锐量化选股混合发起式 C

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,423,690.50	1,423,690.50
本期申购	14,210,547.49	14,210,547.49
本期赎回（以“-”号填列）	-11,964,688.99	-11,964,688.99
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	3,669,549.00	3,669,549.00

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

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

平安新锐量化选股混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期期初	-	-	-
本期利润	-2,578,084.70	-1,803,643.70	-4,381,728.40
本期基金份额交易产生的变动数	210,687.54	1,022,846.53	1,233,534.07
其中：基金申购款	270,514.55	-1,057,187.49	-786,672.94
基金赎回款	-59,827.01	2,080,034.02	2,020,207.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,367,397.16	-780,797.17	-3,148,194.33

平安新锐量化选股混合发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-450,867.44	-560,704.85	-1,011,572.29
本期基金份额交易产生的变动数	-175,142.44	355,733.04	180,590.60
其中：基金申购款	139,899.47	-535,245.70	-395,346.23
基金赎回款	-315,041.91	890,978.74	575,936.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-626,009.88	-204,971.81	-830,981.69

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
活期存款利息收入	3,383.82
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	366.17
结算备付金利息收入	-
其他	1,229.94
合计	4,979.93

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

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,079,809.66
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	-3,079,809.66

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 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年 6月30日
卖出股票成交总额	79,691,948.62
减：卖出股票成本总额	82,659,607.95
减：交易费用	112,150.33
买卖股票差价收入	-3,079,809.66

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

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
	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	72,694.40
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	72,694.40

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,364,348.55
股票投资	-2,364,348.55
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	-2,364,348.55

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	69,056.86
基金转换费收入	34,152.62
合计	103,209.48

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《平安新锐量化选股混合型发起式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。

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 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	2,168.58
信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	2,168.58

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

截至本财务报表批准报出日，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、关联关系

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
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	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

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国信证券	176,342,302.92	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
国信证券	3,200,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30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 （%）
国信证券	60,996.71	100.00	-	-

- 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。

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 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	104,421.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	18,215.66
应支付基金管理人的净管理费	86,205.93

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 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,403.54

注：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。

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 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安新锐量化选股混 合发起式 A	平安新锐量化选股混 合发起式 C	合计
陆基金	-	1.95	1.95
平安人寿	-	23.66	23.66
合计	-	25.61	25.61

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：本基金本报告期末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：本基金本报告期内转融通证券出借业务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：本基金本报告期内转融通证券出借业务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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	平安新锐量化选股混合发起式 A	平安新锐量化选股混合发起式 C
基金合同生效日（2026 年 2 月 10 日）持有的基金份额	10,000,097.23	-

报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,097.23	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	71.5511%	-

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

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 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
国信证券-活期	504,616.78	3,383.82

注：本基金的银行存款由基金托管人国信证券保管，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：本基金本报告期末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

本基金本报告期内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（2026 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

603137	恒尚 节能	2026 年 6 月 16 日	重大事 项停牌	12.94	2026 年 7 月 1 日	14.23	7,700	108,872.14	99,638.00	
--------	----------	--------------------------	------------	-------	-------------------------	-------	-------	------------	-----------	--

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

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

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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日

可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6. 4. 13. 4 市场风险

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

6. 4. 13. 4. 1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。
本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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

6. 4. 13. 4. 1. 1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	2,074,341.50	-	-	-	2,074,341.50
交易性金融资产	-	-	-	11,626,397.80	11,626,397.80
应收申购款	-	-	-	206,584.47	206,584.47
资产总计	2,074,341.50	-	-	11,832,982.27	13,907,323.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	216,122.16	216,122.16
应付管理人报酬	-	-	-	18,480.17	18,480.17
应付托管费	-	-	-	3,080.01	3,080.01
应付销售服务费	-	-	-	931.05	931.05

其他负债	-	-	-	2,172.82	2,172.82
负债总计	-	-	-	240,786.21	240,786.21
利率敏感度缺口	2,074,341.50	-	-	11,592,196.06	13,666,537.56

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投资和交易性资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2026年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	11,626,397.80	85.07
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	11,626,397.80	85.07
----	---------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 （2026 年 6 月 30 日）
	沪深 300 指数上升 5%	438,376.39
	沪深 300 指数下降 5%	-438,376.39

