格林日鑫月熠货币市场基金

2018年第四季度报告

基金管理人:格林基金管理有限公司
基金托管人:国泰君安证券股份有限公司
报告送出日期:2019年01月18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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1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2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	格林货币
基金主代码	004866
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年07月20日
报告期末基金份额总额	1,155,324,025.14份
投资目标	在严格控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	以保证资产的安全性和流动性为基本原则,力求在对国内外宏观经济走势、货币财政政策变动等因素充分评估的基础上,科学预计未来利率走势,择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具,进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	格林基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司

下属分级基金的基金简称	格林货币A	格林货币B
下属分级基金的交易代码	004865	004866
报告期末下属分级基金的份额总额	39,610,820.21份	1,115,713,204.93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(2018年10月01日 - 2018年12月31日)	
	格林货币A	格林货币B
1.本期已实现收益	325,607.58	7,134,507.24
2.本期利润	325,607.58	7,134,507.24
3.期末基金资产净值	39,610,820.21	1,115,713,204.93

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

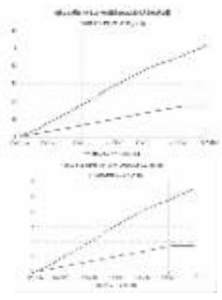
格林货币A净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7683%	0.0064%	0.3456%	0.0000%	0.4227%	0.0064%

格林货币B净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8293%	0.0064%	0.3456%	0.0000%	0.4837%	0.0064%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§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		
曹晋文	本基金基金经理,格林恒元灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017-07-26	-	11	曹晋文先生,中国人民大学统计学硕士,获得注册会计师资格证书。先后就职于中国人寿资产、信诚人寿保险、民生加银基金。现任格林基金固定收益部总监,投资决策委员会委员。
宋东旭	本基金基金经理,格林恒元灵活配置混合型证券投资基金基金经理,格林泓鑫纯债债券型证券投资基金基金经理	2017-07-20	-	6	宋东旭先生,中央财经大学数理金融学士,Rutgers金融数学硕士。曾供职于摩根大通资产投资办公室,负责固定收益类资产的投资。现任格林基金固定收益部基金经理。

注:1、上述任职日期和离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

3、本基金无基金经理助理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,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,无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),制定了《格林基金管理有限公司异常交易监控与报告办法》。基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法,各投资组合经理在授权范围内自主决策,各投资组合共享研究平台,在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。基金管理人实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易,基金管理人执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析,投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合,未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

国内经济方面。2018年三季度GDP增速6.5%,较上季度降低0.2%。在四季度中,CPI受油价持续走低和食品价格下滑的影响出现下行;PPI受石油、化工、钢铁行业拖累继续下滑。短期内石油相关产业对整体工业品价格造成的向下压力或继续持续。总体来看,在内外部压力下,虽然在政策支持下基建投资支撑固定资产投资增速上行,但国内居民消费疲软,进出口贸易受中美贸易战影响拖累,短期内经济增长将继续面临下行压力。

政策方面。中央于12月召开经济工作会议中指出要推行更加积极的财政政策,实施更大规模的减税降费。另指出货币政策要松紧适度,保持流动性合理充裕,解决好民营企业和小微企业融资难融资贵问题。总体来看,中央对于宏观政策的取向更加宽松。

市场层面。利率债收益率在四季度中持续下行,其中十年国开债的收益率经历了10月的缓慢下行后,在 11 月中旬至 12 月底大幅从 4.0%下行至 3.6%。信用债方面,由于宽信用政策力度加大,信用利差在10至12月有所收窄,但12月披露的金融数据仍显示企业贷款走弱,银行风险偏好较低,宽信用效果欠佳。信用利差自12月中旬重新走阔,与利率债背离。

