平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期:2019年4月18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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17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。

§2 基金产品概况

基金简称	平安智慧中国混合
场内简称	–
交易代码	001297
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6月9日
报告期末基金份额总额	817,936,960.29份
投资目标	本基金致力于发掘中国经济转型和产业升级中新技术或新模式带来的投资机会,通过重点投资与高端装备制造、工业4.0、互联网主题相关的优质证券,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用“自下而上,个股优选”的投资策略,挖掘经济转型和产业升级中新技术和新模式带来的投资机会,重点投资高端装备制造业、工业4.0、互联网主题相关的股票,构建在中长期能够从转型中受益的投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,其预期风险收益水平低于股票型证券投资基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 – 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	40,870,038.09
2.本期利润	111,975,142.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.1357
4.期末基金资产净值	435,904,766.32
5.期末基金份额净值	0.533

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。

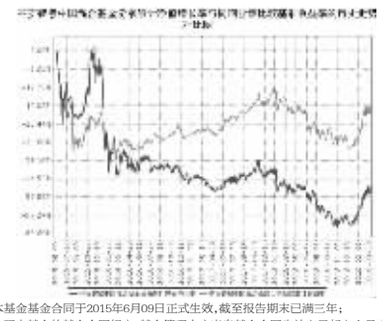
3.2 基金净值表现

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	34.26%	1.61%	22.78%	1.24%	11.48%	0.37%

业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

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



1、本基金基金合同于2015年6月09日正式生效,截至报告期末已满三年;

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的约定。

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

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		
神爱前	平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016年8月2日	2019年1月18日	8	神爱前先生,厦门大学财政学硕士。曾任第一创业证券研究所行业研究员、民生证券研究所高级研究员、第一创业证券资产管理部高级研究员,2014年12月加入平安基金管理有限公司,任投资研究部高级研究员,现任平安策略先锋混合型证券投资基金基金经理。
李化松	权益投资中心投资董事总经理、平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2018年8月10日	–	12	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基金经理。

1、对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年的大幅下跌使得大部分公司的估值达到历史最低水平,2019年一季度市场出现了快速上涨;但这只是对于这种非理性情绪的修复。

目前A股市场优质公司的估值水平仍然处于历史均值以下,和国际同业横向比较也比较低。

只是短期股价涨幅过快,跑在了基本面前面,所以市场需要结合正在公布的年报、季报,对之前的判断给予验证。

对于优质公司,我们可以看到,很多公司的业绩符合甚至超预期,即使短期业绩低于预期,但是只要公司的相对竞争优势持续提升,短期因为经济需求低于预期导致的业绩低于预期,反而是较好的加仓机会。市场上有很多资金其实是在等待这种机会。而对于质地较差的公司,尤其是偏主题炒作的公司,业绩相对于优质公司明显差很多。

对于长期市场,我们坚定乐观,第一,新一轮技术创新驱动的经济增长或将到来,第二,经济增速下台阶对于优质企业和权益投资是好事,第三,外资持续流入改善生态环境;第四,A股市场生态环境持续改善,敢于看空的声音越来越多,政策也更加客观的应对市场。随着经济逐渐接近底部,我们或将迎来中长期的牛市。

4.5 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0.533元;本报告期基金份额净值增长率为34.26%,业绩比较基准收益率为22.78%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

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	383,470,454.63	84.02
	其中:股票	383,470,454.63	84.02
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	60,850,106.44	13.33
8	其他资产	12,106,952.65	2.65
9	合计	456,427,513.72	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	13,334,479.00	3.06
B	采矿业	–	–
C	制造业	266,540,286.38	61.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	7,076,718.00	1.62
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,580,585.00	3.34
J	金融业	24,127,730.00	5.54
K	房地产业	36,219,391.25	8.31
L	租赁和商务服务业	21,591,265.00	4.95
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	383,470,454.63	87.97

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	002304	洋河股份	183,300	23,905,986.00	5.48
2	002127	南极电商	1,885,700	21,591,265.00	4.95
3	002035	华帝股份	1,459,200	20,472,576.00	4.70
4	002271	东方雨虹	912,000	19,215,840.00	4.41
5	601155	新城控股	398,815	18,006,497.25	4.13
6	000858	五粮液	188,899	17,945,405.00	4.12
7	600438	通威股份	1,456,800	17,714,688.00	4.06
8	600519	贵州茅台	20,050	17,122,499.50	3.93
9	002475	立讯精密	661,400	16,402,720.00	3.76
10	300014	亿纬锂能	611,583	14,910,393.54	3.42

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。

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。

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

本基金本报告期无股指期货投资情况。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	433,978.00
2	应收证券清算款	11,567,043.00
3	应收股利	–
4	应收利息	13,223.75
5	应收申购款	92,707.90
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	12,106,952.65

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	825,829,546.79
报告期期间基金总申购份额	40,243,138.81
减:报告期期间基金总赎回份额	48,135,725.31
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“–”填列)	–
报告期期末基金份额总额	817,936,960.29

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(3)平安智慧中国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)平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告原文

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

8.3 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18日

平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期:2019年4月18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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17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。

