

# 平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 年半年度报告摘要

2019 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 22 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	平安转型创新混合	
场内简称	-	
基金主代码	004390	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 4 月 14 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	50,284,253.63 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	平安转型创新混合 A	平安转型创新混合 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	004390	004391
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	36,141,540.59 份	14,142,713.04 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，重点投资与转型创新相关的优质证券，实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取“灵活资产配置、主动投资管理”的投资策略，一方面通过大类资产配置，降低系统性风险，把握市场波动中的投资机会；另一方面利用平安基金的研究平台优势，重点研究、投资与转型创新主题相关的证券资产，构建在中长期能够从经济转型、产业升级中收益的投资组合。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金	
	平安转型创新混合 A	平安转型创新混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	平安转型创新混合 A	平安转型创新混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	7,545,996.78	311,835.88
本期利润	14,526,109.77	339,528.50
加权平均基金份额本期利润	0.3138	0.3634
本期基金份额净值增长率	33.59%	33.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0153	-0.0226
期末基金资产净值	38,378,503.36	14,896,997.17
期末基金份额净值	1.0619	1.0533

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. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上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 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

平安转型创新混合 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
过去一个月	5.54%	1.53%	2.96%	0.58%	2.58%	0.95%
过去三个月	-0.52%	1.85%	-0.11%	0.75%	-0.41%	1.10%
过去六个月	33.59%	1.78%	14.27%	0.77%	19.32%	1.01%
过去一年	10.68%	1.62%	8.26%	0.76%	2.42%	0.86%
自基金合同生效起至今	15.54%	1.16%	10.86%	0.61%	4.68%	0.55%

平安转型创新混合 C

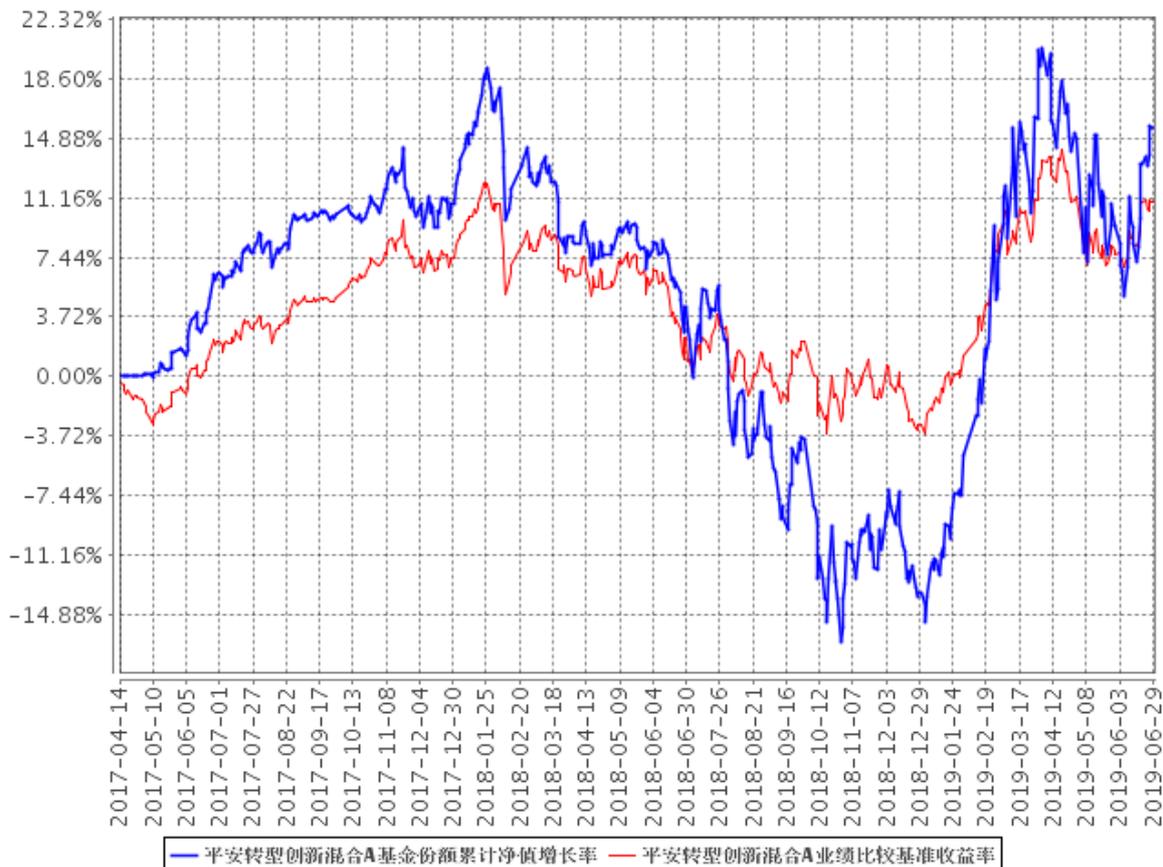
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.49%	1.52%	2.96%	0.58%	2.53%	0.94%
过去三个月	-0.57%	1.85%	-0.11%	0.75%	-0.46%	1.10%
过去六个月	33.85%	1.78%	14.27%	0.77%	19.58%	1.01%
过去一年	10.64%	1.62%	8.26%	0.76%	2.38%	0.86%
自基金合同生效起至今	14.11%	1.16%	10.86%	0.61%	3.25%	0.55%

