# 平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金
# 2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 19 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 平安鼎越混合 |
| 场内简称 | 平安鼎越 |
| 交易代码 | 167002 |
| 前端交易代码 | - |
| 后端交易代码 | - |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 9 月 20 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 63,243,899.75 份 |
| 投资目标 | 本基金转型为上市开放式基金（LOF）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。 |
| 投资策略 | 本基金转型为上市开放式基金（LOF）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，力争实现资产的长期稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50% |
| 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。 |
| 基金管理人 | 平安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（ 2019 年 1 月 1 日 － 2019 年 3 月 31 日 ） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -8,017,703.13 |
| 2.本期利润 | 15,144,302.86 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2107 |
| 4.期末基金资产净值 | 62,379,535.39 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9863 |

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.所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 本报告期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

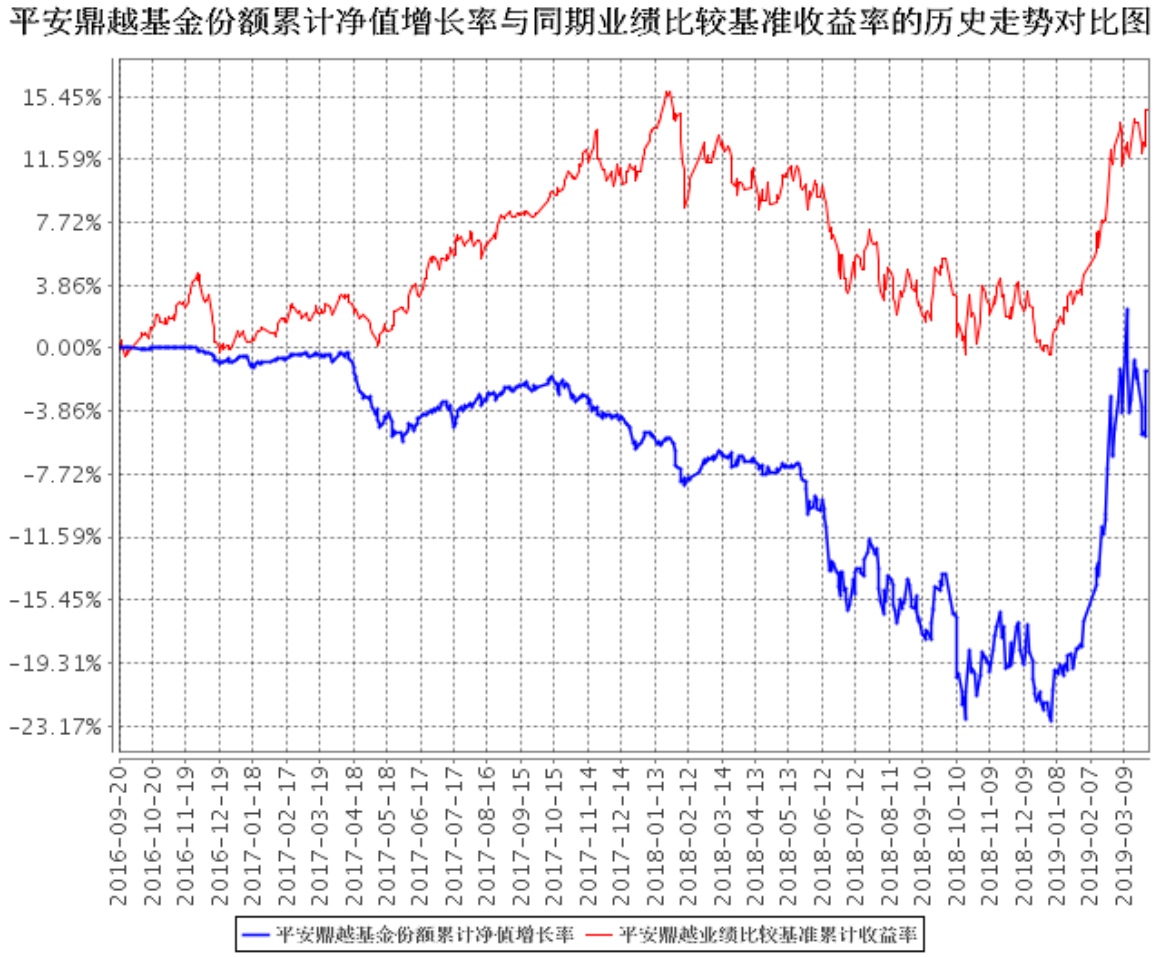
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 26.16% | 1.65% | 14.39% | 0.77% | 11.77% | 0.88% |

业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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




