(上接B082版)

办公地址:深圳市深南大道7028号时代科技大厦20层西
法定代表人:朱治理
联系人:郭东彤
电话:0755-82830333-115
传真:0755-25170807
网址:ww.wanhesec.com
(86)北京懒猫金融信息服务有限公司
注册地址:北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119
办公地址:北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区1111号
法定代表人:许现良
联系人:朱翔宇
联系电话:15921710500
网址:www.lanmao.com
客服电话:400-500-882
(87)厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
邮政编码:361002
法定代表人:陈洪生
联系人:陈承智
电话:0592-3122673
传真:0592-3122701
客服电话:400-918-0808
(88)上海陆享基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路888号1幢1区14032室
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇广场二座16层
法定代表人:陈志英
联系人:唐京莎
电话:021-53398816
网址:http://www.luxxfund.com/
(89)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦
法定代表人:陈继武
联系人:高浩辉
联系电话:021-63333389
客服电话:400 643 3389
网址:https://www.vstonewealth.com/
(90)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼
邮政编码:330000
法定代表人:徐丽峰
联系人:占文驰
电话:0791-86283372
传真:0791-86281305
(91)江苏汇林保大基金销售有限公司
注册地址:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号
办公地址:江苏省南京市鼓楼区中山北路105号中环国际1413室
法定代表人:吴言林
电话:025-66046166转837
传真:025-56663409
联系人:孙平
客户服务热线:025-66046166
网址:www.huilinbd.com
二、注册登记机构
名称:平安基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
法定代表人:罗春风
电话:0755-22624581
传真:0755-23990088
联系人:张平
三、出具法律意见书的律师事务所
律师事务所:北京市京伦律师事务所
地址:北京市海淀区中关村南大街17号韦伯时代中心C座1910
负责人:曹斌(执业证号:11101200110651368)
电话:010-68938188
传真:010-88578761
经办律师:杨晓勇(执业证号:11101200210185600)
伍柳(执业证号:11101201010583675)
联系人:杨晓勇(执业证号:11101200210185600)
四、审计基金财产的会计师事务所
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
联系电话:(021)2323 8888
传真电话:(021)2323 8800
经办注册会计师:曹翠丽、陈怡
联系人:陈怡

第四部分 基金的名称

平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型

混合型证券投资基金

第六部分 基金的运作方式

契约型开放式

第七部分 基金的投资

一、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。

二、投资范围

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的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货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)。

在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的条件下,履行适当程序后,本基金可参与证券投资基金、同业存单的投资,具体投资比例限制、证券投资基金的投资策略、估值方法按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。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,可以将其纳入投资范围。

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0-95%,投资于高端装备制造、工业4.0、互联网主题相关证券不低于非现金基金资产的80%。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,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

三、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或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。

(一)大类资产配置

为有效实施投资策略,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,本基金将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,通过多因子动态资产配置模型和基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型的决策支持,对股票资产和固定收益资产等不同金融工具的风险收益特征进行预测分析,确定合适的中长期的资产配置比例配置方案。

(二)股票投资策略

本基金将精选有良好增值潜力的、与高端装备制造业、工业4.0、互联网主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。股票投资策略将从定性和定量两方面入手,定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素;定量方面主要考察公司估值、资产质量及财务状况,比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标,优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。

1、高端装备制造、工业4.0、互联网主题的界定

1)高端装备制造主题的相关证券界定

本基金所指的高端装备制造业为:在制造业中具有先进核心技术、新产品创新能力、高附加值产品和国际竞争力的行业,以及围绕上述行业提供服务和产品的行业。随着未来经济增长方式的转变、产业结构的升级,从事或受益于上述投资主题的外延也将逐渐扩大,基金管理人有权适时对上述定义进行补充和修订。

2)工业4.0主题的相关证券界定

一类是中国版工业4.0 如何实现的路径类标的,包括智能工厂的模式、基础设施、系统集成方案、通用及辅助设备等;另一类是中国版工业4.0 实施后要突破的重点行业类标的:

与国际先进水平已具备竞争力的产业,如航天装备、通信网络装备、发电与输变电装备、轨道交通装备等;

与国民经济、国防建设和人民生活休戚相关的战略必争产业,如集成电路及其专用生产装备、数控机床与基础制造装备、航空装备、海洋工程装备及船舶等。

随着未来经济增长方式的转变、产业结构的升级,从事或受益于上述投资主题的外延也将逐渐扩大,基金管理人有权适时对上述定义进行补充和修订。

3)互联网主题的相关证券界定

①有独特商业模式、深刻影响人们生活方式的快速成长的互联网公司等;