本基金业绩比较基准为中证综合债指数收益率×50%+沪深 300 指数收益率×50%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证综合债券指数是反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债、和企业债、该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场标准。根据本基金的投资范围约束，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

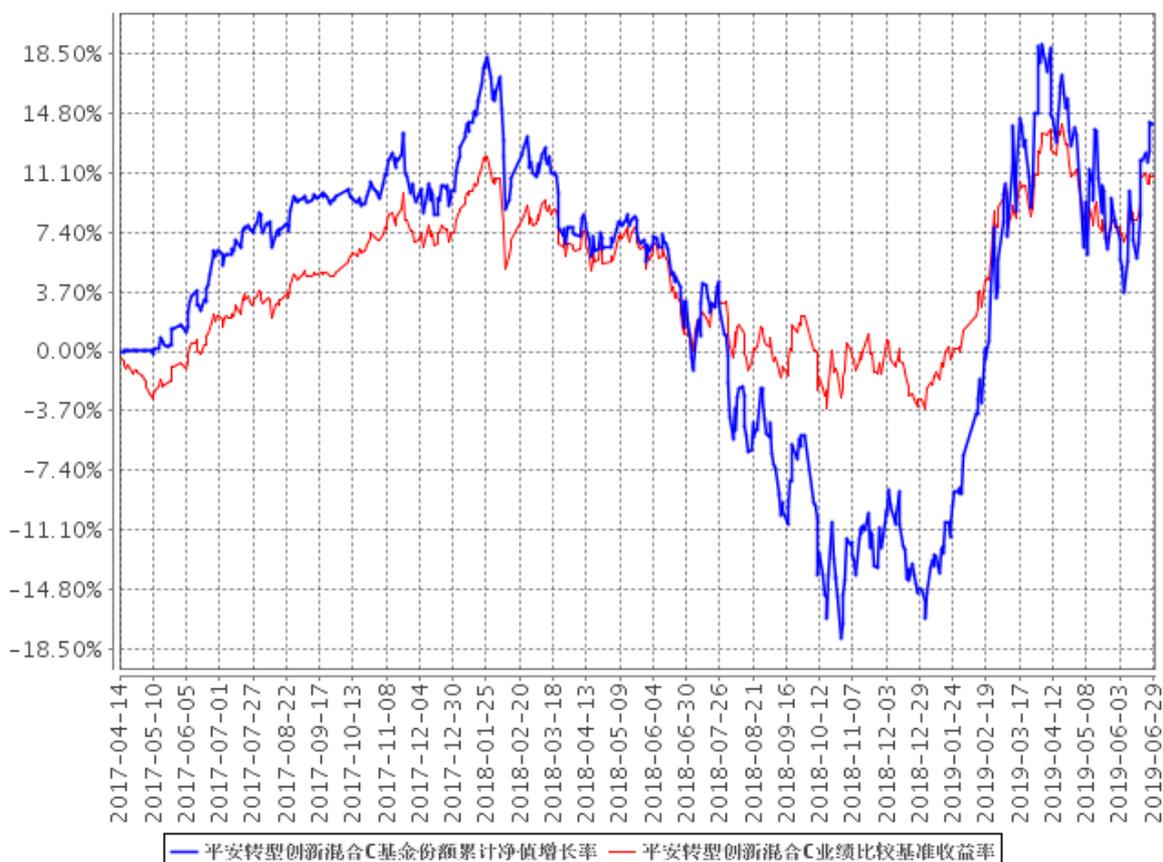
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

