

平安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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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	平安灵活配置混合
场内简称	-
基金主代码	700004
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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
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
报告期末基金份额总额	27,128,757.08 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	-

2.2 基金产品说明

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	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。股票投资方面，采用积极主动的投资管理策略，在构建股票投资组合时，灵活运用多种投资策略，积极挖掘和利用市场中可行的投资机会，以实现基金的投资目标。债券投资方面，以利率预期策略、类属资产配置和久期策略为主，以品种选择策略、收益率利差策略和债券置换策略为辅，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上，构建能获取长期、稳定收益的固定收益类投资组合。
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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	田青
	联系电话	0755-22626828	010-67595096
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-800-4800	010-67595096
传真		0755-23997878	010-66275853

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	http://www.fund.pingan.com
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

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)
本期已实现收益	4,118,111.42
本期利润	5,951,678.11
加权平均基金份额本期利润	0.1971
本期基金份额净值增长率	18.73%
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	0.3434
期末基金资产净值	32,422,439.84
期末基金份额净值	1.1951

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

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	2.22%	0.82%	3.47%	0.69%	-1.25%	0.13%
过去三个月	-1.54%	1.03%	-0.30%	0.91%	-1.24%	0.12%
过去六个月	18.73%	1.00%	16.82%	0.92%	1.91%	0.08%
自基金合同生效起至今	17.51%	0.87%	16.31%	0.88%	1.20%	-0.01%

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%。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。中证全债指数从沪深交易所和银行间市场挑选国债、金融债及企业债组成样本券，最大限度地涵盖了中国固定收益市场可供投资的产品，已成为广受投资者认可的投资中国固定收益市场的基准指标。本基金为混合型基金，

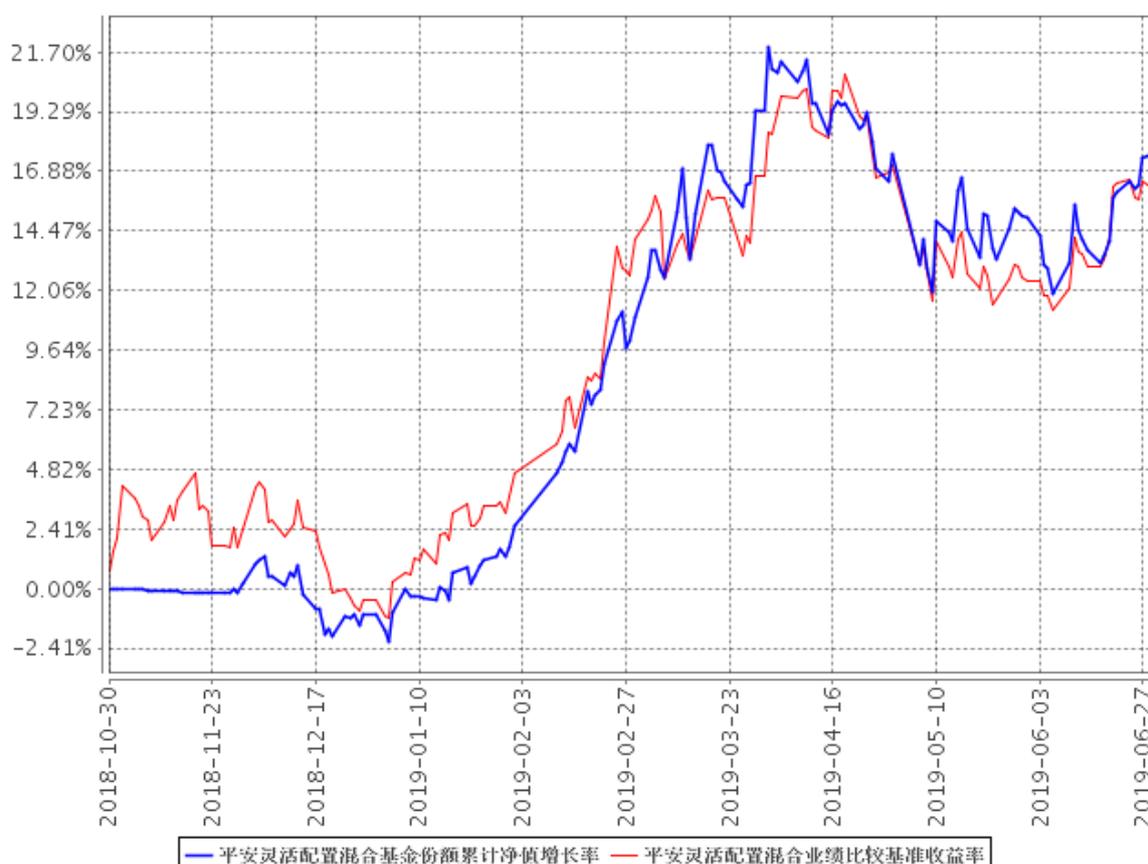
通常情况下基金在运作过程中股票资产将在 30%-80%范围内调整，中长期可能的股票仓位平均在 60%左右。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准的权重分别是 60%和 40%。因此，该基准是衡量本基金投资业绩的理想基准。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、自基金合同生效起至今为 2018 年 10 月 30 日至 2019 年 6 月 30 日。

