

平安日增利货币市场基金

2019年第二季度报告

2019年二季度,经济基本盘出现明显下行,固定资产投资低迷,消费走弱,净出口... 基金资产净值增长率为0.6288%,同期业绩比较基准增长率为0.3413%。

4.5 报告期内基金的投资表现 报告期内,本基金份额净值增长率为0.6288%,同期业绩比较基准增长率为0.3413%。

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5,000万元的情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况 1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:本基金报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例与报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的平均值。

5.3 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

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

5.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明 本基金报告期内投资组合平均剩余期限未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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债券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

6.1 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

6.2 报告期内偏离度绝对值前5大的债券明细

6.3 报告期内负偏离度的绝对值达到-0.25%情况说明

6.4 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

6.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

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7月15日

重要提示 基金管理人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7月12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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 平安日增利货币市场基金

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

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,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。

2. 本基金按日结转份额

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 偏离度, ①-③, ②-④

3.2.2 本报告期基金份额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2013年12月12日正式生效,截至本报告期末已满五年; 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

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7月15日

重要提示 基金管理人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7月12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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 平安日增利货币市场基金

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

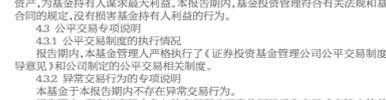
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金按日结转份额

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 偏离度, ①-③, ②-④

3.2.2 本报告期基金份额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2015年6月9日正式生效,截至本报告期末已满四年; 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

平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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。

4.3.1 公平交易专项说明 4.3.1.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明 4.3.2.1 异常交易行为的专项说明

4.3.2.2 异常交易行为的专项说明

4.3.2.3 异常交易行为的专项说明

4.3.2.4 异常交易行为的专项说明

4.3.2.5 异常交易行为的专项说明

4.3.2.6 异常交易行为的专项说明

4.3.2.7 异常交易行为的专项说明

4.3.2.8 异常交易行为的专项说明

4.3.2.9 异常交易行为的专项说明

4.3.2.10 异常交易行为的专项说明

4.3.2.11 异常交易行为的专项说明

4.3.2.12 异常交易行为的专项说明

4.3.2.13 异常交易行为的专项说明

4.3.2.14 异常交易行为的专项说明

4.3.2.15 异常交易行为的专项说明

4.3.2.16 异常交易行为的专项说明

4.3.2.17 异常交易行为的专项说明

4.3.2.18 异常交易行为的专项说明

4.3.2.19 异常交易行为的专项说明

4.3.2.20 异常交易行为的专项说明

4.3.2.21 异常交易行为的专项说明

4.3.2.22 异常交易行为的专项说明

4.3.2.23 异常交易行为的专项说明

4.3.2.24 异常交易行为的专项说明

4.3.2.25 异常交易行为的专项说明

4.3.2.26 异常交易行为的专项说明

4.3.2.27 异常交易行为的专项说明

4.3.2.28 异常交易行为的专项说明

4.3.2.29 异常交易行为的专项说明

4.3.2.30 异常交易行为的专项说明

4.3.2.31 异常交易行为的专项说明

4.3.2.32 异常交易行为的专项说明

4.3.2.33 异常交易行为的专项说明

4.3.2.34 异常交易行为的专项说明

4.3.2.35 异常交易行为的专项说明

4.3.2.36 异常交易行为的专项说明

4.3.2.37 异常交易行为的专项说明

4.3.2.38 异常交易行为的专项说明

4.3.2.39 异常交易行为的专项说明

4.3.2.40 异常交易行为的专项说明

4.3.2.41 异常交易行为的专项说明

4.3.2.42 异常交易行为的专项说明

4.3.2.43 异常交易行为的专项说明

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7月15日

重要提示 基金管理人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7月12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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

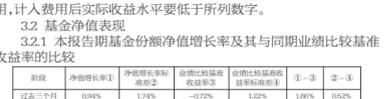
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金按日结转份额

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 偏离度, ①-③, ②-④

3.2.2 本报告期基金份额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2015年6月9日正式生效,截至本报告期末已满四年; 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

