(上接 C87 版)

客服电话:95548
传真:0532-85022605
网址:sd.citics.com
(73)国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市辅星路 13 号
办公地址:广西南宁市滨湖路 46 号
法定代表人:何春梅
联系人:牛孟宇
联系电话:0755-83709350
客服电话:95563
网址:www.ghzq.com.cn
(74)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经十路 20518 号
办公地址:山东省济南市经七路 86 号证券大厦
法定代表人:李玮
联系人:许曼华
联系电话:021-20315117
客服电话:95538
传真:0531-68889752
网址:www.zts.com.cn
(75)中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路 291 号
办公地址:江西省南昌市抚河北路 291 号
法定代表人:王宜四
联系人:刘小莹
联系电话:0755-83689020
传真:010-64818443
客服电话:95335
网址:www.scstock.com
(76)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层
法定代表人:何之江
客服电话:95511-8
传真:0755-82400862
网址:www.stock.pingan.com
(77)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座
办公地址:内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座
法定代表人:庞介民
联系人:熊丽
电话:0471-3953168
传真:0471-3979545
客服电话:400-196-6188,956088
网址:www.cnht.com.cn
(78)浙商证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7 楼
办公地址:浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7 楼
法定代表人:吴承根
联系人:陈姗
联系电话:021-80108643
客服电话:967777
传真:0571-87902090
网址:www.stocke.com.cn
(79)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市黄浦区广东路 689 号
办公地址:上海市广东路 689 号海通证券大厦
法定代表人:周杰
联系人:李笑鸣
联系电话:021-23219275
客服电话:95553
传真:021-23219100
网址:www.htsec.com
(80)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:王常青
联系人:刘畅
联系电话:010-65608231
客服电话:400-8888-108
传真:010-65182261
网址:www.csc108.com
(81)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层
办公地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:陈共炎
联系人:辛国政
客服电话:400-8888-888/95551
传真:010-83574807
网址:www.chinastock.com.cn
(82)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市黄埔区中新广场知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址:广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
客服电话:95575
传真:020-87557689
网址:www.gf.com.cn
(83)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路 268 号
办公地址:上海市浦东新区长柳路 36 号
法定代表人:杨华辉
联系人:乔琳雪
联系电话:021-38565547
客服电话:95562
传真:0591-38507538
网址:www.xyzq.com
(84)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路 228 号
办公地址:南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场
法定代表人:周易
联系人:庞晓芸
联系电话:0755-82492193
客服电话:95597
传真:0755-82492962(深圳)
网址:www.htsc.com.cn
(85)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717
办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层
法定代表人:施华
客服电话:95571
联系人:丁敏
电话:010-59355997
传真:010-57398130
网址:www.foundersc.com
(86)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
法定代表人:张志刚
联系人:尹旭航
联系电话:010-63081493
客服电话:95321
网址:www.cindasc.com
(87)长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人:尤习贵
联系人:奚博宇
联系电话:021-68751860
客服电话:95579 或 4008-888-999
传真:027-85481900
网址:www.95579.com
(88)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
法定代表人:霍达
联系人:黄婵君
联系电话:0755-82960167
客服电话:95565;400-8888-111
传真:0755-82943636
网址:www.newone.com.cn
(89)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼办公地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼
法定代表人:李梅
联系人:李玉婷
联系电话:021-33388229
客服电话:95523 或 4008895523
传真:021-33388224
网址:www.swhysc.com
(90)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层
法定代表人:何如
联系人:李颖
联系电话:0755-82133066
客服电话:95536
网址:www.guosen.com.cn
(91)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
联系人:郑慧
联系电话:010-60838888
客服电话:95548
网址:www.cs.ecitic.com
(92)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址:上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦
法定代表人:贺青
联系电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人:钟伟镇
网址:www.gtja.com
服务热线 : 95521 / 4008888666
(93)宁波银行股份有限公司
注册地址:浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号
办公地址:浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号
法定代表人:陈华裕
客户服务电话:95574
网址:www.nbcb.com
(94)交通银行股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
法定代表人:任德奇
联系人:王菁
联系电话:021-58781234
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
