

平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发  
起式基金中基金（FOF）  
2020 年第 2 季度报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 月 21 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07月20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04月01日起至06月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）	
基金主代码	008461	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年12月27日	
报告期末基金份额总额	67,661,678.65份	
投资目标	本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，通过基金组合管理，在严格控制投资风险和保障资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金在大类资产配置的基础上，精选具有投资价值的基金，获取超越基准的超额收益，在严格控制风险的前提下，追求基金长期资产增值。	
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中债新综合指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金是混合型基金中基金，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、债券型基金中基金、货币型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金将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。	
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	平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）A	平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	008461	008462

报告期末下属分级基金的份额总额	16,981,613.65 份	50,680,065.00 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4月1日-2020年6月30日）	
	平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）A	平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）C
1. 本期已实现收益	1,662,568.36	5,439,024.73
2. 本期利润	4,533,662.86	15,533,262.40
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2617	0.2520
4. 期末基金资产净值	21,099,346.75	62,808,401.92
5. 期末基金份额净值	1.2425	1.2393

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

平安盈丰积极配置三个月持有期混合型（FOF）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	26.81%	1.02%	10.71%	0.74%	16.10%	0.28%
过去六个月	24.10%	1.40%	3.56%	1.24%	20.54%	0.16%
自基金合同生效起至今	24.25%	1.38%	4.86%	1.23%	19.39%	0.15%

平安盈丰积极配置三个月持有期混合型（FOF）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	26.81%	1.02%	10.71%	0.74%	16.10%	0.28%
过去六个月	24.10%	1.40%	3.56%	1.24%	20.54%	0.16%
自基金合同生效起至今	24.25%	1.38%	4.86%	1.23%	19.39%	0.15%

过去三个月	26.64%	1.02%	10.71%	0.74%	15.93%	0.28%
过去六个月	23.79%	1.40%	3.56%	1.24%	20.23%	0.16%
自基金合同生效起至今	23.93%	1.38%	4.86%	1.23%	19.07%	0.15%

### 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

平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）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



平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）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、本基金合同于2019年12月27日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；  
2、截止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		
代宏坤	资产配置事业部 FOF 投资中心投资执行总经理，平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理	2019年12月27日	-	11年	代宏坤先生，四川大学企业管理博士研究生。曾先后担任四川大学教师、上海国际集团博士后研究员、上海证券有限责任公司首席分析师、上海苍石资产管理有限公司投资总监、大泰金石投资管理有限公司副总经理。2017年1月加入平安基金管理有限公司，现任资产配置事业部 FOF 投资中心投资执行总经理，同时担任平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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、《平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，“新冠肺炎”疫情继续在全球扩散，国内局部地区也时有感染者出现，并造成了小范围的传播，但国内抗疫形势总体上缓和，积极复产复工的工作重心不变，政府推出了相应的政策来帮助企业改善经营状况，国内经济复苏的力度较强。

在此背景下，国内股票市场在二季度走出强劲的反弹行情。沪深 300 指数，创业板指数、中小板指数整体上涨，尤其是创业板指数涨幅更大，全面收复 3 月份市场的跌幅。市场结构性的行情继续发展，尤其是医药、消费类基金涨幅巨大，而低估值的板块表现一般。二季度整体上成长风格的基金比价值型的基金表现更好。

该基金在一季度末看好市场在二季度的反弹机会，保持了较高的仓位，并偏向成长风格基金，持有科技、消费和医药类基金。随着市场反弹，降低了部分基金的仓位，并且适度仓位向价值型基金转向，使组合的风格更加均衡。

展望三季度，我们认为 A 股市场仍具有吸引力，市场仍然会呈现出结构化的行情，不同板块的走势或有所收敛。部分板块风险释放的压力较大，低估值板块的吸引力加大，市场风格或会发生转换。我们秉承价值投资理念，在保持一个相对分散化的均衡组合的基础上，积极把握不同风格基金的投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安盈丰积极配置三个月持有期混合型（FOF）A 的基金份额净值为 1.2425 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.81%，截至本报告期末平安盈丰积极配置三个月持有期混合型（FOF）C 的基金份额净值为 1.2393 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.64%，同期业绩比较基准收益率为 10.71%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	67,064,693.33	79.01
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	12,262,462.13	14.45
8	其他资产	5,559,187.35	6.55
9	合计	84,886,342.81	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

注：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

注：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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,650,000.00



3	应收股利	-
4	应收利息	877.65
5	应收申购款	3,908,309.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,559,187.35

#### 5.11.4 报告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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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 基金中基金

### 6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	001513	易方达信息产业混合	契约型开放式	6,779,285.55	15,822,852.47	18.86	否
2	000751	嘉实新兴产业股票	契约型开放式	3,084,935.76	13,422,555.49	16.00	否
3	000083	汇添富消费行业混合	契约型开放式	2,067,457.88	12,822,373.77	15.28	否
4	000251	工银金融地产混合	契约型开放式	4,031,830.67	8,644,244.96	10.30	否
5	004851	广发医疗保健股票	契约型开放式	1,976,700.12	5,997,308.16	7.15	否
6	450009	国富中小盘股票	契约型开放式	2,826,916.24	5,241,102.71	6.25	否
7	001072	华安智能装备主题股票	契约型开放式	1,628,109.74	2,731,968.14	3.26	否

8	110022	易方达消费行业股票	契约型开放式	701,911.50	2,382,287.63	2.84	否
---	--------	-----------	--------	------------	--------------	------	---

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2020年4月1日至2020年6月30日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	9,732.43	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	392,141.73	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	285,929.01	-
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	47,654.95	-
当期交易基金产生的转换费(元)	74,410.53	-

## 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见的那个重大影响事件。

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安盈丰积极配置三个月持有期混合型（FOF）A	平安盈丰积极配置三个月持有期混合型（FOF）C
报告期期初基金份额总额	21,634,416.25	98,680,718.13
报告期期间基金总申购份额	4,859,076.16	14,495,198.24
减：报告期期间基金总赎回份额	9,511,878.76	62,495,851.37
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	16,981,613.65	50,680,065.00

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	平安盈丰积极配置三个月持有期混合型（FOF）A	平安盈丰积极配置三个月持有期混合型（FOF）C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,350.14	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-

报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,350.14	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	58.90	-

## 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## § 9 报告期末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	10,001,350.14	14.78	10,000,000.00	14.78	3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	10,001,350.14	14.78	10,000,000.00	14.78	3年

## § 10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 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

注：无。

### 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）设立的文件
- (2) 平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同
- (3) 平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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) 平安盈丰积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2020年第2季度报告  
原文

## 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

## 11.3 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7月21日