

平安鑫安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	平安鑫安混合		
场内简称	-		
基金主代码	001664		
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	2015 年 12 月 11 日		
基金管理人	平安基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	237,956,774.79 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	平安鑫安混合 A	平安鑫安混合 C	平安鑫安混合 E
下属分级基金场内简称	-	-	-
下属分级基金的交易代码	001664	001665	007049
报告期末下属分级基金份额总额	10,452,801.41 份	2,477,519.41 份	225,026,453.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求在严格控制风险的基础上，实现基金资产的持续稳定增值。		
投资策略	本基金将在资产配置允许的范围内，采取相对灵活的资产配置策略。在大类资产配置过程中，本基金使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整，以规避或分散市场风险，提高基金风险调整后的收益。本基金以自上而下的投资策略，大类资产，动态控制组合风险，力争长期、稳定的回报。		
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%		
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。		
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	王永民
	联系电话	0755-22626828	010-66594896
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

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

基金级别	平安鑫安混合 A	平安鑫安混合 C	平安鑫安混合 E
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)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-517,243.23	-81,005.35	2,328,710.78
本期利润	774,047.00	124,412.82	2,387,735.06
加权平均基金份额本期利润	0.0567	0.0485	0.0176
本期基金份额净值增长率	4.98%	4.75%	2.15%
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	0.0687	0.0538	0.0532
期末基金资产净值	11,171,340.45	2,610,906.83	236,998,145.60
期末基金份额净值	1.0687	1.0538	1.0532

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

平安鑫安混合 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	0.41%	0.02%	2.50%	0.46%	-2.09%	-0.44%
过去三个月	0.79%	0.03%	0.07%	0.60%	0.72%	-0.57%
过去六个月	4.98%	0.26%	11.82%	0.61%	-6.84%	-0.35%
过去一年	-3.46%	0.46%	8.21%	0.60%	-11.67%	-0.14%
过去三年	5.81%	0.44%	16.37%	0.44%	-10.56%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.87%	0.40%	12.47%	0.50%	-5.60%	-0.10%

平安鑫安混合 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	0.38%	0.01%	2.50%	0.46%	-2.12%	-0.45%
过去三个月	0.69%	0.03%	0.07%	0.60%	0.62%	-0.57%
过去六个月	4.75%	0.26%	11.82%	0.61%	-7.07%	-0.35%
过去一年	-3.85%	0.46%	8.21%	0.60%	-12.06%	-0.14%
过去三年	4.54%	0.44%	16.37%	0.44%	-11.83%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.38%	0.41%	12.47%	0.50%	-7.09%	-0.09%

平安鑫安混合 E

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	0.41%	0.01%	2.50%	0.46%	-2.09%	-0.45%
过去三个月	0.78%	0.03%	0.07%	0.60%	0.71%	-0.57%
自基金合同生效起至今	2.15%	0.14%	5.08%	0.64%	-2.93%	-0.50%