(95)北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦
法定代表人:张东宁
联系人:周黎
客服电话:95526
网址:www.bankofbeijing.com.cn
(96)浦领基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08
法定代表人:聂婉君
电话:010-59497361
传真:010-64788016
联系人:李艳
客户服务热线:4000125899
网址:www.zscffund.com
(97)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406
办公地址:广东省深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层
法定代表人:李强
联系人:王雯
电话:0755-83199511
客服电话:4008323000
网址:www.csco.com.cn
(98)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:合肥市蜀山区南二环路 959 号财智中心华安证券 B1 座 0327 室
邮政编码:230081
法定代表人:李工
联系人:范超
联系电话:0551-65161821
客服电话:95318
网址:www.hazq.com
(99)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市新建区子实路 1589 号
办公地址:江西省南昌市新建区子实路 1589 号
法定代表人:徐丽峰
联系人:占文驰
客服电话:956080
网址:www.gszq.com
(100)东北证券股份有限公司
注册地址:吉林省长春市自由大路 1138 号
办公地址:吉林省长春市自由大路 1138 号
法定代表人:李福春
联系人:安岩岩
电话:0431-85096517
客服电话:95360
传真:0431-85096795
网址:www.nesc.cn
(101)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 2 号绿地紫峰大厦 2005
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
(102)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
客服电话:4001099918
网站:www.cfsc.com.cn
(103)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:上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼
联系人:毛林
电话:021-80133597
传真:021-80133413
客服电话:400-808-1016
公司网址:www.fundhaiyin.com
(104)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:许森川
传真:0592-3122701
客服电话:400-918-0808
网址:www.xds.com.cn
(105)天津国美基金销售有限公司
注册地址:天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801
办公地址:北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层
法定代表人:丁东华
联系人: 许艳
电话:010-59287105
传真:010-59287825
客服电话:400-111-0889
网址:www.gomefund.com
(106)首创证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座
办公地址:北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座
法定代表人:毕劲松
电话:95381
网址:www.sczq.com.cn
(107)上海云湾基金销售有限公司
注册地址:中国上海自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层
办公地址:中国上海自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层
法定代表人:冯轶明
联系人:范泽杰
联系电话:021-20538888
客服电话:021-20538888
网址:www.zhengtongfunds.com
(108)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
(109)大同证券股份有限公司
注册地址:大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层
办公地址:山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层
法定代表人:董祥
联系人:薛津
电话:0351-4130322
传真:0351-7219891
网址:www.dtsbc.com.cn
(110)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑 8 号
办公地址:重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦
法定代表人:吴坚
联系人:张煜
电话:023-63786633
客服电话:95355、400-8096-096
传真:023-63786212
网址:www.swsc.com.cn
(111)万联证券股份有限公司
注册地址:广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层
办公地址: 广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 E 座 12 层
法定代表人:张建军
联系人:甘蕾
电话:020-38286026
传真:020-38286588
客服电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.cn
(112)深圳前海京西票号金融控股有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市罗湖区和平路鸿隆世纪广场 B 座 211 室
法定代表人:李晓芸
联系人:盖润英
电话:0755-66607751
网址:http://a24111747.atobo.com.cn
(113)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室
办公地址:天津市南开区宾水西道 8 号
法定代表人:王春峰
联系人:王星
电话:022-28451922
客服电话:4006515988
网址:www.ewww.com.cn
(114)德邦证券股份有限公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
办公地址:上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼
法定代表人:武晓春
联系人:刘熠
电话:021-68761616
网址:www.tebon.com.cn
(115)华融湘江银行股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路一段 828 号杰座大厦
办公地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路一段 828 号杰座大厦
法定代表人:张永宏
客服电话:96599
网址:www.hrxjbank.com
(116)东北证券股份有限公司
注册地址:吉林省长春市自由大路 1138 号
办公地址:吉林省长春市自由大路 1138 号
法定代表人:李福春
联系人:安岩岩
电话:0431-85096517
客服电话:95360
传真:0431-85096795
网址:www.nesc.cn
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:上海市通力律师事务所
地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、陈颖华
联系人:陈颖华
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:021-23238888
传真电话:021-23238800
经办注册会计师:郭素宏、邓昭君
联系人:邓昭君

