

平安安享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。其中平安安享保本混合型证券投资基金的报告期自 2019 年 1 月 1 日至 2 月 14 日，平安安享灵活配置混合型证券投资基金的报告期自 2019 年 2 月 15 日至 3 月 31 日。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	平安安享灵活配置混合
场内简称	-
交易代码	002282
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 2 月 15 日
报告期末基金份额总额	59,528,953.54 份
投资目标	通过对宏观经济和股票市场、债券市场发展趋势的分析，力求把握在不同行情中可行的投资机会，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析，结合经济周期理论，形成对不同市场周期的预测和判断，进行积极、灵活的资产配置，确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50% + 中证全债指数收益率×50%
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：本基金转型日期为 2019 年 2 月 15 日，此处的基金份额日期为 2019 年 3 月 31 日。

转型前：

基金简称	平安安享保本混合
场内简称	-
交易代码	002282
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 日
报告期末基金份额总额	101, 298, 190. 57 份
投资目标	本基金以本金安全为目标，通过有效的组合管理，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	本基金采用恒定比例组合保险策略和时间不变性投资组合保险策略，建立和运用严格的动态资产数量模型，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

注：本基金转型日期为 2019 年 2 月 15 日，此处的基金份额日期为 2019 年 2 月 14 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(2019 年 2 月 15 日 — 2019 年 3 月 31 日)
1. 本期已实现收益	3, 592, 402. 58
2. 本期利润	6, 058, 535. 99
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0895
4. 期末基金资产净值	67, 698, 032. 73
5. 期末基金份额净值	1. 1372

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、本基金于 2019 年 2 月 15 日成立，截至报告期末未满半年。

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（2019 年 1 月 1 日 — 2019 年 2 月 14 日）
1. 本期已实现收益	2,272,848.83
2. 本期利润	1,879,030.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0083
4. 期末基金资产净值	106,107,498.88
5. 期末基金份额净值	1.047

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（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

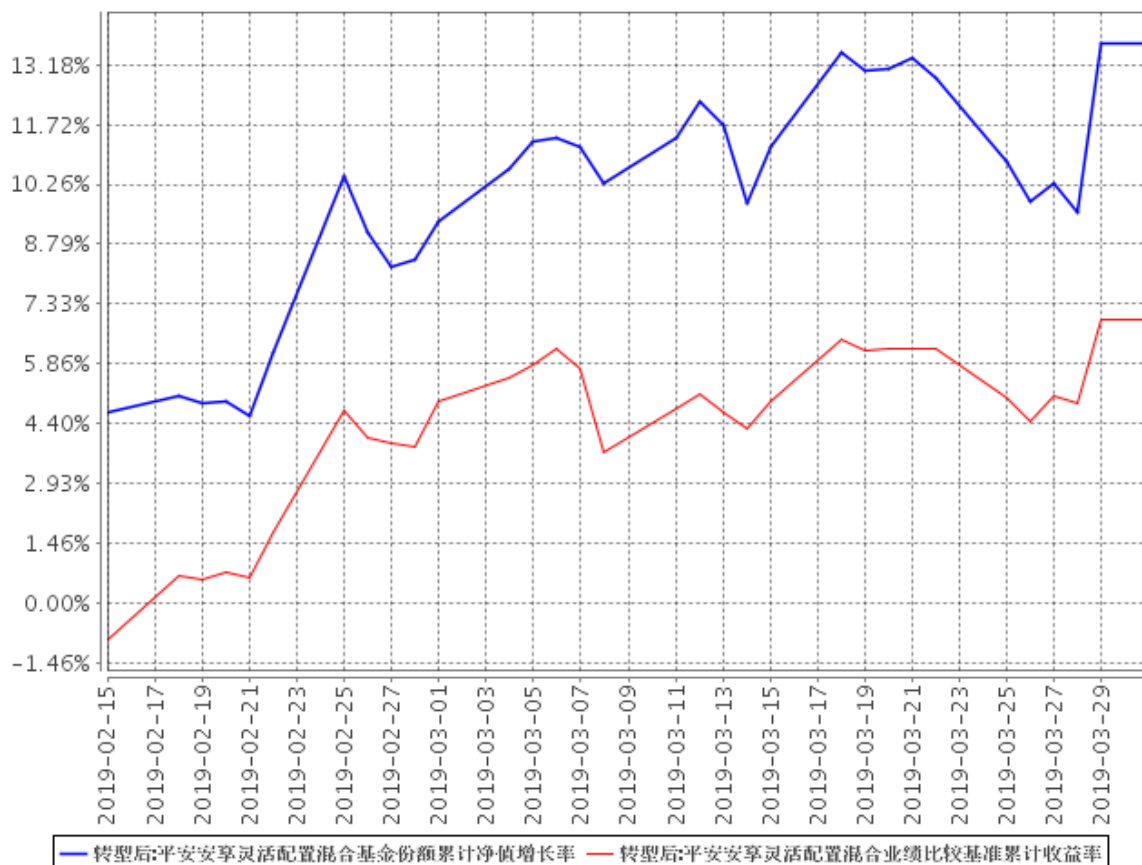
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	8.62%	1.30%	6.93%	0.95%	1.69%	0.35%