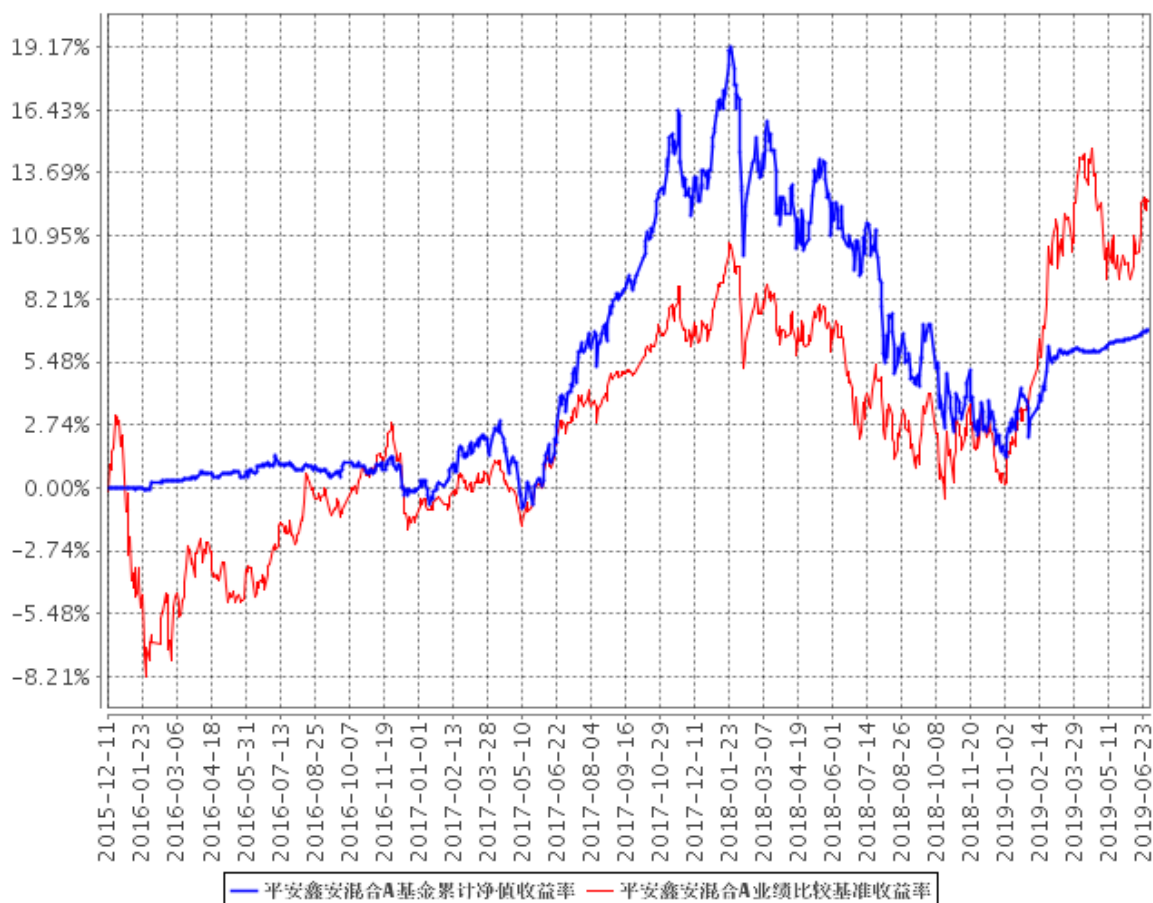
注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证全债指数从沪深交易所和银行间市场挑选国债、金融债及企业债组成样本券，最大限度地涵盖了我国固定收益市场可供投资的产品，已成为广受投资者认可的投资中国固定收益市场的基准指标。本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

