

平安惠诚纯债债券型证券投资基金

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：浙商银行股份有限公司
送出日期：2019年8月23日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。

本半年度报告已由三分之二以上独立董事签章，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定的程序，于2019年8月22日核对了本基金报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等，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及其更新。

本半年度报告摘要能简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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位为人民币元。

本报告期末2019年1月31日起至6月30日止。

1.2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 平安惠诚纯债

场内简称 -

基金主代码 0006316

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 2019年1月31日

基金管理人 平安基金管理有限公司

基金托管人 浙商银行股份有限公司

报告期内基金总资产 100,016,330.26

基金份额净值 不定期

基金份额上市交易场所 -

上市日期 -

2.2 基金产品说明

投资目标 在谨慎控制组合净值波动率的前提下，本基金追求基金资产的长期增值，持续稳健，并力争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、行业前景预判和负债主体公司经营的综合运用，主要采取利率策略、信用策略、息差策略积极调整资产，在严格控制组合波动率的前提下，择机买入并持有期限较长的较好评级债券，同时适当提升组合的风险偏好，使本基金呈现出区间震荡的格局。二季度货币政策一波三折，后半阶段推升收益率中枢，托管行银行间流动性分层和信任危机，央行再度降息并放缓逆回购操作，债市在二季度初大幅调整之后收益率逐步下行。报告期内本基金操作相对灵活，主要配置高等级同业存单和商业银行债，同时参与了利率债的波段操作，基金净值稳定。

4.2.2 报告期内基金业的主要表现

截至2019年6月30日，本基金份额净值为1.0006元，份额累计净值为1.0006元。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望下半年国内经济依然较弱，在全球经济政策将进入宽松格局的背景下，国内货币政策将继续保持对宽松的态势，资金面将维持在合理充裕的水平，通胀也在可接受的范围内，甚至三季度会呈现逐步走低的趋势。综合来看，下半年债市整体相对利好，不过由于债市收益率整体处在历史较低水平，未来债市可能呈现区间震荡的格局。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照会计会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定的基金合同约定的估值原则和方法进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部、运营部及法律合规监察部等相关人员组成。估值工作组由公司分管估值政策、制度及方案的制定和修订、负责定期审阅公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值工作组的相关人员均具有一定的丰富的专业从业经验，具有良好的专业能力，并在相关工作中保持独立性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司按约定期限向中国证券登记结算有限责任公司支付提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司约定提供交易所交易的券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利差定价情况的说明

本基金报告期内未进行利差定价。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内未出现连续二十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0.0001万元的情形。

5.5 托管人报告

6.4.3 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日以及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》，各项具体会计准则及相关规定（以下称“企业会计准则”），中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算办法》XBRML模板第3号《年度报告与半年度报告》，中国证券投资基金业协会以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算办法指引》、《平安惠诚纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报告附注4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许基金使用的其他工具（须符合中国证监会的规定）。本基金不采用资产负债表日公允价值计量的资产或负债（可供出售金融资产除外），可赎回债券、基金的组合投资比例合计不低于基金资产净值的90%；本基金持有的现金或现金等价物、银行存款和应收款项合计不低于基金资产净值的5%。现金不包括准备付息的应付债券、存入保证金、应收款项等。本基金的组合比例较为基准；以中债综合指数（财富）收益率+90%*1年定期存款利率（税后）×10%

6.4.4 会计报表的编制原则

本基金会计报表的编制遵循《企业会计准则—基本原则》，各项具体会计准则及相关规定（以下称“企业会计准则”），中国证监会颁布的《证券投资基金会计核算办法指引》、《平安惠诚纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报告附注4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许基金使用的其他工具（须符合中国证监会的规定）。本基金不采用资产负债表日公允价值计量的资产或负债（可供出售金融资产除外），可赎回债券、基金的组合投资比例合计不低于基金资产净值的90%；本基金持有的现金或现金等价物、银行存款和应收款项合计不低于基金资产净值的5%。现金不包括准备付息的应付债券、存入保证金、应收款项等。本基金的组合比例较为基准；以中债综合指数（财富）收益率+90%*1年定期存款利率（税后）×10%