②为互联网建设提供基础设施的软件、硬件设备等行业的公司等;

③使用互联网技术、互联网工具、互联网思维带动传统行业升级改造的优质上市公司等;

若未来由于技术进步或政策变化导致本基金互联网主题相关行业和公司相关业务的覆盖范围发生变动,基金管理人有权适时对上述定义进行补充和修订。

2、高端装备制造、工业4.0、互联网主题股票投资策略

本基金主要采取“自下而上”的选股策略,基于对上市公司成长性和估值水平的综合考量,使用定性与定量相结合的方法精选股票进行投资。

首先,使用定性分析的方法,从技术能力、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司的基本情况进行分析。

1)在技术能力方面,选择研发团队技术实力强、技术的发展与应用前景广阔并且在技术上具有一定护城河的公司。

2)在市场前景方面,需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势、进而开拓市场、创造利润增长的能力。

3)在公司治理结构方面,将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体系等方面进行评价,公司治理能力的优劣对公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平都有至关重要的影响。

其次,使用定量分析的方法,通过财务和运营数据对企业价值进行评估。本基金主要从行业景气度、盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量。

1)行业景气度

本基金通过一系列定量指标对行业景气度进行研判。这些指标包括行业销售收入增长率、行业毛利率和净利率、原始材料和成品价格指数以及库存率等。通过与历史和市场平均水平进行比较,并结合定性分析的结果来评判行业的景气度水平。

2)盈利能力

本基金通过盈利能力分析评估上市公司创造利润的能力,主要参考的指标包括变现能力、净资产收益率(ROE),毛利率,净利率,EBITDA/主营业务收入等。

3)成长能力

本基金通过成长能力分析评估上市公司未来的盈利增长速度,主要参考的指标包括用户数增长率、主营业务收入增长率和EPS增长率等。

4)估值水平

本基金通过估值水平分析评估当前市场估值的合理性,主要参考的指标包括市值收入比、市盈率 (P/E)、市净率(P/B)、市盈增长比率 (PEG)、自由现金流贴现(FCFF,FCFE)和企业价值/EBITDA等。

(三)债券投资策略

债券投资策略方面,本基金在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定不同类属资产的最优权重。

在微观市场定价分析方面,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

(四)权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值,发现市场对股票权证的非理性定价;利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的。

(五)衍生品投资策略

本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。投资原则为有于基金资产增值,控制下跌风险实现保和锁定收益。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立衍生品投资决策部门或小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

(六)中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制,通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制,严格控制风险,对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估,并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响,通过信用研究和流动性管理后,决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

(七)资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

四、投资限制

(一)组合限制

本基金的投资组合应遵循以下限制:

1、本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%,投资于高端装备制造、工业4.0、互联网主题相关证券不低于非现金基金资产的80%;

2、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,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,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

3、本基金持有一家上市公司的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

5、本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

6、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

7、本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

8、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

9、本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

10、本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

11、本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

12、本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

13、基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

14、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

15、本基金投资单只中期票据的额度不得超过基金资产净值的10%;公司旗下所有基金投资单只中期票据不得超过其发行额的10%;

16、本基金若参与股指期货交易,应当符合下列投资限制:

1) 在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%;

2)本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;其中,有价证券指股票、债券 (不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

3) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产比例为0-95%;

5) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

17、本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过该基金资产净值的10%;

18、基金总资产不得超过基金净资产的140%;

19、本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金) 持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

20、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

21、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

22、法法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第2、12、20、21项以外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

(二)禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

1、承销证券;

2、违反规定向他人贷款或者提供担保;

3、从事承担无限责任的投资;

4、买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;

5、向其基金管理人、基金托管人出资;

6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

7、法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合中国证监会的规定,并履行信息披露义务。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。

业绩比较基准选择理由:

沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数,由中证指数公司编制和维护。该指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。

中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,其选样是在中证全债指数样本的基础上,增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,为债券投资者提供更切合的市场基准。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束,设定本基金的基准为沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%,该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,又或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召集基金份额持有人大会。

六、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。

七、基金管理人代表行使股东及债权人权利的处原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利,保护基金份额持有人的利益;

2、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;

3、有利于基金资产的安全与增值;

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

八、其他

(一)投资决策依据及程序

1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

(1)投资决策委员会制定整体投资战略。

(2)投资研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果,构建股票备选库、精选库,对拟投资对象进行持续跟踪调研,并提供个股、债券决策支持。

(3)基金经理根据投资决策委员会的投资战略,结合投资研究部对证券市场、上市公司、投资时机的分析,拟订所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、行业配置、重仓个股投资方案。

(4) 投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要。

(5)根据决策纪要,基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由集中交易室执行。

(6)集中交易室按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理。

(7) 基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

(8)风险管理委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注基金投资组合的风险状况;基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

(二)基金的融资融券、转融通

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,经与托管人协商一致,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定。

九、基金投资组合报告

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,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。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日,本财务数据未经审计。

1.1 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

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 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

1.2.2 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。

1.3 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

1.4 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。

1.5 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。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 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。

1.9.2 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。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 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。

1.10.2 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。

1.10.3 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。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

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。

1.11.2

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。

1.11.3 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

1.11.4 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。

1.11.5 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。

1.11.6 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。

第八部分基金的业绩

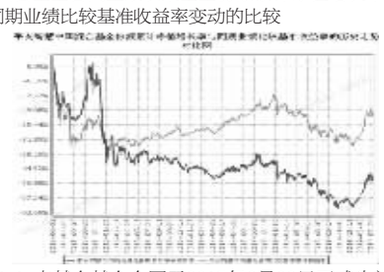
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、自基金合同生效以来(2015年6月9日)至2019年3月31日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
2015.6.9-2015.6.30	-11.90%	1.21%	-13.20%	2.98%	1.30%	-1.77%
2015.7.1-2015.12.31	4.65%	1.86%	-12.06%	2.14%	16.71%	-0.28%
2016.1.1-2016.6.30	-32.86%	2.79%	-12.01%	1.47%	-20.85%	1.32%
2016.7.1-2016.12.31	-10.99%	1.01%	4.11%	0.61%	-15.10%	0.40%
2017.1.1-2017.6.30	-0.36%	0.82%	8.59%	0.46%	-8.95%	0.36%
2017.7.1-2017.12.31	4.19%	1.20%	7.96%	0.56%	-3.77%	0.64%
2018.1.1-2018.6.30	-12.76%	1.51%	-9.63%	0.92%	-3.13%	0.59%
2018.7.1-2018.12.31	-20.44%	1.53%	-10.68%	1.20%	-9.76%	0.33%
2019.1.1-2019.3.31	34.26%	1.61%	22.78%	1.24%	11.48%	0.37%
自基金合同生效起至今	-46.70%	1.64%	-18.76%	1.25%	-27.94%	0.39%

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%

二、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



注:1、本基金基金合同于2015年6月09日正式生效,截至报告期末已满四年;

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。

第九部分基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、基金的相关账户的开户及维护费用;

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3-8项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2 日前在指定媒介上刊登公告。

第十部分其他应披露事项

(一)本基金管理人、基金托管人目前无重大诉讼事项。

(二)最近半年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。

(三)2018年12月9日至2019年6月8日发布的公告:

1、2019年1月3日,平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告;

2、2019年1月17日,关于不法分子冒用“花生宝”名义开展非法金融业务的严正声明;

3、2019年1月18日,平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金2018年第4季度报告;

4、2019年1月19日,关于平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告;

5、2019年1月22日,平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2018年第2期)以及摘要;

6、2019年1月29日,平安基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告;

7、2019年2月12日,平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告;

8、2019年2月27日,平安基金管理有限公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告;

9、2019年2月27日,关于旗下基金所持长春高新(000661)估值调整的公告;

10、2019年3月9日,关于暂停苏州财路基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告;

11、2019年3月15日,关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告;

12、2019年3月18日,关于旗下部分基金新增中证金牛(北京)投资咨询有限公司为销售机构的公告;

13、2019年3月26日,平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金2018年年度报告以及摘要;

14、2019年3月29日,关于暂停北京钱景基金销售有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告;

15、2019年4月3日,关于旗下部分基金新增国盛证券有限责任公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告;

16、2019年4月18日,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;

17、2019年5月10日,关于旗下部分基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告;

18、2019年5月14日,关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构的公告;

(四)《招募说明书》与本次更新的招募说明书内容若有不一致之处,以本次更新的招募说明书为准。

第十一部分对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》等其他有关法律法规的要求及基金合同的规定,对2019年7月19日公布的《平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2019年第1期)》进行了更新,本次重大更新事项为依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订“基金信息披露”章节及相关内容。

平安基金管理有限公司
2019年12月27日