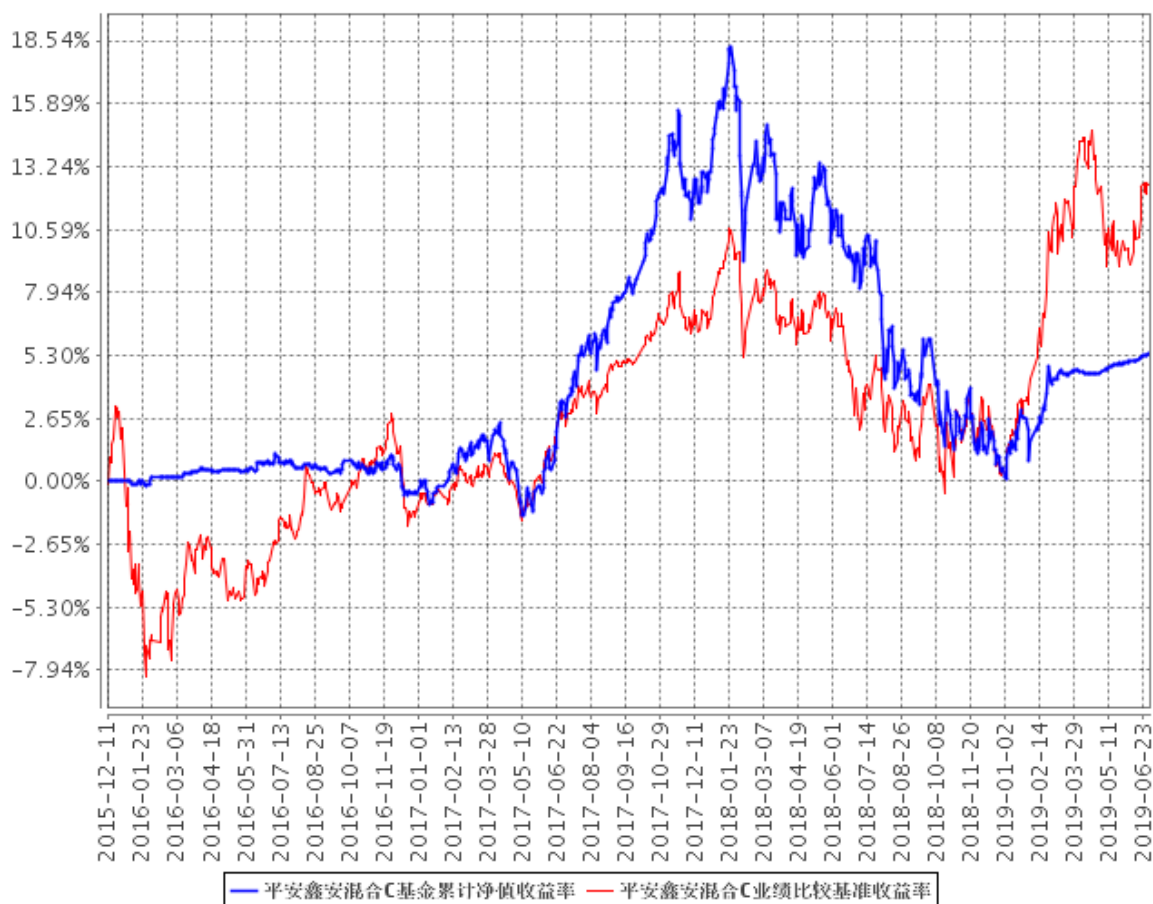
3、E 类份额自基金合同生效以来为 2019 年 2 月 19 日至报告期末。

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

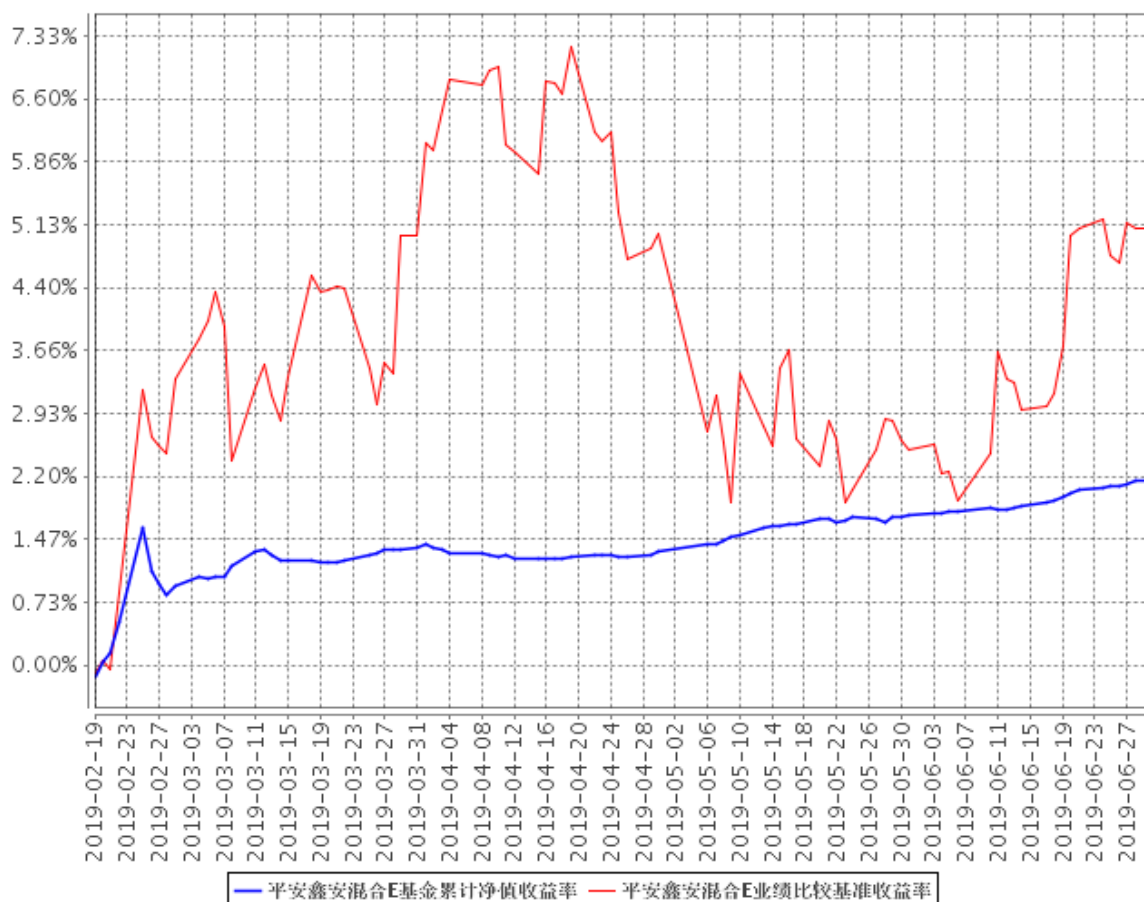
平安鑫安混合A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安鑫安混合C基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安鑫安混合E基金累计净值收益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 2015 年 12 月 11 日正式生效，截至报告期末已满三年；
- 2、自 2019 年 2 月 19 日起在现有份额的基础上增设 E 类份额；
- 3、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