平安转型创新混合A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



平安转型创新混合C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 2017 年 4 月 14 日正式生效，截至报告期末已满两年；
- 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合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股份 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股份 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份 14.3%。

平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富的客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2019 年 6 月 30 日，平安基金共管理 83 只公募基金，公募基金管理总规模 2877 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李化松	权益投资中心投资董事总经理；平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018 年 8 月 10 日	-	13	李化松先生，北京大学硕士。先后担任国信证券有限责任公司经济研究所分析师、华宝兴业基金管理有限公司研究部分析师、嘉实基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理。2018 年 3 月加入平安基金管理有限公司，现任权益投资中心投资董事总经理，同时担任平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安核心优势混合型证券投资基金、平安高端制造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基金经理

					理。
施旭	平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017年5月11日	2019年1月18日	10	施旭先生，哥伦比亚大学金融数学硕士。曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券，2015年加入平安基金管理有限公司，任衍生品投资中心量化研究员，现任平安深证300指数增强型证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安量化精选混合型发起式证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
乔海英	平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017年4月14日	2019年1月18日	7	乔海英女士，南开大学金融学硕士。曾先后任职于博时基金管理有限公司、民生加银基金管理有限公司担任行业研究员，2013年加入平安基金管理有限公司，担任行业研究员，现任平安医疗健康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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期连续四个季度期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A 股市场出现了较大的波动。一方面是因为前期上涨过快的客观调整因素，另一方面，贸易摩擦和外部环境出现了一些变化，市场担心对经济基本面会造成负面影响，对前期较乐观的市场情绪造成了较大影响。

面对市场的大幅波动，我们沉着应对，立足长远、深入研究，认为中国经济和 A 股市场的中

长期向好的趋势并没有发生改变，新一轮以新能源、5G、人工智能、IOT 为代表的技术创新周期没有发生变化，外部因素反而会加快这一进程。因此，我们积极把握市场波动的机会，仓位保持稳定，认真筛选股票，去伪存真，增加了长期优质企业的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金 A 份额净值为 1.0619 元，份额累计净值为 1.1519 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 33.59%，同期业绩基准增长率为 14.27%。本基金 C 份额净值为 1.0533 元，份额累计净值为 1.1383 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 33.85%，同期业绩基准增长率为 14.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于未来，第一，外部冲击会加快世界范围内新技术的发展；第二，外部冲击会激发企业家的创新和奋斗精神，尽快补齐短板，积极适应环境变化，在更大范围内配置资源。这将会促进中国优秀企业成长为世界级的企业。第三，我们欣喜的看到，尽管部分国家的逆全球化风潮越演越烈，但是我们的政策反而更加开放，加速出台改革开放政策。同时也修正了原来一些短期刺激政策；我们相信，中国经济和优秀企业将会经过外部风雨的洗礼，获得更健康的成长。当然，短期外部环境仍会反复，但是，长期中国经济和 A 股市场将迎来更健康持续的成长。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值工作组的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内已出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截止本报告期末，以上情形已经消除。

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,071,068.28	6,172,320.25
结算备付金		34,490.52	322,823.04
存出保证金		55,924.81	92,398.42
交易性金融资产	6.4.7.2	38,394,402.92	36,206,330.77
其中：股票投资		38,394,402.92	36,206,330.77
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		160,311.85	2,607,356.32
应收利息	6.4.7.5	2,294.18	2,120.63
应收股利		-	-
应收申购款		2,777.64	3,167.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		53,721,270.20	45,406,516.73
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		305,195.83	87,376.13
应付管理人报酬		50,733.62	83,870.47
应付托管费		8,455.58	13,978.40
应付销售服务费		2,292.14	12,987.85
应付交易费用	6.4.7.7	22,558.71	138,506.93