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、本基金基金合同于 2018 年 10 月 30 日转型，截至报告期末未满一年；

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		
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	-	11	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。
张恒	平安灵活配置混合型证券投资基金的基金	2018 年 10 月 30 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 年起在创业证券历任投资经理、

	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、平安合盛 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安高等级债债券型证券投资基金、平安惠添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遵规守信情况的说明

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》、《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。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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

本报告期本基金继续秉持我们的投资策略——寻找有投资价值和穿越周期能力的投资标的，重点关注成长型价值股，对市场空间大、盈利能力强、管理层优秀的优质个股进行重点研究及配置。以“买入持有”作为基本投资策略，通过长期持股来获得持续回报，并结合宏观经济、产业政策、行业景气、估值合理性、业绩确定性等角度，动态调整投资组合中的个股权重。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1951 元，累计份额净值为 1.4903 元；本报告期基金份额净值增长率为 18.73%，业绩比较基准收益率为 16.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年下半年中国宏观经济运行虽仍面临一定程度的内外部压力，但应看到国内改革开放与减税降费将继续推进，国际层面贸易摩擦有望逐步缓解，对内改革与对外开放仍将为我国经济创造持续发展契机。因此我们对于中国经济的发展潜力、抵御周期性波动的韧性、以及未来的市场走势都并不悲观。市场仍将始终存在结构性机会，具有长期竞争力且管理优秀的公司仍将具备投

资价值。

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

本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，截至报告期末，以上情况未消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

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

本报告期内，中国建设银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,673,716.46	3,698,275.70
结算备付金		70,526.80	250,034.59
存出保证金		18,917.06	13,216.65
交易性金融资产	6.4.7.2	35,462,707.80	25,135,080.90
其中：股票投资		22,485,477.20	16,548,701.40
基金投资		-	-
债券投资		12,977,230.60	8,586,379.50
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	-	8,600,000.00
应收证券清算款		32,962.67	206,589.79
应收利息	6.4.7.5	143,868.50	140,645.80
应收股利		-	-
应收申购款		2,373.61	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		38,405,072.90	38,043,843.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
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		101,658.91	103,215.12
应付赎回款		1,609,201.96	25,951.54
应付管理人报酬		40,716.55	43,245.14
应付托管费		6,786.08	7,207.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	32,102.46	25,615.06
应交税费		4,130,776.13	4,130,776.93

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	61,390.97	367,006.22
负债合计		5,982,633.06	4,703,017.53
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	21,770,316.66	26,579,809.77
未分配利润	6.4.7.10	10,652,123.18	6,761,016.13
所有者权益合计		32,422,439.84	33,340,825.90
负债和所有者权益总计		38,405,072.90	38,043,843.43

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1951 元，累计份额净值 1.4903 元，基金份额总额 27,128,757.08 份。

