

平安鑫安混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告

2024 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：2024 年 4 月 19 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 2024 年 04 月 18 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 2024 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安鑫安混合
基金主代码	001664
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 11 日
报告期末基金份额总额	12,736,159.98 份
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。
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，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。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%
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。
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
下属分级基金的基金简称	平安鑫安混合 A 平安鑫安混合 C 平安鑫安混合 E

下属分级基金的交易代码	001664	001665	007049
报告期末下属分级基金的份额总额	2,260,428.46 份	539,110.38 份	9,936,621.14 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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）		
	平安鑫安混合 A	平安鑫安混合 C	平安鑫安混合 E
1. 本期已实现收益	-52,738.03	-13,082.92	-244,204.66
2. 本期利润	7,171.08	-1,176.61	-28,193.41
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0030	-0.0021	-0.0028
4. 期末基金资产净值	2,672,501.75	616,542.82	11,517,706.75
5. 期末基金份额净值	1.1823	1.1436	1.1591

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

平安鑫安混合 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	-0.08%	0.84%	2.72%	0.40%	-2.80%	0.44%
过去六个月	-2.01%	0.60%	0.69%	0.36%	-2.70%	0.24%
过去一年	-5.15%	0.45%	-1.31%	0.35%	-3.84%	0.10%
过去三年	-4.31%	0.39%	-3.93%	0.42%	-0.38%	-0.03%
过去五年	11.51%	0.42%	12.91%	0.47%	-1.40%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	18.23%	0.42%	26.91%	0.48%	-8.68%	-0.06%

平安鑫安混合 C

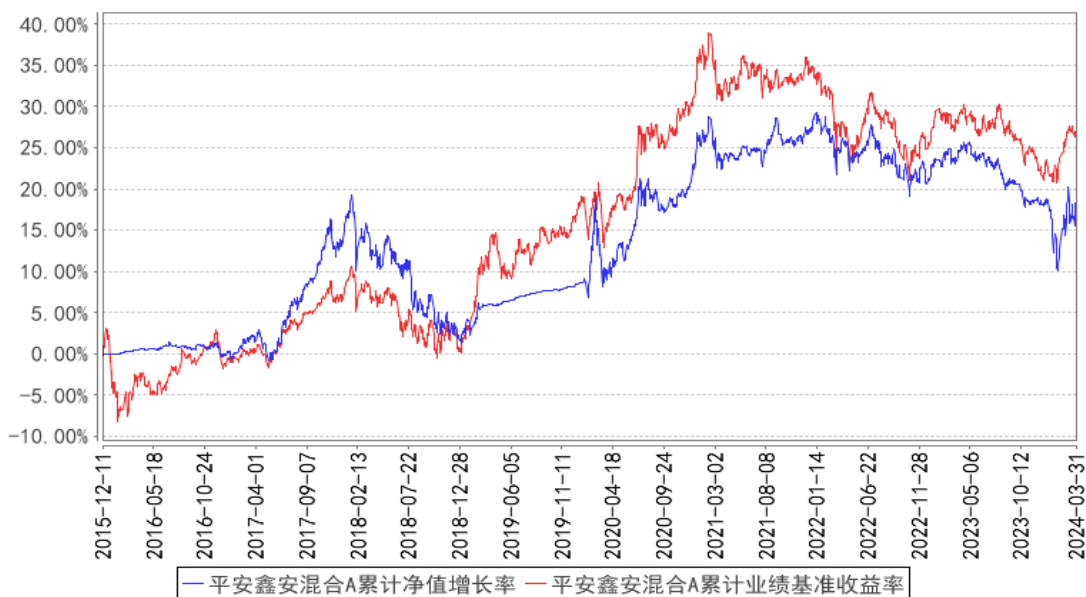
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.18%	0.84%	2.72%	0.40%	-2.90%	0.44%
过去六个月	-2.22%	0.60%	0.69%	0.36%	-2.91%	0.24%
过去一年	-5.55%	0.45%	-1.31%	0.35%	-4.24%	0.10%
过去三年	-5.48%	0.39%	-3.93%	0.42%	-1.55%	-0.03%
过去五年	9.27%	0.42%	12.91%	0.47%	-3.64%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	14.36%	0.42%	26.91%	0.48%	-12.55%	-0.06%

