

# 平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 4 月 20 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 04 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 2020 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                         |
|------------|-------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 平安鼎越混合                                                                  |
| 场内简称       | 平安鼎越                                                                    |
| 基金主代码      | 167002                                                                  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                  |
| 基金合同生效日    | 2016 年 9 月 20 日                                                         |
| 报告期末基金份额总额 | 18,947,060.20 份                                                         |
| 投资目标       | 本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略       | 本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，充分挖掘市场投资机会，力争实现资产的长期稳健增值。   |
| 业绩比较基准     | 沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%                                         |
| 风险收益特征     | 本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。                         |
| 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（2020 年 1 月 1 日-2020 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 5,584,133.48                        |
| 2. 本期利润         | 745,404.96                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0339                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 21,897,921.02                       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1557                              |

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<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -1.82%     | 2.97%         | -3.64%         | 0.95%                 | 1.82% | 2.02% |

##### 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

平安鼎越累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 09 月 20 日正式生效；

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。

### 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 |        |                                                                                      |
| 张俊生 | 权益投资中心投资副总监，平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2018 年 12 月 4 日 | —    | 13 年   | 张俊生先生，中国科学技术大学管理科学与工程专业硕士，曾先后担任广东发展银行政策分析主任、鹏华基金管理有限公司研究员、信达澳银基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基 |

|     |                       |                 |   |     |                                                                                                                                                                           |
|-----|-----------------------|-----------------|---|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                       |                 |   |     | 金经理，深圳昱昇富德资产管理有限公司合伙人兼投资总监，上海华信证券有限责任公司权益投资部总经理。2018 年 10 月加入平安基金管理有限公司，现任权益投资中心投资副总监。同时担任平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安安享灵活配置混合型证券投资基金、平安科技创新混合型证券投资基金基金经理。 |
| 刘俊廷 | 平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2016 年 9 月 20 日 | - | 8 年 | 刘俊廷先生，中国科学院研究生院硕士。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。2014 年 12 月加入平安基金管理有限公司，现任平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安鼎弘混合                                                             |

|  |  |  |  |  |                                                                          |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 型证券投资基金 (LOF)、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金、平安新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------|

注: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合规守信情况的说明

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、《平安鼎越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

2020 年, 市场经历了大幅度的震荡, 其中 1-2 月份市场大幅上涨, 而 3 月份伴随海外疫情超预期发展, 市场对全球经济衰退和全球产业链断裂担忧加剧, 海外股市经历了大幅下跌, 相应的 A 股也受到较大冲击, 特别是外需为主和全球产业链相关的行业, 受冲击较大。

本基金年初基于对市场较乐观判断, 一直维持较高股票仓位配置。持仓结构上, 主要布局科技成长方向, 如电子、通讯、计算机、传媒、新能源汽车等板块, 在 1-2 月取得较好的投资业绩。但 3 月海外疫情的冲击超出预期, 而持仓中外需和全球产业链相关行业比重较大, 基金净值在 3 月份出现了大幅回撤。

展望 2 季度及下半年, 经历了 3 月份全球股市的大幅下跌之后, 我们对权益市场仍然持乐观态度, 认为虽然全球经济一定程度衰退, 同时部分行业需求冲击较大。但一方面股价快速调整, 已经反映了较为悲观的预期, 部分行业和公司股价已经更有性价比。另一方面, 全球疫情在各国防控努力下, 有望在 2 季度逐步从高峰期回落, 全球经济重启有望在 2 季度后段陆续看到。特别是国内疫情明显得到控制, 国内经济有望率先企稳回升。同时, 在全球经济刺激政策下, 随着疫情未来逐步缓解, 环比来看, 下半年全球经济有望逐步企稳回升。

行业配置上面, 虽然经历了 1 季度的净值大幅波动。但仍然坚持认为科技创新仍是未来中国经济发展方向, 相关行业和公司经历了大幅回撤后, 已经包含了过于悲观的业绩下滑预期假设, 在 2 季度全球疫情缓解后, 基本面和估值有重新回升空间。同时部分受益于内需拉动的行业如基建相关和部分必选消费、部分医药生物板块, 未来可能有相对独立的投资机会, 也会是我们未来择机配置的选择。

#### 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 1.1557 元; 本报告期基金份额净值增长率为-1.82%, 业绩比较基准收益率为-3.64%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末, 以上情况未消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定, 予以披露, 且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

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低于 200 人的情形。

## § 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              | 16,591,393.25 | 61.22        |
|    | 其中：股票             | 16,591,393.25 | 61.22        |
| 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          | 4,400,000.00  | 16.23        |
|    | 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      | 6,077,178.74  | 22.42        |
| 8  | 其他资产              | 33,953.58     | 0.13         |
| 9  | 合计                | 27,102,525.57 | 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         | —             | —            |
| B  | 采矿业              | —             | —            |
| C  | 制造业              | 13,191,138.25 | 60.24        |
| 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      | —             | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,400,255.00  | 15.53        |
| J  | 金融业              | —             | —            |
| K  | 房地产业             | —             | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —             | —            |
| 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        | 16,591,393.25 | 75.77 |

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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  | 002475 | 立讯精密 | 38,560 | 1,471,449.60 | 6.72         |
| 2  | 300433 | 蓝思科技 | 91,000 | 1,324,960.00 | 6.05         |
| 3  | 300567 | 精测电子 | 21,400 | 1,121,788.00 | 5.12         |
| 4  | 603986 | 兆易创新 | 4,600  | 1,113,246.00 | 5.08         |
| 5  | 300014 | 亿纬锂能 | 18,551 | 1,077,998.61 | 4.92         |
| 6  | 000977 | 浪潮信息 | 21,168 | 820,895.04   | 3.75         |
| 7  | 002241 | 歌尔股份 | 49,300 | 809,013.00   | 3.69         |
| 8  | 600745 | 闻泰科技 | 7,900  | 801,850.00   | 3.66         |
| 9  | 002624 | 完美世界 | 16,400 | 779,820.00   | 3.56         |
| 10 | 603501 | 韦尔股份 | 4,800  | 748,320.00   | 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投资。

## 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投资。

## 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

本基金本报告期末无权证投资。

## 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

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 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

## 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

闻泰科技股份有限公司（以下简称“公司”）于 2019 年 8 月 16 日收到上海证券交易所《关于对闻泰科技股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定》（以下简称“决定”）（文件编号：上证公监函〔2019〕0062 号）。决定指出公司董事长张学政、公司董事会秘书周斌存在以下违规行为：一、公司实施重大资产重组未按规定履行内部决策程序，也未履行相应信息披露义务；二、公司办理重大资产重组停复牌事项不审慎；三、未按期披露重组预案、草案等相关信息披露文件，未及时回复重组草案、预案问询函。上述违反了《股票上市规则》第 17.2 条、第 17.3 条、第 17.4 条等有关规定。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项对公司的盈利情况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。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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   | 27,189.43 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 539.71    |
| 5  | 应收申购款   | 6,224.44  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 33,953.58 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：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               | 27,319,851.47 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,745,055.63  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 11,117,846.90 |
| 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               | 18,947,060.20 |

## § 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

注：无

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：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鼎越灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安鼎越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) 平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金 2020 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

2020 年 4 月 20 日