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	56,533.79	190,174.28
负债合计		445,769.67	526,894.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	50,284,253.63	56,458,746.25
未分配利润	6.4.7.10	2,991,246.90	-11,579,123.58
所有者权益合计		53,275,500.53	44,879,622.67
负债和所有者权益总计		53,721,270.20	45,406,516.73

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 50,284,253.63 份，其中下属 A 类基金份额 36,141,540.59 份，C 类基金份额 14,142,713.04 份。下属 A 类基金份额净值 1.0619 元，C 类基金份额净值 1.0533 元。

## 6.2 利润表

会计主体：平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		15,479,033.51	-4,024,794.01
1.利息收入		19,761.24	824,841.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,761.24	79,367.66
债券利息收入		-	269,577.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	475,896.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,431,573.41	1,270,185.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,116,137.29	1,154,043.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-330,573.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	315,436.12	446,715.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,007,805.61	-6,169,954.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	19,893.25	50,133.12
<b>减：二、费用</b>		613,395.24	1,851,968.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	340,436.58	807,828.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,739.39	134,638.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,309.33	120,751.51
4. 交易费用	6.4.7.19	146,867.08	636,444.83
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	732.78
7. 其他费用	6.4.7.20	66,042.86	151,572.33
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		14,865,638.27	-5,876,762.50
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		14,865,638.27	-5,876,762.50

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	56,458,746.25	-11,579,123.58	44,879,622.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,865,638.27	14,865,638.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,174,492.62	-295,267.79	-6,469,760.41
其中：1.基金申购款	17,503,437.87	481,857.94	17,985,295.81
2.基金赎回款	-23,677,930.49	-777,125.73	-24,455,056.22
四、本期向基金份额持	-	-	-

有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	50,284,253.63	2,991,246.90	53,275,500.53
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	115,415,114.93	1,989,127.35	117,404,242.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,876,762.50	-5,876,762.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-20,890,011.43	-172,436.17	-21,062,447.60
其中：1.基金申购款	9,131,737.65	434,027.29	9,565,764.94
2.基金赎回款	-30,021,749.08	-606,463.46	-30,628,212.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	94,525,103.50	-4,060,071.32	90,465,032.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗春风 _____	_____ 林婉文 _____	_____ 张南南 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金(原名为平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可

[2016]1233 号《关于准予平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司，已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 231,639,266.13 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 120 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 231,693,739.60 份基金份额，其中认购资金利息折合 54,473.47 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》，平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金。

根据《平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等)、债券资产(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金资产等货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票资产的投资比例为基金资产的 0-95%，其中投资于转型创新主题相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%，其中权证占基金资产净值的 0-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益

率×50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、

财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
上海陆金所基金销售有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
中国平安人寿保险股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
平安证券股份有限公司	基金管理人的股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.8.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
平安证券股份有限公司	-	-	1,455,883.00	0.31%

**6.4.8.1.2 债券交易**

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

**6.4.8.1.3 债券回购交易**

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.4.8.1.4 权证交易**

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
平安证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
平安证券股份有限公司	1,035.58	0.31%	1,035.58	1.06%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**6.4.8.2 关联方报酬****6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	340,436.58
其中：支付销售机构的客户维护费	132,410.23	226,963.12

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

## 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,739.39	134,638.16

注：支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25%/ 当年天数。

## 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安转型创新混合 A	平安转型创新混合 C	合计
平安基金管理有限公司	-	2,258.34	2,258.34
上海陆金所基金销售有限公司	-	208.89	208.89
合计	-	2,467.23	2,467.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安转型创新混合 A	平安转型创新混合 C	合计
平安基金管理有限公司	-	120,733.68	120,733.68
上海陆金所基金销售有限公司	-	12.58	12.58
合计	-	120,746.26	120,746.26

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值×0.80%/当年天数。

**6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无

**6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

平安转型创新混合 C				
关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
深圳平安大华 汇通财富管理 有限公司	13,555,383.42	26.9575%	0.00	0.0000%

**6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期 存款	15,071,068.28	18,205.90	43,434,198.77	57,500.49

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金于本期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

