

平安智能生活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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 19 日

## § 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。

基金托管人中国建设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	平安智能生活混合	
场内简称	-	
交易代码	002598	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 6 月 8 日	
报告期末基金份额总额	30,959,776.44 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，重点投资与智能生活主题相关的优质证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取“灵活资产配置、主动投资管理”的投资策略，一方面通过大类资产配置，降低系统性风险，把握市场波动中的投资机会；另一方面利用平安基金研究平台优势，重点研究、投资与智能生活主题相关的证券资产，构建在中长期能够从经济转型、产业升级中受益的投资组合。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%	
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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安智能生活混合 A	平安智能生活混合 C

下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	002598	002599
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	30,282,444.11 份	677,332.33 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### § 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）	
	平安智能生活混合 A	平安智能生活混合 C
1. 本期已实现收益	1,434,974.74	33,144.30
2. 本期利润	4,004,163.96	94,286.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1288	0.1265
4. 期末基金资产净值	23,101,448.98	514,515.82
5. 期末基金份额净值	0.763	0.760

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

平安智能生活混合 A

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	20.35%	0.99%	17.14%	0.93%	3.21%	0.06%

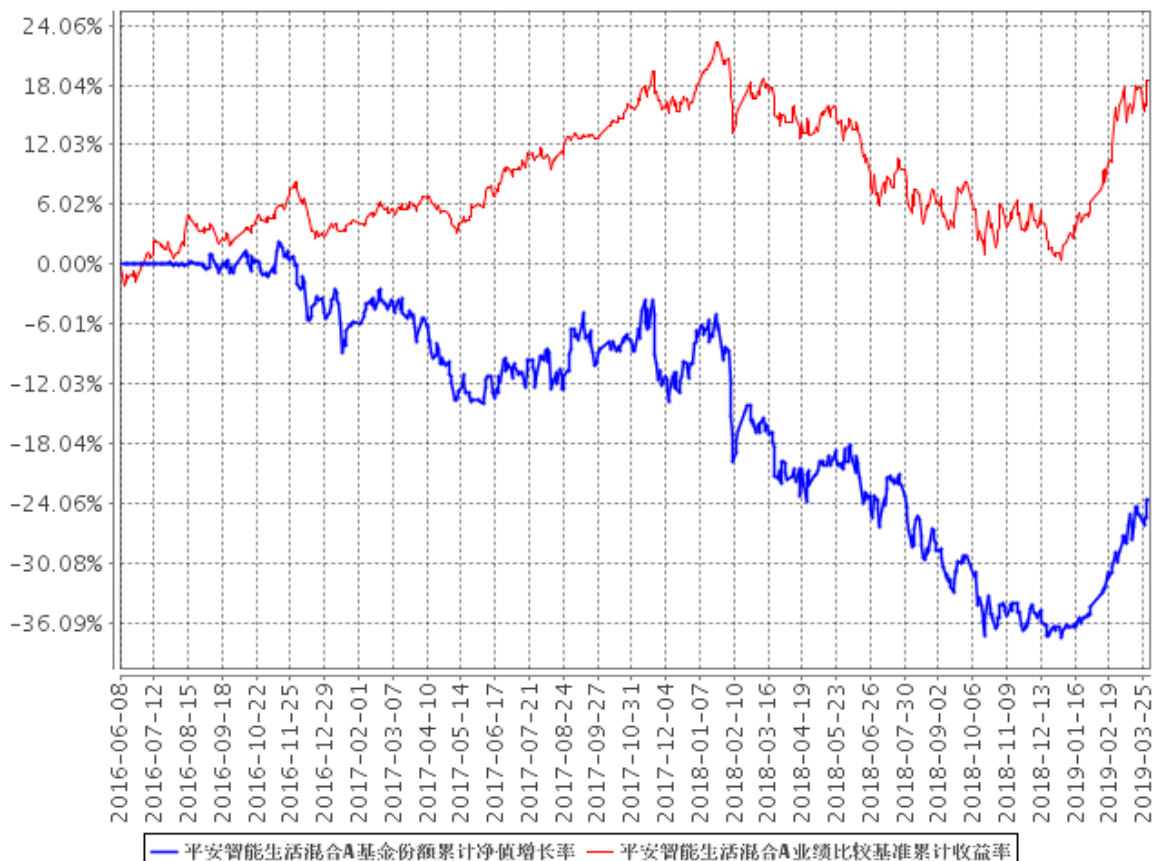
平安智能生活混合 C

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	20.25%	0.98%	17.14%	0.93%	3.11%	0.05%

