

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）
2021 年第 1 季度报告

2021 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：2021 年 4 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 2021 年 04 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 2021 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	77,649,490.26 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	24,303,958.41 份	53,345,531.85 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（2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 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	3,037,180.53	6,392,633.24
2. 本期利润	-1,104,333.24	-2,919,366.41
3. 加权平均基金份额 本期利润	-0.0469	-0.0570
4. 期末基金资产净值	35,442,689.54	77,305,497.59
5. 期末基金份额净值	1.4583	1.4491

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. 本基金 T 日的基金份额净值在所投资基金披露净值或万份收益的当日（法定节假日顺延至第一个交易日）计算，并于 T+3 日公告。

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

平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）A

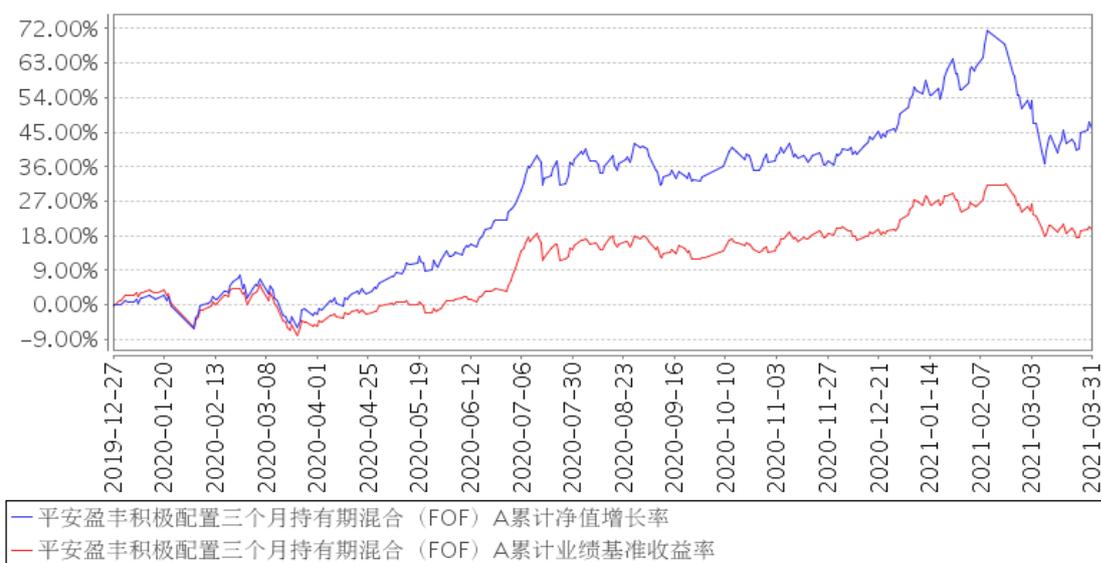
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.64%	1.85%	-2.13%	1.19%	-0.51%	0.66%
过去六个月	9.05%	1.48%	6.58%	1.01%	2.47%	0.47%
过去一年	48.84%	1.37%	26.24%	1.03%	22.60%	0.34%
自基金合同 生效起至今	45.83%	1.43%	19.57%	1.16%	26.26%	0.27%

平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）C

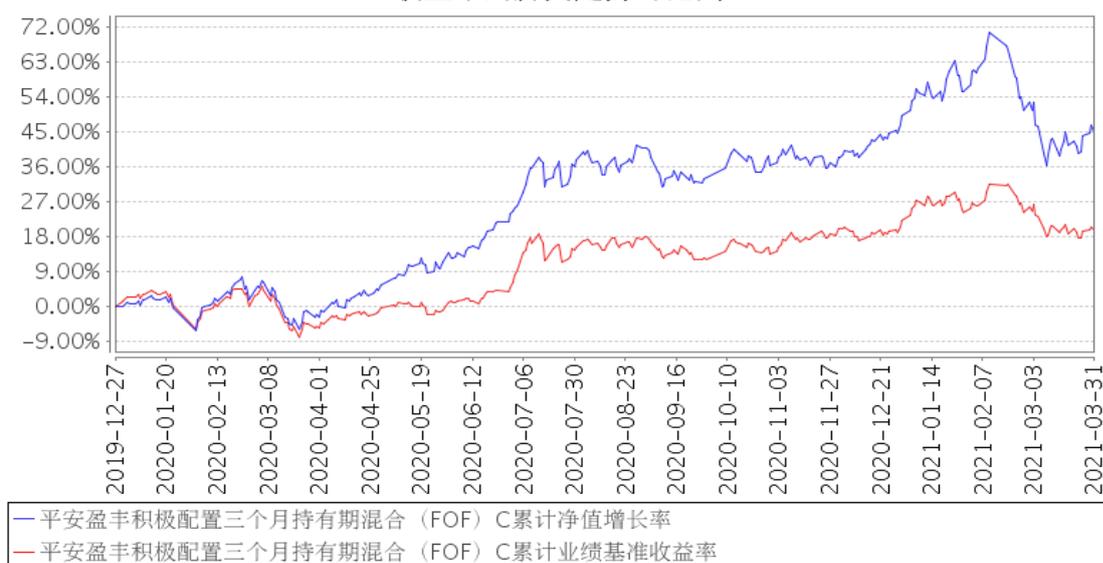
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-2.77%	1.85%	-2.13%	1.19%	-0.64%	0.66%
过去六个月	8.77%	1.48%	6.58%	1.01%	2.19%	0.47%
过去一年	48.08%	1.37%	26.24%	1.03%	21.84%	0.34%
自基金合同 生效起至今	44.91%	1.43%	19.57%	1.16%	25.34%	0.27%

