

平安合泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年半年度报告摘要

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
送出日期:2019年8月23日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事、监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，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签发。
基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同约定，于2019年8月22日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务报表报告、投资组合报告等內容，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运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金经理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基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告告期除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自2019年3月19日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	平安合泰定期
基金代码	-
基金管理人	000600
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金运作方式	-
基金合同生效日	2010年3月19日
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
报告期末基金总资产	10,039,940,126.00
基金合同的存续期	不定期
基金资产净值的上市交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将综合考虑宏观经济环境、基本经济条件以及长期、中期、短期资金需求，并力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将综合运用多种投资策略，包括但不限于：资产配置策略、久期策略、期限选择策略、利率预期策略、信用策略、行业配置策略、个券选择策略、回购策略、新股申购策略、资产支持证券策略、权证策略、国债期货策略等，构建合理的资产配置，从而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。
业绩比较基准	中国债券综合指数(国债+政策性金融债+企业债)×60%+银行存款利率(税后)+股票指数(中证综合指数)×40%
风险收益特征	本基金为债券型基金，风险收益特征属中低风险型基金。
报告截止日	2019年6月30日

6.1 年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:平安合泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

项目	基金持有人	基托持有人
名称	平安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
姓名	施伟正	王长波
信息披露负责人	0706-26206262	010-66904806
电子邮箱	fundcenter@pingan.com	lch@cboc.com.cn
客户服务电话	400-800-4000	95566
传真	0706-26209767	010-66904942

2.4 信息披露方式

基金管理人通过正文中列明的管理人互联网网址: http://www.fund.pingan.com

基金管理人半年度报告备置地点:基金管理人住所

§ 3 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1 期间数据和指标	报告期2019年3月19日至2019年6月30日	本报告期实现收益	4,044,795.20
加权平均基金份额本期利润		0.0003	
本期基金份额净值增长率为		0.89%	
3.2 期末数据报告期	报告期(2019年6月30日)		
期末可供分配基金份额利润		0.0069	
期末基金份额净值		10,039,940.00	
期末基金份额总额		10,069	

注:1.本基金基金合同于2019年3月19日正式生效，截至报告期末未满半年；

2.本期实现收益扣除非利息收入、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.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，而非当期发生数)；

4.本基金绩效报酬不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计人费用后实际收益水平将低于所有者数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长 率	业绩比较基准 收益率	份额净值增 长率相对基 准收益率的 比率
过去一个月	0.40%	0.03%	0.37%
过去二个月	0.72%	0.06%	0.66%
自基金合同生 效至今	0.89%	0.06%	0.86%

注:1.本期财务报表的实际编制期间为2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间；

2.报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0085元，累计份额净值1.0089元，基金份额总额10,029,940.129。

6.2 利润表

会计主体:平安合泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告期:2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期	本报告期	上年度
一、营业收入	2019年3月19日至基金合同生效日止至2019年6月30日	4,047,795.20		
减：营业成本				
减：营业税金及附加				
减：销售费用				
减：管理费用				
减：财务费用				
减：资产减值损失				
加：公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		117,901.74		
加：投资收益(损失以“-”号填列)		6,473.71		
加：汇兑收益(损失以“-”号填列)		0.00		
加：其他收入		0.00		
减：营业外收入		0.00		
减：营业外支出		0.00		
二、营业利润		4,163,269.61		
加：营业外收入		0.00		
减：营业外支出		0.00		
三、利润总额		4,163,269.61		
减：所得税费用		1,040,824.53		
四、净利润		3,122,445.08		

注:1.本期财务报表的实际编制期间为2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间；

2.报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0085元，累计份额净值1.0089元，基金份额总额10,029,940.129。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:平安合泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告期:2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期	本报告期	上年度
一、实收基金	2019年3月19日至基金合同生效日止至2019年6月30日	600,999,000.00		600,999,000.00
减：赎回基金				
减：转换基金				
减：分红				
减：其他				
二、本期期初基金余额		600,999,000.00		600,999,000.00
加：本期利润		4,163,269.61		4,163,269.61
减：本期已分配收益		-1,040,824.53		-1,040,824.53
三、期末基金余额		600,111,445.08		600,111,445.08

注:1.本期财务报表的实际编制期间为2019年3月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间；

2.报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0085元，累计份额净值1.0089元，基金份额总额10,029,940.129。

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中国证监会准予平安基金管理有限公司(以下简称“平安基金”)经中国证监会证监许可[2010]1917号文批准设立，平安基金总股本为人民币13亿元。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股份68.19%;平安资产管理有限公司，持有股份15.71%;亚盈湾物业管理有限公司，持有股份14.3%。

平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”的企业经营理念，致力于通过持续稳定的投拓业绩，不断丰富的客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至2019年6月30日，平安基金管理8只公募基金，公募基金管理规模2877亿元人民币。

6.4.2 基金经理

基金经理对报告期内公司整体经营情况的说明

本报告期内，平安基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露办法》等法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的运营情况符合有关法律法规及基金合同的规定。

6.4.3 管理人对报告期内公司整体经营情况的说明

6.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，平安基金管理人严格按照《公平交易制度》的规定，执行了同日反向交易、定期反向交易、日内反向交易、跨市场反向交易等公平交易制度，未发现不公平交易行为。

6.4.2 对外报价偏离度的分析

本报告期内，平安基金管理人未发现基金对外报价偏离度异常。

6.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期不存在异常交易行为。

报告期内，所有涉及组合参与的交易场所公开竞价均同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该组合当日成交量的5%。

6.4.4