

# 平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>48</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
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 .....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
8.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	56
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 .....	56
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
11.4 基金投资策略的改变 .....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
11.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</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 .....	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
13.1 备查文件目录 .....	64
13.2 存放地点 .....	64
13.3 查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	平安鑫利混合	
基金主代码	003626	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 7 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	51,905,440.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C
下属分级基金的交易代码	003626	006433
报告期末下属分级基金的份额总额	13,268,467.02 份	38,636,973.07 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，本基金通过灵活的资产配置，力求在有效分散风险的同时实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金转型为开放式基金后，将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码		518048	518001
法定代表人		罗春风	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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	2021 年		2020 年		2019 年	
	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C
本期已实现收益	2,949,400.73	9,785,201.18	421,257.04	-11,533,808.95	6,486.75	20,271,556.40
本期利润	3,649,911.61	5,529,898.98	821,933.30	-7,481,267.15	6,933.63	19,463,335.99
加权平均基金份额本期利润	0.1328	0.0311	0.0156	-0.0333	0.0352	0.0293
本期加权平均净值利润率	11.16%	2.62%	1.35%	-2.95%	3.29%	2.74%
本期	3.38%	3.24%	7.04%	6.95%	3.46%	3.17%

基金 份额 净值 增长 率						
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末 可供 分配 利润	2,318,446.57	6,512,006.80	14,295,549.28	42,699,841.84	9,724.82	20,695,849.38
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.1747	0.1685	0.1148	0.1105	0.0811	0.0779
期末 基金 资产 净值	15,993,481.43	46,328,887.77	145,159,042.20	448,922,522.54	130,682.69	288,610,549.23
期末 基金 份额 净值	1.2054	1.1991	1.1660	1.1615	1.0893	1.0860
3.1. 3 累 计期 末指 标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	24.11%	15.50%	20.05%	11.88%	12.15%	4.60%

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

平安鑫利混合 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	1.77%	0.27%	1.37%	0.23%	0.40%	0.04%
过去六个月	1.25%	0.37%	0.51%	0.31%	0.74%	0.06%
过去一年	3.38%	0.34%	2.34%	0.35%	1.04%	-0.01%
过去三年	14.48%	0.37%	28.37%	0.38%	-13.89%	-0.01%
过去五年	23.82%	0.36%	32.81%	0.35%	-8.99%	0.01%
自基金合同生效起至今	24.11%	0.36%	30.39%	0.35%	-6.28%	0.01%

平安鑫利混合 C

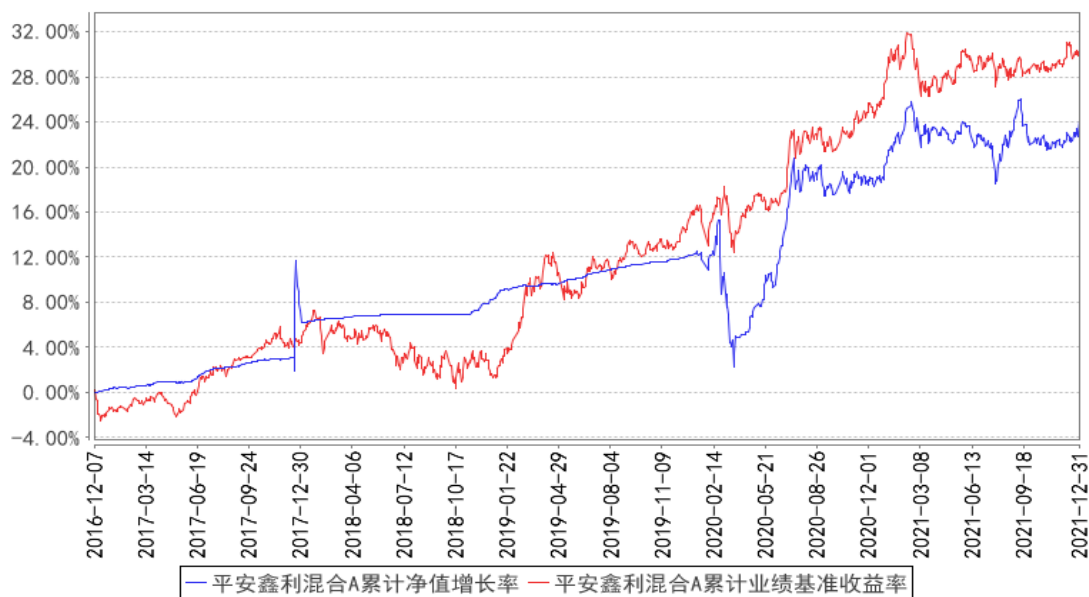
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.74%	0.27%	1.37%	0.23%	0.37%	0.04%
过去六个月	1.18%	0.37%	0.51%	0.31%	0.67%	0.06%
过去一年	3.24%	0.34%	2.34%	0.35%	0.90%	-0.01%