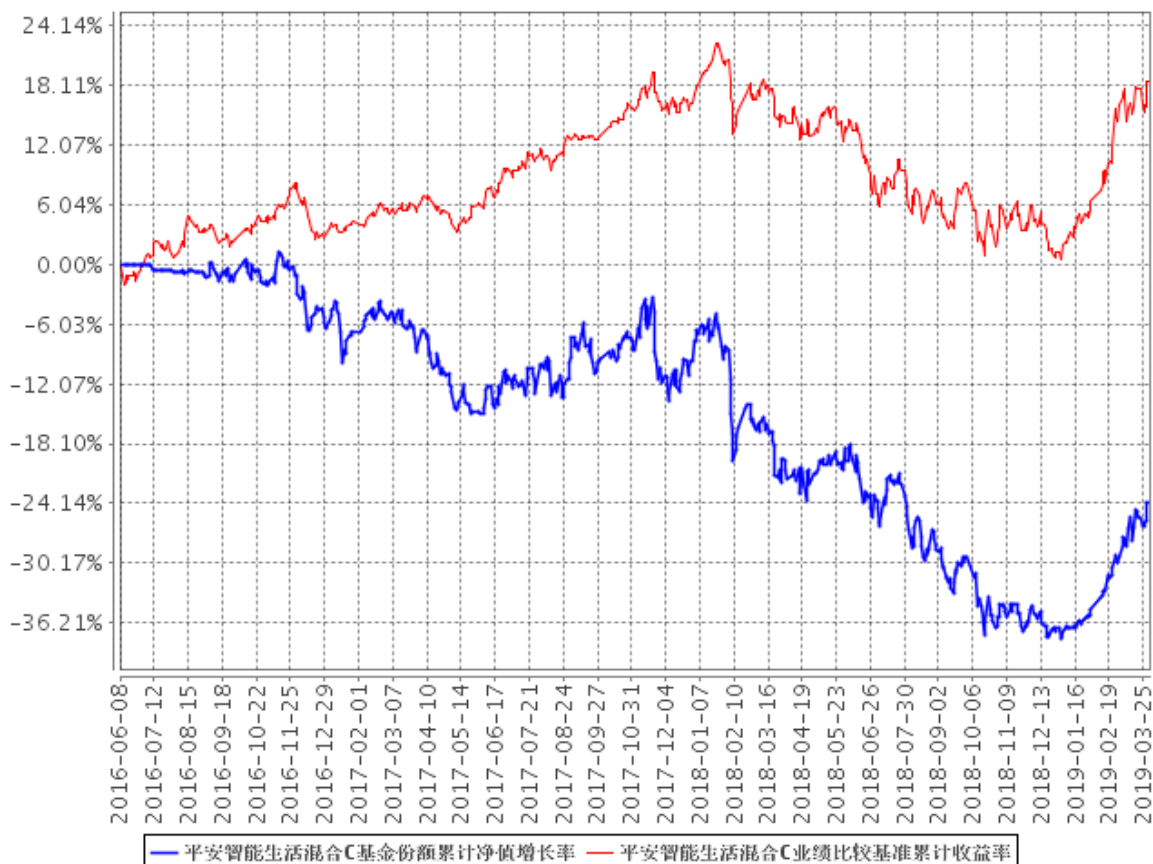
业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*60%+中证综合债指数收益率\*40%

### 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

平安智能生活混合A基金份额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



平安智能生活混合C基金份额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



- 1、本基金基金合同于 2016 年 6 月 8 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。

## § 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		
刘杰	平安智能生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018 年 4 月 23 日	-	10	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。现担任平安智能生活灵活配置混合型证券投资基金、平安行业先锋混合型证券投资基金、平安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合规守信情况的说明

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、《平安智能生活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

2019 年中国宏观经济运行虽仍面临一定程度的内外部压力，但应看到国内改革开放与减税降费将继续推进，国际层面贸易摩擦有望逐步缓解，对内改革与对外开放仍将为我国经济创造持续发展契机。因此我们对于中国经济的发展潜力、抵御周期性波动的韧性、以及未来的市场走势都并不悲观。