第四部分 基金的名称
平安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
通过捕捉股票市场、债券市场不同演变趋势,把握在不同行情中可行的投资机会,以超越业绩比较基准表现为首要投资目标,并以追求基金资产的中长期稳健回报为最终投资目标。
(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,包括国内依法发行交易的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、央行票据、短期融资券、超级短期融资券、商业银行次级债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、定期存款等银行存款以及法律法规允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。
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。
基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 30%-80%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 20%-70%;权证投资比例不高于基金资产净值的 3%,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
(三)投资理念
在资产配置和股票、债券品种选择上注重数量化分析和模型构建。依据股票、固定收益类证券、金融衍生产品等不同市场的风险 - 收益预期,灵活合理配置大类资产,捕捉不同市场的超额收益机会。
(四)投资策略
1、资产配置策略
本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析,结合经济周期理论,形成对不同市场周期的预测和判断,进行积极、灵活的资产配置,确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。
本基金通过平安基金大类资产配置评价体系(TAES)(PINGAN-UOB TACTICAL ASSET EVALUATION SYSTEM)系统化管理各大类资产的配置比例。平安大华大类资产配置评价体系(TAES)分析因素具体包括:宏观经济因素、政府政策因素、盈利因素、估值因素、流动性因素和行为因素六个方面,并将各子因素的细分指标划分为先行指标、同步指标和预警指标三类。
本基金严谨衡量不同类别资产的预期风险 / 收益特征,评估股票市场相对投资价值。在实际投资运作中,不同时期或预期的大类资产配置策略如下:
(1)预期股票市场将趋势上涨,或整体股票市场处于低估值的安全区域,本基金将通过高仓位配置股票资产,低配或者少配债券资产,以增加获取股票市场潜在收益的可能性。
(2)股票市场处于震荡阶段、方向不明确时,本基金将动态调整股票资产、债券资产比例,以波段操作策略为主。重点选择被市场低估的或因市场情绪变化而大幅下跌的行业中的优质个股进行波段操作,追求投资组合的正阿尔法收益。
(3)预期股票市场将趋势下跌,或整体股票市场处于高估值的风险区域,本基金将及时降低股票资产配置比例,最低可至股票资产最低比例。同时适度增加债券资产配置比例,严格控制投资组合风险,避免或减少可能给投资人带来潜在的资本损失。
2、股票投资策略
本基金秉持自下而上的投资理念,在股票投资策略中,通过 QV 选股标准(品质 - 价值选股模型)精选个股。同时,针对目前中国经济和证券市场不确定性的特点,采用成长与价值动态均衡投资(GVDBI)策略发掘主题轮动的投资机会。
(1)QV 选股标准(品质 - 价值选股模型)
在此基础上,通过 QV 选股标准(品质 - 价值选股模型)对入选股票进行基本面的分析,以从中挑选出质地优良、具有投资价值的股票。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。
本基金的股票精选库股票需要有内部深度研究报告支持或基金经理投资报告支持,并通过 QV 选股标准(品质 - 价值选股模型)筛选股票构成本基金的股票精选库。本基金精选库每季度调整一次,具体股票数目将根据中国证券市场的发展同步调整。
(2)成长与价值动态均衡投资(GVDBI)
根据"平安基金大类资产配置评价体系"对证券市场走势进行预判,采用成长与价值动态均衡投资(GVDBI)策略:在看多后市的前提下,主要从成长股票中构建基金组合,追求获得更多超额收益;反之,看空后市则主要从价值股票中构建基金组合,追求落袋为安的投资正回报;调整行情中,根据市场多空双方力量强弱和持续时间,采用灵活权重调整策略,平衡基金组合的风险与预期收益。
3、债券投资策略
本基金可投资的债券品种包括国债、中期票据、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、商业银行次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、可转换债券(包括分离交易的可转换债券)、债券回购、定期存款等银行存款等。综合考虑宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势,采取自上而下和自下而上结合的投资策略积极选择和配置债券资产。
本基金在具体债券组合构建时,以利率预期策略、类属资产配置和久期策略为主,以品种选择策略、收益率利差策略和债券置换策略为辅,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上,构建能获取长期、稳定收益的固定收益类投资组合。
(1)利率预期策略
首先根据对国内外经济形势的预测,分析市场投资环境的变化趋势,重点关注利率趋势变化。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素,对利率走势形成合理预期。
(2)类属资产配置
在类属资产配置层次,根据市场和类属资产的风险收益特征,在判断各类属的利率期限结构与交易活跃的国家信用等级短期券利率期限结构应具有的合理利差水平基础上,将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等子市场。结合各类属资产的市场容量、信用等级和流动性特点,在此基础上运用修正的均值 - 方差等模型,对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。
(3)久期策略
根据对利率期限结构变化的预判,对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案,以降低可能的利率变化给组合带来的损失。具体久期目标的确定将视利率期限结构变化方向而定,例如在预计利率期限结构可能变的更加陡峭时,不久的将来长期债券的价格可能会由于长期利率的上升而下跌,短期债券的价格可能会由于短期利率的下降而上涨,因此可制定适量降低组合久期的目标,增加对短期债券的投资,同时减少对长期债券的投资。
在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资,获取超额的投资收益。
4、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。
5、资产支持证券投资策略
本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下,秉持稳健投资原则,综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得基金资产的长期稳健回报。
6、股指期货投资策略
本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。
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股指期货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。