6.2 利润表

会计主体：平安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
一、收入		6,451,051.31	-
1.利息收入		175,141.87	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,762.34	-
债券利息收入		120,547.22	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,832.31	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,426,737.67	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,147,649.47	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-52,862.09	-
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	331,950.29	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,833,566.69	-
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	15,605.08	-
减：二、费用		499,373.20	-

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	254,559.86	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	42,426.60	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	128,857.96	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	73,528.78	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,951,678.11	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,951,678.11	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安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）	26,579,809.77	6,761,016.13	33,340,825.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,951,678.11	5,951,678.11
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）	-4,809,493.11	-2,060,571.06	-6,870,064.17
其中：1.基金申购款	3,410,199.19	1,536,558.30	4,946,757.49
2.基金赎回款	-8,219,692.30	-3,597,129.36	-11,816,821.66
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）	21,770,316.66	10,652,123.18	32,422,439.84

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：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>张南南</u>
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

平安灵活配置混合型证券投资基金(原名为平安大华灵活配置混合型证券投资基金、平安大华保本混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)是根据原平安大华保本混合型证券投资基金(以下简称“平安大华保本混合基金”)《平安大华保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,由原平安大华保本混合基金转型而来。原平安大华保本混合基金为契约型开放式基金,存续期限不定,原平安大华保本混合基金第二个保本期于 2018 年 10 月 22 日到期,但基金管理人无法为本基金转入下一保本期确定保证人或保本义务人,原平安大华保本混合基金将不能满足继续作为法律法规规定的避险策略型基金运作的条件,基金管理人经与托管人协商一致,自 2018 年 10 月 30 日起,平安大华保本混合基金更名为平安大华灵活配置混合型证券投资基金,《平安大华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为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),基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

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 日起更名为平安灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安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,包括国内依法发行交易的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、央行票据、短期融资券、超级短期融资券、商业银行次级债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、定期存款等银行存款以及法律法规允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 30%-80%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 20%-70%;权证投资比例不高于基金资产净值的 3%,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或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×60% + 中证全债指数收益率×40%。

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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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
平安证券股份有限公司	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
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

平安银行股份有限公司	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
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

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

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金于本期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

本基金于本期无应支付关联方的佣金。

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	254,559.86	-
其中：支付销售机构的客户维护费	65,469.03	-

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	42,426.60		-	

注：支付基金托管行建设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

无

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

本基金于本期末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

无

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
深圳建行活期存款	2,673,716.46	29,016.82	-	-

本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，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

本基金于本期末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	22,485,477.20	58.55
	其中：股票	22,485,477.20	58.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,977,230.60	33.79
	其中：债券	12,977,230.60	33.79
	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	2,744,243.26	7.15
8	其他各项资产	198,121.84	0.52
9	合计	38,405,072.90	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	1,370,109.00	4.23
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,323,028.20	47.26
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	1,943,515.80	5.99
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	371,281.20	1.15

	业		
J	金融业	848,938.00	2.62
K	房地产业	2,628,605.00	8.11
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	22,485,477.20	69.35