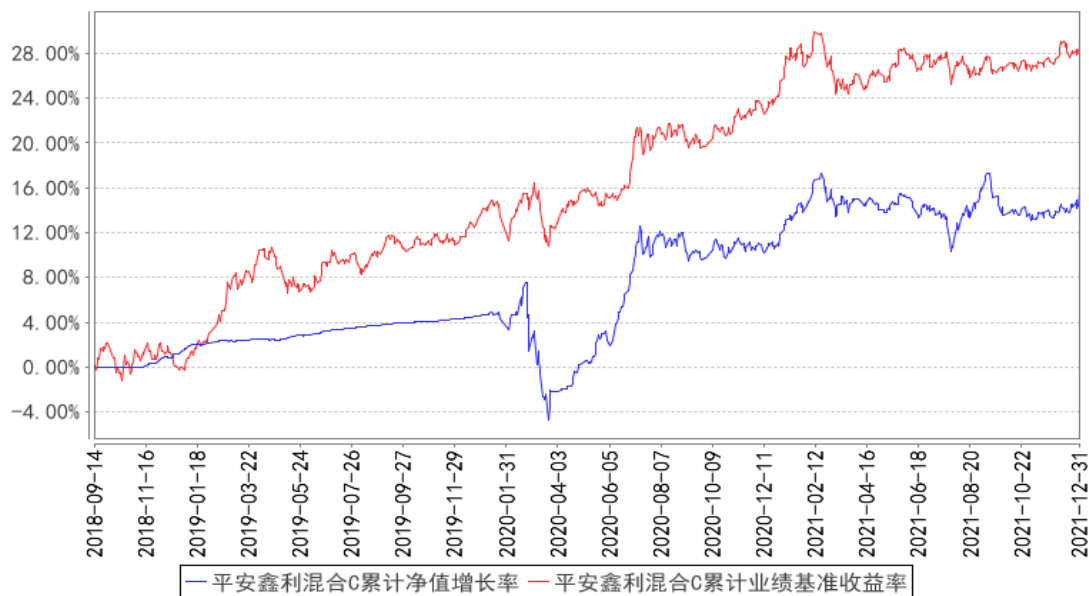
过去三年	13.92%	0.37%	28.37%	0.38%	-14.45%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	15.50%	0.35%	28.41%	0.39%	-12.91%	-0.04%

### 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

平安鑫利混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



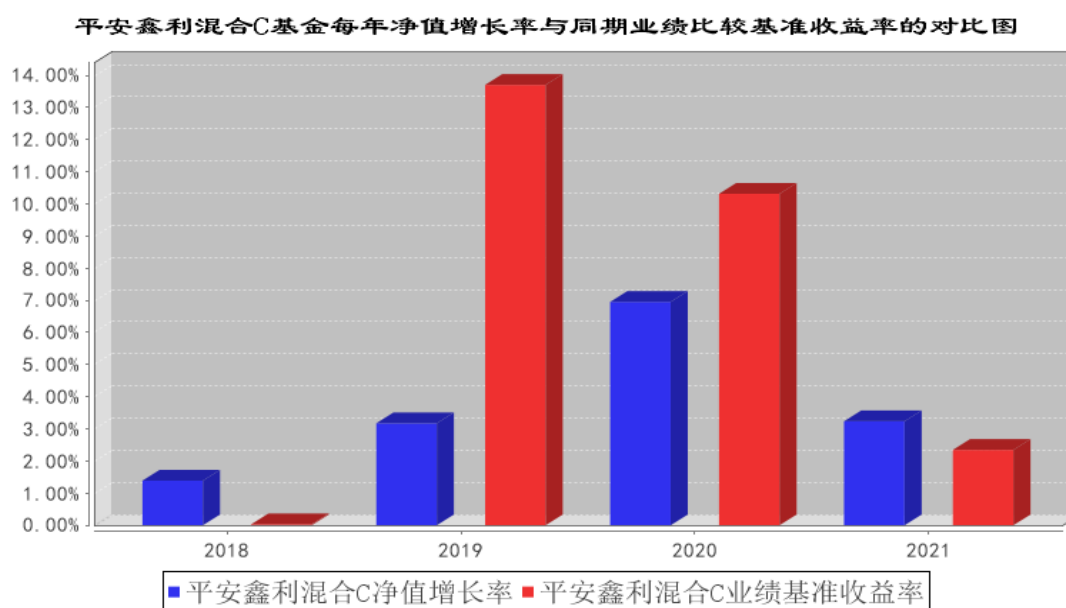
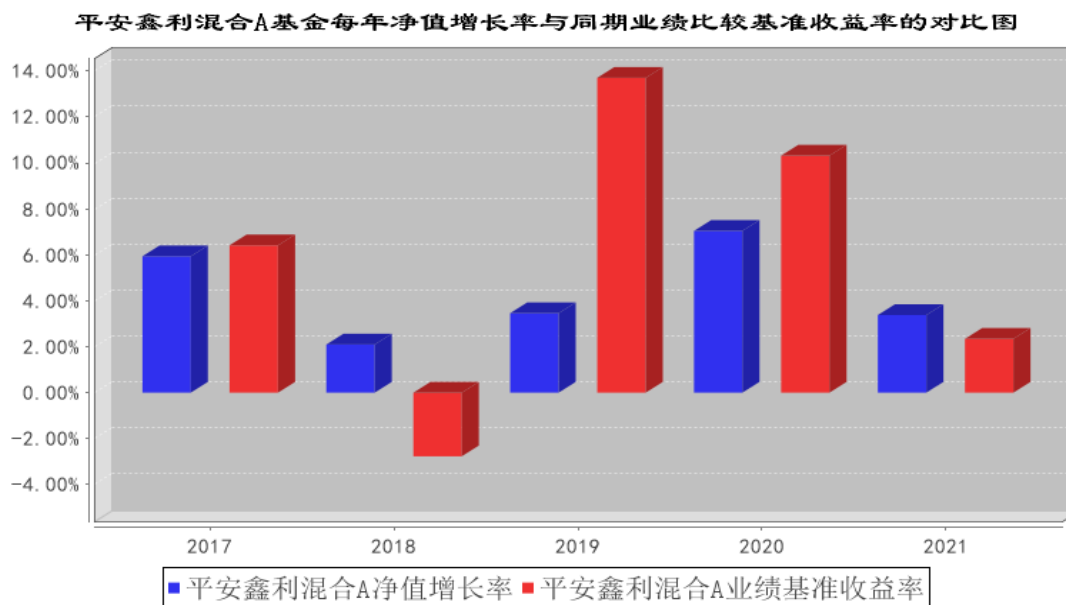
平安鑫利混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 7 日正式生效；
- 2、自 2018 年 9 月 14 日起增设 C 类份额；
- 3、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 过去五年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