## **6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

### **6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### **6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### **6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## **6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

### **6.4.10.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

### **6.4.10.2 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	38,394,402.92	71.47
	其中：股票	38,394,402.92	71.47
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	15,105,558.80	28.12
8	其他各项资产	221,308.48	0.41
9	合计	53,721,270.20	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,269,444.00	2.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	27,088,051.32	50.85
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	2,039,365.00	3.83
G	交通运输、仓储和邮政业	387,660.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,077,937.60	5.78
J	金融业	920,393.00	1.73
K	房地产业	334,040.00	0.63

L	租赁和商务服务业	2,822,364.00	5.30
M	科学研究和技术服务业	348,840.00	0.65
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	106,308.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	38,394,402.92	72.07

## 7.2.2 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。

## 7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	24,000	2,830,800.00	5.31
2	002127	南极电商	251,100	2,822,364.00	5.30
3	002271	东方雨虹	110,190	2,496,905.40	4.69
4	600438	通威股份	167,700	2,357,862.00	4.43
5	002304	洋河股份	16,215	1,971,095.40	3.70
6	600519	贵州茅台	1,900	1,869,600.00	3.51
7	002475	立讯精密	73,200	1,814,628.00	3.41
8	002311	海大集团	56,600	1,748,940.00	3.28
9	002410	广联达	42,800	1,407,692.00	2.64
10	000661	长春高新	3,822	1,291,836.00	2.42

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002304	洋河股份	2,321,530.70	5.17

2	002271	东方雨虹	1,956,087.00	4.36
3	002035	华帝股份	1,811,099.26	4.04
4	601211	国泰君安	1,791,790.94	3.99
5	002475	立讯精密	1,787,566.00	3.98
6	000858	五粮液	1,776,088.12	3.96
7	600809	山西汾酒	1,567,517.00	3.49
8	600519	贵州茅台	1,560,185.20	3.48
9	600030	中信证券	1,480,050.72	3.30
10	603816	顾家家居	1,468,654.00	3.27
11	600703	三安光电	1,401,511.00	3.12
12	300207	欣旺达	1,357,321.00	3.02
13	002410	广联达	1,290,539.00	2.88
14	000625	长安汽车	1,205,962.00	2.69
15	300037	新宙邦	1,144,532.00	2.55
16	000568	泸州老窖	1,138,823.00	2.54
17	300274	阳光电源	1,136,046.00	2.53
18	002299	圣农发展	1,061,273.00	2.36
19	601933	永辉超市	1,026,830.00	2.29
20	002127	南极电商	980,903.00	2.19
21	603233	大参林	976,259.70	2.18
22	002311	海大集团	946,351.00	2.11

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	3,519,118.18	7.84
2	601012	隆基股份	3,263,332.87	7.27
3	300395	菲利华	2,465,758.62	5.49
4	300014	亿纬锂能	2,462,529.00	5.49
5	300271	华宇软件	2,453,771.83	5.47
6	002714	牧原股份	2,374,318.93	5.29
7	600048	保利地产	2,191,613.00	4.88
8	600438	通威股份	2,071,387.86	4.62
9	002035	华帝股份	1,926,893.06	4.29

10	601211	国泰君安	1,923,164.00	4.29
11	601155	新城控股	1,913,976.58	4.26
12	001979	招商蛇口	1,771,516.00	3.95
13	600079	人福医药	1,531,049.00	3.41
14	300037	新宙邦	1,522,754.00	3.39
15	600703	三安光电	1,503,471.23	3.35
16	300196	长海股份	1,466,988.00	3.27
17	002124	天邦股份	1,447,180.40	3.22
18	000002	万科A	1,326,579.00	2.96
19	000625	长安汽车	1,288,877.00	2.87
20	603816	顾家家居	1,267,133.00	2.82
21	300207	欣旺达	1,264,912.00	2.82
22	300203	聚光科技	1,260,439.02	2.81
23	300009	安科生物	1,259,257.00	2.81
24	600383	金地集团	1,137,775.00	2.54
25	600030	中信证券	1,118,426.00	2.49
26	002299	圣农发展	971,787.62	2.17

