平安0-3年期政策性金融债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:平安基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安0-3年期政策性金融债债券	
场内简称	-	
交易代码	006932	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年2月25日	
报告期末基金份额总额	49,838,100.17份	
投资目标	本基金以政策性金融债券为主要投资对象,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金通过对宏观经济周期、行业前景预期和发债主体公司研究的综合运用,主要采取利率策略、息差策略等积极投资策略,在严格控制流动性风险、利率风险的基础上,以政策性金融债券为主要投资对象,构建及调整固定收益投资组合,力争实现基金资产的长期稳定增值。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	中证政策性金融债1-3年指数收益率×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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安0-3年期政策性金融债债券A	平安0-3年期政策性金融债债券C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	006932	006933
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	49,836,798.88份	1,301.29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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	平安0-3年期政策性金融债债券A	平安0-3年期政策性金融债债券C
1. 本期已实现收益	81,436.53	-6.57
2. 本期利润	94,277.96	4.90
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0013	0.0038
4. 期末基金资产净值	50,134,058.12	1,309.28
5. 期末基金份额净值	1.0060	1.0061

注:

1. 本基金基金合同于2019年2月25日正式生效,截至报告期末未满半年;

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;

3. 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0-3年期政策性金融债债券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	0.36%	0.03%	0.63%	0.03%	-0.27%	0.00%

平安0-3年期政策性金融债债券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	0.37%	0.03%	0.63%	0.03%	-0.26%	0.00%

业绩比较基准:中证政策性金融债1-3年指数收益率*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2019年2月25日正式生效,截至报告期末未满半年;

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0-3年期政策性金融债债券型证券投资基金的基金经理	2019年2月25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年起在第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、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安信信优势灵活配置混合型证券投资基金、平安新鼎先锋混合型证券投资基金经理。

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0-3年期政策性金融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

二季度货币政策一波两折,前半季货币政策边际收紧,后半季监管推进金融供给侧改革、托管包商银行,引发银行间市场流动性分层和信任危机,央行最终再度边际放松、着力疏导该现象。经济基本面在一季度良好表现之后,二季度开始呈现回落的压力,而逆周期调节的力度在二季度也相对温和。报告期内本基金操作相对灵活,主要配置0-3年利率债,基金净值稳定上涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,A基金份额净值为1.0060元,本报告期基金份额净值增长率为0.36%;截至本报告期末,C基金份额净值为1.0061元,本报告期基金份额净值增长率为0.37%;同期业绩比较基准收益率为0.63%。

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5,000万元的情形。

§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	46,942,200.00	93.56
	其中:债券	46,942,200.00	93.56
	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	2,814,767.25	5.61
8	其他资产	422,683.68	0.84
9	合计	50,179,650.93	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	46,942,200.00	93.63
	其中:政策性金融债	46,942,200.00	93.63
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	46,942,200.00	93.63

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	190402	19农发02	300,000	29,949,000.00	59.74
2	190201	19国开01	170,000	16,993,200.00	33.89

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

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

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	6,517.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	416,166.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	422,683.68

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仓股票。

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

项目	平安0-3年期政策性金融债债券A	平安0-3年期政策性金融债债券C
报告期期初基金份额总额	150,002,907.68	1,311.30
报告期期间基金总申购份额	29,831,941.13	-
减:报告期期间基金总赎回份额	129,998,049.93	10.01
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	49,836,798.88	1,301.29

§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

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无

§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	序号	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	2019/04/01--2019/04/10	49,999,000.00	-	49,999,000.00	-	0.00%
	2	2019/04/01--2019/05/09	50,000,000.00	14,916,467.78	50,000,000.00	14,916,467.78	29.93%
	3	2019/04/11--2019/06/04	29,999,000.00	-	29,999,000.00	-	0.00%
	4	2019/04/11--2019/06/30	20,002,000.00	-	-	20,002,000.00	40.13%
	5	2019/06/27--2019/06/30	-	14,915,473.35	-	14,915,473.35	29.93%
	6	2019/06/27--2019/06/30	50,000,000.00	14,916,467.78	50,000,000.00	14,916,467.78	29.93%

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。

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5,000万元,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。

§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0-3年期政策性金融债债券型证券投资基金设立的文件

(2)平安0-3年期政策性金融债债券型证券投资基金基金合同

(3)平安0-3年期政策性金融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0-3年期政策性金融债债券型证券投资基金2019年2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7月16日

平安安心灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月16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7月15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,但不保证基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安安心灵活配置混合	
场内简称	-	
交易代码	002304	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年1月18日	
报告期末基金份额总额	212,164,732.73份	
投资目标	通过对宏观经济和股票市场、债券市场发展趋势的分析,力求把握在不同行情中可行的投资机会,追求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析,结合经济周期理论,形成对不同市场周期的预测和判断,进行积极、灵活的资产配置,确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金,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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安安心灵活配置混合A	平安安心灵活配置混合C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	002304	007048
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	180,179,784.11份	31,984,948.62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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	平安安心灵活配置混合A	平安安心灵活配置混合C
1. 本期已实现收益	1,113,328.61	210,246.49
2. 本期利润	2,209,603.18	129,131.25
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0183	0.0034
4. 期末基金资产净值	187,567,658.02	33,334,793.34
5. 期末基金份额净值	1.0410	1.0422

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

平安安心灵活配置混合A

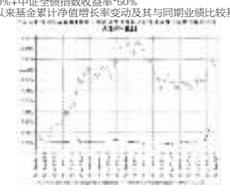
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.72%	0.20%	-0.11%	0.75%	0.83%	-0.55%

