

平安量化精选混合型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告



图1 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图2 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图3 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图4 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

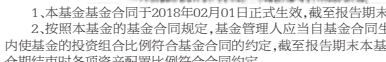


图5 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

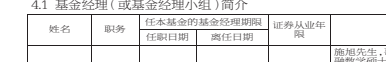


图6 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图7 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

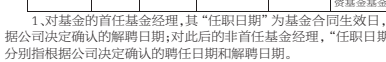


图8 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

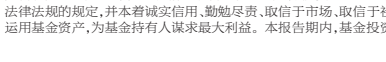


图9 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图10 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

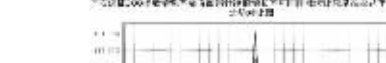


图11 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

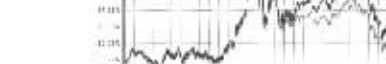


图12 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

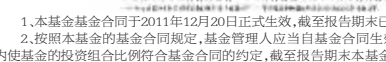


图13 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

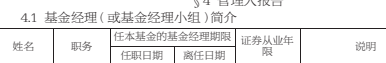


图14 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图15 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图16 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图17 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图18 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

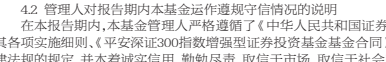


图19 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

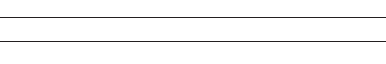


图20 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图21 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

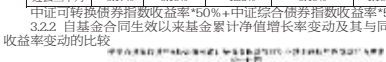


图22 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图23 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

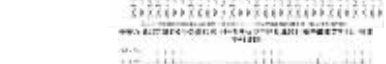


图24 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

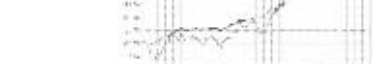


图25 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

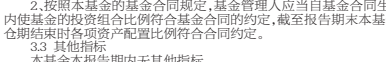


图26 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



图27 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)

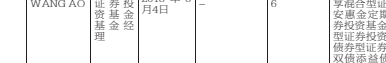


图28 平安量化精选混合型发起式证券投资基金资产净值(单位:亿元)



规模和合同约定的规定,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《证券投资基金管理人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
A股在一季度流动性和风险溢价修复,估值快速回升后,二季度市场受自身盈利修复节奏及外部因素等影响,前期利好被市场反应后,市场进入回落震荡阶段,随着贸易摩擦趋缓,科创板临近,以及流动性宽松的预期的提升,A股季度反弹动力重新累积。二季度,本基金策略以中证800量化增强策略为主,结合人工智能选股技术,争取持部分超额收益。

截至本报告期末平安量化精选混合A基金份额净值为0.9601元,本报告期基金份额净值增长率为-2.46%;截至本报告期末平安量化精选混合C基金份额净值为0.5940元,本报告期基金份额净值增长率为-2.65%;同期业绩比较基准收益率为-0.04%。

4.6 报告期内基金持有人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人数不满200人、基金资产净值低于5,000万元的情形。

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	58,542,504.36	68.83
2	其中:股票	58,542,504.36	68.83
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	买入返售金融资产	-	-
10	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	30,334,460.31	34.11
12	其他资产	52,949.92	0.06
13	合计	88,929,913.59	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	792,314.00	0.08
B	采矿业	766,029.10	0.07
C	制造业	26,867,792.48	28.26
D	电力、热力、燃气及生产供应	1,912,512.00	2.16
E	建筑业	2,888,912.00	2.36
F	批发和零售业	3,529,680.00	2.86
G	交通运输、仓储和邮政业	1,362,826.00	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,963,274.44	2.22
J	金融业	16,211,763.04	16.34
K	房地产业	2,288,000.00	2.63
L	租赁和商务服务业	1,372,062.00	1.16
M	科学研究和技术服务业	277,376.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

5.2.2 报告期末按行业分类的境外股票投资组合
5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

5.4 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债券投资明细

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十名资产支持证券投资明细

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五名贵金属投资明细

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权证投资明细

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 本期国债期货投资损益

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、处罚的情况。

5.11.2 报告期内基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

5.11.4 其他资产构成

5.11.5 其他资产构成

5.11.6 其他资产构成

5.11.7 其他资产构成

5.11.8 其他资产构成

5.11.9 其他资产构成

5.11.10 其他资产构成

5.11.11 其他资产构成

5.11.12 其他资产构成

5.11.13 其他资产构成

5.11.14 其他资产构成

5.11.15 其他资产构成

5.11.16 其他资产构成

5.11.17 其他资产构成

5.11.18 其他资产构成

5.11.19 其他资产构成

5.11.20 其他资产构成

5.11.21 其他资产构成

5.11.22 其他资产构成

5.11.23 其他资产构成

5.11.24 其他资产构成

5.11.25 其他资产构成

5.11.26 其他资产构成

5.11.27 其他资产构成

5.11.28 其他资产构成

5.11.29 其他资产构成

5.11.30 其他资产构成

5.11.31 其他资产构成

5.11.32 其他资产构成

5.11.33 其他资产构成

5.11.34 其他资产构成

5.11.35 其他资产构成

5.11.36 其他资产构成

5.11.37 其他资产构成

5.11.38 其他资产构成

5.11.39 其他资产构成

5.11.40 其他资产构成

5.11.41 其他资产构成

5.11.42 其他资产构成

5.11.43 其他资产构成

5.11.44 其他资产构成

5.11.45 其他资产构成

5.11.46 其他资产构成

5.11.47 其他资产构成

5.11.48 其他资产构成

5.11.49 其他资产构成

5.11.50 其他资产构成

5.11.51 其他资产构成

5.11.52 其他资产构成

5.11.53 其他资产构成

5.11.54 其他资产构成

5.11.55 其他资产构成

5.11.56 其他资产构成

5.11.57 其他资产构成

5.11.58 其他资产构成

5.11.59 其他资产构成

5.11.60 其他资产构成

5.11.61 其他资产构成

5.11.62 其他资产构成

5.11.63 其他资产构成

5.11.64 其他资产构成

5.11.65 其他资产构成

5.11.66 其他资产构成

5.11.67 其他资产构成

5.11.68 其他资产构成

5.11.69 其他资产构成

5.11.70 其他资产构成

5.11.71 其他资产构成

5.11.72 其他资产构成

5.11.73 其他资产构成

5.11.74 其他资产构成

5.11.75 其他资产构成

5.11.76 其他资产构成

5.11.77 其他资产构成

5.11.78 其他资产构成

5.11.79 其他资产构成

5.11.80 其他资产构成

5.11.81 其他资产构成

5.11.82 其他资产构成

5.11.83 其他资产构成

5.11.84 其他资产构成

5.11.85 其他资产构成

5.11.86 其他资产构成

5.11.87 其他资产构成

5.11.88 其他资产构成

5.11.89 其他资产构成

5.11.90 其他资产构成

5.11.91 其他资产构成

5.11.92 其他资产构成

5.11.93 其他资产构成

5.11.94 其他资产构成

5.11.95 其他资产构成

5.11.96 其他资产构成

5.11.97 其他资产构成

5.11.98 其他资产构成

5.11.99 其他资产构成

5.11.100 其他资产构成

5.11.101 其他资产构成

5.11.102 其他资产构成

5.11.103 其他资产构成

5.11.104 其他资产构成</