本基金本报告期内无其他指标。

§ 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		
施旭	平安鑫安混合型证券投资基金的基金经理	2016 年 12 月 27 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。
高勇标	平安鑫安混合型证券投资基金的基金经理	2018年3月16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、平安惠聚纯债债券型证券投资基金基金经理。
张文平	平安鑫安混合型证券投资基金的基金经理；同时担任固定	2019年1月31日	-	8	张文平先生，南京大学硕士。先后担任毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公

	收益投资中心投资执行总经理；				司，现任固定收益投资中心投资执行总经理。同时担任平安短债债券型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠轩纯债债券型证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安惠裕债券型证券投资基金、平安如意中短债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、平安交易型货币市场基金基金经理。
田元强	平安鑫安混合型证券投资基金的基金经理	2019 年 4 月 10 日	-	6	田元强先生，西安交通大学工商管理硕士，曾先后担任鹏元资信评估有限公司信用评级部分析师、生命保险资产管理有限公司信用评级部分析师、中国中投证券有限责任公司研究总部分析师。2016 年 11 月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心固定收益高级研究员。现担任平安交易型货币市场基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、

					平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安3-5年期政策性金融债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安如意中短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》、《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、《平安鑫安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，名义 GDP 持续走低，经济基本面偏弱；货币政策强调“不搞大水漫灌”但整体相对宽松；财政政策适度刺激，基建企稳回升；受阶段性通胀回升、贸易谈判反复等影响，债市预期出现摇摆，债券市场震荡为主。报告期内，本基金的投资操作相对稳健，以配置存单、利率债等资产为主，在兼顾安全性、流动性和收益性的情况下，本基金净值实现增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安鑫安混合 A 基金份额净值为 1.0687 元，份额累计净值为 1.0687 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.98%，同期业绩比较基准收益率为 11.82%；截至本报告期末平安鑫安混合 C 基金份额净值为 1.0538 元，份额累计净值为 1.0538 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.75%，同期业绩比较基准收益率为 11.82%；截至本报告期末平安鑫安混合 E 基金份额净值为 1.0532 元，份额累计净值为 1.0532 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.15%；同期业绩比较基准收益率为 5.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球经济走弱，各国货币政策再次步入宽松格局；国内经济增长动力依然不足，下行压力持续；政策倾向于结构性调节为主，慎搞总量刺激；降低实体融资成本仍将持续，需维持相对宽松的资金面格局；地产行业监管趋严，销售、投资均有望走弱；由此，债市整体偏友好；不过，考虑到债市收益率已经处于历史低位，预计下行将不会顺畅。我们将保持中性偏多的组合特征，灵活操作，力争在兼顾安全性、流动性的情况下，为客户创造稳定良好的收益。

