平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	平安鼎弘混合(LOF)
场内简称	平安鼎弘
交易代码	167003
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4月26日
报告期末基金份额总额	82,109,486.04份
投资目标	本基金转为上市开放式基金(LOF)后,通过合理配置大类资产和精选投资标的,在严格控制下行风险和保持资产流动性的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金转为上市开放式基金(LOF)后,在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上,深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件,将事件性因素作为投资的主线,形成以事件驱动为核心的投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*80%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。
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

§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)
1.本期已实现收益	-1,537,566.85
2.本期利润	-2,469,318.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0284
4.期末基金资产净值	87,323,477.24
5.期末基金份额净值	1.0635

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。

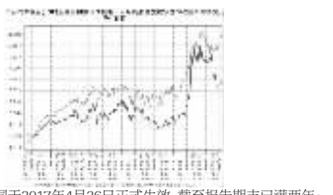
3.2 基金净值表现

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	-2.74%	0.25%	0.38%	0.29%	-3.12%	-0.04%

业绩比较基准:中证综合债指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%

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4月26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		
高勇标	平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)的基金经理	2017年6月27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、平安安享灵活配置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、平安中短债债券型证券投资基金、平安惠鑫纯债债券型证券投资基金、平安合意定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠鑫纯债债券型证券投资基金。
刘俊廷	平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)的基金经理	2017年4月26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)、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安价值优势灵活配置混合型证券投资基金、平安鼎鑫先锋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、《平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)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

由于一季度地方债发行前置和财政支出发力,宏观经济在4月份达到了年内高位。与此同时,通胀水平因为猪肉价格上涨而出现小幅上升。经济和通胀水平上升,导致货币政策在4月份出现边际收紧,推动债券收益率上行。而5月中美贸易战反复性再起,美联储年内降息预期发酵,欧日经济持续疲弱,叠加国内在5月底出现银行破刚兑事件,再一次引发风险偏好回落,货币政策重新边际放松,央行向中小银行和非银机构定向流动性支持,债券收益率也跟随下行。

权益市场方面,二季度市场对经济基本面的悲观预期增强,包商银行被央行接管引发市场关注同业市场的信用风险,中美贸易摩擦再次发酵,美国加大对中国的征税力度,市场开始出现一定幅度的回调.中美两国元首通电话后,市场情绪开始出现一定幅度的改善.在此过程中,本基金采取绝对收益策略,股票仓位保持较低水平,转而重点配置可转债品种.本基金保持了投资组合的流动性,同时在债券和权益两类资产中灵活切换,基金净值表现相对平稳.

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1.0635元;本报告期基金份额净值增长率为-2.74%,业绩比较基准收益率为0.38%。

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	1,968,106.00	2.15
	其中:股票	1,968,106.00	2.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	55,604,361.57	60.68
	其中:债券	55,604,361.57	60.68
	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	33,637,626.97	36.71
8	其他资产	422,100.21	0.46
9	合计	91,632,194.75	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	1,968,106.00	2.25
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	1,968,106.00	2.25

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	54,700	1,968,106.00	2.25

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	35,050,500.00	40.14
	其中:政策性金融债	35,050,500.00	40.14
4	企业债券	6,722,760.00	7.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	13,831,101.57	15.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,604,361.57	63.68

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	190210	19国开10	200,000	20,064,000.00	22.98
2	190203	19国开03	100,000	9,936,000.00	11.38
3	112690	18广发01	66,000	6,722,760.00	7.70
4	108602	国开1704	50,000	5,050,500.00	5.78
5	132013	17宝武EB	25,250	2,523,485.00	2.89

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末无贵金属投资。

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

本基金本报告期末无权证投资。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

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	74,322.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	347,777.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	422,100.21

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	132013	17宝武EB	2,523,485.00	2.89
2	132007	16凤凰EB	1,978,000.00	2.27
3	132011	17浙报EB	1,567,040.00	1.79
4	110040	生益转债	1,330,300.00	1.52
5	127005	长证转债	1,159,800.00	1.33
6	128027	崇达转债	1,154,975.28	1.32
7	132006	16皖新EB	1,151,480.00	1.32
8	128036	金农转债	677,850.00	0.78
9	113517	曙光转债	541,750.00	0.62
10	123002	国祯转债	243,092.50	0.28

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中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	93,831,987.04
报告期期间基金总申购份额	8,925.33
减:报告期期间基金总赎回份额	11,731,426.33
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	82,109,486.04

§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	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	2019/04/01--2019/06/30	34,003,590.00	0.00	0.00	34,003,590.00	41.41%
	2	2019/04/01--2019/06/30	40,004,400.00	0.00	0.00	40,004,400.00	48.72%
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鼎弘混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)基金合同