本报告期本基金继续秉持我们的投资策略——寻找有投资价值和穿越周期能力的投资标的，重点关注成长型价值股，对市场空间大、盈利能力强、管理层优秀的优质个股进行重点研究及配置。以“买入持有”作为基本投资策略，通过长期持股来获得持续回报，并结合宏观经济、产业政策、行业景气、估值合理性、财务稳健性等角度，动态调整投资组合中的个股权重。

本报告期的组合运作中，我们继续坚持上述投资策略，并结合行业景气程度与估值合理性等因素，阶段性加大了耐用消费品、农业、医药、食品饮料等板块的持股权重。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安智能生活混合 A 基金份额净值为 0.763 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.35%；截至本报告期末平安智能生活混合 C 基金份额净值为 0.760 元，本报告期基金份额净值增长率为 20.25%；同期业绩比较基准收益率为 17.14%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。截止本报告期末，以上情形未消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

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 人的情况。

## § 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	16,000,183.16	67.11
	其中：股票	16,000,183.16	67.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,018,695.10	4.27
	其中：债券	1,018,695.10	4.27
	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	6,532,412.15	27.40
8	其他资产	291,197.82	1.22
9	合计	23,842,488.23	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	1,658,346.80	7.02
B	采矿业	658,896.00	2.79
C	制造业	10,478,524.00	44.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	810,327.00	3.43
G	交通运输、仓储和邮政业	317.80	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	434,558.56	1.84
K	房地产业	1,095,145.00	4.64
L	租赁和商务服务业	857,018.00	3.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-



0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,050.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	16,000,183.16	67.75

### 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投资港股通股票。

### 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	002311	海大集团	32,400	913,680.00	3.87
2	300498	温氏股份	20,238	821,662.80	3.48
3	603708	家家悦	32,900	810,327.00	3.43
4	600887	伊利股份	27,200	791,792.00	3.35
5	600612	老凤祥	16,300	723,720.00	3.06
6	603369	今世缘	24,100	691,670.00	2.93
7	600547	山东黄金	21,200	658,896.00	2.79
8	600161	天坛生物	25,100	630,010.00	2.67
9	002124	天邦股份	34,400	601,312.00	2.55
10	002508	老板电器	17,900	576,380.00	2.44

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	585,674.40	2.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	433,020.70	1.83
	其中：政策性金融债	433,020.70	1.83
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	1,018,695.10	4.31

**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**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019547	16 国债 19	6,320	585,674.40	2.48
2	108602	国开 1704	4,270	433,020.70	1.83

**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**

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

**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**

本基金本报告期末无贵金属投资。

**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**

本基金本报告期末无权证投资。

**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**

本基金本报告期末无股指期货投资。

**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**

本基金本报告期末无国债期货持仓。

### 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

天邦食品股份有限公司（以下简称“公司”）于 2018 年 9 月 5 日发布《关于子公司收到环境保护局行政处罚决定书的公告》，披露公司子公司桂宏养殖有限公司收到当地环境保护局出具的行政处罚决定书，有排放污水超标及猪场的污水处理系统未正常使用的行为。当地环保局依据《中华人民共和国水污染防治法》第八十三条第二、三款的规定予以处罚人民币五十万元整；公司 2019 年 3 月 2 日发布《关于收到宁波证监局行政监管措施决定书的公告》，公告称存在对收购中国动物保健品有限公司（00940.HK）过程中对于其被取消上市地位及除牌的进展情况未持续披露，以及对其股权计提资产减值准备的依据披露不完整等情况。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	20,346.69
2	应收证券清算款	250,882.07
3	应收股利	-
4	应收利息	19,179.56
5	应收申购款	789.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	291,197.82

**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。

**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

项目	平安智能生活混合 A	平安智能生活混合 C
报告期期初基金份额总额	32,287,595.60	780,127.95
报告期期间基金总申购份额	333,730.70	154,684.45
减：报告期期间基金总赎回份额	2,338,882.19	257,480.07
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	30,282,444.11	677,332.33

**§ 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智能生活灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安智能生活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
- (5) 平安智能生活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