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	11,526,759.80
第二层次	99,638.00
第三层次	-
合计	11,626,397.80

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,626,397.80	83.60
	其中：股票	11,626,397.80	83.60
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	2,074,341.50	14.92
8	其他各项资产	206,584.47	1.49
9	合计	13,907,323.77	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	152,936.00	1.12
B	采矿业	76,540.00	0.56
C	制造业	7,515,453.80	54.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	74,365.00	0.54
E	建筑业	175,203.00	1.28
F	批发和零售业	828,065.00	6.06
G	交通运输、仓储和邮政业	220,484.00	1.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	902,814.00	6.61
J	金融业	-	-
K	房地产业	304,119.00	2.23
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	768,721.00	5.62
N	水利、环境和公共设施管理业	454,045.00	3.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	76,860.00	0.56
Q	卫生和社会工作	76,792.00	0.56
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,626,397.80	85.07

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	603137	恒尚节能	7,700	99,638.00	0.73
2	688670	金迪克	5,700	96,558.00	0.71
3	301390	经纬股份	2,800	90,328.00	0.66
4	688426	康为世纪	4,800	88,032.00	0.64
5	300640	德艺文创	14,300	80,509.00	0.59
6	300923	研奥股份	3,600	80,208.00	0.59
7	688078	龙软科技	3,800	79,990.00	0.59
8	300564	筑博设计	6,600	79,266.00	0.58
9	002381	双箭股份	15,300	79,254.00	0.58
10	301355	南王科技	8,100	79,218.00	0.58
11	603183	建研院	22,200	78,810.00	0.58
12	300838	浙江力诺	5,900	78,765.00	0.58
13	603879	永悦科技	17,400	78,648.00	0.58

14	688701	卓锦股份	10,400	78,312.00	0.57
15	600287	苏豪时尚	17,700	78,057.00	0.57
16	688420	美腾科技	3,700	77,959.00	0.57
17	300642	透景生命	6,600	77,880.00	0.57
18	301163	宏德股份	3,500	77,630.00	0.57
19	300886	华业香料	3,900	77,610.00	0.57
20	300583	赛托生物	6,900	77,487.00	0.57
21	603860	中公高科	3,200	77,408.00	0.57
22	688395	正弦电气	3,500	77,350.00	0.57
23	301505	苏州规划	4,800	77,280.00	0.57
24	300823	建科智能	5,300	77,274.00	0.57
25	688113	联测科技	2,200	77,220.00	0.57
26	603900	莱绅通灵	13,700	77,131.00	0.56
27	301131	聚赛龙	2,400	77,112.00	0.56
28	603208	江山欧派	7,200	77,040.00	0.56
29	300519	新光药业	6,500	77,025.00	0.56
30	002968	新大正	9,100	76,986.00	0.56
31	000548	湖南投资	18,800	76,892.00	0.56
32	688681	科汇股份	5,500	76,890.00	0.56
33	002732	燕塘乳业	6,200	76,880.00	0.56
34	600455	博通股份	3,500	76,860.00	0.56
35	002524	光正眼科	23,200	76,792.00	0.56
36	600697	欧亚集团	7,900	76,788.00	0.56
37	688616	西力科技	7,600	76,760.00	0.56
38	300112	万讯自控	12,400	76,756.00	0.56
39	603041	美思德	7,400	76,738.00	0.56
40	300387	富邦科技	11,300	76,727.00	0.56
41	300176	鸿特科技	15,800	76,630.00	0.56
42	603385	惠达卫浴	15,700	76,616.00	0.56
43	300958	建工修复	7,200	76,608.00	0.56
44	002105	信隆健康	15,500	76,570.00	0.56
44	688067	爱威科技	3,800	76,570.00	0.56
45	600051	宁波联合	13,600	76,568.00	0.56
46	301010	晶雪节能	4,700	76,563.00	0.56
47	003042	中农联合	6,300	76,545.00	0.56
48	002629	仁智股份	17,800	76,540.00	0.56
49	600235	民丰特纸	15,400	76,538.00	0.56
50	000663	永安林业	15,000	76,500.00	0.56
51	688393	安必平	4,300	76,454.00	0.56
52	688217	睿昂基因	3,700	76,442.00	0.56
53	002820	桂发祥	9,100	76,440.00	0.56
54	002679	福建金森	9,700	76,436.00	0.56
55	000702	正虹科技	15,400	76,384.00	0.56