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，以上情况已经消除。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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安鑫安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：平安鑫安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	409,846.09	352,011.14
结算备付金		252,221.34	160,098.90
存出保证金		9,151.00	73,323.86
交易性金融资产	6.4.7.2	280,967,081.70	19,406,638.87
其中：股票投资		-	9,362,638.87
基金投资		-	-
债券投资		280,967,081.70	10,044,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
贵金属投资		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,673,823.82	279,791.27
应收股利		-	-
应收申购款		124,402.42	798.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	25,555.44	-
资产总计		284,462,081.81	20,272,662.96
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		33,439,863.28	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	166,471.47
应付管理人报酬		129,324.18	14,137.97
应付托管费		21,554.02	4,418.12
应付销售服务费		21,273.59	930.06
应付交易费用	6.4.7.7	19,564.41	8,108.16
应交税费		2,337.42	-

应付利息		8,382.20	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	39,389.83	213,000.00
负债合计		33,681,688.93	407,065.78
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	237,956,774.79	19,548,985.66
未分配利润	6.4.7.10	12,823,618.09	316,611.52
所有者权益合计		250,780,392.88	19,865,597.18
负债和所有者权益总计		284,462,081.81	20,272,662.96

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，平安鑫安 A 基金份额净值 1.0687 元，基金份额总额 10,452,801.41 份；平安鑫安 C 基金份额净值 1.0538 元，基金份额总额 2,477,519.41 份；平安鑫安 E 基金份额净值 1.0532 元，基金份额总额 225,026,453.97 份；平安鑫安份额总额合计为 237,956,774.79 份。

6.2 利润表

会计主体：平安鑫安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		4,283,229.50	-3,402,730.11
1.利息收入		2,728,247.60	2,221,876.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,021.65	79,548.42
债券利息收入		2,476,941.10	2,140,694.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		228,284.85	1,633.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-48,926.88	8,270,550.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-684,552.56	8,467,431.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	634,349.50	-746,351.98
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	1,276.18	549,471.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,555,732.68	-13,921,771.63
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	48,176.10	26,614.20

减：二、费用		997,034.62	2,784,434.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	482,093.48	921,723.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	86,926.71	288,038.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	75,306.26	7,484.20
4. 交易费用	6.4.7.19	44,090.95	1,298,880.70
5. 利息支出		231,396.46	47,984.47
其中：卖出回购金融资产支出		231,396.46	47,984.47
6. 税金及附加		1,589.13	6,114.07
7. 其他费用	6.4.7.20	75,631.63	214,209.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,286,194.88	-6,187,164.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,286,194.88	-6,187,164.38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安鑫安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）	19,548,985.66	316,611.52	19,865,597.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,286,194.88	3,286,194.88
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）	218,407,789.13	9,220,811.69	227,628,600.82
其中：1. 基金申购款	321,574,485.80	14,155,595.42	335,730,081.22
2. 基金赎回款	-103,166,696.67	-4,934,783.73	-108,101,480.40
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	237,956,774.79	12,823,618.09	250,780,392.88

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
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	224,428,373.36	30,893,365.28	255,321,738.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,182,664.38	-6,182,664.38
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)	-200,869,167.45	-22,224,754.94	-223,093,922.39
其中：1.基金申购款	177,172.32	24,237.16	201,409.48
2.基金赎回款	-201,046,339.77	-22,248,992.10	-223,295,331.87
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)	23,559,205.91	2,485,945.96	26,045,151.87

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

平安鑫安混合型证券投资基金(原名为平安大华鑫安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[2015]1476号《关于准予平安大华鑫安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《平安大华鑫安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人民币394,571,226.89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(2015)第1378号验资报告予以验证。

经向中国证监会备案,《平安大华鑫安混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 394,638,660.15 份基金份额,其中认购资金利息折合 67,433.26 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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

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》,平安大华鑫安混合型证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安鑫安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《平安鑫安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,包括国内依法发行上市股票(包括中小板、创业及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,以及债券等固定收益金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等)以及经中国证监会允许基金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,可将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-90%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 40%+中证全债指数收益率 \times 60%。

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》、《平安鑫安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。

本财务报表仍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
中国银行股份有限公司	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
平安不动产有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

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	-	-	155,562.30	0.02%

6.4.8.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
平安证券	68,091,024.66	55.22%	30,937,827.13	33.69%