组合操作上,本报告期内本基金主要投资于同业存单、同业存款及短融,并于季末择机加配了逆回购的投资。期限搭配以及杠杆水平合适,组合整体的流动性较好。下一阶段本基金仍将继续做好流动性管理工作,结合基金管理人对市场的判断,优化组合结构,把握货币市场价格波动节奏,提升组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林货币A基金份额净值为1.000元,本报告期内该类基金份额净值收益率为0.7683%,同期业绩比较基准收益率为0.3456%;截至报告期末格林货币B基金份额净值为1.000元,本报告期内该类基金份额净值收益率为0.8293%,同期业绩比较基准收益率为0.3456%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	固定收益投资	706,230,995.78	61.10
	其中:债券	706,230,995.78	61.10
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	324,276,238.92	28.06
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	122,358,689.32	10.59
4	其他资产	2,970,580.61	0.26
5	合计	1,155,836,504.63	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	3.84
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	55
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	36.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	18.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	38.78	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	4.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	2.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.79	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期限超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	60,116,961.53	5.20
	其中:政策性金融债	60,116,961.53	5.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,002,559.20	0.87
6	中期票据	-	-
7	同业存单	636,111,485.05	55.06
8	其他	-	-
9	合计	706,230,995.78	61.13
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111810563	18兴业银行CD563	900,000	89,565,264.58	7.75
2	111809388	18浦发银行CD388	500,000	49,749,979.00	4.31
3	111809427	18浦发银行CD427	400,000	39,658,989.99	3.43
4	180404	18农发04	300,000	30,086,752.40	2.60
5	180201	18国开01	300,000	30,030,199.13	2.60
6	111809086	18浦发银行CD086	300,000	29,906,125.90	2.60
7	111807089	18招商银行CD089	300,000	29,945,390.52	2.59
8	111811327	18平安银行CD327	300,000	29,868,893.37	2.59
9	111818362	18华夏银行CD362	300,000	29,814,560.06	2.58
10	111807072	18招商银行CD072	300,000	29,774,741.71	2.58

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1575%
报告期内偏离度的最低值	-0.0441%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0588%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价或折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

5.9.2 18 兴业银行CD563(代码:111810563)为本基金前十大持仓证券之一。2018年4月19日,中国银行保险监督管理委员会对兴业银行重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、向四证不全的房地产项目提供融资等违规行为,处以5870万元罚款。

18平安银行CD327(代码:111811327)为本基金前十大持仓证券之一,2018年12月28日,中国银行保险监督管理委员会湖北监管局对平安银行武汉分行贷款三查不尽职、贷前调查不尽职导致违规发放并购贷款的行为,处以90万元罚款;2018年9月27日,中国银监会上海监管局对平安银行上海分行借款人收入情况贷前调查未尽职等违规行为,责令改正,并处以 150万元罚款。

18招商银行CD089(代码:111807089)、18招商银行CD072(代码:111807072)为本基金前十大持仓证券之二。2018年2月12日,中国银监会对招商银行违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本等严重违反审慎经营规则的违规行为,罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

18浦发银行CD388(代码:111809388)、18浦发银行CD427(代码:111809427)、18浦发银行CD086(代码:111809086)为本基金前十大持仓证券之三。2018年1月18日,四川银监局对浦发银行成都分行内控管理严重失效、授信管理违规、违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为,处以人民币46175万元的罚款。2018年2月12日,中国银监会对浦发银行通过资管计划投资分行协议存款虚增一般存款、提供不实说明材料、不配合调查取证等严重违反审慎经营规则的违规行为,罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,290.17
2	应收证券清算款	48,230.14
3	应收利息	2,919,060.30
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	2,970,580.61

5.9.4 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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	格林货币A	格林货币B
报告期期初基金份额总额	34,661,642.79	826,127,507.12
报告期期间基金总申购份额	86,746,014.70	956,883,052.39
报告期期间基金总赎回份额	81,796,837.28	766,297,354.58
报告期期末基金份额总额	39,610,820.21	1,115,713,204.93

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2018-10-19	-1,300,000.00	-1,300,000.00	-
2	赎回	2018-10-23	-2,600,000.00	-2,600,000.00	-
3	赎回	2018-11-07	-1,600,000.00	-1,600,000.00	-
4	赎回	2018-11-15	-1,500,000.00	-1,500,000.00	-
5	申购	2018-11-26	14,000,000.00	14,000,000.00	-
6	赎回	2018-12-06	-500,000.00	-500,000.00	-
7	赎回	2018-12-13	-1,200,000.00	-1,200,000.00	-
8	赎回	2018-12-14	-2,200,000.00	-2,200,000.00	-
9	申购	2018-12-21	14,000,000.00	14,000,000.00	-
10	赎回	2018-12-25	-21,500,000.00	-21,500,000.00	-
11	赎回	2018-12-28	-500,000.00	-500,000.00	-
12	红利发放	2018-12-31	97,815.45	97,815.45	-
合计			-4,802,184.55	-4,802,184.55	

注:本基金的收益分配按日结转份额,列示在"分红再投"项下一并披露。

§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

本报告期内,本基金单一投资者持有份额比例没有达到或超过总份额20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予格林日鑫月熠货币市场基金募集注册的文件;

2、《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》;

3、《格林日鑫月熠货币市场基金托管协议》;

4、《格林日鑫月熠货币市场基金招募说明书》及其更新;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照;

8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件,或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