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	002311	海大集团	39,600	1,223,640.00	3.77
2	603708	家家悦	50,940	1,162,450.80	3.59
3	600887	伊利股份	27,400	915,434.00	2.82
4	600383	金地集团	76,600	913,838.00	2.82
5	600690	海尔智家	51,400	888,706.00	2.74
6	600612	老凤祥	19,261	860,966.70	2.66
7	601128	常熟银行	109,500	845,340.00	2.61
8	603369	今世缘	28,900	806,021.00	2.49
9	002299	圣农发展	31,200	789,984.00	2.44
10	002372	伟星新材	45,180	786,132.00	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	002299	圣农发展	1,394,414.00	4.18
2	600741	华域汽车	1,372,211.96	4.12
3	601818	光大银行	1,319,807.00	3.96
4	600547	山东黄金	1,251,701.51	3.75
5	002311	海大集团	1,241,637.00	3.72
6	002714	牧原股份	1,117,904.00	3.35
7	002746	仙坛股份	1,110,440.80	3.33
8	601128	常熟银行	1,061,559.00	3.18
9	603369	今世缘	1,055,631.06	3.17
10	002124	天邦股份	1,047,809.50	3.14
11	600612	老凤祥	1,035,320.00	3.11
12	600690	海尔智家	1,030,221.00	3.09
13	601336	新华保险	997,820.00	2.99
14	600383	金地集团	956,663.00	2.87
15	600887	伊利股份	926,152.26	2.78
16	600161	天坛生物	910,549.00	2.73
17	000860	顺鑫农业	910,063.10	2.73
18	002841	视源股份	875,989.00	2.63
19	603708	家家悦	853,086.10	2.56
20	601933	永辉超市	836,731.00	2.51
21	002508	老板电器	811,419.00	2.43
22	603801	志邦家居	799,442.00	2.40
23	600809	山西汾酒	795,286.00	2.39
24	002557	洽洽食品	793,089.00	2.38
25	000550	江铃汽车	787,032.00	2.36
26	002901	大博医疗	759,468.00	2.28
27	002384	东山精密	743,416.00	2.23
28	603605	珀莱雅	714,695.00	2.14
29	600872	中炬高新	713,346.00	2.14
30	603899	晨光文具	704,446.00	2.11

31	002372	伟星新材	703,818.00	2.11
32	000661	长春高新	695,608.00	2.09

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	002714	牧原股份	2,665,320.73	7.99
2	300498	温氏股份	2,127,743.00	6.38
3	002124	天邦股份	1,896,063.00	5.69
4	600547	山东黄金	1,869,623.00	5.61
5	600161	天坛生物	1,538,022.80	4.61
6	601818	光大银行	1,309,513.00	3.93
7	601012	隆基股份	1,306,182.95	3.92
8	000661	长春高新	1,016,599.00	3.05
9	002127	南极电商	1,016,437.00	3.05
10	002384	东山精密	1,009,648.00	3.03
11	600271	航天信息	946,183.00	2.84
12	002841	视源股份	945,546.00	2.84
13	002032	苏泊尔	936,534.84	2.81
14	601336	新华保险	886,543.00	2.66
15	600612	老凤祥	878,047.63	2.63
16	002117	东港股份	868,742.64	2.61
17	002901	大博医疗	863,707.00	2.59
18	002746	仙坛股份	855,790.00	2.57
19	600048	保利地产	826,695.00	2.48
20	603605	珀莱雅	801,340.00	2.40
21	600741	华域汽车	777,054.63	2.33
22	002311	海大集团	755,098.00	2.26
23	000860	顺鑫农业	722,040.00	2.17
24	601229	上海银行	710,006.00	2.13
25	300188	美亚柏科	701,220.00	2.10
26	603043	广州酒家	688,509.00	2.07
27	601398	工商银行	688,282.00	2.06

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	49,506,204.11
卖出股票收入（成交）总额	49,567,835.28

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,977,230.60	40.03
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	12,977,230.60	40.03

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19 国债 01	94,990	9,491,400.80	29.27
2	019547	16 国债 19	38,030	3,485,829.80	10.75

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	18,917.06
2	应收证券清算款	32,962.67
3	应收股利	-
4	应收利息	143,868.50
5	应收申购款	2,373.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	198,121.84

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

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
1,389	19,531.14	0.00	0.00%	27,128,757.08	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	29,013.68	0.1069%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年10月30日）基金份额总额	44,668,313.88
本报告期期初基金份额总额	33,122,025.51
本报告期期间基金总申购份额	4,249,586.18
减：本报告期期间基金总赎回份额	10,242,854.61
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	27,128,757.08

§ 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	
国盛证券	2	73,217,829.39	73.90%	52,088.48	73.90%	-
华创证券	2	23,597,249.86	23.82%	16,784.20	23.81%	-
国信证券	1	2,258,960.14	2.28%	1,610.11	2.28%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	新增 2 个

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
国盛证券	15,667,498.00	81.37%	59,900,000.00	67.23%	-	-
华创证券	2,014,798.50	10.46%	29,200,000.00	32.77%	-	-
国信证券	1,571,968.50	8.16%	-	-	-	-

中投证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

平安基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日