(上接A71版)

联系人:韩钰
电话:010-6083 3754
传真:010-5776 2999
客服电话:400-990-8826
网址:www.citicsf.com
(75)苏州财路基金销售有限公司
注册地址:苏州工业园区华池街88号1幢1003室
办公地址:苏州市姑苏区苏站路1599号7号楼1101室
法定代表人:高志华
联系人:张君
电话:0512-68603767,18516765123
客服电话:0512-68603767
网址:www.cai6.com
(76)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
联系人:威晓强
客服电话:400-061-8518
网址:https://danjuanapp.com
(77)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:钱燕飞
联系人:赵耶
客服电话:95177
网址:www.snjijin.com
(78)深圳信诚基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋210室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区时代财富大厦第49A单元
法定代表人:周文
联系人:杨涛
客服电话:0755-23946579
网址:www.ecpefund.com
(79)南京证券股份有限公司
注册地址:南京市玄武区大钟亭8号
办公地址:南京市江东中路389号
法定代表人:步国旬
联系人:王万君
电话:025-58519523
客服电话:95386
网址:www.njzq.cn
(80)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
法定代表人:俞洋
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号
联系人:杨莉娟
业务联系电话:021-54967552
传真电话:021-54967293
网站:www.cfsc.com.cn
客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
(81)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
联系人:蓝杰
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客户服务电话:021-65370077
网址:www.jiyufund.com.cn
(82)海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
法定代表人:刘惠
联系人:毛林
客服电话:400-808-1016
网址:www.fundhaiyin.com
(83)华瑞保险销售有限公司
注册地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
办公地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
法定代表人:路昊
联系人:茆勇强
电话:021-61058785
传真:021-61098515
客服电话:400-111-5818
网址:www.huaruisales.com
(84)通华财富(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼
法定代表人:马刚
联系人:杨徐霆
电话:021-60818249
客服电话:95156
(85)万和证券股份有限公司
注册地址:海口市南沙路49号通信广场二楼
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:0755-25170087
客服电话:400-888-2882
网址:www.wanhesec.com
(86)中民财富基金销售(上海)有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号17层05单元
法定代表人:弭洪军
联系人:黄鹏
电话:021-33355333
传真:021-63353736
客服电话:400-876-5716
(87)弘业期货股份有限公司
注册地址:南京市中华路50号
办公地址:南京市中华路50号
法定代表人:周剑秋
联系人:郭晓蓉
电话:025-68509525
传真:025-52313068
客服电话:400-828-1288
网址:http://www.ftol.com.cn/etrading/
(88)民商基金销售(上海)有限公司
注册地址:上海黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼A31室
办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
联系人:杨一新
电话:021-50206003
传真:021-50206001
客服电话:021-50206003
公司网站 http://www.msftec.com
(89)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
邮政编码:518000
法定代表人:姜昧军
联系人:王雯
客服电话:4008-323-000
网址:www.csco.com.cn
(90) 华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
邮政编码:230081
法定代表人:李工
联系人:范超
客服电话:95318
网址:www.hazq.com
(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
(92)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/
(93)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/
二、基金注册登记机构
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:广东仁人律师事务所
地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座23楼
负责人:杨少南
电话:0755- 82960158
传真:0755-82960236
经办律师:段善武、陈福平
联系人:段善武
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

平安鑫安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。

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类金融工具(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(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、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,可以将其纳入投资范围。

本基金为混合型基金,基金的投资组合比例为:股票等权益类资产投资占基金资产的比例范围为0-90%,其中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,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的,基金管理人在履行适当程序后,可以做出相应调整。

三、投资策略

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。

(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,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。

(二)股票投资策略

在严格控制风险的前提下,本基金将适度参与股票、权证等权益类资产的投资,以增加基金收益。

1、新股申购策略

本基金主要从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面确定参与标的、参与规模和退出时机,并综合考虑新股中签率、股价估值水平等因素,在有效识别和防范风险的前提下,获取较高的申购收益。

2、二级市场股票投资策略

本基金将主要采用"自下而上"的个股选择方法,在拟配置的行业内部通过定量与定性相结合的分析方法选筛选个股。

(1)定量分析:通过财务和运营数据进行企业价值评估,初步筛选出具备优势的股票备选库。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量。

①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净资产收益率(ROE)、毛利率、净利率、EBITDA/主营业务收入等。

②成长能力

投资方法上重视投资价值与成长潜力的平衡,一方面利用价值投资标准筛选低价股票,避免市场波动时的风险和股票价格高企的风险;另一方面,利用成长性投资可分享高成长收益的机会。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EPS增长率和主营业务收入增长率等。

③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。

(2)定性分析的方法:通过QV选股标准(品质-价值选股模型)从持续成长性、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司进行一步的精选。

QV选股标准(品质-价值选股模型)筛选主要包括以下几个方面:

品质评估(Quality)

商业模式(Business Model):商业模式清晰,有前途。

公司治理(Management):公司有良好治理结构,包括管理层水平、战略眼光、执行能力和公司运作架构等方面。

财务状况(Financial):财务状况健康。包括较高的ROE,低负债水平,高毛利或低成本,资本开支政策严格。

估值评级(Valuation)

未来盈利:对公司未来的盈利进行预测,并评估内在价值。

合理价格:投资股票的策略持续有效的基础是,可以用合理价格买到有吸引力的股票。如果买入一家优秀企业的股票而支付了过高价格,这将抵消这一优秀企业未来几年所创造的价值。

(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0-90%;

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,其中,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、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%;

6、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%;

7、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%;

8、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%;

9、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%;

10、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%;

11、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%;

12、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%;

13、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;

14、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;

15、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%;

16、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%;

17、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)占基金资产的比例为0-90%;

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%;

18、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%;

19、基金总资产不得超过基金净资产的140%;

20、本基金主动投资于流动性受限资产的合计不得超过该基金资产净值的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、13、20、21项外,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×40%+中证全债指数收益率×60%。

采用该比较基准主要基于如下考虑:

1、作为专业指数提供商提供的指数,中证指数公司提供的中证系列指数体系具有一定的优势和市场影响力;

2、在中证系列指数中,沪深300指数的市场代表性比较强,适合作为本基金股票投资的比较基准;而中证全债指数能够较好的反映债券市场变动的全貌,适合作为本基金债券投资的比较基准。

如果指数编制单位停止计算编制这些指数或更改指数名称,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

如果今后法律法规发生变化,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,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,本基金可以在与基金托管人协商一致,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

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、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定,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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	117,222,687.67	78.76
	其中:债券	117,222,687.67	78.76
	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	2,374,335.78	1.60
8	其他资产	29,247,690.63	19.65
9	合计	148,844,714.08	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票 。

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	24,995,905.30	18.69
	其中:政策性金融债	16,995,105.30	12.71
4	企业债券	8,001,600.00	5.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,761,600.00	15.53
7	可转债(可交换债)	195,082.37	0.15
8	同业存单	63,268,500.00	47.31
9	其他	-	-
10	合计	117,222,687.67	87.66

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

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	111805235	18建设银行CD235	200,000	19,392,000.00	14.50
2	111809352	18浦发银行CD352	200,000	19,384,000.00	14.50
3	180412	18农发12	100,000	10,030,000.00	7.50
4	111915108	19民生银行CD108	100,000	9,977,000.00	7.46
5	111812200	18北京银行CD200	100,000	9,688,000.00	7.24

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资情况。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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 报告期末本基金投资的国债期货投资。

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

银保监会于2018年11月9日做出银保监银罚决字〔2018〕5号处罚决定,由于中国民生银行股份有限公司(以下简称"公司"):贷款业务严重违反审慎经营规则,根据相关规定对公司罚款200万元。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。

1.11.2

本基金本报告期末未持有股票。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,854.02
2	应收证券清算款	14,518,231.63
3	应收股利	-
4	应收利息	1,295,929.27
5	应收申购款	13,426,675.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,247,690.63

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

本基金本报告期末未持有股票。

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12月11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:

平安鑫安A

阶段	份额净值增长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
2015.12.11-2015.12.31	0.00%	0.00%	1.86%	0.59%	-1.86%	-0.59%
2016.1.1-2016.12.31	-0.10%	0.11%	-2.97%	0.57%	2.87%	-0.46%
2017.1.1-2017.6.30	4.10%	0.32%	4.10%	0.24%	0.00%	0.08%
2017.7.1-2017.12.31	9.42%	0.42%	3.85%	0.28%	5.57%	0.14%
2018.1.1-2018.6.30	-2.72%	0.66%	-2.73%	0.46%	0.01%	0.20%
2018.7.1-2018.12.31	-8.04%	0.59%	-3.22%	0.59%	-4.82%	0.00%
2019.1.1-2019.3.31	4.16%	0.37%	11.74%	0.61%	-7.58%	-0.24%
自基金合同生效起至今	6.03%	0.42%	12.39%	0.49%	-6.36%	-0.07%

沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%。

平安鑫安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	②-③	②-④
2015.12.11-2015.12.31	0.00%	0.00%	1.86%	0.59%	-1.86%	-0.59%
2016.1.1-2016.12.31	-0.50%	0.12%	-2.97%	0.57%	2.47%	-0.45%
2017.1.1-2017.6.30	3.92%	0.33%	4.10%	0.24%	-0.18%	0.09%
2017.7.1-2017.12.31	9.28%	0.42%	3.85%	0.28%	5.43%	0.14%
2018.1.1-2018.6.30	-3.01%	0.66%	-2.73%	0.46%	-0.28%	0.20%
2018.7.1-2018.12.31	-8.21%	0.59%	-3.22%	0.59%	-4.99%	0.00%
2019.1.1-2019.3.31	4.04%	0.36%	11.74%	0.61%	-7.70%	-0.25%
自基金合同生效起至今	4.66%	0.42%	12.39%	0.49%	-7.73%	-0.07%

沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%。

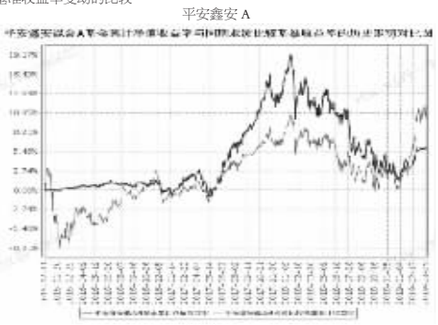
平安鑫安E

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	③-③	②-④
自基金份额成立日起至今	1.37%	0.24%	5.01%	0.73%	-3.64%	-0.49%

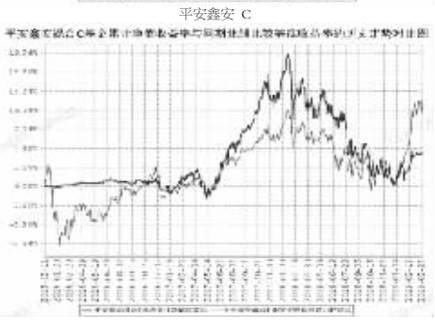
注:E类基金份额成立日为2019年2月19日。

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

平安鑫安A



平安鑫安C



平安鑫安E

/注:1、本基金基金合同于2015年12月11日正式生效,截至报告期已满三年;

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。

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、从C类、E类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金的相关账户的开户及维护费用;

10、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0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.60%÷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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费, C类基金份额的销售服务年费为0.40%,E类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。

销售服务费分别按前一日C类、E类基金资产净值的对应销售服务年费率计提。计算方法如下:

H=E×销售服务年费率÷当年天数

H为C类、E类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类、E类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经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划出,由注册登记机构代收,注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

销售服务费使用范围不包括基金募集期间的上述费用。

上述"一、基金费用的种类中第4—9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11日至2019年6月10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,平安鑫安混合型证券投资基金2018年第4季度报告;

4、2019年1月23日, 平安鑫安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;

5、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;

6、2019年2月1日,平安鑫安混合型证券投资基金基金经理变更公告;

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16日,关于召开平安鑫安混合型证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的公告;

9、2019年