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7月15日

重要提示 基金管理人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7月12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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

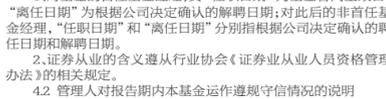
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金按日结转份额

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 偏离度, ①-③, ②-④

3.2.2 本报告期基金份额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

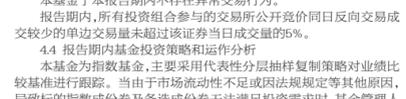


1. 本基金基金合同于2015年6月9日正式生效,截至本报告期末已满四年; 2. 按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内

平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金

2019年第二季度报告

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



4.3.1 公平交易制度的执行情况 4.3.1.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明 4.3.2.1 异常交易行为的专项说明

4.3.2.2 异常交易行为的专项说明

4.3.2.3 异常交易行为的专项说明

4.3.2.4 异常交易行为的专项说明

4.3.2.5 异常交易行为的专项说明

4.3.2.6 异常交易行为的专项说明

4.3.2.7 异常交易行为的专项说明

4.3.2.8 异常交易行为的专项说明

4.3.2.9 异常交易行为的专项说明

4.3.2.10 异常交易行为的专项说明

4.3.2.11 异常交易行为的专项说明

4.3.2.12 异常交易行为的专项说明

4.3.2.13 异常交易行为的专项说明

4.3.2.14 异常交易行为的专项说明

4.3.2.15 异常交易行为的专项说明

4.3.2.16 异常交易行为的专项说明

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7月15日

重要提示 基金管理人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7月12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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

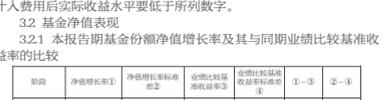
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金按日结转份额

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 偏离度, ①-③, ②-④

3.2.2 本报告期基金份额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12月27日正式生效,截至本报告期末未满一年; 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

本本基金本报告期末未持有股票。

5.3.2 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票投资明细

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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资产支持证券投资明细

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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人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 报告期内,本基金未参与股票交易。

5.11.3 其他资产构成

5.9 投资组合报告附注 5.9.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行人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。

5.9.2 中国民生银行于2018年7月26日做出处罚决定,由于平安银行股份有限公司(以下简称“公司”)未按规定履行客户身份识别义务,未按规定保存客户身份资料及交易记录,未按规定报送大额交易报告或可疑报告,根据相关法律法规处以100万元。本基金经理人对该公司进行了深入的分析和了解,认为该事项有利于公司规范开展业务,对公司的偿债能力不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

上海证监局于2018年10月8日做出行政处罚决定书(沪证监罚字〔2018〕49号处罚决定,由于上海银行股份有限公司(以下简称“公司”)未按规定履行客户身份识别义务,未按规定保存客户身份资料及交易记录,未按规定报送大额交易报告或可疑报告,根据相关法律法规处以100万元。本基金经理人对该公司进行了深入的分析和了解,认为该事项有利于公司规范开展业务,对公司的偿债能力不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金经理人对上述两家公司的其他证券没有发行主体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、处罚的证券。

5.9.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

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,分项之和与合计项可能有尾差。

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期末基金份额总额, 基金份额

7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易金额(元), 占基金资产净值比例(%)

8 1 备查文件目录 (1)中国证监会批准平安日增利货币市场基金设立的文件 (2)平安日增利货币市场基金基金合同 (3)平安日增利货币市场基金托管协议 (4)基金管理人业务资格批文、营业执照和公司章程 (5)平安日增利货币市场基金2019年第二季度报告原文

8.2 存放地点 基金管理人、基金托管人住所

8.3 查阅方式 (1)投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件 (2)投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金经理人平安基金管理有限公司,客户服务热线:4008004800(免长途话费)

平安基金管理有限公司 2019年7月15日

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人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 报告期内,本基金未参与股票交易。

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 资产名称, 金额(元)

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 5.11.5.1 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,分项之和与合计项可能有尾差。

6 开放式基金份额变动