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；

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		
代宏坤	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 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。

4.1.1 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。

4.2 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 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

一季度，在美国 10 年期国债利率攀升、全球通胀预期增加的背景下，国内政策收紧的预期升温，国内股票市场在 2021 年第一季度走出了过山车的走势，在春节前延续了去年的涨势，指数快速冲高，但是在春节后市场大幅回落。沪深 300 指数季度下跌 3.13%，创业板指数季度下跌 7%，中小板指数季度下跌 6.86%。春节前表现较好的成长股、消费股较大幅度的回落，相对来说，周期股和价值股回落的幅度较小。

该基金一季度的表现也是在春节前大幅上涨，在春节后随着市场快速回落，创出了基金成立以来的最大回撤。这一较为激烈的波动，主要原因是基金在偏消费类、医药类和科技类基金的比重较高，这些板块在春节前涨幅较大，但在春节后回落也较大。在这个过程中，基金经理和投资

人都承受了较大压力。一方面，我们认为，从中期来看，这些风格的基金仍然会是市场的热点，短期回调后的投资价值渐显，仍具有中长期的投资价值。另一方面，使组合的配置更加的平衡是今后要改善的方向。基金经理有信心把握好市场的投资机会，使组合的配置更加合理。

展望二季度，我们认为权益市场延续波动加大的震荡走势，中期保持乐观，市场在前期的调整后，短期延续反弹的走势。风格上中期继续看好偏价值和周期股，短期成长股反弹的动力可能更大。我们观察到，国内经济处于持续复苏的过程中，包括 PMI、工业企业利润增速等指标显著回升；信贷社融全面超预期，结构与新增均指向经济继续复苏；在一定时期内通胀的压力不大，大宗商品价格逐步传导至 PPI，目前已经看到工业品价格上涨，但猪肉价格的回落一定程度上拖累了 CPI 上行；政策方面，两会定调以稳为重点、不急转弯，稳增长和稳就业仍是硬要求；央行一季度工作会议中表示下一阶段稳健的货币政策灵活精准、合理适度、保持流动性合理充裕。

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（FOF）A 的基金份额净值为 1.4583 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.64%，截至本报告期末平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）C 的基金份额净值为 1.4491 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.77%，同期业绩比较基准收益率为-2.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

§ 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	105,763,041.39	93.06
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	7,421,176.10	6.53

8	其他资产	466,815.99	0.41
9	合计	113,651,033.48	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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	670.16
5	应收申购款	460,694.60
6	其他应收款	5,451.23
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	466,815.99

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	005267	嘉实价值精选股票	契约型开放式	7,845,861.81	17,208,328.71	15.26	否
2	110022	易方达消费行业股票	契约型开放式	3,498,759.04	17,154,415.57	15.21	否
3	162605	景顺长城鼎益混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	5,315,111.34	16,657,558.94	14.77	否
4	001043	工银美丽城镇股票	契约型开放式	6,297,098.29	15,887,578.99	14.09	否
5	110013	易方达科翔混合	契约型开放式	2,991,052.64	13,749,868.99	12.20	否
6	004851	广发医疗保健股票	契约型开放式	2,784,566.14	9,220,255.40	8.18	否
7	001717	工银前沿医疗股票 A	契约型开放式	1,946,114.22	7,977,122.19	7.08	否
8	007083	平安高端制造混合 C	契约型开放式	3,443,163.06	7,907,912.60	7.01	是

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 3 月 31 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)	32,505.12	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	152,868.71	7,815.97
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	17,410.03	17,410.03
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	388,800.73	38,724.25
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	64,800.05	6,453.96
当期交易基金产生的转换费(元)	149,969.85	-

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

§ 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（FOF）A	平安盈丰积极配置三个月持有期混合（FOF）C
报告期期初基金份额总额	23,373,334.89	49,260,348.28
报告期期间基金总申购份额	5,992,947.82	20,569,252.38
减：报告期期间基金总赎回份额	5,062,324.30	16,484,068.81
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	24,303,958.41	53,345,531.85

§ 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（FOF）A	平安盈丰积极配置三个月持有期混合（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（%）	41.15	-

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	12.88	10,000,000.00	12.88	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	12.88	10,000,000.00	12.88	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

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）募集注册的文件

(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) 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

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，客户服务热线：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 4 月 21 日