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	-	-	-	-
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	144.87	0.02%	144.87	0.03%

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	482,093.48	921,723.22
其中：支付销售机构的客户维护费	189,576.38	410,874.14

注：自 2019 年 1 月 1 日至 3 月 17 日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 0.80% 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 × 0.80% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《平安基金管理有限公司关于平安鑫安混合型证券投资基金调整管理费率、托管费率、修改基金合同表述相关事项的公告》，自 2019 年 3 月 18 日起，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 0.60% 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 × 0.60% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

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托管费	86,926.71	288,038.51

注：自 2019 年 1 月 1 日至 3 月 17 日，支付基金托管行中国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。

根据基金份额持有人大会表决通过的《平安基金管理有限公司关于平安鑫安混合型证券投资基金调整管理费率、托管费率、修改基金合同表述相关事项的公告》，自 2019 年 3 月 18 日起，支付基金托管行中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 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			
	平安鑫安混合 A	平安鑫安混合 C	平安鑫安混合 E	合计
中国银行股份有限公司	0.00	0.00	3,610.31	3,610.31
平安银行股份有限公司	0.00	0.00	1,408.33	1,408.33
平安基金管理有限公司	0.00	9,250.50	62.22	9,312.72
上海陆金所基金销售有限公司	0.00	60,768.88	52.80	60,821.68
平安证券股份有限公司	0.00	0.00	18.34	18.34
合计	0.00	70,019.38	5,152.00	75,171.38
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			
	平安鑫安混合 A	平安鑫安混合 C	平安鑫安混合 E	合计
平安基金管理有限公司	0.00	96.47	-	96.47
平安证券股份有限公司	0.00	2.06	-	2.06
中国银行股份有限公司	0.00	4,333.39	-	4,333.39
上海陆金所基金销售有限公司	0.00	21.85	-	21.85
平安银行股份有限公司	0.00	2,664.19	-	2,664.19
合计	0.00	7,117.96	-	7,117.96

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 0.40% 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 × 0.40% / 当年天数。

支付基金销售机构的销售服务费按 E 类基金份额前一日基金资产净值 0.1% 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 E 类基金份额销售服务费 = 前一日 E 类基金份额基金资产净值 × 0.1% / 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

平安鑫安混合 A				
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
平安不动产有限公司	19,219,680.95	8.0770%	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
中国银行	409,846.09	21,738.07	12,763,541.42	57,566.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金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 33,439,863.28 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111907055	19 招商银行 CD055	2019 年 7 月 1 日	97.01	418,000	40,550,180.00
合计				418,000	40,550,180.00

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	280,967,081.70	98.77
	其中：债券	280,967,081.70	98.77
	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	662,067.43	0.23
8	其他各项资产	2,832,932.68	1.00
9	合计	284,462,081.81	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	601233	桐昆股份	300,497.44	1.51

2	000002	万 科 A	275,884.00	1.39
3	002468	申通快递	264,266.00	1.33
4	600741	华域汽车	251,074.54	1.26
5	002236	大华股份	212,564.00	1.07
6	000910	大亚圣象	194,157.20	0.98
7	002027	分众传媒	194,037.00	0.98
8	601111	中国国航	193,973.00	0.98
9	000651	格力电器	193,624.00	0.97
10	600029	南方航空	191,031.00	0.96
11	002475	立讯精密	156,013.00	0.79
12	300144	宋城演艺	154,513.00	0.78
13	600887	伊利股份	153,549.00	0.77
14	000568	泸州老窖	133,062.00	0.67
15	002241	歌尔股份	116,320.00	0.59
16	600048	保利地产	115,740.00	0.58
17	002456	欧菲光	97,005.00	0.49
18	601211	国泰君安	96,522.00	0.49
19	300498	温氏股份	96,000.00	0.48

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	603156	养元饮品	2,237,777.47	11.26
2	000540	中天金融	952,680.00	4.80
3	000002	万 科 A	391,610.00	1.97
4	000651	格力电器	350,571.00	1.76
5	600741	华域汽车	321,788.00	1.62
6	601233	桐昆股份	319,010.00	1.61
7	600887	伊利股份	268,876.00	1.35
8	002468	申通快递	264,840.00	1.33
9	002027	分众传媒	242,640.00	1.22
10	002236	大华股份	237,486.00	1.20
11	300713	英可瑞	231,205.34	1.16
12	002859	洁美科技	231,050.21	1.16

