

平安灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告

2018 年 12 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 1 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 1 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 2018 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	平安灵活配置混合
场内简称	-
交易代码	700004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 10 月 30 日
报告期末基金份额总额	33,122,025.51 份
投资目标	通过捕捉股票市场、债券市场不同演变趋势，把握在不同行情中可行的投资机会，以超越业绩比较基准表现为首要投资目标，并以追求基金资产的中长期稳健回报为最终投资目标。
投资策略	在资产配置和股票、债券品种选择上注重数量化分析和模型构建。依据股票、固定收益类证券、金融衍生产品等不同市场的风险-收益预期，灵活合理配置大类资产，捕捉不同市场的超额收益机会。
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	本基金为混合型基金，其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，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	中国建设银行股份有限公司

注：1、本基金的转型日期为 2018 年 10 月 30 日，该日起原“平安保本混合型证券投资基金”正式变更为“平安灵活配置混合型证券投资基金”。

2、本基金转型日期为 2018 年 10 月 30 日，此处的基金份额日期为 2018 年 12 月 31 日。

转型前：

基金简称	平安保本混合
场内简称	-
交易代码	700004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 9 月 11 日
报告期末基金份额总额	47,243,364.37 份
投资目标	采用投资组合保险技术,以保本期到期时本金安全为目标,通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,力争实现基金资产的稳定增长和保本期收益的最大化。
投资策略	采用恒定比例组合保险策略,动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例,以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标,并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于股票基金和一般混合基金。
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

本基金转型日期为 2018 年 10 月 30 日,此处的基金份额日期为 2018 年 10 月 29 日。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018 年 10 月 30 日 — 2018 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-337,102.25
2. 本期利润	-371,648.07
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0101
4. 期末基金资产净值	33,340,825.90
5. 期末基金份额净值	1.0066

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. 本基金转型后的报告期间为 2018 年 10 月 30 日至 2018 年 12 月 31 日。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 10 月 1 日 — 2018 年 10 月 29 日)
1. 本期已实现收益	514, 572. 32
2. 本期利润	141, 146. 42
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0008
4. 期末基金资产净值	48, 058, 313. 03
5. 期末基金份额净值	1. 017

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. 本基金转型期前报告期间为 2018 年 10 月 1 日至 2018 年 10 月 29 日。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

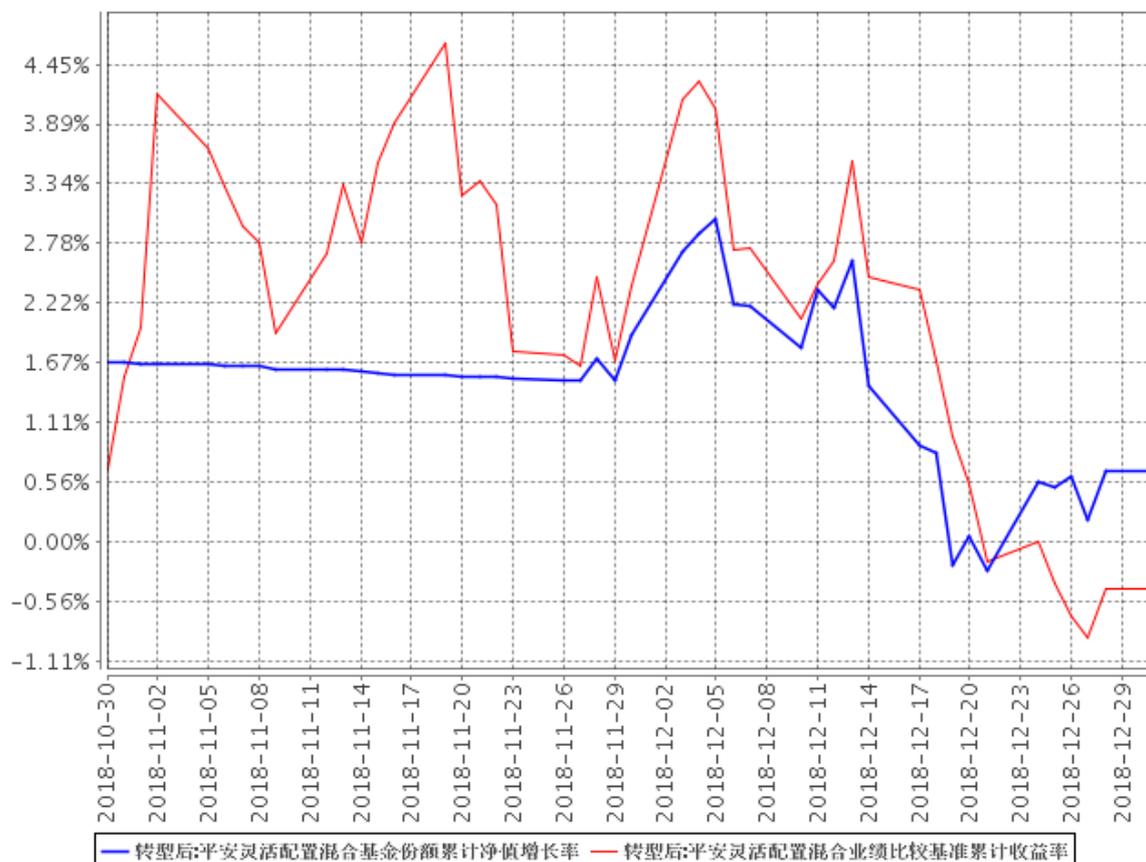
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-1. 02%	0. 37%	-0. 44%	0. 74%	-0. 58%	-0. 37%