56	002494	华斯股份	17,200	76,368.00	0.56
57	002574	明牌珠宝	18,400	76,360.00	0.56
58	603536	惠发食品	9,800	76,342.00	0.56
59	603214	爱婴室	6,300	76,293.00	0.56
60	688659	元琛科技	7,300	76,212.00	0.56
61	688613	奥精医疗	5,400	76,194.00	0.56
62	002817	黄山胶囊	13,000	76,180.00	0.56
63	002873	新天药业	10,400	76,128.00	0.56
64	603321	梅轮电梯	13,300	76,076.00	0.56
65	002133	广宇集团	31,800	76,002.00	0.56
66	600303	曙光股份	30,500	75,945.00	0.56
67	300417	南华仪器	7,400	75,924.00	0.56
67	603029	天鹅股份	5,400	75,924.00	0.56
68	688203	海正生材	7,600	75,848.00	0.55
69	301001	凯淳股份	3,500	75,845.00	0.55
70	603709	中源家居	5,600	75,824.00	0.55
71	600099	林海股份	9,500	75,810.00	0.55
72	301272	英华特	2,300	75,762.00	0.55
73	300732	设研院	13,600	75,752.00	0.55
74	300126	锐奇股份	13,100	75,718.00	0.55
75	000633	合金投资	15,900	75,684.00	0.55
76	603506	南都物业	8,100	75,654.00	0.55
77	300851	交大思诺	3,400	75,650.00	0.55
78	003003	天元股份	7,600	75,620.00	0.55
79	000637	茂化实华	21,600	75,600.00	0.55
79	301037	保立佳	6,300	75,600.00	0.55
79	688565	力源科技	8,000	75,600.00	0.55
80	688244	永信至诚	5,300	75,578.00	0.55
81	300621	维业股份	11,900	75,565.00	0.55
82	002760	凤形股份	4,600	75,532.00	0.55
83	300030	阳普医疗	13,000	75,530.00	0.55
84	603168	莎普爱思	16,000	75,520.00	0.55
85	300549	优德精密	5,800	75,516.00	0.55
86	688021	奥福科技	3,900	75,504.00	0.55
87	300074	华平股份	22,200	75,480.00	0.55
88	600692	亚通股份	13,900	75,477.00	0.55
89	605122	四方新材	7,000	75,460.00	0.55
90	600148	长春一东	5,200	75,452.00	0.55
91	000985	大庆华科	5,300	75,419.00	0.55
92	301515	港通医疗	4,300	75,379.00	0.55
93	300645	正元智慧	6,400	75,328.00	0.55
94	688058	宝兰德	3,600	75,312.00	0.55
95	300371	汇中股份	7,700	75,306.00	0.55

96	301006	迈拓股份	6,000	75,300.00	0.55
97	301126	达嘉维康	8,800	75,240.00	0.55
98	301429	森泰股份	4,800	75,216.00	0.55
99	300025	华星创业	17,900	75,180.00	0.55
100	002949	华阳国际	7,600	75,164.00	0.55
101	600128	苏豪弘业	9,900	75,141.00	0.55
102	600774	汉商集团	12,000	75,120.00	0.55
103	300405	科隆股份	14,500	75,110.00	0.55
104	605567	春雪食品	9,400	75,106.00	0.55
105	000856	冀东装备	10,500	75,075.00	0.55
106	301049	超越科技	4,200	75,012.00	0.55
107	300535	达威股份	5,500	74,965.00	0.55
108	688528	秦川物联	8,200	74,948.00	0.55
109	600493	凤竹纺织	14,300	74,932.00	0.55
110	600883	博闻科技	10,700	74,900.00	0.55
111	002566	益盛药业	12,400	74,896.00	0.55
112	001336	楚环科技	3,400	74,868.00	0.55
113	301519	舜禹股份	6,900	74,865.00	0.55
114	002144	宏达高科	7,600	74,860.00	0.55
115	300929	华骐环保	7,100	74,834.00	0.55
116	688638	誉辰智能	2,400	74,808.00	0.55
117	688695	中创股份	4,000	74,800.00	0.55
118	001366	播恩集团	6,900	74,796.00	0.55
119	001231	农心科技	4,100	74,784.00	0.55
119	300106	西部牧业	7,600	74,784.00	0.55
120	688329	艾隆科技	3,700	74,777.00	0.55
121	600561	江西长运	15,100	74,745.00	0.55
122	002316	亚联发展	18,400	74,704.00	0.55
123	600689	上海三毛	7,700	74,690.00	0.55
124	600137	浪莎股份	4,600	74,658.00	0.55
125	300675	建科院	6,300	74,655.00	0.55
126	301113	雅艺科技	5,000	74,550.00	0.55
127	688466	金科环境	5,800	74,414.00	0.54
128	000605	渤海股份	13,900	74,365.00	0.54
129	688296	和达科技	6,500	74,360.00	0.54
130	301156	美农生物	6,840	74,350.80	0.54
131	301167	建研设计	6,000	74,340.00	0.54
131	600448	华纺股份	29,500	74,340.00	0.54
132	301130	西点药业	3,100	74,338.00	0.54
133	600778	友好集团	15,200	74,328.00	0.54
134	603022	新通联	9,300	74,307.00	0.54
135	300865	大宏立	3,400	74,290.00	0.54
136	603908	牧高笛	4,400	74,272.00	0.54

