

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

基金管理人:平安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2019年7月16日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月15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。投资人投资有风险，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。

本报告期间自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 平安量化精选混合

场内简称 -

交易代码 006496

基金运作方式 灵活配置混合

基金合同生效日 2018年2月1日

报告期末基金份额总额 92,462,674.63份

基金类别 在严控风险的基础上，本基金通过量化模型进行资产配置，精选优质股票，力争实现基金资产的长期增值。

投资目标 本基金通过量化模型，在严控风险的基础上，精选优质股票，力争实现基金资产的长期增值。

风险收益特征 本基金是股票型基金，净值表现及预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

基金管理人 平安基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 平安量化精选混合A 平安量化精选混合C

下属分级基金的场内简称 -

下属分级基金的交易代码 006496 006497

下属分级基金的上市交易代码 -

报告期末下属分级基金的份额总额 57,972,424.20份 34,670,143.20份

下属分级基金的份额净值 0.9490 0.9490

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位:人民币元

报告期:2019年4月1日 - 2019年6月30日

平安量化精选混合A 平安量化精选混合C

1.本期已实现收益 4,956,196.48 327,422.00

2.本期利润 -423,159.76 -17,269.00

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0069 -0.0068

4.期末基金资产净值 56,489,090.83 32,022,832.61

5.期末基金份额净值 0.9490 0.9490

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.2 本基金报告期内基金的份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安量化精选混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.46% 1.31% -0.05% 1.06% -1.96% 0.25%

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.68% 1.31% -0.05% 1.06% -2.10% 0.25%

沪深300指数收益率*70%+商业银行活期存款利率(税后)*30%

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

平安量化精选混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.46% 1.31% -0.05% 1.06% -1.96% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.3 报告期内本基金的业绩表现

平安量化精选混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.46% 1.31% -0.05% 1.06% -1.96% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.4 本基金报告期内基金的份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安量化精选混合C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.68% 1.31% -0.05% 1.06% -2.10% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.5 其他指标

平安量化精选混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.46% 1.31% -0.05% 1.06% -1.96% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.6 本基金报告期内基金的份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安量化精选混合C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.68% 1.31% -0.05% 1.06% -2.10% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.7 其他指标

平安量化精选混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.46% 1.31% -0.05% 1.06% -1.96% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.8 本基金报告期内基金的份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安量化精选混合C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.68% 1.31% -0.05% 1.06% -2.10% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.9 其他指标

平安量化精选混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.46% 1.31% -0.05% 1.06% -1.96% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.10 本基金报告期内基金的份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安量化精选混合C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.68% 1.31% -0.05% 1.06% -2.10% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.11 其他指标

平安量化精选混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.46% 1.31% -0.05% 1.06% -1.96% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.12 本基金报告期内基金的份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安量化精选混合C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.68% 1.31% -0.05% 1.06% -2.10% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.13 其他指标

平安量化精选混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.46% 1.31% -0.05% 1.06% -1.96% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.14 本基金报告期内基金的份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安量化精选混合C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.68% 1.31% -0.05% 1.06% -2.10% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.15 其他指标

平安量化精选混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.46% 1.31% -0.05% 1.06% -1.96% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.16 本基金报告期内基金的份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安量化精选混合C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.68% 1.31% -0.05% 1.06% -2.10% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.17 其他指标

平安量化精选混合A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.46% 1.31% -0.05% 1.06% -1.96% 0.25%

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)和经常性损益之和，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.所述基金业绩标准不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算费用后实际收益水平以低于所示数字。

3.2.18 本基金报告期内基金的份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安量化精选混合C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.68% 1.31% -0.05% 1.06% -2.10% 0.25%