注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

2、本基金于 2019 年 2 月 15 日转型，过去三个月为 2019 年 2 月 15 日至报告期末

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

平安安享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、平安安享灵活配置混合型证券投资基金由平安安享保本转型而来，转型日期为 2019 年 2 月 15 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

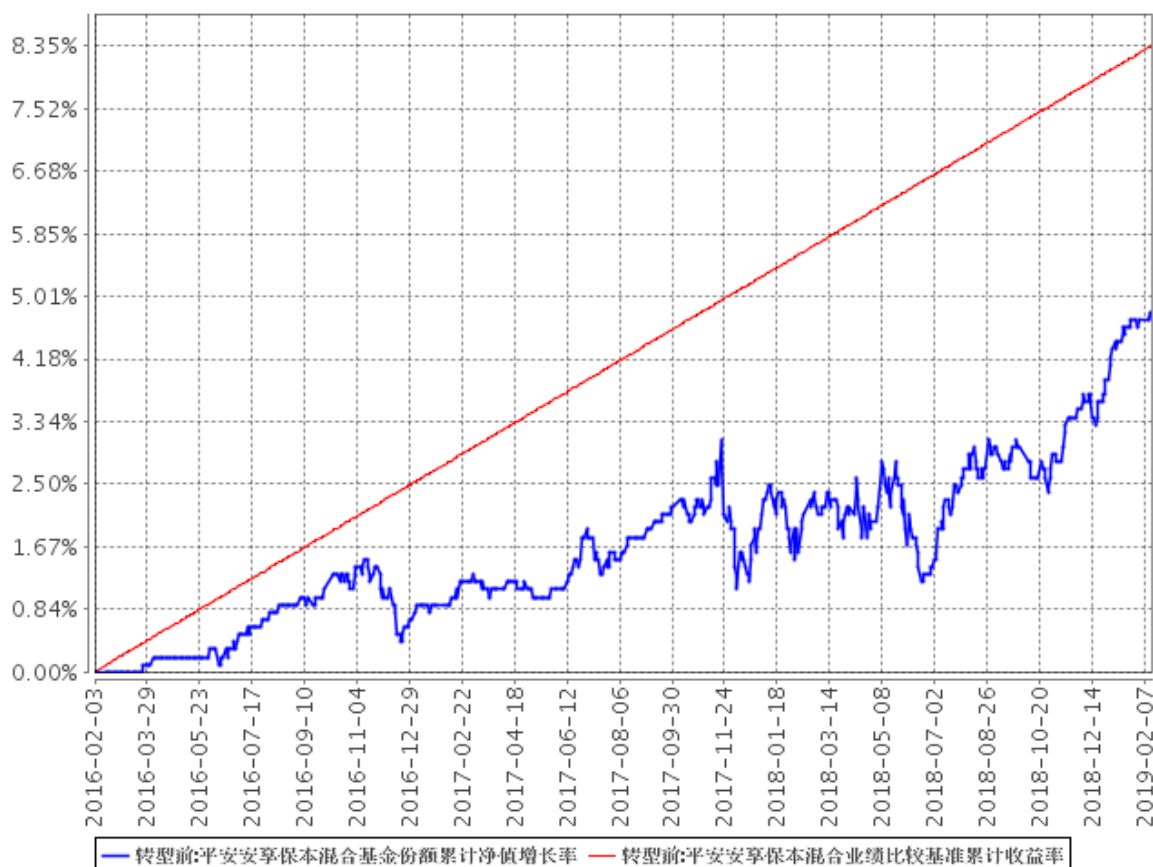
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	0.77%	0.07%	0.31%	0.01%	0.46%	0.06%

注：1、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)

2、本基金于 2019 年 2 月 15 日转型，过去三个月为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 14 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