平安鑫安混合 E

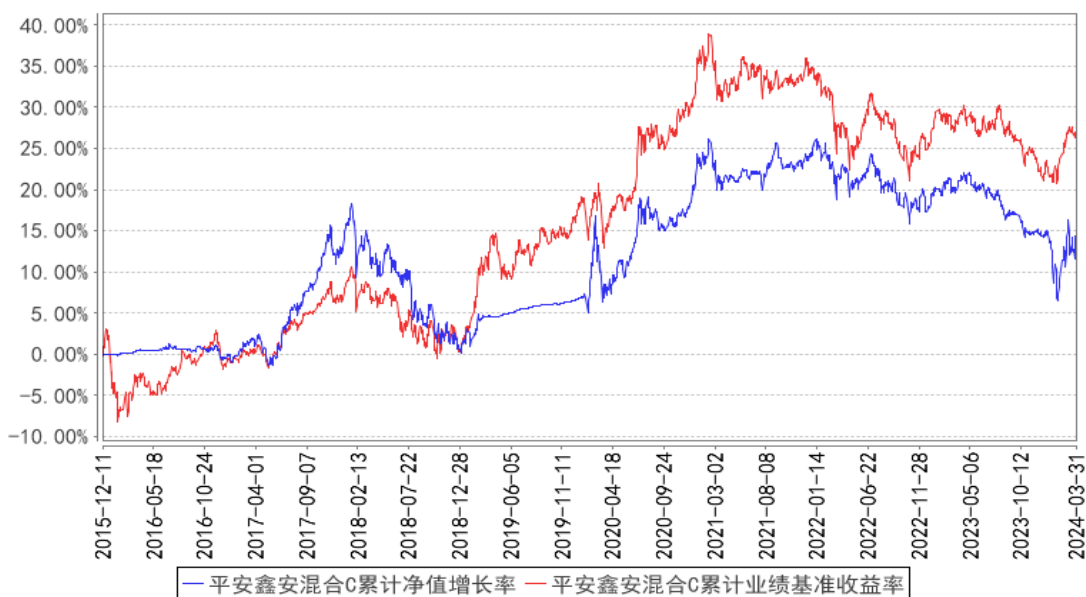
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.11%	0.84%	2.72%	0.40%	-2.83%	0.44%
过去六个月	-2.08%	0.60%	0.69%	0.36%	-2.77%	0.24%
过去一年	-5.26%	0.45%	-1.31%	0.35%	-3.95%	0.10%
过去三年	-4.62%	0.39%	-3.93%	0.42%	-0.69%	-0.03%
过去五年	10.91%	0.42%	12.91%	0.47%	-2.00%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	12.42%	0.42%	18.57%	0.47%	-6.15%	-0.05%

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

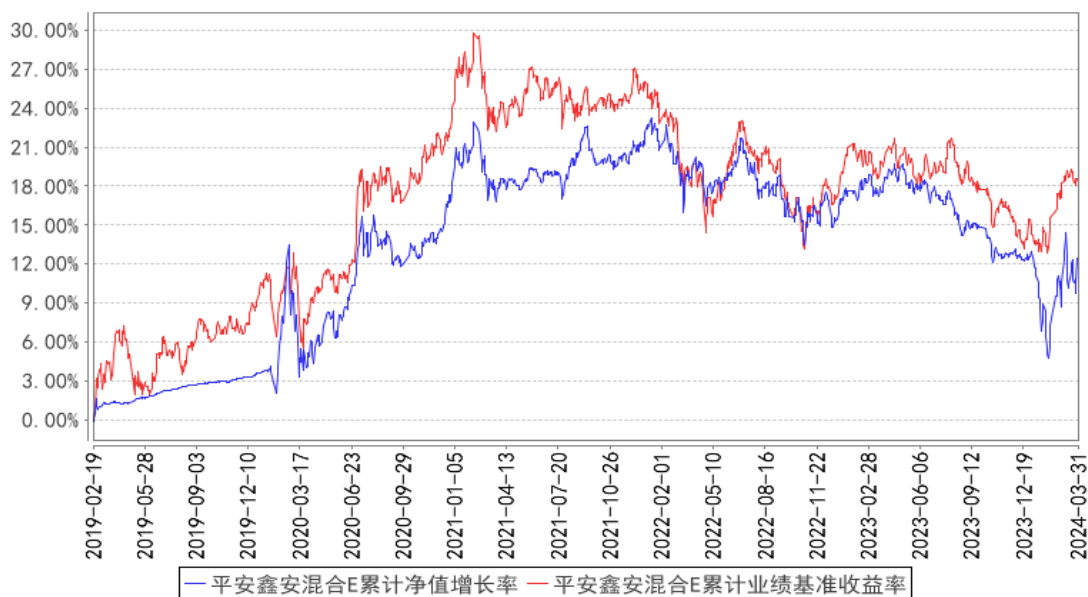
平安鑫安混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安鑫安混合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