6.4.5 会计报表的编制依据

6.4.6 会计期间

6.4.7 会计政策和会计估计

6.4.8 会计估计

6.4.9 会计政策和会计估计的变更

6.4.10 会计差错和会计舞弊的处理

6.4.11 会计报表的批准报出

6.4.12 会计报表的批准报出

6.4.13 会计报表的批准报出

6.4.14 会计报表的批准报出

6.4.15 会计报表的批准报出

6.4.16 会计报表的批准报出

6.4.17 会计报表的批准报出

6.4.18 会计报表的批准报出

6.4.19 会计报表的批准报出

6.4.20 会计报表的批准报出

6.4.21 会计报表的批准报出

6.4.22 会计报表的批准报出

6.4.23 会计报表的批准报出

6.4.24 会计报表的批准报出

6.4.25 会计报表的批准报出

6.4.26 会计报表的批准报出

6.4.27 会计报表的批准报出

6.4.28 会计报表的批准报出

6.4.29 会计报表的批准报出

6.4.30 会计报表的批准报出

6.4.31 会计报表的批准报出

6.4.32 会计报表的批准报出

6.4.33 会计报表的批准报出

6.4.34 会计报表的批准报出

6.4.35 会计报表的批准报出

6.4.36 会计报表的批准报出

6.4.37 会计报表的批准报出

6.4.38 会计报表的批准报出

6.4.39 会计报表的批准报出

6.4.40 会计报表的批准报出

6.4.41 会计报表的批准报出

6.4.42 会计报表的批准报出

6.4.43 会计报表的批准报出

6.4.44 会计报表的批准报出

6.4.45 会计报表的批准报出

6.4.46 会计报表的批准报出

6.4.47 会计报表的批准报出

6.4.48 会计报表的批准报出

6.4.49 会计报表的批准报出

6.4.50 会计报表的批准报出

6.4.51 会计报表的批准报出

6.4.52 会计报表的批准报出

6.4.53 会计报表的批准报出

6.4.54 会计报表的批准报出

6.4.55 会计报表的批准报出

6.4.56 会计报表的批准报出

6.4.57 会计报表的批准报出

6.4.58 会计报表的批准报出

6.4.59 会计报表的批准报出

6.4.60 会计报表的批准报出

6.4.61 会计报表的批准报出

6.4.62 会计报表的批准报出

6.4.63 会计报表的批准报出

6.4.64 会计报表的批准报出

6.4.65 会计报表的批准报出

6.4.66 会计报表的批准报出

6.4.67 会计报表的批准报出

6.4.68 会计报表的批准报出

6.4.69 会计报表的批准报出

6.4.70 会计报表的批准报出

6.4.71 会计报表的批准报出

6.4.72 会计报表的批准报出

6.4.73 会计报表的批准报出

6.4.74 会计报表的批准报出

6.4.75 会计报表的批准报出

6.4.76 会计报表的批准报出

6.4.77 会计报表的批准报出

6.4.78 会计报表的批准报出

6.4.79 会计报表的批准报出

6.4.80 会计报表的批准报出

6.4.81 会计报表的批准报出

6.4.82 会计报表的批准报出

6.4.83 会计报表的批准报出

6.4.84 会计报表的批准报出

6.4.85 会计报表的批准报出

6.4.86 会计报表的批准报出

6.4.87 会计报表的批准报出

6.4.88 会计报表的批准报出

6.4.89 会计报表的批准报出

6.4.90 会计报表的批准报出

6.4.91 会计报表的批准报出

6.4.92 会计报表的批准报出

6.4.93 会计报表的批准报出

6.4.94 会计报表的批准报出

6.4.95 会计报表的批准报出

6.4.96 会计报表的批准报出

6.4.97 会计报表的批准报出

6.4.98 会计报表的批准报出

6.4.99 会计报表的批准报出