(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 × 60% + 中证全债指数收益率 × 40%。
(六)风险收益特征
本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金,低于股票型基金。
(七)投资限制
1、组合限制
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:
(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10%;
(2)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%;
(3)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%;
(4)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%;
(5)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%;
(6)本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 30%-80%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 20%-70%;
(7)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%;
(8)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%;
(9)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%;
(10)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%;
(11)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;
(12)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;
(13)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%;
(14)本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;
(15)本基金在任何交易日日终,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%;
(16)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;
(17)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;
(18)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)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;
(19)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%;
(20)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;
(21)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%;
(22)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;
(23)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;
(24)法律法规、基金合同规定的其他比例限制。
本基金在开始进行股指期货投资之前,应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。
如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。
除上述第(11)、(20)、(22)、(23)项所规定的情形外,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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金转型之日起开始。
2、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)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,但是国务院另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有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;
(7)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;
(8)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动;
(9)法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。
(八)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法
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、有利于基金财产的安全与增值;
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。
(九)基金的融资、融券
本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。
(十)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。
基金托管人中国建设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 2020 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	20,809,162.86	61.81
	其中:股票	20,809,162.86	61.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,436,414.60	13.18
	其中:债券	4,436,414.60	13.18
	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	6,948,473.37	20.64
8	其他资产	1,470,666.09	4.37
9	合计	33,664,716.92	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,082,969.66	44.79
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	2,169,648.00	7.43
G	交通运输、仓储和邮政业	703,876.00	2.41
H	住宿和餐饮业	633,041.00	2.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,888,719.20	6.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,522,677.00	5.21
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	258,672.00	0.89
R	文化、体育和娱乐业	549,560.00	1.88
S	综合	-	-
	合计	20,809,162.86	71.24

