(上接B078版)

联系电话:4000-555-671
客服电话:4000-555-671
网址:http://www.hgccpb.com/
(6)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:黄祎
联系人:徐亚丹
联系电话:021-51327185
客服电话:400-799-1888
网址:www.520fund.com.cn
(7)喜鹊财富基金销售有限公司
注册地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
法定代表人:王舰正
联系人:曹砚财、张萌
联系电话:010-58349088
客服电话:4006997719
网址:www.xiquefund.com
(8)宜信普泽(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区西大望路1号2号楼9层1008
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号2号楼9层1008
法定代表人:戎兵
联系人:魏晨
联系电话:010-52413385
客服电话:400-6099-200
网址:http://www.yixinfund.com/
(9)大连网金基金销售有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
法定代表人:樊怀东
联系人:王清臣
传真:0411-39027835
客服电话:4000-899-100
网址:http://www.fundzone.cn
(10)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室
办公地址:北京市朝阳区融新科技中心C座17层
法定代表人:钟斐斐
联系人:赵旸
联系电话:010-61840600
客服电话:400-159-9288
网址:http://www.danjuanapp.com/
(11)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1号
法定代表人:王锋
联系人:王锋
联系电话:025-66996699
客服电话:95177
网址:http://www.snjijin.com/
(12)上海基煜基金销售有限公司
注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址: 上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
联系人: 蓝杰
电话: 021-65370077
传真: 021-55085991
客户服务电话: 021-65370077
网址: www.jiyufund.com.cn
(13)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
联系电话:010-56282140
客服电话:400-619-905
网址:http://www.fundzone.cn
(14)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路1号903室
办公地址:浙江省杭州市余杭区同顺街18号同花顺大楼
法定代表人:吴强
联系人:董一锋
联系电话:0571-88911818
客服电话:952555
网址:http://www.5ifund.com/
(15)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人:其实
联系人:高莉莉
电话:021-54509998
传真:021-64385308
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
(16)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼401室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号903室
法定代表人:杨文斌
联系人:徐超逸
联系电话:021-36696312
客服电话:400-700-9665
网址:http://www.ehowbuy.com/
(17)上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号陆家嘴金融服务广场二期11层
法定代表人:张跃伟
联系人:党敏
联系电话:021-20691935
客服电话:400-820-2899
网址:http://www.erichfund.com/
(18)北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路17号10层1015室
办公地址:北京市朝阳区工体北路甲2号盈科中心东门2层216室
法定代表人:何静
联系人:王重阳
联系电话:400-618-0707
客服电话:400-618-0707
网址:http://www.hongdianfund.com/
(19)珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-349
办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室
法定代表人:肖雯
联系人:邱湘湘
联系电话:020-89629099
客服电话:020-89629066
网址:http://www.yingmi.cn/
(20)中国平安人寿保险股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 14、15、16、41、44、45、46 层
办公地址: 深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 14、15、16、41、44、45、46 层
法定代表人:丁新民
联系人:葛童
联系电话:021-38646046
客服电话:95511 转 1
传真:021-50475630
网址:http://life.pingan.com
(21)华瑞保险销售有限公司
注册地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
办公地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
法定代表人:路昊
联系人:茆勇强
电话:021-61058785
传真:021-61098515
客服电话:400-111-5818
网址:www.huaruisales.com
(22)北京度小满基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区上地十街10号1幢1层101
办公地址:北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦
法定代表人:葛新
联系人:孙博超
联系电话:010-61952703
客服电话:95055-4
网址:www.baiyingfund.com
(23)深圳市金海九州基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区海德三道168号航天科技广场A座32楼
法定代表人:彭维熙
联系人:彭维熙
联系电话:0755-81994266
客服电话:4000993333
网址:www.jhjzfund.com
(24)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦
法定代表人:陈继武
联系人:高浩辉
联系电话:021-63333389
客服电话:400 643 3389
网址:https://www.vstonewealth.com/
(25)平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路5023号
办公地址:广东省深圳市福田区益田路5023号
法定代表人:谢永林
联系人:赵杨
联系电话:0755-22166574
客服电话:95511-3
传真:021-50979507
网址:http://bank.pingan.com
(26)平安证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层
办公地址: 深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层
法定代表人:何之江
客服电话:95511-8
传真:0755-82400862
网址:www.stock.pingan.com
(27)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈共炎
联系人:辛国政
客服电话:400-8888-888/95551
传真:010-83574807
网址:www.chinastock.com.cn
(28)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
成立时间:1987年4月8日
联系人:邓炯鹏
联系电话: 0755-83077278
客服电话:95555
网址:www.cmbchina.com
二、注册登记机构
平安基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层
法定代表人:罗春风
电话:0755-22624581
传真:0755-23990088
联系人:张平
三、出具法律意见书的律师事务所
律师事务所:广东仁人律师事务所
地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座23楼
负责人:杨少南
电话:0755- 82960158
传真:0755-82960236
经办律师:段善武、陈福平
联系人:段善武
四、审计基金财产的会计师事务所
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
联系电话:(021)2323 8888
传真电话:(021)2323 8800
经办注册会计师:郭素宏、邓昭君
联系人:邓昭君

## 第四部分 基金的名称

平安惠盈纯债债券型证券投资基金

## 第五部分 基金的类型

债券型证券投资基金

## 第六部分 基金的运作方式

契约型开放式

## 第七部分 基金的投资

一、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。

二、投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、国债期货、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产。但可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证,因上述原因持有的股票和权证等资产,应在其可交易之日起10个交易日内卖出。