13	601111	中国国航	225,319.00	1.13
14	000910	大亚圣象	215,009.00	1.08
15	600519	贵州茅台	204,120.00	1.03
16	600029	南方航空	188,100.00	0.95
17	000568	泸州老窖	181,745.00	0.91
18	601211	国泰君安	181,576.00	0.91
19	002475	立讯精密	171,343.00	0.86
20	002860	星帅尔	156,606.60	0.79

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	3,389,832.18
卖出股票收入（成交）总额	13,422,195.33

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	15,252,500.00	6.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,980,983.20	5.97
	其中：政策性金融债	14,980,983.20	5.97
4	企业债券	20,024,000.00	7.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	924,198.50	0.37
8	同业存单	229,785,400.00	91.63
9	其他	-	-
10	合计	280,967,081.70	112.04

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	111903047	19 农业银行 CD047	500,000	48,510,000.00	19.34
2	111907055	19 招商银行 CD055	500,000	48,505,000.00	19.34
3	111906168	19 交通银行 CD168	200,000	19,396,000.00	7.73
3	111917036	19 光大银行 CD036	200,000	19,396,000.00	7.73
4	111914086	19 江苏银行 CD086	200,000	19,386,000.00	7.73
5	111805235	18 建设银行 CD235	200,000	19,380,000.00	7.73

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。

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情况。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日做出处罚决定，由于上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）：未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或可疑报告、与身份不明的客户进行交易。根据相关规定对公司罚款 170 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力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。

银保监会于 2018 年 11 月 19 日做出银保监银罚决字〔2018〕14 号处罚决定，由于中信银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）理财资金违规缴纳土地款；（二）自有资金融资违规缴纳土地款；（三）为非保本理财产品提供保本承诺；（四）本行信贷资金为理财产品提供融资；（五）收益权转让业务违规提供信用担保；（六）项目投资审核严重缺位。根据相关规定对公司罚款 2280 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力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。

银保监会于 2018 年 11 月 9 日做出银保监银罚决字〔2018〕13 号处罚决定，由于交通银行股份有限公司（以下简称“公司”）：并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位。根据相关规定对公司罚款 50 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力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。

银保监会于 2018 年 11 月 9 日做出银保监银罚决字〔2018〕12 号处罚决定，由于交通银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露不合规；（九）现场检查配合不力。根据相关规定对公司罚款 690 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力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。

银保监会于 2018 年 11 月 9 日做出银保监银罚决字〔2018〕10 号处罚决定，由于光大银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）以误导方式违规销售理财产品；（三）以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品；（四）违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务；（五）同业投资违规接受担保；（六）通过同业投资或贷款虚增存款规模。根据相关规定对公司没收违法所得 100 万元，罚款 1020 万元，合计 1120 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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	9,151.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,673,823.82
5	应收申购款	124,402.42
6	其他应收款	-

7	待摊费用	25,555.44
8	其他	-
9	合计	2,832,932.68

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

本基金本报告期末未持有股票。

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
平安鑫安混合 A	177	59,055.38	0.00	0.00%	10,452,801.41	100.00%
平安鑫安混合 C	61	40,615.07	0.00	0.00%	2,477,519.41	100.00%
平安鑫安混合 E	8,469	26,570.61	19,219,680.95	8.54%	205,806,773.02	91.46%
合计	8,700	27,351.35	19,219,680.95	8.08%	218,737,093.84	91.92%

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	平安鑫安混合 A	0.00	0.0000%
	平安鑫安混合 C	964.04	0.0389%
	平安鑫安混合 E	19.38	0.0000%
	合计	983.42	0.0004%

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	平安鑫安混合 A	0
	平安鑫安混合 C	0
	平安鑫安混合 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	平安鑫安混合 A	0

