平安惠悦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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1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	平安惠悦纯债
场内简称	-
交易代码	004826
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	2017年9月12日
报告期末基金份额总额	3,621,209,752.38份
投资目标	在谨慎控制组合净值波动率的前提下,本基金追求基金资产的长期、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合风险的前提下,获得债券市场的整体回报率及超额收益。
业绩比较基准	中债综合指数(总财富)收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%
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。
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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	13,813,947.83
2.本期利润	26,508,055.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0205
4.期末基金资产净值	3,937,424,202.96
5.期末基金份额净值	1.0873

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。

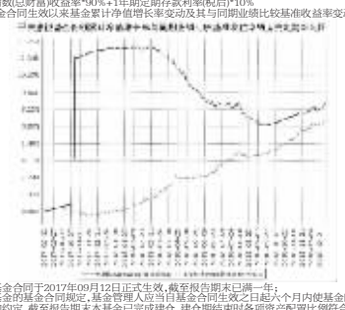
3.2 基金净值表现

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	1.55%	0.05%	2.43%	0.04%	-0.88%	0.01%

中债综合指数(总财富)收益率*90%+1年期定期存款利率(税后)*10%

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2017年09月12日正式生效,截至报告期末已满一年;

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		
高勇标	平安惠悦纯债债券型证券投资基金基金经理	2017年9月14日	-	8	高勇标先生,西南财经大学硕士,曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017年4月加入平安基金管理有限公司,任投资研究部固定收益组投资经理,现任平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安安盈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、平安鑫安混合型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安惠泽纯债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、平安鑫荣混合型证券投资基金基金经理。
张文平	固定收益投资中心投资执行总经理、平安惠悦纯债债券型证券投资基金的基金经理	2018年9月20日	-	7	张文平先生,南京大学硕士。先后担任毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公司,现任固定收益投资中心投资执行总经理。同时担任平安短债债券型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠轩纯债债券型证券投资基金基金经理。
申俊华	平安惠悦纯债债券型证券投资基金基金经理	2017年9月12日	2018年10月24日	10	申俊华女士,湖南大学金融学博士。曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员,2012年加入平安基金管理有限公司,曾担任固定收益研究员,现担任平安财富宝货币市场基金、平安日增利货币市场基金基金经理。

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、《平安惠悦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

四季度宏观经济稳中有降,通胀中枢维持较低水平,社会融资总量余额增速持续下行,货币政策维持中性偏松基调。央行于10月份再次降准,货币市场资金面保持相对宽松状态。另一方面,中美贸易战持续发酵,股市剧烈调整,债市避险情绪升温,利率债和高等级信用债收益率持续下行,而低等级信用债受金融强监管、债务违约等影响,信用利差反而有所扩大。本基金在符合基金合同约定的投资范围和投资限制的基础上,近期主要投资于利率债,致力于获得稳健的投资收益。

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1.0873元;本报告期基金份额净值增长率为1.55%,业绩比较基准收益率为2.43%。

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	3,871,295,871.89	92.40
	其中:债券	3,871,295,871.89	92.40
	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	194,540,611.81	4.64
	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	41,735,679.66	1.00
8	其他资产	82,273,447.27	1.96
9	合计	4,189,845,610.63	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	3,871,295,871.89	98.32
	其中:政策性金融债	3,871,295,871.89	98.32
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,871,295,871.89	98.32

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	180212	18国开12	6,500,000	657,150,000.00	16.69
2	180203	18国开03	3,400,000	349,826,000.00	8.88
3	180208	18国开08	3,100,000	315,673,000.00	8.02
4	170209	17国开09	3,100,000	314,805,000.00	8.00
5	180313	18进出13	2,600,000	262,756,000.00	6.67

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	35,393.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	82,238,054.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	82,273,447.27

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	561,770,224.71
报告期期间基金总申购份额	3,522,548,057.80
减:报告期期间基金总赎回份额	463,108,530.13
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	3,621,209,752.38