1、本基金基金合同于 2016 年 09 月 20 日正式生效，截至报告期末已满两年；

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合同约定。

## 3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘俊廷 | 平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2016 年 9 月 20 日 | - | 7 | 刘俊廷先生，中国科学院研究生院硕士。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。2014 年 12 月加入平安基金管理有限公司，现任平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安安盈保本混合型证券投资基金、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| WANG AO | 平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2018 年 3 月 16 日 | - | 6 | WANG AO 先生，澳大利亚籍，CAIA、FRM，CFA，澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士。曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012 年 9 月加入平安基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益研究员。现任平安鼎信债券型证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安惠裕债券型证券投资基金、平安添利 |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 债券型证券投资基金、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安双债添益债券型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
| 张俊生 | 权益投资中心投资副总监、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2018 年 12 月 4 日 | - | 12 | 张俊生先生，中国科学技术大学管理科学与工程专业硕士，曾先后担任广东发展银行政策分析主任、鹏华基金管理有限公司研究员、信达澳银基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理，深圳昱昇富德资产管理有限公司合伙人兼投资总监，上海华信证券有限责任公司权益投资部总经理。2018 年 10 月加入平安基金管理有限公司，现任权益投资中心投资副总监,同时担任平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度虽然宏观经济增速回落，但稳健的货币政策适度宽松，积极的财政政策更为积极，减税降费、新基建等逆周期调节举措逐步落实，同时发展资本市场和提高直接融资重要性明显上升，股市在经历了 2018 年的大幅下跌后，2019 年一季度迎来大幅反弹行情。

本基金基于一季度股市行情的相对乐观判断，一方面基金整体仓位保持在较高水平，重点配置了两方面主线:一是受益货币政策和监管环境边际改善的券商、地产等板块，另外，重点配置了符合政策扶持导向的新经济板块，如新能源，人工智能，工业互联网，物联网，5G，半导体，消费电子等板块，另外也适度配置了部分景气拐点明确的周期类行业比如养殖和部分基本面良好的消费类行业，取得了一定的投资效果。

展望二季度，我们保持谨慎乐观的判断。一方面逆周期政策调节因素会在二季度逐步落地，效果会逐步体现出来，经济下滑趋势会有所缓解。另一方面，由于一季度市场整体涨幅较大，悲观预期和行业估值已明显修复，随着年报季报期到来，行业和个股机会将会明显分化，整体估值修复的上涨行情可能逐步暂告段落，甚至阶段性也会出现有较明显的市场调整。但部分景气明确趋势向上，业绩超预期的行业和公司，或将会走出独立行情，也是后续我们重点挖掘的目标。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9863 元；本报告期基金份额净值增长率为 26.16%，业绩比较基准收益率为 14.39%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 57,637,966.64 | 87.04 |
| | 其中：股票 | 57,637,966.64 | 87.04 |
| 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 | 8,532,549.53 | 12.89 |
| 8 | 其他资产 | 48,653.39 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 66,219,169.56 | 100.00 |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 2,607,332.00 | 4.18 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 27,863,035.00 | 44.67 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 898,930.00 | 1.44 |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

| | | | |
|---|---|---|---|
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,713,377.44 | 12.37 |
| J | 金融业 | 5,688,838.00 | 9.12 |
| K | 房地产业 | 9,487,008.00 | 15.21 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,151,455.00 | 3.45 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,227,991.20 | 1.97 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 57,637,966.64 | 92.40 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 300498 | 温氏股份 | 64,220 | 2,607,332.00 | 4.18 |
| 2 | 300014 | 亿纬锂能 | 94,400 | 2,301,472.00 | 3.69 |
| 3 | 000063 | 中兴通讯 | 78,500 | 2,292,200.00 | 3.67 |
| 4 | 601155 | 新城控股 | 49,200 | 2,221,380.00 | 3.56 |
| 5 | 600383 | 金地集团 | 161,300 | 2,217,875.00 | 3.56 |
| 6 | 002127 | 南极电商 | 187,900 | 2,151,455.00 | 3.45 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 77,800 | 1,927,884.00 | 3.09 |
| 8 | 600703 | 三安光电 | 119,300 | 1,750,131.00 | 2.81 |
| 9 | 300232 | 洲明科技 | 116,400 | 1,662,192.00 | 2.66 |
| 10 | 300601 | 康泰生物 | 29,000 | 1,644,300.00 | 2.64 |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

## 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

洲明科技，2018 年 10 月 9 日公告，收到深交所监管函：公司 2018 年半年报显示，报告期内计提资产减值准备 2884.00 万元，占 2017 年度经审计净利润的 10.14%。公司未按照《创业板信息披露业务备忘录第 10 号：定期报告披露相关事项》的要求履行董事会审议程序及相关信息披露义务。公司上述行为违反了《创业板上市规则（2018 年修订）》第 1.4 条、2.6 条、11.11.3 条，《创业板上市公司规范运作指引（2015 年修订）》第 1.3 条、2.3.1 条的规定。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该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。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 5.11.2

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股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 35,872.70 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,219.49 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,635.09 |
| 5 | 应收申购款 | 4,926.11 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 48,653.39 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 76,905,231.65 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 211,608.47 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 13,872,940.37 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 63,243,899.75 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

（2）平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金合同

（3）平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金托管协议

（4）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（5）平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告原文

## 8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

## 8.3 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

2019 年 4 月 19 日



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn