

平安安盈灵活配置混合型证券投资基金

2022 年第 1 季度报告

2022 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 4 月 22 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 04 月 21 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 2022 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安安盈灵活配置混合	
基金主代码	002537	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 4 月 26 日	
报告期末基金份额总额	161,218,283.72 份	
投资目标	通过对宏观经济和股票市场、债券市场发展趋势的分析，力求把握在不同行情中可行的投资机会，追求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	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。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%	
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。	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安安盈灵活配置混合 A	平安安盈灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	002537	014051
报告期末下属分级基金的份额总额	157,038,844.85 份	4,179,438.87 份

§ 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（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日）	
	平安安盈灵活配置混合 A	平安安盈灵活配置混合 C
1. 本期已实现收益	-49,299,201.32	-1,149,654.89
2. 本期利润	-87,369,541.14	-1,297,730.80
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.5329	-0.4085
4. 期末基金资产净值	380,088,813.02	10,101,674.58
5. 期末基金份额净值	2.4203	2.4170

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 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

平安安盈灵活配置混合 A

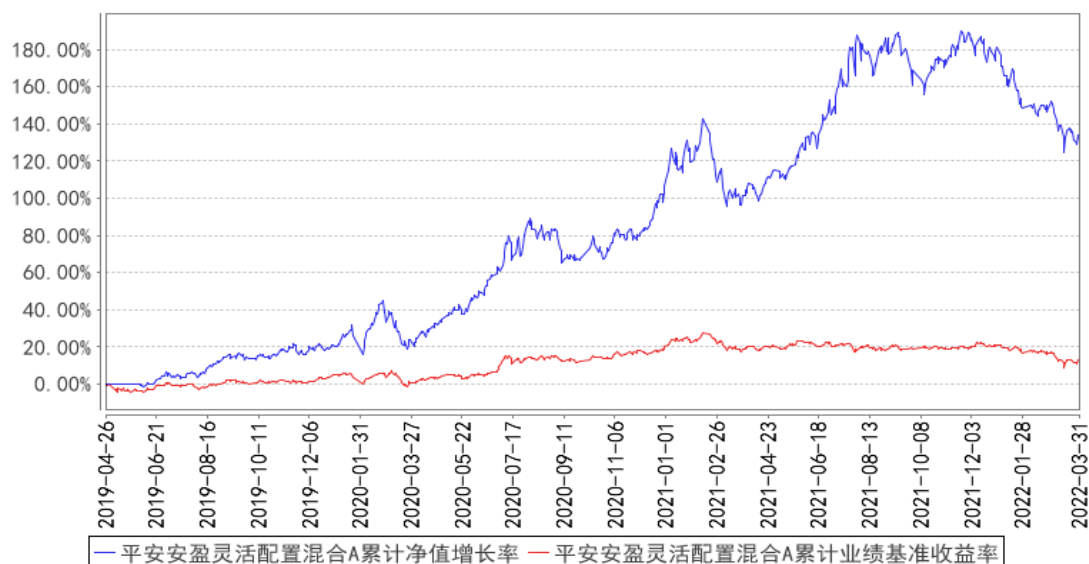
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-18.08%	1.36%	-7.04%	0.73%	-11.04%	0.63%
过去六个月	-14.30%	1.28%	-5.65%	0.59%	-8.65%	0.69%
过去一年	13.63%	1.49%	-5.72%	0.57%	19.35%	0.92%
自基金合同生效起至今	130.50%	1.52%	12.41%	0.63%	118.09%	0.89%

平安安盈灵活配置混合 C

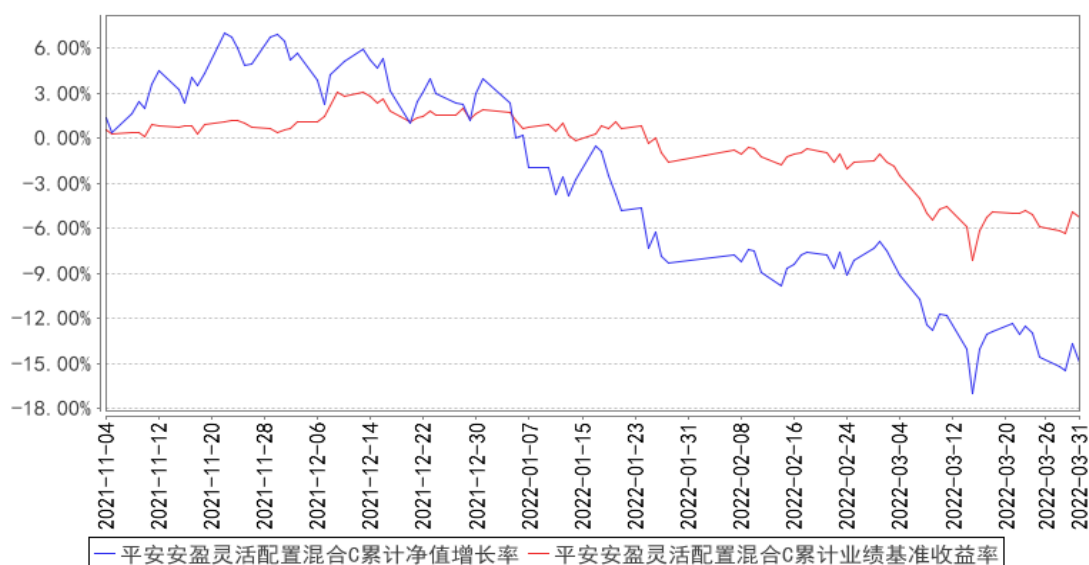
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-18.15%	1.36%	-7.04%	0.73%	-11.11%	0.63%
自基金合同生效起至今	-14.94%	1.30%	-5.28%	0.61%	-9.66%	0.69%

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

平安安盈灵活配置混合A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



平安安盈灵活配置混合C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 2019 年 4 月 26 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基金合同约定；

3、本基金于 2021 年 11 月 02 日增设 C 类份额，C 类份额从 2021 年 11 月 04 日开始有份额，所以上 C 类份额走势图从 2021 年 11 月 04 日开始；

§ 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		
薛冀颖	平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020 年 11 月 3 日	-	10 年	薛冀颖先生, 清华大学信息科学技术专业博士研究生, 曾担任鹏华基金管理有限公司研究员、融通基金管理有限公司基金经理。2020 年 6 月加入平安基金管理有限公司, 现担任平安安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安优质企业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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年一季度整体市场有明显调整，其中上证指数下跌 10.65%，深证综指下跌 16.29%，创业板综指下跌 18.25%，沪深 300 下跌 14.53%，板块之间分化明显，机构持仓相对较多的电子、新能源、食品饮料等板块跌幅相对较大，机构持仓相对较低的煤炭、房地产、银行等板块表现相对靠前，本基金年初以来面对市场新增的一些利空因素：如大宗商品涨价超预期、国内疫情反复以及俄乌冲突等，在组合结构上进行了一些调整，适当降低了一些之前涨幅较大、预期过于饱满、同时受到上游成本压力及终端消费影响的个股，适当增加了一些跟稳增长相关的房地产、基建等领域的个股，主要在于认为国内宏观经济压力短期相对较大，预计会有较多稳增长的政策持续出台，而相关板块估值相对较低，能看到相对更确定的收益空间。总体而言让组合结构更加均衡，对个股更加追求安全性和收益的确定性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安安盈灵活配置混合 A 的基金份额净值 2.4203 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.08%，同期业绩比较基准收益率为-7.04%；截至本报告期末平安安盈灵活配置混合 C 的基金份额净值 2.4170 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.15%，同期业绩比较基准收益率为-7.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 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	308,806,726.13	77.54
	其中：股票	308,806,726.13	77.54
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	61,677,123.32	15.49
8	其他资产	27,761,384.51	6.97
9	合计	398,245,233.96	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	6,271,658.00	1.61
B	采矿业	9,243,585.00	2.37
C	制造业	191,210,992.32	49.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	16,656,835.00	4.27
F	批发和零售业	6,530,280.14	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	12,402,435.93	3.18
H	住宿和餐饮业	7,603.20	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,788,206.44	1.23
J	金融业	11,359,348.00	2.91
K	房地产业	42,861,594.00	10.98
L	租赁和商务服务业	3,081,825.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	31,563.47	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	21,551.15	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,313,474.48	0.34
R	文化、体育和娱乐业	3,025,774.00	0.78
S	综合	—	—
	合计	308,806,726.13	79.14

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	300750	宁德时代	26,312	13,479,637.60	3.45
2	600048	保利发展	720,400	12,751,080.00	3.27
3	600519	贵州茅台	7,400	12,720,600.00	3.26
4	600522	中天科技	691,000	11,747,000.00	3.01
5	601012	隆基股份	131,500	9,492,985.00	2.43

6	601088	中国神华	310,500	9,243,585.00	2.37
7	603596	伯特利	138,200	8,984,382.00	2.30
8	601658	邮储银行	1,653,200	8,910,748.00	2.28
9	603806	福斯特	78,300	8,886,267.00	2.28
10	002371	北方华创	32,100	8,795,400.00	2.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

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

注：本基金本报告期无股指期货投资。

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

注：本基金本报告期无国债期货投资。

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

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 6 月 22 日作出银保监罚决字（2021）23 号处罚决定，由于中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“公司”）一、违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费；二、未经客户同意违规办理短信收费业务；三、信息系统相关功能在开发、投产、维护、后评估等方面存在缺陷及不足；四、向监管机构报送材料内容不实；五、未在监管要求时限内报送材料；六、未按监管要求提供保存业务办理相关凭证。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、第四十七条和相关审慎经营规则《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，对方公司做出没收违法所得 11.401116 万元，罚款 437.677425 万元，罚没合计 449.078541 万元的决定。

中国人民银行于 2021 年 8 月 13 日作出银罚字（2021）16 号处罚决定，由于中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“公司”）违反账户管理相关规定，根据相关规定对公司罚款 600 万元。

国家外汇管理局北京外汇管理部于 2021 年 11 月 24 日作出京汇罚（2021）16 号处罚决定，由于中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“公司”）办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查的；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；违反外汇市场交易管理；未按照规定进行国际收支统计申报；未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料，根据相关规定对公司给予警告，没收违法所得 673625.55 元人民币，并处 444 万元人民币罚款。

中国银行保险监督管理委员会于 2022-03-21 作出银保监罚决字（2022）16 号处罚决定，由于中国邮政储蓄银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报抵押物价值 EAST 数据；四、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；五、未报送贷款承诺业务 EAST 数据；六、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；七、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；八、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；九、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十一、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十二、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十三、2018 年行政处罚问题依然存在，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对中国邮政储蓄银行股份有限公司罚款 370 万元。

本基金管理人对上述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。我们对上述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库以外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	803,313.21
2	应收证券清算款	26,924,342.61
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	33,728.69
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	27,761,384.51

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无流通受限的股票。

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

项目	平安安盈灵活配置混合 A	平安安盈灵活配置混合 C
报告期期初基金份额总额	162,516,191.83	423,167.01
报告期期间基金总申购份额	17,589,583.62	3,901,824.98
减：报告期期间基金总赎回份额	23,066,930.60	145,553.12
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	157,038,844.85	4,179,438.87

§ 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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安安盈灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安安盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安安盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 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

2022 年 4 月 22 日