格林基金管理有限公司
2019年01月18日

平安惠盈纯债债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:2019年1月18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2019年1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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安惠盈纯债
场内简称	-
交易代码	002795
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月3日
报告期末基金份额总额	491,330,823.44份
投资目标	在谨慎控制组合净值波动率的前提下,本基金追求基金产品的长期、持续增值,并力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过对宏观经济周期、行业前景预测和发债主体公司研究的综合运用,主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略,在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上,深入挖掘价值被低估固定收益投资品种,构建及调整固定收益投资组合。 本基金将灵活应用组合久期配置策略、类属资产配置策略、个券选择策略、息差策略、现金头寸管理策略等。在合理管理并控制组风险的前提下获得债券市场的整体回报率及超额收益。
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金品。
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

§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(2018年10月1日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	8,436,640.64
2.本期利润	14,852,900.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0303
4.期末基金资产净值	511,564,826.18
5.期末基金份额净值	1.041

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	2.86%	0.07%	0.68%	0.01%	2.21%	0.06%

业绩比较基准:一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%

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

1、本基金基金合同于2016年6月3日正式生效,截至报告期末已满两年;

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		
余斌	平安惠盈纯债债券型证券投资基金基金经理	2017年12月1日	-	6	余斌先生,哈尔滨工业大学硕士,先后担任大公国际资信评估有限公司评级部分析师,华西证券股份有限公司固定收益总部项目经理、长城证券股份有限公司资产管理部信用研究员,华创证券有限责任公司投资银行资本市场部高级副总监。2015年10月加入平安基金管理有限公司,任投资研究部固定收益研究员。现任平安惠享纯债债券型证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、平安惠隆纯债债券型证券投资基金、平安鼎信债券型证券投资基金、平安惠裕债券型证券投资基金、平安惠盈纯债债券型证券投资基金、平安合润定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金。平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合悦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金、平安惠轩纯债债券型证券投资基金基金经理。

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遵规守信情况的说明

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、《平安惠盈纯债债券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

2018年四季度经济基本面下行趋势确定,货币政策整体维持宽松态势,债券市场不断走牛,期限利差、信用利差逐步压缩。报告期内本基金维持高杠杆操作,以高等级信用债为底仓,同时参与利率债波段操作,使得基金净值保持了稳步增长。

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1.041元;本报告期基金份额净值增长率为2.86%,业绩比较基准收益率为0.65%。

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量不满200人、基金资产净值低于5000万元的情形。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	645,807,997.62	98.23
	其中:债券	645,807,997.62	98.23
	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	1,808,846.61	0.28
8	其他资产	9,855,052.29	1.50
9	合计	657,471,896.52	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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票 。

5.4 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	60,199,000.00	11.77
	其中:政策性金融债	30,109,000.00	5.89
4	企业债券	262,566,000.00	51.33
5	企业短期融资券	20,068,000.00	3.92
6	中期票据	302,704,000.00	59.17
7	可转债(可交换债)	270,997.62	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	645,807,997.62	126.24

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

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	1382212	13哪交投MTN1	400,000	43,624,000.00	8.53
2	101456005	14粤铁建MTN001	400,000	42,476,000.00	8.30
3	078035	07江西高速债	400,000	42,320,000.00	8.27
4	101752042	17粤电MTN002	400,000	42,044,000.00	8.22
5	101756048	17皖交控MTN002	400,000	41,848,000.00	8.18

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,131.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,852,182.34
5	应收申购款	738.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,855,052.29

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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	489,643,012.50
报告期期间基金总申购份额	1,689,472.02
减:报告期期间基金总赎回份额	1,661.08
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	491,330,823.44

§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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018/10/01--2018/12/31	489,439,119.76	-	-	489,439,119.76	99.62%
产品特有风险							
本报告期内,本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时,可能引发巨额赎回,若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时,存在一定的流动性风险;为应对巨额赎回而进行投资标的变现时,可能存在仓位调整困难,甚至对基金份额净值造成不利影响。基金管理人对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理,但当基金出现巨额赎回并被全部确认时,申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险,未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。 在极端情况下,当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。						

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、自2018年10月25日起,本基金管理人法定名称由"平安大华基金管理有限公司"变更为"平安基金管理有限公司"。

2、经本基金管理人2017年第六次临时股东会审议通过,并经中国证券监督管理委员会《关于核准平安大华基金管理有限公司变更股权的批复》(证监许可【2018】1595号),公司新增注册资本10亿元人民币。本次增资完成后,本公司注册资本由3亿元人民币增加至13亿元人民币。

3、本基金名称由"平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金"变更为"平安惠盈纯债债券型证券投资基金"。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安惠盈纯债债券型证券投资基金设立的文件

(2)平安惠盈纯债债券型证券投资基金基金合同

(3)平安惠盈纯债债券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)平安惠盈纯债债券型证券投资基金2018年第4季度报告原文

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
2019年1月18日

平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:2019年1月18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2019年1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