平安安享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 2016 年 2 月 3 日正式生效，截至 2019 年 2 月 14 日已满三年；
- 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		
张恒	平安安享保本混合型证券投资基金基金经理	2018年2月8日	2019年2月14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、平安安心灵活配置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。
高勇标	平安安享保本混合型证券投资基金基金经理	2018年3月16日	2019年2月14日	8	高勇标先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险

					<p>有限公司固定收益部投资经理。2017 年 4 月加入平安基金管理有限公司，任投资研究部固定收益组投资经理，现任平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF)、平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安安盈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、平安鑫安混合型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安惠泽纯债债券型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安惠鸿纯债债券型证券投资基金、平安合意定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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		
高勇标	平安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2019 年 2 月 15 日	-	8	高勇标先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总

					<p>经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017 年 4 月加入平安基金管理有限公司，任投资研究部固定收益组投资经理，现任平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF)、平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安安盈保本混合型证券投资基金、平安安享灵活配置混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安惠泽纯债债券型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安惠鸿纯债债券型证券投资基金、平安合意定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。</p>
张俊生	平安安享灵活配置混合型证券投资基金	2019 年 3 月 1 日	-	12	<p>张俊生先生，中国科学技术大学管理科学与工程专业硕士，曾先后担任广东发展银行政策分析主任、鹏华基金管理有限公司研究员、信达澳银基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理，深圳昱昇富德资产管理有限公司合伙人兼投资总监，上海华信证券有限责任公司权益投资部总经理。2018 年 10 月加入平安基金管理有限公司，现任</p>

					权益投资中心投资副 总监。同时担任平安 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、 平安安享灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理。
张恒	平安安享灵 活配置混 合型证券投 资基金基 金基金经 理	2019 年 2 月 15 日	2019 年 3 月 13 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 安安心灵活配置混 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、平安惠诚纯债债 券型证券投资基金、 平安 0-3 年期政策性 金融债债券型证券投 资基金、平安季添盈 三个月定期开放债券 型证券投资基金、平 安惠聚纯债债券型证 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。

4.2 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、《平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（转型前：《平安安享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

一季度宏观经济继续下滑，不过幅度有所放缓。三大需求中，基建投资已经企稳回升，并推动固定资产投资逐步回升；消费震荡回落，但下行放缓；前期抢出口因素消退、中美贸易关系影响显现，出口开始回落平稳；但贸易谈判向好，对未来的预期有所改善。货币政策强调“不搞大水漫灌”、防止“流动性幻觉”，整体宽松，但进一步宽松的可能性不大；社融企稳回升，融资需求改善。受上述因素影响，利率债收益率先下后上，总体呈区间震荡走势。信用债在一系列宽信用政策的推动下，整体表现较强，中高等级信用利差继续压缩。本基金保持了债券投资组合的流动性，主要配置高等级的中短期信用债和利率债，同时参与了可转债的波段操作，基金净值

表现平稳上升。

权益市场方面，本基金原为保本基金，2019 年 2 月变更为灵活配置基金。基金产品类型变更，可投资范围和侧重点有所变化。但由于产品完成变更前，1-2 月市场已经大幅上涨，期间作为保本基金，由于合同对股票仓位在限制，明显跑输大盘。在产品类型变更完毕后，基于对 1 季度股市在乐观预期，迅速加大了股票配置仓位，重点配置了受益货币政策和监管环境边际改善的券商、地产等板块，投资业绩有所提升。后续将适当等待市场调整机会，重点挖掘符合政策导向，景气明确趋势向上，业绩有望超预期的行业和公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 3 月 31 日，平安安享灵活配置混合基金份额净值为 1.1372 元，本报告期（2019 年 2 月 15 日至 2019 年 3 月 31 日）基金份额净值增长率为 8.62%；同期业绩比较基准收益率为 6.93%。

截至 2019 年 2 月 14 日，平安安享保本混合基金份额净值为 1.0470，本报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 14 日）基金份额净值增长率为 0.77%；同期业绩比较基准收益率为 0.31%。

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。

§ 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	46,784,846.06	52.59
	其中：股票	46,784,846.06	52.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,036,126.76	4.54
	其中：债券	4,036,126.76	4.54
	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	12,100,000.00	13.60
	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	25,282,026.29	28.42
8	其他资产	760,675.35	0.86
9	合计	88,963,674.46	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	730,800.00	1.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,464,541.31	12.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,331,712.00	1.97
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	3,938,993.00	5.82
J	金融业	11,923,247.85	17.61
K	房地产业	20,395,551.90	30.13
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	46,784,846.06	69.11