注：本基金基金合同于 2016 年 12 月 7 日正式生效。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过往三年无利润分配情况。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。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 2021 年 12 月 31 日，平安基金共管理 158 只公募基金，公募资产管理总规模约为 4,561.10 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘杰	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020 年 11 月 30 日	-	14 年	刘杰先生，外交学院经济学硕士。曾先后担任金元证券投资银行部项目经理，天弘基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理，英大基金管理有限公司专户投资部投资经理、基金经理等。2017 年 8 月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资研究部投资经理。现担任平安行业先锋混合型证券投资基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金基金经理。
高勇标	固定收益投资中心总监助理，平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020 年 2 月 11 日	2021 年 3 月 30 日	11 年	高勇标先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017 年 4 月加入平安基金管理有限公司，曾任投资研究部固定收益组投资经理，现任固定收益投资中心总监助理，同时担任平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、平安瑞兴一年定期开放混合型

					证券投资基金、平安合润 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠润纯债债券型证券投资基金、平安惠合纯债债券型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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

权益方面，报告期本基金继续秉持一贯的投资策略——以价值型成长股作为投资重点，对市场空间大、盈利能力强、商业模式成熟、产品力突出、管理层优秀的行业龙头公司进行重点跟踪研究，实行买入并长期持有的投资策略。同时结合宏观经济、产业政策、行业景气、估值合理性等角度进行决策，以降低净值回撤及波动，力争为持有人创造持续且稳健的投资回报。本报告期的投资运作中继续执行上述投资策略，对估值更具吸引力且基本面逐步改善的板块及个股给予了更高重视并增加了配置。

实际运作中，由于在 2021 年初，对国内疫苗全面接种后疫情有效防控较为乐观，本组合中受疫情影响较大的可选消费、交通运输，以及大金融等板块持股相对较多。但受疫情防控复杂性及市场风格影响，全年上述品种表现一般。但展望未来，我们认为疫情终会得到有效控制，且质地良好且相对低估的行业及个股仍有价值回归机会。同时，在基金运作上进一步淡化行业及赛道属性，更多自下而上进行个股选择。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安鑫利混合 A 的基金份额净值 1.2054 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.38%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%；截至本报告期末平安鑫利混合 C 的基金份额净值 1.1991 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.24%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%。

#### 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 2022 年，国内外宏观经济运行在经历了疫情影响及货币宽松后，国内经济稳增长及外围经济控通胀的压力逐渐显现，同时疫情对全球生产生活影响逐步减弱。因此，自上而下，我们认为有长期投资逻辑且过去两年受疫情影响复苏较慢的行业存在修复空间；中观层面，国内经济稳增长压力对相关低估值板块将提供较好的业绩估值改善机会；微观层面，A 股市场整体估值水平合理，但分化仍较明显，因此结构性机会及个股机会仍然存在。因此我们认为几个方向值得重视：稳增长扩内需板块、基本面良好且业绩和估值均有提升空间的个股、以及有绝对收益属性的低估值高股息品种等。

#### 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

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。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、资本市场风险监控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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约

定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 21111 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	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了平安鑫利混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动

	情况。
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。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安鑫利混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>平安鑫利混合基金的基金管理人平安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估平安鑫利混合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，除非基金管理人管理层计划清算平安鑫利混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安鑫利混合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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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，就可能导致对平安鑫利混合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</p>



	<p>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鑫利混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 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>我们与基金管理人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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	郭素宏	李崇
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	20,541,981.12	21,428,040.36
结算备付金		116,528.64	7,882,457.16
存出保证金		96,146.81	191,811.84
交易性金融资产	7.4.7.2	38,830,326.97	560,330,060.39
其中：股票投资		28,823,326.97	127,812,443.73
基金投资		—	—
债券投资		10,007,000.00	432,517,616.66
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	20,000,000.00	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	177,074.02	6,142,312.75
应收股利		—	—
应收申购款		3,627.96	95,373.09
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		79,765,685.52	596,070,055.59
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		16,947,435.21	-
应付赎回款		118,885.07	926,887.69
应付管理人报酬		57,756.85	308,307.16
应付托管费		9,626.14	51,384.53
应付销售服务费		8,284.49	38,059.33
应付交易费用	7.4.7.7	112,987.27	454,479.20
应交税费		9,340.49	28,269.42
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,000.80	181,103.52
负债合计		17,443,316.32	1,988,490.85
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	51,905,440.09	511,011,277.35
未分配利润	7.4.7.10	10,416,929.11	83,070,287.39
所有者权益合计		62,322,369.20	594,081,564.74
负债和所有者权益总计		79,765,685.52	596,070,055.59

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 51,905,440.09 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.2054 元，A 类基金份额 13,268,467.02 份；下属 C 类基金份额净值 1.1991 元，C 类基金份额 38,636,973.07 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		12,718,055.58	-1,682,335.04
1. 利息收入		5,788,493.27	6,800,880.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	95,282.92	129,927.15
债券利息收入		5,583,289.65	6,233,056.55
资产支持证券利息收入		-	40,026.52
买入返售金融资产收入		109,920.70	397,869.95