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	47,440,354.36
卖出股票收入（成交）总额	60,376,225.11

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 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。

## **7.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## **7.9 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。

## **7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **7.10.1 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情况。

### **7.10.2 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。

## **7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **7.11.1 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情况。

### **7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无国债期货投资。

### **7.11.3 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情况。

## **7.12 投资组合报告附注**

### **7.12.1**

基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

**7.12.2**

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。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	55,924.81
2	应收证券清算款	160,311.85
3	应收股利	-
4	应收利息	2,294.18
5	应收申购款	2,777.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	221,308.48

**7.12.4 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。

**7.12.5 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。

**7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
平安转型创新混合 A	2,604	13,879.24	0.00	0.00%	36,141,540.59	100.00%
平安转型创新混合 C	30	471,423.77	13,555,383.42	95.85%	587,329.62	4.15%
合计	2,631	19,112.22	13,555,383.42	26.96%	36,728,870.21	73.04%

上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安转型创新混合 A	5,908.51	0.0163%
	平安转型创新混合 C	26,998.57	0.1909%
	合计	32,907.08	0.0654%

上述从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安转型创新混合 A	0
	平安转型创新混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	平安转型创新混合 A	0
	平安转型创新混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安转型创新混 合 A	平安转型创新混 合 C
基金合同生效日（2017 年 4 月 14 日）基金份 额总额	163,559,598.92	68,134,140.68
本报告期期初基金份额总额	56,381,961.64	76,784.61
本报告期期间基金总申购份额	2,908,041.05	14,595,396.82
减：本报告期期间基金总赎回份额	23,148,462.10	529,468.39
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	36,141,540.59	14,142,713.04

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2、经平安基金管理有限公司（以下简称“公司”）2019 年第三次股东会议审议通过，由薛世峰先生接替李兆良先生任职公司的独立董事，任职日期为 2019 年 6 月 7 日。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，公司收到监管机构对我司采取责令改正措施的决定、对相关责任人出具警示函的决定。公司高度重视，制定并实施相关整改措施，及时向监管机构提交整改报告。报告期内，公司已完成整改。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西南证券	1	15,150,827.60	14.06%	10,776.70	14.01%	-
安信证券	3	10,202,931.81	9.47%	7,255.99	9.43%	-
广州证券	2	8,719,408.37	8.09%	6,201.51	8.06%	-
方正证券	2	8,677,774.06	8.05%	6,168.75	8.02%	-
天风证券	2	7,952,198.23	7.38%	5,656.23	7.35%	-
渤海证券	1	7,407,442.02	6.87%	5,269.04	6.85%	-
申港证券	1	6,789,990.31	6.30%	4,829.81	6.28%	-
中泰证券	1	6,114,677.10	5.67%	4,349.30	5.65%	-
华泰证券	2	5,939,791.73	5.51%	4,226.86	5.49%	-
光大证券	2	4,989,866.31	4.63%	3,550.44	4.62%	-
万联证券	4	3,787,822.89	3.52%	2,693.22	3.50%	-
东北证券	7	3,251,618.60	3.02%	2,315.14	3.01%	-
中信证券	3	3,052,464.00	2.83%	2,171.19	2.82%	-
川财证券	1	2,671,140.00	2.48%	1,902.51	2.47%	-
长江证券	1	2,445,897.90	2.27%	1,739.98	2.26%	-
上海证券	2	2,236,044.36	2.08%	1,591.19	2.07%	-
东兴证券	2	2,142,383.18	1.99%	1,523.94	1.98%	-
中信建投	2	1,605,251.00	1.49%	1,141.74	1.48%	-
华创证券	2	1,458,737.00	1.35%	1,037.54	1.35%	-
广发证券	2	1,416,043.00	1.31%	1,290.55	1.68%	-
华宝证券	2	778,488.00	0.72%	553.63	0.72%	-
海通证券	2	528,786.00	0.49%	376.17	0.49%	-
银河证券	2	428,176.00	0.40%	304.57	0.40%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-

国联证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	4	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/06/24--2019/06/30	0.00	13,555,383.42	0.00	13,555,383.42	26.96%
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

平安基金管理有限公司

2019 年 8 月 22 日