137	002802	洪汇新材	7,000	73,640.00	0.54
138	300597	吉大通信	10,400	73,632.00	0.54
139	000590	古汉医药	9,000	73,530.00	0.54
140	002591	恒大高新	12,000	73,440.00	0.54
141	688004	博汇科技	4,000	72,800.00	0.53
142	002862	实丰文化	5,400	69,282.00	0.51
143	002800	天顺股份	5,300	68,847.00	0.50
144	002780	三夫户外	5,600	67,984.00	0.50
145	001209	洪兴股份	4,200	67,284.00	0.49
146	300635	中达安	5,400	65,718.00	0.48
147	605151	西上海	2,800	49,308.00	0.36

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002494	华斯股份	607,280.00	4.44
2	688113	联测科技	572,859.48	4.19
3	688203	海正生材	517,413.93	3.79
4	300371	汇中股份	514,882.00	3.77
5	002144	宏达高科	505,547.00	3.70
6	603073	彩蝶实业	496,742.00	3.63
7	300823	建科智能	467,945.00	3.42
8	301163	宏德股份	461,123.00	3.37
9	002949	华阳国际	455,759.00	3.33
10	688468	科美诊断	453,525.27	3.32
11	603321	梅轮电梯	449,691.00	3.29
12	605567	春雪食品	447,705.00	3.28
13	688395	正弦电气	444,230.85	3.25
14	600778	友好集团	442,999.00	3.24
15	002817	黄山胶囊	440,674.00	3.22
16	600689	上海三毛	433,844.00	3.17
17	301234	五洲医疗	431,188.00	3.16
18	300610	晨化股份	425,956.00	3.12
19	600768	宁波富邦	424,636.00	3.11
20	300717	华信新材	419,020.00	3.07
21	001373	翔腾新材	417,155.00	3.05
22	603329	上海雅仕	416,259.00	3.05
23	002316	亚联发展	414,471.00	3.03
24	688056	莱伯泰科	410,678.87	3.00
25	002671	龙泉股份	391,972.00	2.87
26	600099	林海股份	380,452.00	2.78
27	603385	惠达卫浴	379,804.00	2.78