平安鑫安混合E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 2015 年 12 月 11 日正式生效；
- 2、自 2019 年 2 月 19 日起增设 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。

3.3 其他指标

注：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		
刘杰	平安鑫安混合型证券投资基金基金经理	2021年3月31日	-	16年	刘杰先生，外交学院经济学硕士。曾先后担任金元证券投资银行部项目经理，天弘基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理，英大基金管理有限公司专户投资部投资经理、基金经理等。2017年8月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资研究部投资经理。现担任平安行业先锋混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安价值回报混合型证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。
康子冉	平安鑫安	2024年1月	-	8年	康子冉先生，中国人民大学经济学博士

混合型证券投资基金基金经理	26 日			研究生，曾先后担任万科企业股份有限公司董事会办公室总裁文字助理、中国五矿集团有限公司办公厅研究室副总裁秘书、行业调研员、中国人寿养老保险有限公司行业研究员、北京国际信托有限公司权益投资经理、泰康养老保险股份有限公司股票投资总监。2023 年 12 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安鑫安混合型证券投资基金、平安灵活配置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

一季度，本产品实现收益-1.65%，最大回撤-6.79%，一季度市场先经历大幅下挫，继而在 2 月初反弹修复，本产品围绕市场波动节奏，重点配置波动性较低，防御属性较强红利资产，结合品种的业绩确定性、估值水平、产业格局和股息率水平，首选龙头的油气、煤炭企业作为重点标的，其次配置银行和公用事业、纺织服装中高股息企业，从选股上，重点配置 10 倍市盈率以下，股息率 5%以上，全年预期业绩增速 5%-10%的品种。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安鑫安混合 A 的基金份额净值 1.1823 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.08%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%；截至本报告期末平安鑫安混合 C 的基金份额净值 1.1436 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.18%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%；截至本报告期末平安鑫安混合 E 的基金份额净值 1.1591 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.11%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%。

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 人的情形。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。

§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	13,320,948.95	83.18
	其中：股票	13,320,948.95	83.18
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	2,682,825.21	16.75
8	其他资产	11,441.10	0.07

9	合计	16,015,215.26	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	4,177,069.00	28.21
C	制造业	4,345,504.95	29.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,824,675.00	12.32
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,365,481.00	9.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,468,704.00	9.92
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	139,515.00	0.94
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	13,320,948.95	89.97

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	603993	洛阳钼业	99,900	831,168.00	5.61
2	600027	华电国际	104,900	720,663.00	4.87
3	002478	常宝股份	109,700	693,304.00	4.68
4	600938	中国海油	22,600	660,598.00	4.46
5	600398	海澜之家	73,200	658,800.00	4.45
6	688522	纳睿雷达	9,905	614,010.95	4.15

7	600028	中国石化	94,200	601,938.00	4.07
8	600026	中远海能	35,700	600,831.00	4.06
9	600011	华能国际	63,000	590,940.00	3.99
10	301486	致尚科技	10,500	589,890.00	3.98

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。

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：本基金本报告期内无国债期货投资。

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

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。

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	9,895.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,545.20
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11,441.10

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	平安鑫安混合 A	平安鑫安混合 C	平安鑫安混合 E
报告期期初基金份额总额	2,406,560.94	552,068.87	10,457,174.38
报告期期间基金总申购份额	494,147.55	9,115.50	21,395.63
减：报告期期间基金总赎回份额	640,280.03	22,073.99	541,948.87
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	2,260,428.46	539,110.38	9,936,621.14
-------------	--------------	------------	--------------

§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鑫安混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安鑫安混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安鑫安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

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

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：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2024 年 4 月 19 日