平安安心灵活配置混合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	0.70%	0.20%	-0.11%	0.75%	0.81%	-0.55%

沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

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 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		
刘俊廷	平安安心灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2019年1月18日	-	7	刘俊廷先生,中国科学院研究生院硕士,曾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年起在第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、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安信信优势灵活配置混合型证券投资基金、平安新鼎先锋混合型证券投资基金经理。
张恒	平安安心灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2019年1月18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年起在第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、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安鼎弘混合型证券投资基金、平安惠誠純債債券型证券投資基金、平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、平安合盛3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安高等级债债券型证券投资基金、平安惠添纯债债券型证券投资基金基金经理。
曹力	平安安心灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2019年1月18日	2019年4月10日	10	曹力先生,马里兰大学博士。曾先后担任美国联邦政府经济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,曾任资本市场专户投资部投资经理。曾担任平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安安盈保本混合型证券投资基金、平安佑值优势灵活配置混合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、《平安安心灵活配置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

二季度货币政策一波两折,前半季货币政策边际收紧,后半季监管推进金融供给侧改革、托管包商银行,引发银行间市场流动性分层和信任危机,央行最终再度边际放松、着力疏导该现象。经济基本面在一季度良好表现之后,二季度开始呈现回落的压力,而逆周期调节的力度在二季度也相对温和。报告期内本基金操作相对灵活,主要配置0-3年利率债,基金净值稳定上涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,A基金份额净值为1.0410元,本报告期基金份额净值增长率为0.72%;截至本报告期末平安安心灵活配置混合A基金份额净值为1.0422元,本报告期基金份额净值增长率为0.70%;同期业绩比较基准收益率为-0.11%。

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5,000万元的情形。

§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	71,303,316.52	32.23
	其中:股票	71,303,316.52	32.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	147,000,910.10	66.44
	其中:债券	147,000,910.10	66.44
	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	1,646,483.80	0.74
8	其他资产	1,289,184.46	0.58
9	合计	221,239,894.88	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	71,303,316.52	32.23
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	71,303,316.52	32.23

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	002142	宁波银行	462,970	11,222,392.80	5.08
2	600000	浦发银行	900,000	10,512,000.00	4.76
3	600036	招商银行	288,000	10,362,240.00	4.69
4	601939	建设银行	1,300,000	9,672,000.00	4.38
5	601328	交通银行	1,499,981	9,179,883.72	4.16
6	601166	兴业银行	500,000	9,145,000.00	4.14
7	601288	农业银行	2,500,000	9,000,000.00	4.07
8	601818	光大银行	580,000	2,209,800.00	1.00

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	9,996,000.00	4.53
	其中:政策性金融债	9,996,000.00	4.53
4	企业债券	6,567,325.60	2.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,123,600.00	0.96
7	可转债(可交换债)	2,278,984.50	1.03
8	同业存单	126,035,000.00	57.05
9	其他	-	-
10	合计	147,000,910.10	66.55

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	111910145	19兴业银行CD145	200,000	19,408,000.00	8.79
2	111909116	19浦发银行CD116	200,000	19,398,000.00	8.78
3	111914086	19江苏银行CD086	200,000	19,386,000.00	8.78
4	111997451	19徽商银行CD034	200,000	19,374,000.00	8.77
5	190201	19国开01	100,000	9,996,000.00	4.53

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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

中国人民银行于2018年7月26日做出处罚决定,由于上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“公司”):未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或可疑报告、与身份不明的客户进行交易,根据相关规定对公司罚款170万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项有利于公司规范开展业务,对公司的偿债能力暂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。

银保监会于2018年11月9日做出银保监银罚决字(2018)8号处罚决定,由于中国民生银行股份有限公司(以下简称“公司”):(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)同业投资违规接受担保;(三)同业投资、理财资金违规投资房地产,用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资;(四)本行理财产品之间风险隔离不到位;(五)个人理财资金违规投资;(六)票据代理未明示,增信未簿记和计提资本占用;(七)为非保本理财产品提供保本承诺。根据相关规定对公司罚款3160万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项有利于公司规范开展业务,对公司的偿债能力暂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。

银保监会于2018年11月9日做出银保监银罚决字(2018)5号处罚决定,由于中国民生银行股份有限公司(以下简称“公司”):贷款业务严重违反审慎经营规则。根据相关规定对公司罚款200万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项有利于公司规范开展业务,对公司的偿债能力暂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。

本基金本报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人严格遵循《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告》等有关法律法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

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	12,829.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,276,155.73
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	1,289,184.46

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113014	林洋转债	957,100.00	0.43

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未存在流通受限。

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	平安安心灵活配置混合A	平安安心灵活配置混合C
报告期期初基金份额总额	38,038,601.93	58,140,030.62
报告期期间基金总申购份额	152,867,796.32	2,915,169.56
减:报告期期间基金总赎回份额	10,726,614.14	29,070,251.56
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	180,179,784.11	31,984,948.62

§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

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无

§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	序号	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	2019040101--201904022	29,069,767.44	0.00	29,069,767.44	0.00	0.00%
	2	2019040101--20190507	29,069,767.44	0.00	0.00	29,069,767.44	13.70%
	3	2019060801--20190630	0.00	97,360,529.65	0.00	97,360,529.65	45.89%
	4	2019060801--20190630	0.00	48,679,778.02	0.00	48,679,778.02	22.94%

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。

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5,000万元,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。

§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灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安安心灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(3)平安安心灵活配置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)平安安心灵活配置混合型