§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	
		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	20181001-20181128	280,556,438.79	-	-	280,556,438.79	7.75%
	2	20181001-20181128	280,557,373.98	-	-	280,557,373.98	7.75%
	3	20181116-20181127	-	185,338,708.18	-	185,338,708.18	5.12%
	4	20181129-20181224	-	463,090,673.34	463,090,673.34	0.00	0.00%
	5	20181129-20181225	-	463,090,673.34	-	463,090,673.34	12.79%
	6	20181225-20181225	-	452,404,210.14	-	452,404,210.14	12.49%
	7	20181226-20181231	-	922,508,302.58	-	922,508,302.58	25.48%

产品持有风险

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。

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"平安大华惠悦纯债债券型证券投资基金"变更为"平安惠悦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悦纯债债券型证券投资基金设立的文件

(2)平安惠悦纯债债券型证券投资基金基金合同

(3)平安惠悦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)平安惠悦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19日

平安量化精选混合型发起式证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1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	平安量化精选混合
场内简称	-
交易代码	005486
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月1日
报告期末基金份额总额	201,429,616.82份
投资目标	在严格控制风险的基础上,本基金通过量化模型进行资产配置、精选股票,力求在有效分散风险的同时实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在投资过程中主要运用量化投资策略进行投资管理,减少人为主观情绪及个人判断的失误概率,使投资过程富有纪律性和规范性,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。本基金的投资策略主要包括两部分:一是,采取数量化方法,运用行业轮动投资时钟的资产配置策略,确定资产配置的具体比例;二是,在股票投资过程中,本基金将保持通过模型选股构建股票投资组合的投资策略,强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及预期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	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	平安量化精选混合A / 平安量化精选混合C
下属分级基金的场内简称	- / -
下属分级基金的交易代码	005486 / 005487
下属分级基金的前端交易代码	- / -
下属分级基金的后端交易代码	- / -
报告期末下属分级基金的份额总额	108,715,599.18份 / 92,714,017.64份
下属分级基金的风险收益特征	- / -

§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)	
	平安量化精选混合A	平安量化精选混合C
1. 本期已实现收益	-2,544,632.35	-2,371,075.08
2. 本期利润	-6,214,106.38	-5,575,629.50
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0552	-0.0568
4. 期末基金资产净值	91,177,734.42	77,177,217.14
5. 期末基金份额净值	0.8387	0.8324

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

平安量化精选混合A

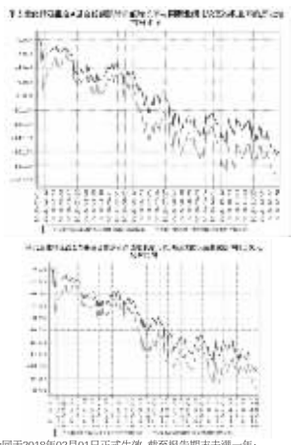
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.19%	0.93%	-8.03%	1.15%	1.84%	-0.22%

平安量化精选混合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	-6.39%	0.93%	-8.03%	1.15%	1.64%	-0.22%

沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%

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2018年02月01日正式生效,截至报告期末未满一年;

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		
施旭	平安量化精选混合型发起式证券投资基金的基金经理	2018年2月1日	-	8	施旭先生,哥伦比亚大学金融数学硕士。曾任职于西部证券、MockingBird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券,2015年加入平安基金管理有限公司,任衍生品投资中心量化研究员,现任平安深证300指数增强型证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安量化精选混合型发起式证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数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、《平安量化精选混合型发起式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

回顾四季度,一方面,市场盈利进入加速下行阶段,周期、消费等强势行业也受宏观经济下行的影响也逐渐回落,A股市场整体也震荡下行;另一方面,市场也进入了政策维度的集中博弈期,监管层面对流动性、市场监管与预期的引导使得四季度也出现了一定的阶段结构性行情,但总体依然处于风险偏好和估值下行的趋势,市场估值逐渐进入历史估值底部区域。