(3)平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)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)平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)2019年第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

平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	平安合慧定开债
场内简称	-
交易代码	005896
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型定期开放式,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)或自每一开放期结束之日次日起(含)至3个月(含)后对应日的前一日止(若该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一工作日)。本基金自封闭期结束之后第一个工作日起(含)进入开放期,本基金每个开放期最长不超过10个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。
基金合同生效日	2018年6月20日
报告期末基金份额总额	1,010,000,000.00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	本基金通过对宏观经济周期、行业前景预测和发债主体公司研究的综合运用,主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略,在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上,深入挖掘价值被低估的固定收益投资品种,构建及调整固定收益投资组合。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
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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	10,342,390.37
2.本期利润	6,952,827.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0069
4.期末基金资产净值	1,050,770,869.20
5.期末基金份额净值	1.0404

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。

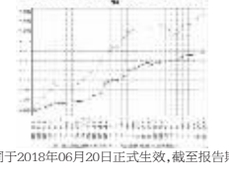
3.2 基金净值表现

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	0.67%	0.02%	0.65%	0.06%	0.02%	-0.04%

业绩比较基准:中债综合指数(总财富)收益率

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06月20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		
段玮婧	平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理	2018年6月20日	-	12	段玮婧女士,中山大学硕士,曾担任中国中投证券有限责任公司投资经理。2016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组投资经理。2017年1月起担任平安交易型货币市场基金、平安金管家货币市场基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合瑞定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合盈定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合意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、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠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、平安合泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安钜值优势灵活配置混合型证券投资基金、平安惠泰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基金经理。
余斌	平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理	2018年7月4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、平安惠信债券型证券投资基金、平安惠裕债券型证券投资基金、平安惠盛纯债债券型证券投资基金、平安合前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、平安合意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、平安惠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、平安合泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安钜值优势灵活配置混合型证券投资基金、平安惠泰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、《平安合慧定期开放纯债债券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

二季度债市整体波动较大,前期受经济数据超预期影响,各类债券收益率大幅度上行,后续经济数据、贸易战加剧影响,收益率有所下行,但各类主要债券整体依然上行为主。整个季度支持债市整体走牛的两大逻辑(基本面趋弱、资金面宽松)仍在,主要是受事件性冲击,导致债市小幅上行,整体维持震荡态势。报告期内本基金以利率债及高等级信用债投资为主,以中短久期、高杠杆操作为主,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1.0404元;本报告期基金份额净值增长率为0.67%,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	3,412,312,600.00	96.67
	其中:债券	3,412,312,600.00	96.67
	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	20,900,130.45	0.59
	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	51,429,533.67	1.46
8	其他资产	45,350,589.57	1.28
9	合计	3,529,992,853.69	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	325,885,000.00	31.01
	其中:政策性金融债	49,915,000.00	4.75
4	企业债券	347,325,290.00	33.05
5	企业短期融资券	120,680,000.00	11.48
6	中期票据	315,328,000.00	30.01
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	96,780,000.00	9.21
9	其他	-	-
10	合计	1,205,998,290.00	114.77

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	1820019	18宁波银行02	1,000,000	102,310,000.00	9.74
2	136544	16联通03	1,000,000	100,000,000.00	9.52
3	111817185	18光大银行CD185	1,000,000	96,780,000.00	9.21
4	1822002	18招银租赁债01	900,000	92,844,000.00	8.84
5	136773	16清控02	900,000	87,840,000.00	8.36

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

银保监会于2018年11月9日做出银保监银罚决字〔2018〕11号处罚决定,由于浙商银行股份有限公司(以下简称“公司”):(一)投资同业理财产品未尽职审查;(二)为客户缴交土地出让金提供理财资金融资;(三)投资非保本理财产品违规接受回购承诺;(四)理财产品销售文本使用误导性语言;(五)个人理财资金违规投资;(六)理财产品相互交易,业务风险隔离不到位;(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5550万元。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。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,164,269.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,164,269.91

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	1,010,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	1,010,000,000.00

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.99

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无

§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	10,000,000.00	0.99	10,000,000.00	0.99	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	10,000,000.00	0.99	10,000,000.00	0.99	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2019/04/01--2019/06/30	1,000,000,000.00	-	-	1,000,000,000.00	99.01%
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。						

§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合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金设立的文件

(2)平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同

(3)平安合慧定期开放纯债债券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) 平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金2019年第2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7月16日

平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金

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:杭州银行股份有限公司
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。

基金托管人杭州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