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%

注：本基金于 2018 年 10 月 30 日转型，过去三个月实际对应期间为 2018 年 10 月 30 日至报告期末。

3.2.2 自基金转型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

平安灵活配置混合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、平安灵活配置混合型证券投资基金由平安保本混合型证券投资基金转型而来，转型日为 2018 年 10 月 30 日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满半年；

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未完成建仓。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

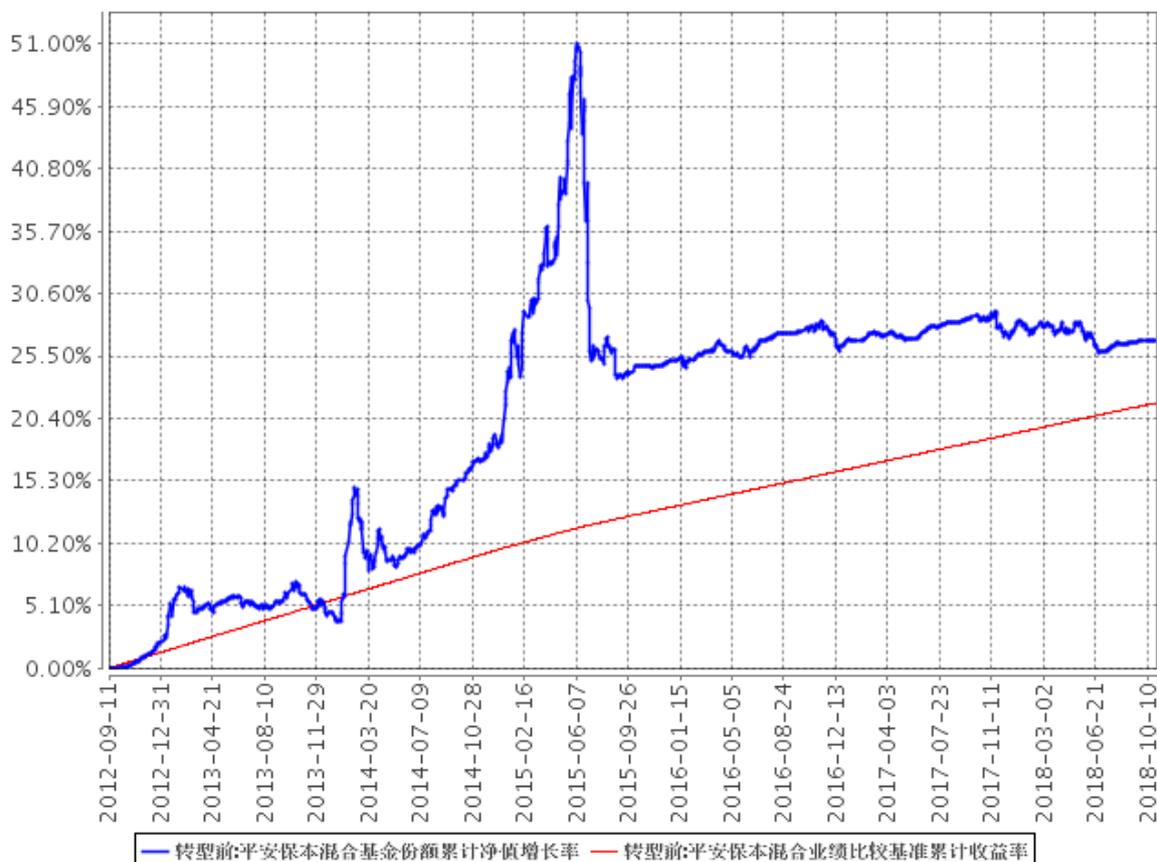
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.10%	0.04%	0.20%	0.01%	-0.10%	0.03%