四季度,基金策略以防守为主,在控制总体仓位的前提下,收紧组合行业和风格暴露,以精选低估值个股为主要配置策略继续以量化多因子选股模型为框架,精选低估值个股为主要配置策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安量化精选混合A基金份额净值为0.8387元,本报告期基金份额净值增长率为-6.19%;截至本报告期末平安量化精选混合C基金份额净值为0.8324元,本报告期基金份额净值增长率为-6.39%;同期业绩比较基准收益率为-8.03%。

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	84,110,847.45	49.29
	其中:股票	84,110,847.45	49.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	36,158,400.00	21.19
	其中:债券	36,158,400.00	21.19
	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	35,000,000.00	20.51
	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	14,306,120.09	8.38
8	其他资产	1,070,489.71	0.63
9	合计	170,645,857.25	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	1,434,625.00	0.85
B	采矿业	2,026,331.00	1.20
C	制造业	34,948,308.99	20.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	415,625.00	0.25
E	建筑业	4,279,556.00	2.54
F	批发和零售业	2,108,406.00	1.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,728,241.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,843,371.00	1.09
J	金融业	28,053,395.45	16.66
K	房地产业	5,999,415.01	3.56
L	租赁和商务服务业	1,273,574.00	0.76
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	84,110,847.45	49.96

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	600036	招商银行	99,200	2,499,840.00	1.48
2	600519	贵州茅台	4,210	2,483,942.10	1.48
3	600030	中信证券	134,700	2,156,547.00	1.28
4	601166	兴业银行	133,600	1,995,984.00	1.19
5	002399	海普瑞	79,900	1,841,695.00	1.09
6	000651	格力电器	51,400	1,834,466.00	1.09
7	600016	民生银行	314,500	1,802,085.00	1.07
8	600104	上汽集团	62,950	1,678,876.50	1.00
9	601328	交通银行	284,955	1,649,889.45	0.98
10	601668	中国建筑	288,400	1,643,880.00	0.98

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	36,158,400.00	21.48
	其中:政策性金融债	36,158,400.00	21.48
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	36,158,400.00	21.48

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	018005	国开1701	360,000	36,158,400.00	21.48

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	66,790.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,003,699.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,070,489.71

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	2,156,547.00	1.28	重大事项

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	平安量化精选混合A	平安量化精选混合C
报告期期初基金份额总额	114,165,429.25	100,858,854.95
报告期期间基金总申购份额	20,921.87	17,775.33
减:报告期期间基金总赎回份额	5,470,751.94	8,162,612.64
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	108,715,599.18	92,714,017.64

§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

单位:份

项目	平安量化精选混合A	平安量化精选混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,005,417.21	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,005,417.21	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.97	0.00

备注:比例中的分母为两类份额总额的合计。

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,005,417.21	4.97	10,005,417.21	4.97	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,005,417.21	4.97	10,005,417.21	4.97	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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"平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金"变更为"平安量化精选混合型发起式证券投资基金"。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安量化精选混合型发起式证券投资基金设立的文件

(2)平安量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同

(3)平安量化精选混合型发起式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)平安量化精选混合型发起式证券投资基金2018年第4季度报告原文

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

10.3 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19日

平安双债添益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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1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	平安双债添益债券	
场内简称	-	
交易代码	005750	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年6月4日	
报告期末基金份额总额	40,587,903.37份	
投资目标	本基金通过对可转债和信用债的积极投资,在严格控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金将密切关注经济运行趋势,把握领先指标,预测未来走势,深入分析国家推行的财政与货币政策对未来宏观经济运行以及投资环境的影响。本基金将根据宏观经济、基准利率水平,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,做出最佳的资产配置及风险控制。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%	
风险收益特征	从基金资产整体运