28	301429	森泰股份	379,667.00	2.78
29	688565	力源科技	378,133.71	2.77
30	300838	浙江力诺	376,264.00	2.75
31	603908	牧高笛	370,522.00	2.71
32	002661	克明食品	369,758.00	2.71
33	002802	洪汇新材	362,373.00	2.65
34	000633	合金投资	360,711.00	2.64
35	300640	德艺文创	358,599.00	2.62
36	300534	陇神戎发	357,209.00	2.61
37	300642	透景生命	354,141.00	2.59
38	300923	研奥股份	353,146.00	2.58
39	301515	港通医疗	348,306.00	2.55
40	000548	湖南投资	346,744.00	2.54
41	301505	苏州规划	346,056.00	2.53
42	603208	江山欧派	345,604.13	2.53
43	688329	艾隆科技	343,685.39	2.51
44	001366	播恩集团	343,396.00	2.51
45	300851	交大思诺	341,276.00	2.50
46	603836	海程邦达	338,212.00	2.47
47	301131	聚赛龙	334,581.77	2.45
48	603326	我乐家居	333,415.00	2.44
49	001205	盛航股份	332,192.00	2.43
50	300635	中达安	331,822.00	2.43
51	688616	西力科技	331,580.62	2.43
52	002890	弘宇股份	330,742.00	2.42
53	300694	蠡湖股份	330,718.00	2.42
54	001219	青岛食品	325,761.31	2.38
55	688118	普元信息	325,426.18	2.38
56	002629	仁智股份	324,422.00	2.37
57	600419	天润乳业	323,338.00	2.37
58	301006	迈拓股份	313,993.00	2.30
59	002205	国统股份	313,771.00	2.30
60	603096	新经典	312,930.00	2.29
61	300645	正元智慧	311,926.00	2.28
62	600493	凤竹纺织	310,226.00	2.27
63	300074	华平股份	309,843.00	2.27
64	600128	苏豪弘业	309,388.00	2.26
65	002893	京能热力	306,320.00	2.24
66	688638	誉辰智能	304,580.67	2.23
67	002968	新大正	303,833.00	2.22
68	300112	万讯自控	302,627.00	2.21
69	688021	奥福科技	302,047.89	2.21
70	603709	中源家居	301,816.00	2.21

71	603214	爱婴室	301,459.00	2.21
72	688217	睿昂基因	301,083.72	2.20
73	300549	优德精密	300,952.00	2.20
74	002633	申科股份	300,795.00	2.20
75	300886	华业香料	300,553.00	2.20
76	301390	经纬股份	298,889.00	2.19
77	301049	超越科技	298,837.00	2.19
78	605266	健之佳	298,789.00	2.19
79	002566	益盛药业	298,473.00	2.18
80	300519	新光药业	298,465.00	2.18
81	688067	爱威科技	298,422.22	2.18
82	688129	东来技术	298,401.64	2.18
83	002732	燕塘乳业	298,382.00	2.18
84	300025	华星创业	298,331.00	2.18
85	301126	达嘉维康	298,162.00	2.18
86	603029	天鹅股份	297,902.00	2.18
87	688058	宝兰德	297,660.56	2.18
88	300597	吉大通信	297,511.00	2.18
89	600448	华纺股份	297,302.00	2.18
90	300387	富邦科技	297,221.00	2.17
91	688695	中创股份	297,154.95	2.17
92	300621	维业股份	296,818.00	2.17
93	603900	莱绅通灵	296,484.00	2.17
94	301001	凯淳股份	296,232.00	2.17
95	301519	舜禹股份	295,900.00	2.17
96	688078	龙软科技	295,753.82	2.16
97	002133	广宇集团	295,678.00	2.16
98	600051	宁波联合	295,219.00	2.16
99	300800	力合科技	294,930.00	2.16
100	300417	南华仪器	294,402.00	2.15
101	301130	西点药业	294,089.00	2.15
102	000663	永安林业	294,006.00	2.15
103	300535	达威股份	293,621.00	2.15
104	688466	金科环境	293,586.35	2.15
105	600235	民丰特纸	293,360.00	2.15
106	603168	莎普爱思	293,238.00	2.15
107	600561	江西长运	293,218.00	2.15
108	001209	洪兴股份	293,074.00	2.14
109	000985	大庆华科	293,069.00	2.14
110	301167	建研设计	292,854.00	2.14
111	603022	新通联	292,821.00	2.14
112	300958	建工修复	292,815.00	2.14
113	301355	南王科技	292,809.00	2.14

