平安安心保本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:中国银行股份有限公司
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。

基金托管人中国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	平安安心保本混合
场内简称	-
交易代码	002304
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1月15日
报告期末基金份额总额	424,179,261.68份
投资目标	本基金以本金安全为目标,通过有效的组合管理,力争实现基金资产的稳定增长和保本期收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略和时间不变性投资组合保险策略,建立和运用严格的动态资产数量模型,动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例,以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标,并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于股票基金和一般混合基金。
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(2018年10月1日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-3,847,786.81
2.本期利润	-1,994,494.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0045
4.期末基金资产净值	436,294,213.88
5.期末基金份额净值	1.029

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。

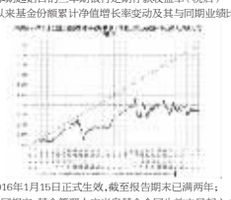
3.2 基金净值表现

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	-0.39%	0.12%	0.65%	0.01%	-1.04%	0.11%

业绩比较基准:每个保本期起始日的三年期银行定期存款收益率(税后)

3.2.2 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



1、本基金基金合同于2016年1月15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基金合同约定。

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		
张恒	平安安心保本混合型证券投资基金基金经理	2018年2月8日	-	7	张恒先生,西南财经大学硕士。曾先后任职于华泰证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫基金、景顺长城基金,2015年起在男男一创业证券历任投资经理、高级投资经理、投资主办人。2017年11月加入平安基金管理有限公司,任固定收益投资部投资经理。现任平安鑫荣混合型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安灵活配置混合型证券投资基金、平安安心保本混合型证券投资基金、平安安享保本混合型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金基金经理。
刘俊廷	平安安心保本混合型证券投资基金的基金经理	2018年6月29日	-	7	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)、平安安盈保本混合型证券投资基金、平安安心保本混合型证券投资基金、平安大华价值优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
曹力	平安安心保本混合型证券投资基金基金经理	2018年8月9日	-	10	曹力先生,马里兰大学博士。曾先后担任美国联邦政府交通部统计分析中心统计分析师、华泰联合证券高级分析师、华泰证券投资经理、中国中投证券有限责任公司量化投资总监。2014年9月加入平安基金管理有限公司,曾担任资本市场专户投资部投资经理。现担任平安安心保本混合型证券投资基金、平安安盈保本混合型证券投资基金、平安大华价值优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
WANG AO	平安鼎信债券型证券投资基金的基金经理	2016年7月21日	-	6	WANG AO先生,澳大利亚籍,CAIA,FRM,CFA,澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士,曾任渣打银行国际业务部外汇政策管理室。2012年9月加入平安基金管理有限公司,担任投资研究部固定收益研究员。现任平安鼎信债券型证券投资基金、平安鼎享混合型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安惠裕债券型证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安双债添益债券型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
余斌	平安鼎信债券型证券投资基金的基金经理	2017年10月16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、平安惠裕纯债债券型证券投资基金、平安鼎位债券型证券投资基金、平安惠裕纯债债券型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、平安合盈定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合益定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合瑞定期开放纯债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、平安合悦定期开放纯债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、平安鼎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。

3、本基金的基金经理曹力先生因身体原因暂停履行基金经理的职责。

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、《平安安心保本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

四季度货币政策继续保持放松、10月份金融数据的超预期下滑再次点燃了市场做多的情绪,中长期利率债和3.5年期信用债都大幅下行,短端在年末资金面的扰动下有一定的上行。由于本基金即将在2019年1月中旬到期,在此情形下,本基金主要配置剩余期限在保本期到期前的短期债券以及部分利率债。

权益市场方面,2018年四季度,由于贸易争端、去杠杆以及宏观政策担忧等不确定因素,引发市场对经济前景的担忧,悲观情绪的蔓延,股票市场表现欠佳。今年以来本基金权益部分在《基金合同》约定的股票投资比例范围内运作,基金2018年股票仓位的平均水平相对于2017年有所降低。在考虑投资标的布局时,不断地对投资组合进行扫描,坚持自上而下和自下而上相结合选股。

2018年四季度,面对不确定的宏观环境,投资重点上更倾向于弱周期的消费成长股以及科技类成长股,倾向于那些现金流清晰、竞争格局让人放心、能够清晰感受到业绩的公司股票,比如消费、新能源、科技、交通、医药、家电等板块。

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1.029元;本报告期基金份额净值增长率为-0.39%,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	7,470,645.20	1.71
	其中:股票	7,470,645.20	1.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	289,914,000.00	66.25
	其中:债券	289,914,000.00	66.25
	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	100,000,390.00	22.85
	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	32,808,432.43	7.50
8	其他资产	7,385,005.27	1.69
9	合计	437,578,472.90	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	185,878.00	0.04
B	采矿业	433,675.00	0.10
C	制造业	4,610,250.00	1.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	195,225.00	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	126,518.00	0.03
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	1,839,811.20	0.42
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	79,228.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	7,470,645.20	1.71