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,023,357.86	-13,040,782.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,524,041.17	-4,643,088.78
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	451,232.59	-8,879,208.82
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	52,123.29
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,048,084.10	429,391.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,554,791.32	4,453,218.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	460,995.77	104,349.09
减：二、费用		3,538,244.99	4,976,998.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,467,405.18	1,884,999.60
2. 托管费	7.4.10.2.2	244,567.52	314,166.65
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	210,544.51	253,706.76
4. 交易费用	7.4.7.19	1,379,943.39	1,805,486.70
5. 利息支出		13,091.53	492,994.49
其中：卖出回购金融资产支出		13,091.53	492,994.49
6. 税金及附加		15,492.86	16,444.61
7. 其他费用	7.4.7.20	207,200.00	209,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,179,810.59	-6,659,333.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,179,810.59	-6,659,333.85

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	511,011,277.35	83,070,287.39	594,081,564.74

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,179,810.59	9,179,810.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-459,105,837.26	-81,833,168.87	-540,939,006.13
其中：1. 基金申购款	343,743,598.47	63,658,182.39	407,401,780.86
2. 基金赎回款	-802,849,435.73	-145,491,351.26	-948,340,786.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	51,905,440.09	10,416,929.11	62,322,369.20
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	265,867,210.84	22,874,021.08	288,741,231.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,659,333.85	-6,659,333.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	245,144,066.51	66,855,600.16	311,999,666.67
其中：1. 基金申购款	585,269,404.27	87,975,818.30	673,245,222.57
2. 基金赎回款	-340,125,337.76	-21,120,218.14	-361,245,555.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填	-	-	-

列)			
五、期末所有者 权益(基金净值)	511,011,277.35	83,070,287.39	594,081,564.74

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：

罗春风

林婉文

张南南

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

平安鑫利灵活配置混合证券投资基金(原名为平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)是根据原平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“平安大华鑫利定期开放基金”)《平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,由平安大华鑫利定期开放基金转型而来。原平安大华鑫利定期开放基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,原平安大华鑫利定期开放基金的第二次开放期自 2017 年 12 月 14 日起至 2017 年 12 月 20 日止,因在第二次开放期最后一日终触发本基金的转型条件,本基金自 2018 年 1 月 19 日起正式转型为平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金。

根据《平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府

债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:封闭期内股票资产占基金资产的比例

例范围为 0%-100%;债券资产占基金资产的比例范围为 0%-100%;开放期内或按照《基金合同》的约定,本基金转型为开放式基金后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%;投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。在封闭期内,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;开放期内或转型为开放式基金后,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 30%+中证综合债指数收益率 $\times$ 70%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款

项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最

近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产



支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

本基金的收益分配政策为：（1）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资者选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益登记日当日收市后计算的基金份额净值为基准转为基金份额进行再投资；（2）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；（3）每一基金份额享有同等分配权；（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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）本基金的基金管理人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）本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	20,541,981.12	21,428,040.36
定期存款	-	-
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	-	-
合计	20,541,981.12	21,428,040.36

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	27,873,319.49	28,823,326.97	950,007.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	10,007,400.00	-400.00
	合计	10,007,400.00	-400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	37,880,719.49	38,830,326.97	949,607.48
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	123,888,224.17	127,812,443.73	3,924,219.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	132,830,849.58	-430,232.92
	银行间市场	299,106,587.84	1,010,412.16
	合计	431,937,437.42	580,179.24
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	555,825,661.59	560,330,060.39	4,504,398.80

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

### 7.4.7.4 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 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,000,000.00	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

#### 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。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,359.14	3,086.41
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	52.40	3,547.10
应收债券利息	174,619.18	6,135,592.94
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	43.30	86.30
合计	177,074.02	6,142,312.75

### 7.4.7.6 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。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	110,924.77	447,436.74
银行间市场应付交易费用	2,062.50	7,042.46
合计	112,987.27	454,479.20

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.80	103.52
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	179,000.00	181,000.00
合计	179,000.80	181,103.52

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 平安鑫利混合 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	124,495,756.93	124,495,756.93
本期申购	43,897,312.29	43,897,312.29
本期赎回（以“-”号填列）	-155,124,602.20	-155,124,602.20
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	13,268,467.02	13,268,467.02

## 平安鑫利混合 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	386,515,520.42	386,515,520.42
本期申购	299,846,286.18	299,846,286.18
本期赎回（以“-”号填列）	-647,724,833.53	-647,724,833.53
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	38,636,973.07	38,636,973.07

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安鑫利混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,295,549.28	6,367,735.99	20,663,285.27
本期利润	2,949,400.73	700,510.88	3,649,911.61
本期基金份额交易产生的变动数	-14,926,503.44	-6,661,679.03	-21,588,182.47
其中：基金申购款	7,790,714.98	-1,159,476.57	6,631,238.41
基金赎回款	-22,717,218.42	-5,502,202.46	-28,219,420.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,318,446.57	406,567.84	2,725,014.41

平安鑫利混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42,699,841.84	19,707,160.28	62,407,002.12
本期利润	9,785,201.18	-4,255,302.20	5,529,898.98
本期基金份额交易产生的变动数	-45,973,036.22	-14,271,950.18	-60,244,986.40
其中：基金申购款	52,181,726.21	4,845,217.77	57,026,943.98
基金赎回款	-98,154,762.43	-19,117,167.95	-117,271,930.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,512,006.80	1,179,907.90	7,691,914.70

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	74,663.86	90,822.00
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	17,224.73	36,881.74
其他	3,394.33	2,223.41
合计	95,282.92	129,927.15

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	7,524,041.17	-4,643,088.78
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	7,524,041.17	-4,643,088.78

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	548,040,610.30	633,846,790.22
减：卖出股票成本总额	540,516,569.13	638,489,879.00
买卖股票差价收入	7,524,041.17	-4,643,088.78