114	002873	新天药业	292,736.00	2.14
115	688426	康为世纪	292,687.56	2.14
116	002524	光正眼科	292,639.00	2.14
117	600287	苏豪时尚	292,591.00	2.14
118	603860	中公高科	292,503.00	2.14
119	688393	安必平	292,314.57	2.14
120	600148	长春一东	292,080.00	2.14
121	300564	筑博设计	291,662.00	2.13
122	000702	正虹科技	291,473.00	2.13
123	600774	汉商集团	291,167.00	2.13
124	300929	华骐环保	291,141.00	2.13
125	300512	中亚股份	290,815.00	2.13
126	300675	建科院	290,686.00	2.13
127	000637	茂化实华	290,559.00	2.13
128	301037	保立佳	290,480.00	2.13
129	002820	桂发祥	290,208.00	2.12
130	600455	博通股份	289,334.00	2.12
131	000605	渤海股份	289,250.00	2.12
132	688681	科汇股份	289,184.41	2.12
133	688296	和达科技	289,136.72	2.12
134	688670	金迪克	288,834.04	2.11
135	688701	卓锦股份	288,752.79	2.11
136	603183	建研院	288,749.00	2.11
137	600697	欧亚集团	288,716.00	2.11
138	003003	天元股份	288,343.00	2.11
139	600883	博闻科技	288,199.00	2.11
140	300405	科隆股份	288,198.00	2.11
141	301156	美农生物	288,188.00	2.11
142	688420	美腾科技	287,810.60	2.11
143	000590	古汉医药	287,797.00	2.11
144	603536	惠发食品	287,568.00	2.10
145	605122	四方新材	287,561.00	2.10
146	002105	信隆健康	287,473.00	2.10
147	301272	英华特	287,361.00	2.10
148	688528	秦川物联	287,295.49	2.10
149	688004	博汇科技	287,291.33	2.10
150	688659	元琛科技	286,982.37	2.10
151	603506	南都物业	285,739.00	2.09
152	603041	美思德	284,103.00	2.08
153	002381	双箭股份	283,786.00	2.08
154	001231	农心科技	282,976.00	2.07
155	301010	晶雪节能	281,557.00	2.06
156	001336	楚环科技	277,883.00	2.03

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002494	华斯股份	500,845.00	3.66
2	688113	联测科技	486,234.73	3.56
3	688468	科美诊断	465,336.59	3.40
4	603073	彩蝶实业	461,861.00	3.38
5	301234	五洲医疗	455,485.00	3.33
6	688203	海正生材	450,465.94	3.30
7	300610	晨化股份	425,066.00	3.11
8	001373	翔腾新材	423,185.00	3.10
9	600768	宁波富邦	412,514.00	3.02
10	300717	华信新材	408,494.00	2.99
11	603329	上海雅仕	405,427.00	2.97
12	002144	宏达高科	400,455.00	2.93
13	300371	汇中股份	396,962.00	2.90
14	300823	建科智能	387,225.00	2.83
15	002671	龙泉股份	380,806.00	2.79
16	688395	正弦电气	379,259.47	2.78
17	688056	莱伯泰科	378,083.82	2.77
18	002661	克明食品	370,148.00	2.71
19	301163	宏德股份	358,613.00	2.62
20	002949	华阳国际	357,649.00	2.62
21	603321	梅轮电梯	356,532.00	2.61
22	300534	陇神戎发	354,349.00	2.59
23	688129	东来技术	348,267.91	2.55
24	300838	浙江力诺	332,345.32	2.43
25	002316	亚联发展	327,381.00	2.40
26	002893	京能热力	327,380.00	2.40
27	300694	蠡湖股份	324,467.00	2.37
28	001219	青岛食品	324,006.00	2.37
29	001259	利仁科技	323,110.00	2.36
30	600419	天润乳业	320,449.00	2.34
31	600689	上海三毛	320,354.00	2.34
32	002633	申科股份	320,146.00	2.34
33	688118	普元信息	319,707.59	2.34
34	002890	弘宇股份	316,032.00	2.31
35	603096	新经典	314,731.00	2.30
36	001205	盛航股份	312,335.00	2.29
37	603326	我乐家居	310,726.00	2.27
38	002817	黄山胶囊	310,543.00	2.27

39	301072	中捷精工	310,039.00	2.27
40	603836	海程邦达	307,123.40	2.25
41	605567	春雪食品	305,557.00	2.24
42	605266	健之佳	303,995.00	2.22
43	301429	森泰股份	303,964.00	2.22
44	600778	友好集团	303,234.00	2.22
45	600847	万里股份	299,788.00	2.19
46	300800	力合科技	299,280.00	2.19
47	300512	中亚股份	298,254.00	2.18
48	002802	洪汇新材	292,482.00	2.14
49	002205	国统股份	291,982.00	2.14
50	300334	津膜科技	291,451.00	2.13
51	600099	林海股份	291,327.00	2.13
52	001366	播恩集团	291,304.00	2.13
53	301469	恒达新材	287,261.00	2.10
54	603679	华体科技	286,843.00	2.10
55	301502	华阳智能	286,397.00	2.10
56	003001	中岩大地	282,352.00	2.07
57	688355	明志科技	282,020.76	2.06
58	688671	碧兴物联	280,811.93	2.05
59	300851	交大思诺	277,826.00	2.03
60	688718	唯赛勃	277,207.03	2.03
61	603307	扬州金泉	274,566.34	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	96,650,354.30
卖出股票收入（成交）总额	79,691,948.62