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

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	300014	亿纬锂能	60,000	943,200.00	0.22
2	600332	白云山	20,000	715,200.00	0.16
3	000333	美的集团	15,600	575,016.00	0.13
4	600028	中国石化	71,500	361,075.00	0.08
5	601009	南京银行	52,700	340,442.00	0.08
6	601328	交通银行	55,300	320,187.00	0.07
7	600872	中炬高新	10,200	300,492.00	0.07
8	300470	日机密封	13,420	298,595.00	0.07
9	002008	大族激光	8,700	264,132.00	0.06
10	300001	特锐德	15,000	262,950.00	0.06

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	30,046,000.00	6.89
	其中:政策性金融债	30,046,000.00	6.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	231,269,000.00	53.01
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	28,599,000.00	6.55
9	其他	-	-
10	合计	289,914,000.00	66.45

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	011800669	18国瑞龙SCP001	300,000	30,225,000.00	6.93
2	011800711	18越秀租赁SCP001	300,000	30,219,000.00	6.93
2	011800728	18天津轨交SCP001	300,000	30,219,000.00	6.93
3	011800724	18华侨城SCP003	300,000	30,204,000.00	6.92
4	011800725	18深航空SCP002	300,000	30,201,000.00	6.92
5	071800039	18渤海证券CP010	300,000	30,042,000.00	6.89

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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	21,908.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,362,897.48
5	应收申购款	199.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,385,005.27

5.11.4 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

本基金本报告期末前十名股票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	458,578,057.82
报告期期间基金总申购份额	26,721.25
减:报告期期间基金总赎回份额	34,425,517.39
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	424,179,261.68

§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 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"平安大华安心保本混合型证券投资基金"变更为"平安安心保本混合型证券投资基金"。

§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安心保本混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安安心保本混合型证券投资基金基金合同

(3)平安安心保本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)平安安心保本混合型证券投资基金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

平安鼎信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	平安鼎信债券
场内简称	-
交易代码	002988
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7月21日
报告期末基金份额总额	527,393,946.75份
投资目标	在谨慎投资的前提下,力争战胜业绩比较基准,追求基金资产的长期、稳健、持续增值。
投资策略	转型为"平安鼎信债券型证券投资基金"后,本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置,把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会,根据宏观经济、基准利率水平等因素,预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平,结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,进行大类资产配置。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险均高于货币市场基金,但低于混合型基金和股票型基金。
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

§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	5,832,321.04
2.本期利润	14,606,336.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0277
4.期末基金资产净值	545,742,584.33
5.期末基金份额净值	1.0348

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。

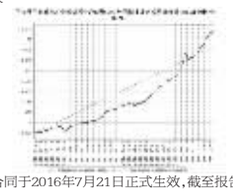
3.2 基金净值表现

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	2.69%	0.05%	0.98%	0.01%	1.71%	0.04%

业绩比较基准:三年期银行定期存款收益率(税后)+1.5%

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7月21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		
WANG AO	平安鼎信债券型证券投资基金的基金经理	2016年7月21日	-	6	WANG AO先生,澳大利亚籍,CAIA,FRM,CFA,澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士,曾任渣打银行国际业务部外汇政策管理室。2012年9月加入平安基金管理有限公司,担任投资研究部固定收益研究员。现任平安鼎信债券型证券投资基金、平安鼎享混合型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安惠裕债券型证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安双债添益债券型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
余斌	平安鼎信债券型证券投资基金的基金经理	2017年10月16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、平安惠裕纯债债券型证券投资基金、平安鼎位债券型证券投资基金、平安惠裕纯债债券型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、平安合盈定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合益定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合瑞定期开放纯债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、平安合悦定期开放纯债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、平安鼎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、《平安鼎信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,以中短期利率债为主,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1.0348元;本报告期基金份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为0.98%。

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20个工作日基金资产净值低于5000万的情形。

本基金本报告期内出现连续20个工作日基金持有人数低于200人的情形。截止本报告期末,以上情形已经消除。

§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	689,690,050.00	97.60
	其中:债券	689,690,050.00	97.60
	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	4,203,263.07	0.59
8	其他资产	12,760,861.31	1.81
9	合计	706,654,174.38	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	71,264,000.00	13.06
	其中:政策性金融债	71,264,000.00	13.06
4	企业债券	199,091,050.00	36.48
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	419,335,000.00	76.84
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	689,690,050.00	126.38

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	101456017	14津城建MTN001	400,000	42,436,000.00	7.78
2	1880035	18可钢绿色债	400,000	42,052,000.00	7.71
3	180210	18国开10	400,000	41,252,000.00	7.56
4	101782001	17可钢集MTN007	400,000	40,956,000.00	7.50
5	131800014	18武汉地铁GN001	400,000	40,872,000.00	7.49

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	45.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,760,815.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,760,861.31

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	527,388,039.06
报告期期间基金总申购份额	5,917.61
减:报告期期间基金总赎回份额	9.92
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	527,393,946.75

§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	527,366,110.39	-	-	527,366,110.39	99.99%
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。基金经理会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。						

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"平安大华鼎信债券型证券投资基金"变更为"平安鼎信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安心保本混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安安心保本混合型证券投资基金基金合同

(3)平安安心保本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)平安安心保本混合型证券投资基金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

平安惠享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	平安惠享纯债
场内简称	-
交易代码	003286
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10月27日
报告期末基金份额总额	319,890,584.31份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,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	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率