#### 7.4.7.12.3 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证券出借差价收入。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖 债券（、债转股及债券 到期兑付）差价收入	451,232.59	-8,879,208.82
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	451,232.59	-8,879,208.82

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债	980,119,080.17	1,548,919,308.09



券到期兑付)成交总额		
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	965,256,867.48	1,538,696,618.40
减:应收利息总额	14,410,980.10	19,101,898.51
买卖债券差价收入	451,232.59	-8,879,208.82

#### 7.4.7.13.3 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。

#### 7.4.7.13.4 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。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	5,125,000.00
减:卖出资产支持证券成本总额	-	5,000,000.00
减:应收利息总额	-	72,876.71
资产支持证券投资收益	-	52,123.29

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 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。

##### 7.4.7.14.2 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。

##### 7.4.7.14.3 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。

##### 7.4.7.14.4 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。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 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。

##### 7.4.7.15.2 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。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,048,084.10	429,391.95
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	2,048,084.10	429,391.95

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-3,554,791.32	4,453,218.06
股票投资	-2,974,212.08	3,924,219.56
债券投资	-580,579.24	528,998.50
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	-3,554,791.32	4,453,218.06

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	460,995.37	103,790.14
基金转换费收入	0.40	558.95
合计	460,995.77	104,349.09

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减。赎回费计入基金资产的比例根据《平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》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。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,364,693.39	1,779,909.20
银行间市场交易费用	15,250.00	25,577.50
合计	1,379,943.39	1,805,486.70

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	52,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	207,200.00	209,200.00

#### 7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、基金销售机构
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构

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。

#### 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
平安证券	10,218,139.28	1.04	-	-

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

###### 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 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	7,267.83	1.04	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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 (%)
-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,467,405.18	1,884,999.60
其中：支付销售机构的客户维护费	171,815.33	646,416.16

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 0.60%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 × 0.60% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	244,567.52	314,166.65

注：支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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 × 0.10% / 当年天数。

##### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C	合计
陆基金	—	22,550.01	22,550.01
平安基金	—	130,506.92	130,506.92
平安人寿	—	860.94	860.94
平安银行	—	38.96	38.96
平安证券	—	8.16	8.16
合计	—	153,964.99	153,964.99

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C	合计
陆基金	-	233,691.84	233,691.84
平安基金	-	16,724.84	16,724.84
平安人寿	-	2,241.85	2,241.85
平安证券	-	79.73	79.73
合计	-	252,738.26	252,738.26

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 0.1% 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 × 0.1% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

平安鑫利混合 C

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)

平安汇通	17,746,001.60	45.9301	-	-
------	---------------	---------	---	---

#### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期	20,541,981.12	74,663.86	21,428,040.36	90,822.00

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
平安证券股份有限公司	605011	杭州热电	公开发行	525	3,239.25
平安证券股份有限公司	605162	新中港	公开发行	1,377	8,358.39
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2021 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	可流通日	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
301045	天禄科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-

		日								
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 28 日	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
688296	和达科技	2021 年 7 月 19 日	2022 年 1 月 27 日	新股锁定	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688701	卓锦股份	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股锁定	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	-
688722	同益中	2021 年 10 月 8 日	2022 年 4 月 19 日	新股锁定	4.51	10.19	3,687	16,628.37	37,570.53	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限



内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让

#### 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

注：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的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券（上年末：62.26%）。

#### 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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合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 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,541,981.12	-	-	-	20,541,981.12
结算备付金	116,528.64	-	-	-	116,528.64
存出保证金	96,146.81	-	-	-	96,146.81
交易性金融资产	10,007,000.00	-	-	28,823,326.97	38,830,326.97
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收利息	-	-	-	177,074.02	177,074.02
应收申购款	-	-	-	3,627.96	3,627.96
资产总计	50,761,656.57	-	-	29,004,028.95	79,765,685.52
负债					

应付赎回款	-	-	-	118,885.07	118,885.07
应付管理人报酬	-	-	-	57,756.85	57,756.85
应付托管费	-	-	-	9,626.14	9,626.14
应付证券清算款	-	-	-	16,947,435.21	16,947,435.21
应付销售服务费	-	-	-	8,284.49	8,284.49
应付交易费用	-	-	-	112,987.27	112,987.27
应交税费	-	-	-	9,340.49	9,340.49
其他负债	-	-	-	179,000.80	179,000.80
负债总计	-	-	-	17,443,316.32	17,443,316.32
利率敏感度缺口	50,761,656.57	-	-	11,560,712.63	62,322,369.20
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,428,040.36	-	-	-	21,428,040.36
结算备付金	7,882,457.16	-	-	-	7,882,457.16
存出保证金	191,811.84	-	-	-	191,811.84
交易性金融资产	392,827,616.66	39,690,000.00	-	127,812,443.73	560,330,060.39
应收利息	-	-	-	6,142,312.75	6,142,312.75
应收申购款	-	-	-	95,373.09	95,373.09
资产总计	422,329,926.02	39,690,000.00	-	134,050,129.57	596,070,055.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	926,887.69	926,887.69
应付管理人报酬	-	-	-	308,307.16	308,307.16
应付托管费	-	-	-	51,384.53	51,384.53
应付销售服务费	-	-	-	38,059.33	38,059.33
应付交易费用	-	-	-	454,479.20	454,479.20
应交税费	-	-	-	28,269.42	28,269.42
其他负债	-	-	-	181,103.52	181,103.52
负债总计	-	-	-	1,988,490.85	1,988,490.85
利率敏感度缺口	422,329,926.02	39,690,000.00	-	132,061,638.72	594,081,564.74