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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约定的备选股票库

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	206,584.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	206,584.47

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明

1	603137	恒尚节能	99,638.00	0.73	停牌
---	--------	------	-----------	------	----

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 (%)
平安新锐 量化选股 混合发起 式 A	117	119,454.40	11,998,917.39	85.85	1,977,247.19	14.15
平安新锐 量化选股 混合发起 式 C	187	19,623.26	0.00	0.00	3,669,549.00	100.00
合计	287	61,483.32	11,998,917.39	68.00	5,646,796.19	32.00

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	平安新锐量化选股混合发起 式 A	364,414.00	2.6074
	平安新锐量化选股混合发起 式 C	104,898.95	2.8586
	合计	469,312.95	2.6596

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	平安新锐量化选股混合发起式 A	0
	平安新锐量化选股混合发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安新锐量化选股混合发起式 A	10~50
	平安新锐量化选股混合发起式 C	0
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,097.23	56.67	10,000,000.00	56.67	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,097.23	56.67	10,000,000.00	56.67	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安新锐量化选股混合发起式 A	平安新锐量化选股混合发起式 C
基金合同生效日（2026 年 2 月 10 日）基金份额总额	12,265,148.50	1,423,690.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	16,526,171.93	14,210,547.49
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	14,815,155.85	11,964,688.99
基金合同生效日起至报告期期末基金	-	-

拆分变动份额		
本报告期期末基金份额总额	13,976,164.58	3,669,549.00

§ 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

管理人：公司副总经理林婉文因达到退休年龄，于报告期辞去公司副总经理兼财务负责人职务。林婉文离任后，由公司总经理肖宇鹏兼任公司财务负责人。

托管人：本报告期内本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

管理人：本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务的诉讼或仲裁。

托管人：本报告期内无涉及本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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期无托管人受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期无托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	2	176,342,302.92	100.00	60,996.71	100.00	

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

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

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

3、本基金本报告期合同生效，上述租用交易单元均为本期新增所用。

4、报告期内退租交易单元的情况:无。

10.7.2 基金租用或者通过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	-	-	3,200,000.00	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新增国信证券股份有限公司为平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月14日
2	关于平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年02月03日
3	平安基金管理有限公司关于平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年02月11日
4	关于平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回、	中国证监会规定报刊及网站	2026年02月12日

	转换、定期定额投资业务的公告		
5	平安基金管理有限公司关于新增东莞证券股份有限公司为平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月06日
6	平安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月11日
7	平安基金管理有限公司关于新增上海证达通基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月18日
8	平安基金管理有限公司关于新增平安银行股份有限公司（行E通）为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月19日
9	平安基金管理有限公司关于新增招商银行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	2026年03月25日
10	平安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月31日
11	平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026年04月15日
12	平安基金管理有限公司关于新增易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年04月24日
13	平安基金管理有限公司对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露	中国证监会规定报刊及网站	2026年04月30日
14	平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年05月22日
15	平安新锐量化选股混合型发起式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	2026年05月23日
16	平安新锐量化选股混合型发起式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	2026年05月23日
17	平安基金管理有限公司关于新增南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年06月03日
18	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部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年06月10日
19	平安基金管理有限公司关于新增泰信财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年06月10日
20	平安基金管理有限公司关于新增汇	中国证监会规定报刊及	2026年06月18日

	添富基金销售（上海）有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	网站	
21	平安基金管理有限公司关于新增上海陆享基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 06 月 26 日
22	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	2026 年 06 月 26 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2026 年 02 月 10 日-2026 年 06 月 30 日	10,000,097.23	0.00	0.00	10,000,097.23	56.67
	2	2026 年 03 月 26 日-2026 年 06 月 09 日	0.00	9,457,515.78	9,457,515.78	0.00	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

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新锐量化选股混合型发起式证券投资基金募集注册的文件

-
- (2) 平安新锐量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同
 - (3) 平安新锐量化选股混合型发起式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

2026 年 8 月 27 日