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期期末未投资港股通股票。
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	603883	老百姓	14,100	1,098,390.00	3.76
2	002035	华帝股份	85,400	948,794.00	3.25
3	000860	顺鑫农业	15,200	933,128.00	3.19
4	600201	生物股份	42,000	895,440.00	3.07
5	002508	老板电器	30,100	856,044.00	2.93
6	002007	华兰生物	17,200	824,224.00	2.82
7	601933	永辉超市	80,100	820,224.00	2.81
8	600161	天坛生物	22,200	807,636.00	2.76
9	600570	恒生电子	9,048	795,319.20	2.72
10	600383	金地集团	55,300	779,177.00	2.67

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,436,414.60	15.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,436,414.60	15.19

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	113531	百姓转债	7,830	1,072,631.70	3.67
2	128080	顺丰转债	7,850	1,021,599.00	3.50
3	113009	广汽转债	5,320	607,969.60	2.08
4	113011	光大转债	4,940	578,474.00	1.98
5	113013	国君转债	4,810	565,800.30	1.94

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
本基金本报告期无国债期货投资。
1.11 投资组合报告附注
1.11.1 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
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。
1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,035.12
2	应收证券清算款	1,446,611.18
3	应收股利	-
4	应收利息	6,527.25
5	应收申购款	8,492.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,470,666.09

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113531	百姓转债	1,072,631.70	3.67
2	113009	广汽转债	607,969.60	2.08
3	113011	光大转债	578,474.00	1.98
4	113013	国君转债	565,800.30	1.94

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(2018 年 10 月 30 日)至 2020 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
2018.10.30-2018.12.31	-1.02%	0.37%	-0.44%	0.74%	-0.58%	-0.37%
2019.1.1-2019.12.31	27.63%	0.83%	23.23%	0.74%	4.40%	0.09%
2020.1.1-2020.3.31	1.46%	1.76%	-4.77%	1.15%	6.23%	0.61%
自基金合同生效以来	28.16%	1.00%	16.82%	0.82%	11.34%	0.18%

业绩比较基准:沪深 300 指数收益率 *60%+ 中证全债指数收益率 *40%
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 2018 年 10 月 30 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,建仓结束时各项资产配置比例符合基金合同的约定。
第九部分 基金的费用与税收
(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、基金财产拨划支付的银行费用;
4、基金合同生效后的基金信息披露费用;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
7、基金的证券、期货交易费用;
8、基金的开户费用、账户维护费用;
9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。
(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
(三)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
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年管理费率÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年托管费率÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
3、除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
(四)不列入基金费用的项目
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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用依照《平安大华保本混合型证券投资基金基金合同》执行。
(五)费用调整
基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在规定媒介上刊登公告。
(六)基金税收
基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。
第十部分 其他应披露事项
本基金 2019 年 4 月 30 日至 2020 年 4 月 29 日发布的公告:

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
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
2019 年 6 月 12 日	平安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)
2019 年 6 月 18 日	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告
2019 年 6 月 30 日	平安基金管理有限公司 2019 年 6 月 30 日基金净值披露公告
2019 年 7 月 5 日	关于旗下基金所持新城控股(代码:601155)估值调整的公告
2019 年 7 月 9 日	关于子公司深圳平安大华汇通财富管理有限公司名称变更的公告
2019 年 7 月 16 日	平安灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告
2019 年 7 月 31 日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告
2019 年 8 月 20 日	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告
2019 年 8 月 23 日	平安灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告(摘要)
2019 年 8 月 23 日	平安灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告
2019 年 8 月 26 日	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告
2019 年 8 月 30 日	平安基金管理有限公司关于暂停凤凰金信(银川)基金销售有限公司代销旗下部分基金业务的公告
2019 年 10 月 25 日	平安灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告
2019 年 10 月 25 日	关于旗下部分基金新增浦领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
2019 年 12 月 21 日	关于旗下 21 只基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订相关法律文件的公告
2019 年 12 月 21 日	平安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新 - 摘要
2019 年 12 月 21 日	平安灵活配置混合型证券投资基金托管协议
2019 年 12 月 21 日	平安灵活配置混合型证券投资基金基金合同
2019 年 12 月 21 日	平安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
2020 年 1 月 20 日	平安灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告
2020 年 2 月 29 日	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告
2020 年 3 月 27 日	平安基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告
2020 年 4 月 22 日	平安灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告
2020 年 4 月 28 日	平安基金管理有限公司关于暂停扬州国信嘉利基金销售有限公司代销旗下基金业务的公告

