

平安合泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

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,但各类主要债券依然上行为主,整个季度支持债市整体走牛的两端逻辑(基本面趋弱、资金宽松)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,报告期内本基金还处于建仓期,主要以中短期利率债操作为主,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1.0069元;本报告期基金份额净值增长率为0.72%,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

本基金本报告期末未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满20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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	3,543,497,055.30	99.28
3	基金投资	3,543,497,055.30	99.28
4	衍生金融资产	-	-
5	其他资产	-	-
6	资产减值准备	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	政府债券	-	-
5	企业债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,201,022.86	0.03
8	其他资产	4,275,352.61	0.09
合计			

本基金不支付任何申购费。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	31,399.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	其他资产	-