

信息披露 disclosure

平安惠兴纯债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

摘要：《平安惠兴纯债债券型证券投资基金合同》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。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 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。

4.2.2 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

一季度货币政策强调“不搞大水漫灌”、防止“流动性幻觉”，整体宽松，但进一步宽松的可持续性不大。在宽信用政策不断推进的情况下，社融逐步企稳回升，融资需求改善，市场风险偏好逐步提升，债市小幅下行，整体维持震荡态势。报告期内本基金保持高杠杆操作，以中长期利率债为主，并逐步提升高等级中期信用债仓位，使得基金净值保持了稳步增长。

4.5 报告期内基金的投资业绩

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1.04%，业绩比较基准收益率为1.08%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末未出现连续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	-	-
2	其中：股票	-	-
3	固定收益投资	1,292,002,000.00	93.62
4	其中：债券	1,292,002,000.00	93.62
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	67,613,297.63	4.91
11	其他资产	20,224,912.73	1.46
12	合计	1,380,840,210.36	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

本基金本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

平安惠轩纯债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 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。

4.2.2 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

一季度货币政策强调“不搞大水漫灌”、防止“流动性幻觉”，整体宽松，但进一步宽松的可持续性不大。在宽信用政策不断推进的情况下，社融逐步企稳回升，融资需求改善，市场风险偏好逐步提升，债市小幅下行，整体维持震荡态势。报告期内本基金保持一定的杠杆操作，以高信用等级债为主，逐步提升信用债仓位，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 报告期内基金的投资业绩

截至本报告期末本基金份额净值为1.0128元；本报告期基金份额净值增长率为1.42%，业绩比较基准收益率为1.06%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末未出现连续20个工作日基金资产净值低于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	-	-
2	其中：股票	-	-
3	固定收益投资	12,513,226,300.00	96.59
4	其中：债券	12,513,226,300.00	96.59
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	130,699,316.87	0.99
11	其他资产	447,476,268.20	3.42
12	合计	13,090,701,885.07	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	129,949,000.00	1.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,658,119,400.00	62.30
4	其中：政策性金融债	1,049,303,600.00	9.95
5	企业债券	837,990,000.00	7.95
6	企业短期融资券	300,133,000.00	2.86
7	中期票据	3,762,426,000.00	35.69
8	可转债（可交换债）	-	-
9	待偿还信用债	766,884,000.00	7.26
10	其他	169,728,000.00	1.60
11	合计	12,513,226,300.00	116.69

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

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。

5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.9 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国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

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人主体没有受到监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 报告期内基金投资的前十名证券的发行人主体没有受到监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.3 其他资产构成

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.33 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.39 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.40 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.42 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.43 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.45 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.46 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.47 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.48 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.49 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.50 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.51 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.52 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.54 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.55 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.56 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.57 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.58 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.59 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.60 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.61 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.62 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.63 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.64 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.65 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.66 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.67 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.69 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.70 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.71 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.72 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.73 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.74 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.75 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.76 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.78 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.79 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.80 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.81 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.82 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.83 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.84 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.85 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.86 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.87 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.88 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.89 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.90 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.91 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.92 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.93 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.94 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.95 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.96 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.97 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.98 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.99 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.100 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.101 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.102 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.103 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.104 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.105 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.106 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.107 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.108 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.109 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.110 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.111 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.112 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.113 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.114 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.115 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.116 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.117 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.118 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.119 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.120 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.121 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.122 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.123 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.124 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.125 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.126 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.127 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细