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	600383	金地集团	209,500	2,880,625.00	4.26
2	601155	新城控股	50,330	2,272,399.50	3.36
3	000002	万科A	60,600	1,861,632.00	2.75
4	601211	国泰君安	90,459	1,822,748.85	2.69
5	600030	中信证券	72,100	1,786,638.00	2.64
6	601688	华泰证券	78,700	1,763,667.00	2.61
7	600048	保利地产	123,100	1,752,944.00	2.59
8	000671	阳光城	208,800	1,743,480.00	2.58
9	000961	中南建设	183,200	1,740,400.00	2.57
10	600325	华发股份	182,080	1,689,702.40	2.50

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,736,373.60	5.52
	其中：政策性金融债	3,736,373.60	5.52
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）	299,753.16	0.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,036,126.76	5.96

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	018005	国开1701	37,360	3,736,373.60	5.52
2	127012	招路转债	490	48,999.46	0.07
3	123020	富祥转债	330	37,936.80	0.06
4	128057	博彦转债	360	35,998.82	0.05
5	110053	苏银转债	270	26,999.41	0.04

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

中南建设，2018 年 7 月 2 日公告，收到深交所监管函：公司于 2018 年 4 月 27 日披露的 2018 年第一季度报告显示，公司实现归属于上市公司股东的净利润为 37,950.89 万元，同比增长 205.57%，但公司未及时履行业绩预告披露义务。公司的上述行为违反了本所《股票上市规则》第 1.4 条、第 2.1 条及《主板信息披露业务备忘录第 1 号一定期报告披露相关事宜》的规定。2018 年 8 月 23 日公告，于 2018 年 8 月 21 日收到中国证券监督管理委员会江苏监管局（以下简称“江苏证监局”）行政监管措施决定书《关于对江苏中南建设集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（【2018】45 号），现将主要内容公告如下：

经查，你公司于 2017 年 11 月 11 日与深圳市和润达投资有限公司（以下简称“深圳和润达”）签署协议，将你公司所持中南（深圳）房地产开发有限公司（以下简称“深圳中南”）47%的股权转让给深圳和润达。该笔股权转让中，你公司获得股权转让收益 37,726 万元，持有的剩余 18%深圳中南股权按照公允价值计量产生投资收益 12,374 万元，共计实现投资收益 50,100 万元，扣除所得税影响实现净利润 37,357 万元，占你公司 2016 年经审计的合并报表归属于母公司的净利润的 91.62%，你公司未履行临时信息披露义务。

上述行为违反《上市公司信息披露管理办法》（中国证监会令第 40 号）第二条、第三十条的规定，鉴于你公司对该事项在 2017 年年报中进行了披露，并于 2018 年 6 月 7 日进行补充披露，现根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，决定对你公司采取出具警示函的监管措施。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	116,575.65

2	应收证券清算款	500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	143,803.26
5	应收申购款	296.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	760,675.35

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	-	-
	其中：股票	-	-
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	152,606,677.65	99.88
8	其他资产	178,728.68	0.12
9	合计	152,785,406.33	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

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

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

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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	118,218.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	60,510.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	178,728.68

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 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2019年2月15日）基金份额总额	101,298,190.57
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,056,890.05
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	42,826,127.08
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	59,528,953.54

此处报告期为本基金转型后，具体时间自 2019-2-15 至 2019-3-31。

§ 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	241,878,062.48
报告期期间基金总申购份额	3,244,364.01
减：报告期期间基金总赎回份额	143,824,235.92
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

填列)	
报告期期末基金份额总额	101,298,190.57

此处报告期为本基金转型前，具体时间自 2019-1-1 至 2019-2-14。

§ 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）

无

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）

无

§ 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）

无

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）

无

§ 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

平安安享保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）为契约型开放式证券投资基金，基金管理人为平安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司，基金登记机构为平安基金管理有限公司，保证人为中国投融资担保股份有限公司。本基金每个保本期为三年，第一个保本期自 2016 年 2 月 3 日起至 2019 年 2 月 11 日止。鉴于本基金的第一个保本期到期，且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，本基金管理人经与基金托管人协商一致，根据《平安安享保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）中的约定，变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“平安大华安享灵活配置混合型证券投资基金”。同时因平安基金管理有限公司已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记，公司名称由“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”，并已根据相关法律法规要求公告更名事宜。为保护投资者利益，避免对投资者造成混淆和误导，转型后的基金名称由“平安大华安享灵活配置混合型证券投资基金”变更为“平安安享灵活配置混合型证券投资基金”。

§ 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大华安享保本混合型证券投资基金设立的文件
- （2）平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- （3）平安安享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) 平安安享灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 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 4 月 19 日