开放式基金	平安鑫安混合 C	0
	平安鑫安混合 E	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安鑫安混合 A	平安鑫安混合 C	平安鑫安混合 E
基金合同生效日（2015 年 12 月 11 日） 基金份额总额	264,842,656.60	129,796,003.55	-
本报告期期初基金份额总额	16,936,372.92	2,612,612.74	-
本报告期期间基金总申购份额	576,223.76	321,663.94	320,676,598.10
减：本报告期期间基金总赎回份额	7,059,795.27	456,757.27	95,650,144.13
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	10,452,801.41	2,477,519.41	225,026,453.97

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安鑫安混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，平安鑫安混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人平安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定自 2019 年 3 月 5 日至 2019 年 3 月 17 日以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议审议了《关于平安鑫安混合型证券投资基金调整基金管理费率相关事项的议案》、《关于平安鑫安混合型证券投资基金调整基金托管费率相关事项的议案》和《关于平安鑫安混合型证券投资基金修改基金合同表述相关事项的议案》，本次大会决议自 2019 年 3 月 18 日起生效。详细内容请阅读本公司于 2019 年 3 月 20 日发布的《平安基金管理有限公司关于平安鑫安混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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、2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
民生证券	2	3,453,866.51	20.57%	2,525.84	18.67%	-
银河证券	2	3,219,413.12	19.17%	2,997.83	22.15%	-
国泰君安	2	2,748,274.53	16.37%	1,955.19	14.45%	-
东方证券	2	1,468,464.00	8.74%	1,073.90	7.94%	-
长江证券	1	1,447,202.00	8.62%	1,347.70	9.96%	-
中泰证券	1	1,054,903.00	6.28%	750.35	5.55%	-
招商证券	2	858,960.00	5.11%	800.10	5.91%	-
华泰证券	3	736,268.01	4.38%	523.73	3.87%	新增 2 个
广发证券	1	691,998.14	4.12%	644.56	4.76%	-
中信证券	2	544,886.00	3.24%	507.42	3.75%	-
西南证券	1	317,128.20	1.89%	225.58	1.67%	-
兴业证券	2	251,773.00	1.50%	179.08	1.32%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

注：

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
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	3,299,878.50	2.68%	-	-	-	-
国泰君安	13,173,989.78	10.68%	27,600,000.00	30.00%	-	-
东方证券	331,224.92	0.27%	8,000,000.00	8.70%	-	-
长江证券	1,204,766.20	0.98%	17,700,000.00	19.24%	-	-
中泰证券	18,600.00	0.02%	-	-	-	-
招商证券	810,252.47	0.66%	-	-	-	-
华泰证券	2,267,007.14	1.84%	-	-	-	-
广发证券	8,381,647.00	6.80%	-	-	-	-
中信证券	21,200,909.81	17.19%	-	-	-	-
西南证券	3,078,012.74	2.50%	1,000,000.00	1.09%	-	-
兴业证券	292,982.80	0.24%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

国海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	321,078.50	0.26%	15,000,000.00	16.30%	-	-
西藏东方财富	177,156.00	0.14%	14,700,000.00	15.98%	-	-
平安证券	68,091,024.66	55.22%	-	-	-	-
安信证券	668,066.80	0.54%	8,000,000.00	8.70%	-	-

§ 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	2019/03/04--2019/03/26	0.00	19,219,680.95	0.00	19,219,680.95	8.08%
	2	2019/03/04--2019/03/26	0.00	19,219,680.95	19,219,680.95	0.00	0.00%

产品特有风险

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。

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 5000 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、为更好地满足投资者的投资需求，根据《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》及《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的规定及平安鑫安混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同的约定，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）在与本基金基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案后，决定自 2019 年 2 月 19 日起在现有基金份额的基础上增设 E 类份额，原 A 类份额和 C 类份额保持不变。详细内容请阅读本公司 2019 年 2 月 19 日发布的《关于平安鑫安混合型证券投资基金增设 E 类份额及相关事项的公告》。

2、为保护基金份额持有人利益，根据《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》和《平安鑫安混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，平安鑫安混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2019 年 2 月 19 日起提高本基金基金份额净值的精确位数至 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。详细内容请阅读本公司 2019 年 2 月 19 日发布的《关于平安鑫安混合型证券投资基金提高基金份额净值精度并修改基金合同、托管协议的公告》。

平安基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日