§2 基金产品概况

基金简称	平安中高等级公司债利差因子ETF
场内简称	公司债
交易代码	511030
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018年12月27日
报告期末基金份额总额	51,090,710.00份
投资目标	本基金将紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%,年化跟踪误差不超过3%。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,力争把跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金力争把标本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中债–中高等级公司债利差因子指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险收益水平相应会高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。本基金属于指数基金,采用分层抽样复制策略,跟踪中债–中高等级公司债利差因子指数,其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 – 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	42,895,120.11
2.本期利润	39,171,262.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0145
4.期末基金资产净值	5,149,357,764.06
5.期末基金份额净值	100.7885

注:1.本基金基金合同于2018年12月27日正式生效,截至本报告期末未满半年;

2.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;

3.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。

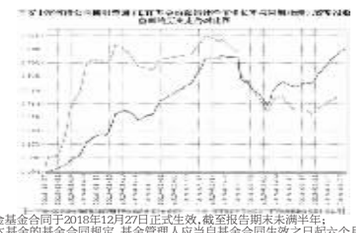
3.2 基金净值表现

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%	0.04%	0.38%	0.06%	0.39%	–0.01%

中债–中高等级公司债利差因子指数收益率

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



1、本基金基金合同于2018年12月27日正式生效,截至报告期末未满半年;

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完成建仓。

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

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		
李宪	平安中债–中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2018年12月27日	–	6	李宪先生,上海交通大学工商管理专业硕士,曾先后担任德勤华永会计师事务所高级审计员、汇添富基金管理股份有限公司资运经理。2017年4月加入平安基金管理有限公司,曾任资产配置事业部ETF指数投资中心指数研究员,现担任平安中证5–10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债–中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

1、对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安中债–中高等级公司债利差因子交易型开放式指数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

本基金为被动管理基金,主要采用代表性分层抽样复制策略对业绩比较基准进行跟踪。报告期内利用利用量化科技手段对分析标的指数中各成份公司债的历史数据和市场流动性,以隐含评级为最主要的指标,选取最具性价比的公司债构建组合,达到复制标的指数、降低交易成本的目的。

4.5 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100.7885元;本报告期基金份额净值增长率为0.77%,业绩比较基准收益率为0.38%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

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	4,919,471,119.90	95.46
	其中:债券	4,919,471,119.90	95.46
	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	12,000,000.00	0.23
	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	101,858,347.11	1.98
8	其他资产	120,295,802.14	2.33
9	合计	5,153,625,269.15	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

5.2.2 报告期末积极投资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。

5.2.3 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资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	136079	15中航债	1,400,000	140,490,000.00	2.73
2	143616	18浙能01	1,300,000	134,550,000.00	2.61
3	143562	18川发01	1,200,000	125,112,000.00	2.43
4	143257	17广电01	1,200,000	124,416,000.00	2.42
5	136773	16清控02	1,100,000	107,855,000.00	2.09

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

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

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

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

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

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

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

报告期内,本基金未参与股票交易。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	122,149.22
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	119,884,179.22
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	289,473.70
8	其他	–
9	合计	120,295,802.14

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

5.11.5.1 报告期末指数投资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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,104,070,932.00
报告期期间基金总申购份额	50,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	–
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“–”填列)	–5,053,030,222.00
报告期期末基金份额总额	51,090,710.00

2019年2月20日为本基金份额折算日,折算前份额为5,104,070,932.00份,折算后份额为51,040,710.00份,因折算产生的份额变动–5,053,030,222.00计入拆分变动份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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者超过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	20190101–20190331	4,000,538,999.00	–	3,960,533,609.00		40,005,390.00	78.30%
产品特有风险								
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。								

2019年2月20日为本基金份额折算日,因份额折算产生的份额变动计入“赎回份额”,所列客户实际未进行赎回。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安中债–中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

(2)平安中债–中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金基金合同

(3)平安中债–中高等级公司债利差因子交易型开放式指数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)平安中债–中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金2019年第1季度报告原文

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 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18日

平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期:2019年4月18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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17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。

§2 基金产品概况

基金简称	平安中证沪港深高股息
场内简称	–
交易代码	003702
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	2017年1月25日
报告期末基金份额总额	15,077,579.19份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证沪港深高股息精选指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,力争把跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金力争把标本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证沪港深高股息精选指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 – 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	–52,880.41
2.本期利润	2,503,766.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.1602
4.期末基金资产净值	15,038,576.84
5.期末基金份额净值	0.9974

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。

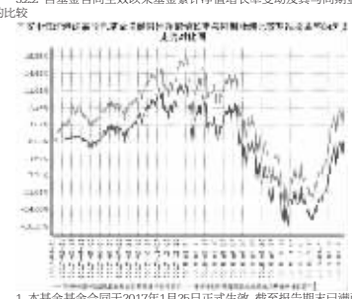
3.2 基金净值表现

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	19.04%	1.21%	19.81%	1.21%	–0.77%	0.00%

业绩比较基准:中证沪港深高股息精选指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%

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



1、本基金基金合同于2017年1月25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

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		
施旭	平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金的基金经理	2017年1月25日	–	9	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、平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金、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基金经理。
钱晶	平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金经理	2018年3月26日	–	7	钱晶先生,美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017年10月加入平安基金管理有限公司,任资产配置事业部ETF指数投资中心指数研究员。现任平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金、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MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

1、对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安中证沪港深高股息精选指数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.