

# 平安优势产业灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年第 1 季度报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 4 月 22 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 04 月 21 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 2020 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	平安优势产业混合
基金主代码	006100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 8 月 22 日
报告期末基金份额总额	452,898,138.14 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过把握中国经济转型过程中产业升级、消费升级的投资机会、充分利用研究投资优势，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究。通过综合考虑相关类别资产的风险收益水平及市场走势，结合经济、金融的政策调整、环境改变及其发展趋势，动态调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例，优化投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%

风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安优势产业混合 A	平安优势产业混合 C
下属分级基金的交易代码	006100	006101
报告期末下属分级基金的份额总额	202,711,716.42 份	250,186,421.72 份

### § 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（2020年1月1日-2020年3月31日）	
	平安优势产业混合 A	平安优势产业混合 C
1. 本期已实现收益	43,558,923.44	34,522,580.36
2. 本期利润	62,317,038.97	-9,709,727.45
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1406	-0.0369
4. 期末基金资产净值	273,556,908.11	332,375,239.31
5. 期末基金份额净值	1.3495	1.3285

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

平安优势产业混合 A

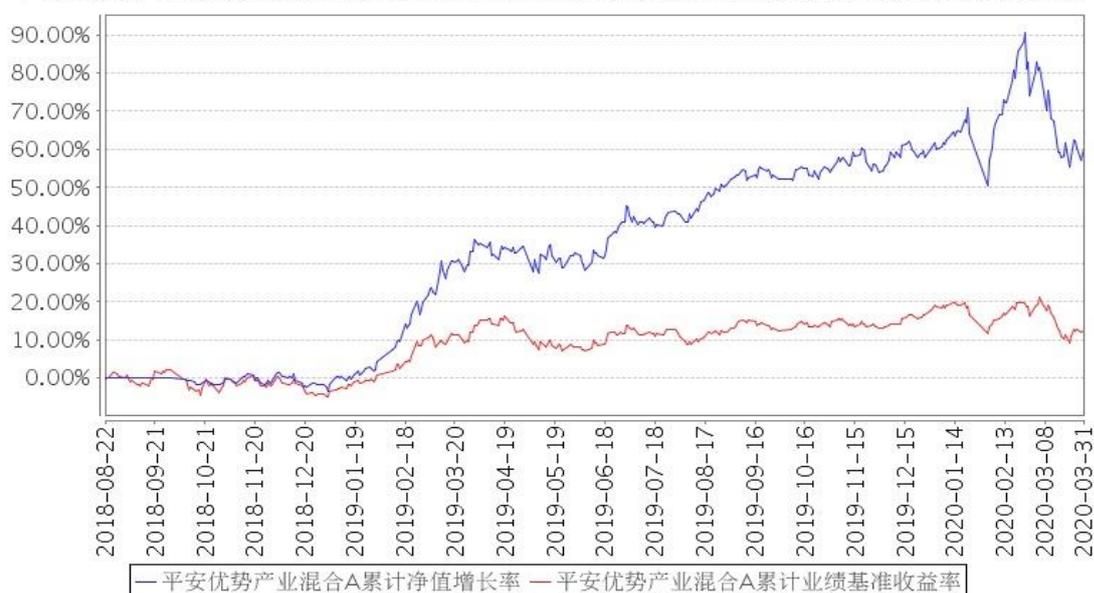
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.17%	2.44%	-4.77%	1.15%	4.60%	1.29%

平安优势产业混合 C

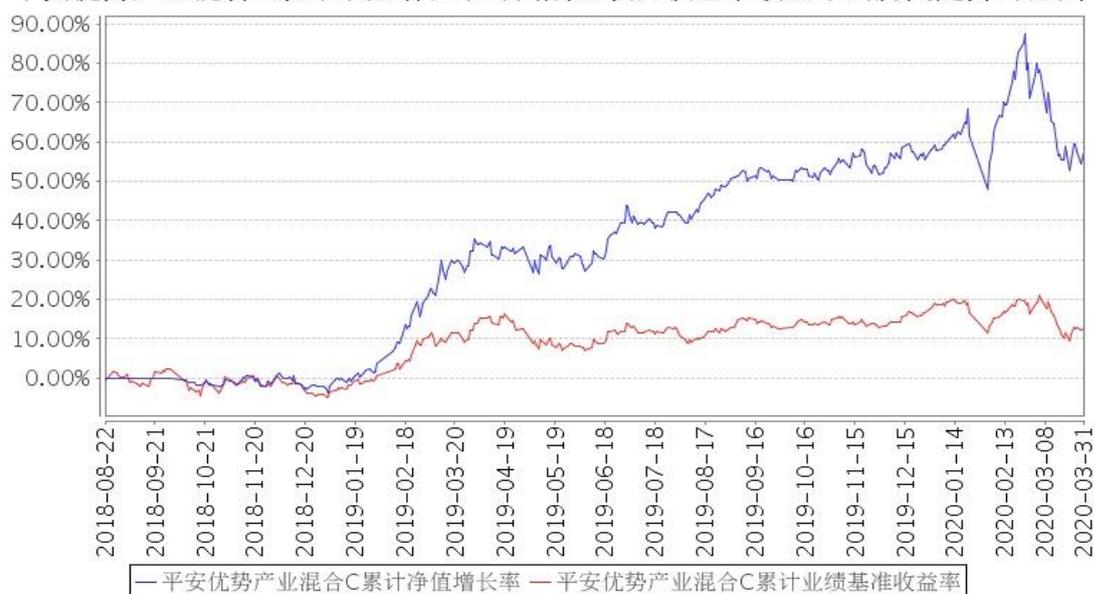
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.38%	2.44%	-4.77%	1.15%	4.39%	1.29%