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

假设	除市场利率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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	1,192.73	467,804.15

	市场利率上升 25 个基点	-1,190.96	-465,412.78
--	---------------	-----------	-------------

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	28,823,326.97	46.25	127,812,443.73	21.51
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	28,823,326.97	46.25	127,812,443.73	21.51

##### 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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	708,027.78	7,960,818.74

	沪深 300 指数下降 5%	-708,027.78	-7,960,818.74
--	-------------------	-------------	---------------

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 28,566,367.12 元，属于第二层次的余额为 10,007,000.00 元，属于第三层次的余额为 256,959.85 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 127,454,616.52 元，第二层次 432,875,443.87 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

——权益工具投资

2021 年 1 月 1 日 -

购买 371,963.83

兑付 -

出售 -

转入第三层级 -

转出第三层级 -286,706.18

当期利得或损失总额 171,702.20

计入损益的利得或损失 171,702.20

2021 年 12 月 31 日 256,959.85

2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 171,702.20

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的第三层级的交易性金融资产(均为股票投资)公允价值为 256,959.85 元,采用平均价格亚式期权模型进行估值,不可观察输入值为预期波动率,与公允价值之间为负相关关系。

交易性金融资产

——资产支持证券投资

2020 年 1 月 1 日 5,000,000.00

购买 -

兑付 -

出售 -5,052,123.29

转入第三层级 -

转出第三层级 -

当期利得或损失总额 52,123.29

计入损益的利得或损失 52,123.29

2020 年 12 月 31 日 -

2020 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2020 年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 52,123.29

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

第三层次资产为在交易所挂牌转让的资产支持证券。根据中国证券投资基金业协会发布的《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》,本基金管理人认为上述资产支持证券的成本能够近似体现公允价值,因此上述资产支持证券公允价值根据成本确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	28,823,326.97	36.13
	其中：股票	28,823,326.97	36.13
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	10,007,000.00	12.55
	其中：债券	10,007,000.00	12.55
	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	20,000,000.00	25.07
	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	20,658,509.76	25.90
8	其他各项资产	276,848.79	0.35



9	合计	79,765,685.52	100.00
---	----	---------------	--------

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,042,416.00	1.67
C	制造业	13,115,016.20	21.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	651,713.80	1.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	308,736.00	0.50
H	住宿和餐饮业	1,782,066.00	2.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,030,246.11	1.65
J	金融业	5,724,069.32	9.18
K	房地产业	4,465,506.00	7.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	642,475.74	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	31,590.00	0.05
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	29,491.80	0.05
S	综合	-	-
	合计	28,823,326.97	46.25

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600048	保利发展	191,600	2,994,708.00	4.81
2	600919	江苏银行	310,900	1,812,547.00	2.91
3	600258	首旅酒店	68,200	1,782,066.00	2.86
4	601658	邮储银行	339,800	1,732,980.00	2.78
5	603369	今世缘	29,200	1,588,480.00	2.55
6	600487	亨通光电	103,500	1,564,920.00	2.51
7	600030	中信证券	57,400	1,515,934.00	2.43

8	600690	海尔智家	50,500	1,509,445.00	2.42
9	600383	金地集团	113,400	1,470,798.00	2.36
10	603611	诺力股份	61,000	1,183,400.00	1.90
11	603156	养元饮品	41,600	1,181,856.00	1.90
12	603558	健盛集团	96,000	1,130,880.00	1.81
13	603733	仙鹤股份	27,400	1,118,194.00	1.79
14	603727	博迈科	50,800	1,042,416.00	1.67
15	603239	浙江仙通	58,200	1,018,500.00	1.63
16	600036	招商银行	13,600	662,456.00	1.06
17	603908	牧高笛	15,600	647,400.00	1.04
18	601668	中国建筑	129,400	647,000.00	1.04
19	600566	济川药业	21,700	614,978.00	0.99
20	603357	设计总院	65,400	602,988.00	0.97
21	688369	致远互联	8,408	598,229.20	0.96
22	600702	舍得酒业	2,500	568,250.00	0.91
23	600285	羚锐制药	32,000	505,600.00	0.81
24	600718	东软集团	23,900	324,084.00	0.52
25	600004	白云机场	25,600	308,736.00	0.50
26	600085	同仁堂	6,800	305,864.00	0.49
27	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.17
28	688216	气派科技	2,000	99,300.00	0.16
29	688722	同益中	3,687	37,570.53	0.06
30	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.05
31	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.05
32	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.04
33	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.02
34	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.02
35	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.02
36	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.01
37	301059	金三江	259	4,998.70	0.01
38	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.01
39	301053	远信工业	155	4,460.90	0.01
40	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.01
41	601009	南京银行	17	152.32	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	002677	浙江美大	12,722,156.00	2.14
2	600258	首旅酒店	12,152,485.00	2.05
3	002353	杰瑞股份	11,460,850.89	1.93

4	002727	一心堂	10,277,479.00	1.73
5	600048	保利发展	9,051,888.00	1.52
6	002327	富安娜	8,473,531.00	1.43
7	601111	中国国航	8,451,870.36	1.42
8	000513	丽珠集团	7,702,736.76	1.30
9	601633	长城汽车	7,351,896.90	1.24
10	601658	邮储银行	7,350,557.00	1.24
11	600383	金地集团	7,238,957.71	1.22
12	002142	宁波银行	7,199,552.00	1.21
13	600066	宇通客车	6,649,347.34	1.12
14	000333	美的集团	6,561,276.00	1.10
15	002508	老板电器	6,512,284.00	1.10
16	000915	华特达因	6,497,499.00	1.09
17	601166	兴业银行	6,243,189.00	1.05
18	601601	中国太保	6,109,923.00	1.03
19	688089	嘉必优	6,067,089.56	1.02
20	300577	开润股份	6,044,340.81	1.02