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 12 月 21 日公布的《平安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:
1、根据最新资料,更新了"重要提示"。
2、根据最新资料,更新了"第二部分、释义"。
3、根据最新资料,更新了"第三部分、基金管理人"。
4、根据最新资料,更新了"第四部分、基金托管人"。
5、根据最新资料,更新了"第五部分、相关服务机构"。
6、根据最新资料,更新了"第八部分、基金的投资"。
7、根据最新资料,更新了"第九部分、基金的业绩"。
8、根据最新资料,更新了"第十三部分、基金的收益与分配"。
9、根据最新资料,更新了"第十四部分、基金的会计与审计"。
10、根据最新资料,更新了"第十五部分、基金的信息披露"。
11、根据最新资料,更新了"第十六部分、风险揭示"。
12、根据最新资料,更新了"第十七部分、基金合同的变更、终止与基金财产的清算"。
13、根据最新资料,更新了"第十八部分、基金合同的内容摘要"。
14、根据最新资料,更新了"第十九部分、基金托管协议的内容摘要"。
15、根据最新资料,更新了"第二十部分、对基金份额持有人的服务"。
16、根据最新资料,更新了"第二十一部分、其他应披露的事项"。
17、根据最新情况,更新了"第二十二部分、对招募说明书更新部分的说明"。

平安基金管理有限公司
2020 年 6 月 11 日

平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国民生银行股份有限公司为销售机构的公告

根据平安基金管理有限公司(以下简称"本公司")与中国民生银行股份有限公司(以下简称"民生银行")签署的销售协议,本公司自 2020 年 6 月 12 日起新增民生银行直销银行代理销售本公司旗下部分基金,并开通转换业务。现将相关事项公告如下:
一、自 2020 年 6 月 12 日起,投资者可通过民生银行直销银行办理本基金的开户、申购、赎回及转换业务。

编号	基金代码	基金名称	定投业务	转换业务	是否参加费率优惠
1	006986	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金(A 类份额)	不支持	支持	是
2	006987	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金(C 类份额)	不支持	支持	是
3	006988	平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金(E 类份额)	不支持	支持	是
4	007645	平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金(A 类份额)	不支持	支持	是
5	007646	平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金(C 类份额)	不支持	支持	是
6	007647	平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金(E 类份额)	不支持	支持	是
7	007053	平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金(A 类份额)	不支持	支持	是
8	007054	平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金(C 类份额)	不支持	支持	是
9	007055	平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金(E 类份额)	不支持	支持	是
10	003024	平安惠金定期开放债券型证券投资基金 (A 类)	不支持	支持	是
11	006717	平安惠金定期开放债券型证券投资基金 (C 类)	不支持	支持	是

注:上表中同一产品 A、C、E 类份额之间不能相互转换,募集期内不支持定投和转换。
二、重要提示
1、基金转换是指基金份额持有人按照《基金合同》和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金的基金份额的行为。基金转换业务规则与转换业务的收费计算公式参见本公司网站的《平安基金管理有限公司关于旗下开放式基金转换业务规则说明的公告》。
2、投资者通过民生银行直销银行申购、转换上述基金,享受费率优惠,优惠活动解释权归民生直销银行所有,请投资者咨询民生银行直销银行。本公司对其申购费率、转换补差费率均不设折扣限制,优惠活动的费率折扣由民生银行直销银行和执行,本公司根据民生银行直销银行提供的费率折扣办理,若费率优惠活动内容变更,以民生直销银行的活动公告为准,本公司不再另行公告。
三、投资者可通过以下途径咨询有关详情:
1、中国民生银行股份有限公司直销银行
客服电话:10100123
网址:www.mszxyh.com
2、平安基金管理有限公司
客服电话:400—800—4800
网址:fund.pingan.com
风险提示: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,也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上,根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择合适的基金产品。
特此公告

平安基金管理有限公司
2020 年 6 月 11 日