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

平安优势产业混合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



平安优势产业混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2018 年 08 月 22 日正式生效；

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.3 其他指标

注：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		
黄维	平安优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2018年8月22日	-	9年	黄维先生，北京大学微电子学硕士。曾先后任广发证券股份有限公司研究员、广发证券资产管理（广东）有限公司投资经理。2016年5月加入平安基金管理有限公司，现任平安睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金、平安优势产业灵活配置混合型证券投资基金、平安安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安匠心优选混合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。

#### 4.2 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、《平安优势产业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

新冠肺炎疫情在全球蔓延，短期对经济产生一定负面冲击，但从中长期看消费升级和产业升级趋势不可逆转，而且龙头企业由于具备更强的抗风险能力，其市场份额有望逆势扩张，因此本产品配置思路紧密围绕上述两条主线，自下而上精选优质个股，注重其业绩确定性以及估值匹配度，同时关注其长期成长空间。

展望后市，我们认为聚焦盈利成长确定性的格局不会改变，我们将围绕消费、医药、科技创新和高端制造等主线，继续挖掘估值合适及质地优秀的投资标的。在盈利驱动的市场结构中，成长确定的个股将有望带来良好的投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安优势产业混合 A 的基金份额净值为 1.3495 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.17%；截至本报告期末平安优势产业混合 C 的基金份额净值为 1.3285 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.38%；同期业绩比较基准收益率为-4.77%。

#### 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 5,000 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	530,548,096.51	85.36
	其中：股票	530,548,096.51	85.36
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	88,185,649.01	14.19
8	其他资产	2,829,099.90	0.46
9	合计	621,562,845.42	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	337,128,176.63	55.64
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	29,779,596.00	4.91
G	交通运输、仓储和邮政业	15,770,039.73	2.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	110,280,652.27	18.20
J	金融业	-	-
K	房地产业	19,558,469.00	3.23
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业		-
N	水利、环境和公共设施管理业		-
O	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作	18,031,162.88	2.98
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		-
	合计	530,548,096.51	87.56

### 5.2.2 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。

### 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	600519	贵州茅台	29,500	32,774,500.00	5.41
2	603233	大参林	472,692	29,779,596.00	4.91
3	000860	顺鑫农业	454,473	27,900,097.47	4.60
4	002007	华兰生物	561,522	26,908,134.24	4.44
5	300188	美亚柏科	1,318,131	26,797,603.23	4.42
6	002311	海大集团	661,609	26,596,681.80	4.39
7	600570	恒生电子	281,644	24,756,507.60	4.09
8	001914	招商积余	829,100	19,558,469.00	3.23
9	600763	通策医疗	167,296	18,031,162.88	2.98
10	002050	三花智控	1,089,890	17,514,532.30	2.89

### 5.4 报告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。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：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

注：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

注：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

本基金本报告期无国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本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。

### 5.11.2 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	699,072.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,550.45
5	应收申购款	2,114,476.67

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,829,099.90

#### 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

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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	平安优势产业混合 A	平安优势产业混合 C
报告期期初基金份额总额	31,614,781.53	288,298,339.80
报告期期间基金总申购份额	1,054,630,047.84	210,083,159.71
减：报告期期间基金总赎回份额	883,533,112.95	248,195,077.79
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	202,711,716.42	250,186,421.72

## § 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

注：无

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：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优势产业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安优势产业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) 平安优势产业灵活配置混合型证券投资基金 2020 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

2020 年 4 月 22 日