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	600258	首旅酒店	14,874,624.26	2.50
2	002677	浙江美大	14,847,902.71	2.50
3	601633	长城汽车	12,472,771.19	2.10
4	000333	美的集团	11,173,355.92	1.88
5	002727	一心堂	11,149,069.00	1.88
6	002353	杰瑞股份	10,980,253.80	1.85
7	002508	老板电器	10,614,316.00	1.79
8	002142	宁波银行	10,593,885.18	1.78
9	000858	五粮液	9,675,840.00	1.63
10	000915	华特达因	9,568,711.70	1.61
11	000513	丽珠集团	9,380,457.89	1.58
12	600048	保利发展	9,076,410.40	1.53
13	601601	中国太保	8,813,787.83	1.48
14	600004	白云机场	8,579,590.04	1.44
15	600519	贵州茅台	8,444,874.55	1.42
16	002327	富安娜	8,077,999.23	1.36
17	601658	邮储银行	8,047,660.00	1.35
18	600754	锦江酒店	7,957,298.67	1.34
19	603369	今世缘	7,901,971.65	1.33
20	601111	中国国航	7,547,710.80	1.27

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	444,501,664.45
卖出股票收入（成交）总额	548,040,610.30

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,007,000.00	16.06
	其中：政策性金融债	10,007,000.00	16.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,007,000.00	16.06

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210206	21 国开 06	100,000	10,007,000.00	16.06

#### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无股指期货投资。

## 8.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.3 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

中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 25 日作出银保监罚决字〔2020〕72 号，由于中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“公司”）一、同业投资业务接受第三方金融机构信用担保；二、买入返售项下的金融资产不符合监管规定；三、信贷资产收益权转让业务接受交易对手兜底承诺；四、同业投资按照穿透原则对应至最终债务人未纳入统一授信管理；五、个别产业基金同业投资业务违规投向股权；六、同业投资投前调查不尽职；七、资金违规支付股票定向增发款；八、同业投资资金（通过置换方式）违规投向“四证”不全的房地产项目；九、债务性资金用作固定资产投资项目资本金；十、资金违规通过融资平台公司为地方政府融资；十一、未进行资金投向风险审查和合规性审查；十二、理财投资收益未及时确认为收入；十三、部分分行为非保本理财产品出具保本承诺；十四、出具与事实不符的理财投资清单；十五、投资权益类资产的理财产品违规面向一般个人客户销售；十六、理财投资接受第三方银行信用担保；十七、代客理财资金用于本行自营业务，未实现风险隔离；十八、理财产品相互交易，未实现风险隔离；十九、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易人为调节收益；二十、理财风险准备金用于期限错配引发的应收未收利息垫款；二十一、使用非代客资金为理财产品垫款；二十二、未在理财产品存续期内披露非标资产风险状况发生实质性变化的信息；二十三、未按照《保险兼业代理协议》约定收取代销手续费；二十四、债券承销与投资业务未建立“防火墙”制度；二十五、部分重要岗位人员未按照规定期限轮岗；二十六、未按规定披露代销产品信息。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第四十三条、第五十五条、第七十四条和相关审慎经营规则，做出罚款 4550 万元决定。

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 6 月 22 日作出银保监罚决字〔2021〕23 号处罚决定，

由于中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“公司”）一、违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费；二、未经客户同意违规办理短信收费业务；三、信息系统相关功能在开发、投产、维护、后评估等方面存在缺陷及不足；四、向监管机构报送材料内容不实；五、未在监管要求时限内报送材料；六、未按监管要求提供保存业务办理相关凭证。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、第四十七条和相关审慎经营规则《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，对方公司做出没收违法所得 11.401116 万元，罚款 437.677425 万元，罚没合计 449.078541 万元的决定。

中国人民银行于 2021 年 8 月 13 日作出银罚字（2021）16 号处罚决定，由于中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“公司”）违反账户管理相关规定，根据相关规定对公司罚款 600 万元。

国家外汇管理局北京外汇管理部于 2021 年 11 月 24 日作出京汇罚（2021）16 号处罚决定，由于中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“公司”）办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查的；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；违反外汇市场交易管理；未按照规定进行国际收支统计申报；未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料，根据相关规定对公司给予警告，没收违法所得 673625.55 元人民币，并处 444 万元人民币罚款。

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 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	96,146.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	177,074.02
5	应收申购款	3,627.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	276,848.79
---	----	------------

#### 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不存在流通受限情况。

#### 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（%）
平安鑫利混合 A	330	40,207.48	13,059,643.01	98.43	208,824.01	1.57
平安鑫利混合 C	1,342	28,790.59	34,306,405.67	88.79	4,330,567.40	11.21
合计	1,646	31,534.29	47,366,048.68	91.25	4,539,391.41	8.75

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	平安鑫利混合 A	16,656.12	0.1255
	平安鑫利混合 C	27,205.76	0.0704
	合计	43,861.88	0.0845

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	平安鑫利混合 A	0
	平安鑫利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安鑫利混合 A	0~10
	平安鑫利混合 C	0~10
	合计	0~10

## 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	平安鑫利混合 A	平安鑫利混合 C
基金合同生效日 （2016 年 12 月 7 日） 基金份额总额	200,058,990.97	—
本报告期期初基金份额总额	124,495,756.93	386,515,520.42
本报告期基金总申购份额	43,897,312.29	299,846,286.18
减：本报告期基金总赎回份额	155,124,602.20	647,724,833.53
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	13,268,467.02	38,636,973.07