业绩比较基准：每个保本期起始日的三年期银行定期存款收益率(税后)

注：本基金于 2018 年 10 月 30 日转型，过去三个月实际对应期间为 2018 年 10 月 01 日至 2018 年 10 月 29 日。

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

平安保本混合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 2012 年 09 月 11 日正式生效，截至报告期末已满六年；
- 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基金合同约定。

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（转型前）

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	平安保本混合型证券投资基金的基金经理	2018年6月29日	2018年10月29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、平安安心保本混合型证券投资基金、平安大华估值优势灵活配置混合型证券投资基金、平安保本混合型证券投资基金基金经理。
张恒	平安保本混合型证券投资基金的基金经理	2018年2月8日	2018年10月29日	7	张恒先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于华泰证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫基金、景顺长城基金，2015年起在第一创业证券历任投资经理、高级投资经理、投资主办人。2017年11月加入平安基金管理有限公司，任固定收益投资部投资经理。现任平安鑫荣混合型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券

					投资基金、平安保本混合型证券投资基金、平安安心保本混合型证券投资基金、平安安享保本混合型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金、平安惠锦纯债债券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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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	平安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018年10月30日	2018年11月22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、平安安心保本混合型证券投资基金、平安大华估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张恒	平安灵活配	2018年10月	-	7	张恒先生，西南财经

	置混合型证券投资基金的基金经理	30 日			大学硕士。曾先后任职于华泰证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫基金、景顺长城基金，2015 年起在第一创业证券历任投资经理、高级投资经理、投资主办人。2017 年 11 月加入平安基金管理有限公司，任固定收益投资部投资经理。现任平安鑫荣混合型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安灵活配置混合型证券投资基金、平安安心保本混合型证券投资基金、平安安享保本混合型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金基金经理。
刘杰	平安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018 年 11 月 22 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、《平安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（转型前：《平安保本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

2018 年四季度中国宏观经济运行内外部均面临一定压力，虽市场整体动态估值已逐渐具备吸引力，但宏观经济增速回落幅度仍有待观察；国际层面中美贸易摩擦阶段性缓解，美联储加息周期虽仍未结束但渐趋尾声，为明后年我国经济政策提供了更大调控空间。因此我们对于未来的市

场走势并不过分悲观。

本报告期本基金的投资策略——继续寻找有投资价值和穿越周期能力的投资标的，重点关注内需驱动、需求相对稳定的行业及个股，并结合估值合理性、财务稳健性的角度选择品种。同时，对于成长性良好，资产质量健康且估值回落至合理区间的成长股也采取了择机介入的投资策略。并根据宏观经济、行业政策及估值水平等因素，动态调整投资组合。

2018 年四季度，我们采取上述投资策略，从风险可控、收益可期两个维度构建投资组合。行业层面而言，我们对于农业、贵金属、公用事业、科技创新类等板块提高了关注程度，并从估值及股息回报、政策预期改善角度，增加了金融地产等板块的配置。个股层面，仍重点选择成长性良好、资产质量优良且估值合理的个股进行配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0066 元；本报告期（2018 年 10 月 30 日至 2018 年 12 月 31 日）基金份额净值增长率为-1.02%，业绩比较基准收益率为-0.44%。

截至 2018 年 10 月 29 日，本基金份额净值为 1.0170 元；本报告期（2018 年 10 月 01 日至 2018 年 10 月 29 日）基金份额净值增长率为 0.10%，业绩比较基准收益率为 0.20%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

转型前：

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。

转型后：

本基金本报告期已出现连续 20 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。

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

转型后:

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	16,548,701.40	43.50
	其中：股票	16,548,701.40	43.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,586,379.50	22.57
	其中：债券	8,586,379.50	22.57
	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	8,600,000.00	22.61
	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	3,948,310.29	10.38
8	其他资产	360,452.24	0.95
9	合计	38,043,843.43	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	1,909,443.00	5.73
B	采矿业	698,775.00	2.10
C	制造业	8,723,352.40	26.16
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	1,009,682.00	3.03
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	832,859.00	2.50
J	金融业	1,179,692.00	3.54
K	房地产业	1,115,187.00	3.34
L	租赁和商务服务业	479,776.00	1.44
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	599,935.00	1.80
S	综合	-	-
	合计	16,548,701.40	49.63

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	40,100	1,049,818.00	3.15
2	002714	牧原股份	29,900	859,625.00	2.58
3	600547	山东黄金	23,100	698,775.00	2.10
4	603043	广州酒家	25,100	679,708.00	2.04
5	600612	老凤祥	14,861	668,745.00	2.01
6	600048	保利地产	54,200	639,018.00	1.92
7	601398	工商银行	120,200	635,858.00	1.91
8	601012	隆基股份	35,800	624,352.00	1.87
9	600161	天坛生物	28,300	601,375.00	1.80
10	300144	宋城演艺	28,100	599,935.00	1.80

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	8,586,379.50	25.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	8,586,379.50	25.75

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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019547	16 国债 19	56,050	5,131,377.50	15.39
2	010107	21 国债(7)	33,560	3,455,002.00	10.36

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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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	13,216.65
2	应收证券清算款	206,589.79
3	应收股利	-
4	应收利息	140,645.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	360,452.24

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。

转型前:

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	133,928.00	0.22
	其中:股票	133,928.00	0.22
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	60,196,059.89	99.67
8	其他资产	62,615.09	0.10
9	合计	60,392,602.98	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	28,466.00	0.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	105,462.00	0.22
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	133,928.00	0.28

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	002450	康得新	6,200	105,462.00	0.22
2	601118	海南橡胶	4,300	28,466.00	0.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资情况。

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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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	11,571.83

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	51,043.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,615.09

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002450	康得新	105,462.00	0.22	重大事项
2	601118	海南橡胶	28,466.00	0.06	重大事项

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（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2018年10月30日）基金份 额总额	47,243,364.37
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	106,424.94
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	14,227,763.80
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动 份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	33,122,025.51

本基金转型日期为2018年10月30日，此处的基金期末份额日期为2018年12月31日。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	224,930,412.05
报告期期间基金总申购份额	75,904.18
减：报告期期间基金总赎回份额	177,762,951.86
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	47,243,364.37

本基金转型日期为 2018 年 10 月 30 日，此处的基金期末份额日期为 2018 年 10 月 29 日。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、平安保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2012 年 8 月 13 日至 2012 年 9 月 7 日进行募集，并于 2012 年 9 月 11 日正式成立。本基金每个保本期为三年，第一个保本期自 2012 年 9 月 11 日起至 2015 年 9 月 10 日止，第二个保本期自 2015 年 10 月 23 日起至 2018 年 10 月 22 日止。鉴于本基金无法为转入下一保本期确定保证人或保本义务人，本基金将不能满足继续作为法律法规规定的避险策略基金运作的条件，为此，本基金管理人经与本基金托管人协商一致，根据《平安保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中“如保本到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为‘平安灵活配置混合型证券投资基金’。

2、自 2018 年 10 月 25 日起，本基金管理人法定名称由“平安大华基金管理有限公司”变更为“平安基金管理有限公司”。

3、经本基金管理人 2017 年第六次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会《关于核准平安大华基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可【2018】1595 号），公司新增注册资本 10 亿元人民币。本次增资完成后，本公司注册资本由 3 亿元人民币增加至 13 亿元人民币。

§ 9 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安灵活配置混合型证券投资基金（转型前：平安保本混合型证券投资基金）设立的文件
- (2) 平安灵活配置混合型证券投资基金基金合同（转型前：平安保本混合型证券投资基金基金合同）
- (3) 平安灵活配置混合型证券投资基金托管协议（转型前：平安保本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) 平安灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告原文

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

10.3 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 1 月 19 日