## § 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

1. 2021 年 3 月 2 日，王金涛担任平安基金管理有限公司总经理助理。



2. 公司监事巢傲文先生因工作调动,经公司 2021 年 12 月 17 日召开的 2021 年第四次股东会审议,不再出任公司第四届监事会监事,并由许黎女士接替巢傲文先生任职公司的监事。
3. 2021 年 1 月 26 日,根据工作安排,陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日,平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁(主持工作)。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内,本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 5 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 50,000.00 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

本报告期内,本基金管理人、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	
东吴证券	2	154,721,960.42	15.70%	110,057.83	15.69%	-
华创证券	2	129,919,684.45	13.18%	92,413.48	13.18%	-
国泰君安证券	1	106,637,301.17	10.82%	75,847.93	10.82%	-
西部证券	1	97,045,226.26	9.85%	69,025.88	9.84%	新增 1 个
中信建投证券	2	61,039,360.21	6.19%	43,412.66	6.19%	-
申万宏源证券	2	55,119,299.00	5.59%	39,208.75	5.59%	-
东北证券	3	48,977,517.86	4.97%	34,833.09	4.97%	-

兴业证券	1	38,719,335.78	3.93%	27,541.18	3.93%	-
长江证券	1	38,449,473.32	3.90%	27,349.41	3.90%	-
国盛证券	1	37,947,895.39	3.85%	26,992.38	3.85%	-
中泰证券	1	37,257,602.48	3.78%	26,502.05	3.78%	-
安信证券	1	32,557,475.03	3.30%	23,157.52	3.30%	-
天风证券	2	26,575,376.76	2.70%	18,900.75	2.70%	-
光大证券	2	23,890,499.41	2.42%	16,993.08	2.42%	-
海通证券	2	20,073,836.10	2.04%	14,278.90	2.04%	-
国信证券	2	16,987,418.70	1.72%	12,083.57	1.72%	-
华泰证券	2	16,324,523.54	1.66%	11,611.29	1.66%	-
中信证券	3	13,984,439.68	1.42%	9,947.51	1.42%	-
平安证券	4	10,218,139.28	1.04%	7,267.83	1.04%	-
恒泰证券	2	9,631,656.69	0.98%	7,048.30	1.01%	-
开源证券	2	5,391,799.60	0.55%	3,835.11	0.55%	-
方正证券	2	4,127,265.70	0.42%	2,935.02	0.42%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-

西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	退租 2 个
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- （1）研究实力
- （2）业务服务水平
- （3）综合类研究服务对投资业绩贡献度
- （4）专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，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。

### 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
东吴证券	20,185,177.00	5.46%	162,000,000.00	21.72%	-	-
华创证券	3,003,372.00	0.81%	20,000,000.00	2.68%	-	-
国泰君安 证券	-	-	541,000,000.00	72.52%	-	-
西部证券	3,006,100.00	0.81%	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	10,000,000.00	1.34%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	27,742,742.80	7.50%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	25,798,239.30	6.98%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	289,943,900.00	78.43%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	3,000,000.00	0.40%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	10,000,000.00	1.34%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司 2020 年 12 月 31 日基金净值公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 01 日
2	平安基金管理有限公司关于平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 08 日
3	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 21 日
4	平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
5	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 12 日
6	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 30 日
7	平安鑫利灵活配置混合型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	2021 年 03 月 31 日
8	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 01 日
9	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 01 日
10	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 22 日
11	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 21 日
12	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
13	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
14	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 02 日
15	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	2021 年 06 月 24 日
16	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日
17	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日
18	平安基金管理有限公司关于旗下基金	中国证监会规定报刊及	2021 年 06 月 30 日

	投资关联方承销期内承销证券的公告	网站	
19	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 07 月 21 日
20	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 07 月 23 日
21	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 07 月 23 日
22	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 07 月 23 日
23	平安基金管理有限公司关于公司旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 07 月 23 日
24	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 07 月 23 日
25	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 02 日
26	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增诺亚正行基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 18 日
27	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增众惠基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 23 日
28	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 25 日
29	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 31 日
30	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大河财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 09 月 09 日
31	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富（北京）基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 09 月 14 日
32	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 09 月 23 日
33	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信百信银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 09 月 28 日
34	平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 10 月 27 日
35	平安基金管理有限公司关于新增国信	中国证监会规定报刊及	2021 年 11 月 09 日

	证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	网站	
36	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旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 11 月 12 日
37	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 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

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	2021/01/06—2021/01/10	77,258,992.19	—	77,258,992.19	—	—
	2	2021/01/26—2021/02/03	—	17,041,581.46	17,041,581.46	—	—
	3	2021/02/01—2021/02/03; 2021/12/28—2021/12/31	13,059,643.01	—	—	13,059,643.01	25.16
	4	2021/02/04—2021/08/25	—	84,012,433.84	84,012,433.84	—	—
	5	2021/03/31—2021/12/31	—	68,746,001.60	51,000,000.00	17,746,001.60	34.19
	6	2021/08/26—2021/10/26	—	43,454,719.28	43,454,719.28	—	—
	7	2021/12/27—2021/12/31	—	16,560,404.07	—	16,560,404.07	31.90
个人	—	—	—	—	—	—	—
产品特有风险							
<p>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</p>							

项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》和相关基金基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对本基金就引入侧袋机制事宜修订基金合同、托管协议等法律文件。修订自 2021 年 7 月 23 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 7 月 23 日发布的《平安基金管理有限公司关于公司旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修改基金合同部分条款的公告》

## § 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鑫利灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- （2）平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- （3）平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- （4）法律意见书
- （5）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 13.3 查阅方式

- （1）投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- （2）投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日