基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金参与国债期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

三、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。

1、资产配置策略

本基金在资产配置层面主要通过对宏观经济变量 (包括GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)、债券市场整体收益率曲线变化、申购赎回现金流情况等因素的综合分析和判断。在此基础上,确定资产在非信用类固定收益类证券(现金、国家债券、中央银行票据等)和信用类固定收益类证券之间的配置比例,整体组合的久期范围以及杠杆率水平。

同时,本基金将根据市场收益率曲线的定位情况和个券的市场收益率情况,综合判断个券的投资价值,选择风险收益特征最匹配的品种,构建具体的个券组合,以期增强基金资产的获利能力。

2、债券投资策略

(1)组合久期配置策略

通过预测收益率曲线的形状和变化趋势,对各类型债券进行久期配置;当收益率曲线走势难以判断时,参考基准指数的样本券久期构建组合久期,确保组合收益超过基准收益。根据操作,具体包括跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

在目标久期的执行过程中,将特别注意对信用风险、流动性风险及类属资产配置的管理,以使得组合的各种风险在控制范围之内。

(2)类属资产配置策略

根据不同债券资产类品种收益与风险的估计和判断,通过分析各类属资产的相对收益和风险因素,确定不同债券种类的配置比例。主要决策依据包括未来的宏观经济和利率环境研究和预测, 利差变动情况、市场容量、信用等级情况和流动性情况等。通过情景分析的方法,判断各个债券类属的预期持有期回报,在不同债券品种之间进行配置。

在类属资产配置层面上, 本基金根据市场和类属资产的信用水平,在判断各类属的利率期限结构与国债利率期限结构应具有的合理利差水平基础上,将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等子市场。结合各类属资产的市场容量、信用等级和流动性特点,在目标久期管理的基础上,运用修正的均值-方差等模型,定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。

同时,本基金针对债券市场所涉及行业在同样宏观周期背景下不同行业的景气度的情况,通过分散化投资和行业预判进行,具体表现为:1)分散化投资:发行人涉及众多行业,本组合将保持在各行业配置比例上的分散化结构, 避免过度集中配置在产业链高度相关的上中下游行业。2)行业投资:本组合将依据对下一阶段各行业景气度特征的研判,确定在下一阶段在各行业的配置比例,卖出景气度降低行业的债券,提前布局景气度提升行业的债券。

(3)息差策略

本基金将通过正回购,融资买入收益率高于回购成本的债券,适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报,选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种,灵活控制杠杆组合仓位,降低组合波动率。

(4)个券选择策略

在个券选择过程中,本基金将根据市场收益率曲线的定位情况和个券的市场收益率情况,综合判断个券的投资价值,选择风险收益特征最匹配的品种,构建具体的个券组合。

1)信用债投资策略

在信用债的选择方面,本基金将通过对行业经济周期、发行主体内外部评级和市场利差分析等判断,并结合税收差异和信用风险溢价综合判断个券的投资价值,加强对企业债、公司债等品种的投资,通过对信用利差的分析和管理,获取超额收益。

本基金还将利用目前的交易所和银行间两个投资市场的利差不同,密切关注两市场之间的利差波动情况,积极寻找跨市场中现券和回购操作的套利机会。

2)资产支持证券投资策略

深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用蒙特卡罗方法等数量化定价模型,评估其内在价值,并结合资产支持证券类资产的市场特点,进行此类品种的投资。

3)中小企业私募债券投资策略

针对中小企业私募债券,本基金以持有到期,获得本金和票息收入为主要投资策略,同时,密切关注债券的信用风险变化,力争在控制风险的前提下,获得较高收益。本基金投资中小企业私募债,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

4)可转债投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金主要从公司基本面分析、理论定价分析、债券发行条款、投资导向的变化等方面综合评估可转债投资价值,选取具有较高价值的可转债进行投资。本基金将着重对可转债对应的基础股票进行分析与研究,对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行重点选择。

本基金还将积极关注可转换债券在一、二级市场上可能存在的价差所带来的投资机会,在严格控制风险的前提下,参与可转换债券的一级市场申购,获得稳定收益。

3、现金头寸管理

由于法律法规限制和开放式基金正常运作的需要,基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其主要用途包括:支付潜在赎回金额、计提管理费和托管费等各类费用的需求、支付交易费用、应对上市公司配股和增发等行为。为有效控制现金留存的影响,基金管理人将采用积极的现金头寸管理手段。具体采用手段包括:

(1)合理控制现金头寸:根据对申购、赎回、转换等业务和相关费用提留的预判, 结合标的指数走势和成份股流动性进行合理的现金留存,最大限度降低现金的持有比例;

(2)提升现金头寸收益:在法律法规或市场条件允许的前提下,通过现金权益化的方式降低现金拖累的影响。

4、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合的整体风险的目的。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;

(2) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;

(6)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(7)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(8)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(10)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(11)本基金投资于中小企业私募债券比例合计不高于基金资产的10%;

(12)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

(13)本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;

本基金管理人将按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;

(14)本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(15)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(16)基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(17)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(18)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(19)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(10)、(17)、(18)项外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行,但须提前公告,不需要经基金份额持有人大会审议。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(6)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议, 并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%

本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金是通过债券等固定收益资产来获取的收益,力争获取相对稳健的绝对回报,追求委托财产的保值增值。

若未来法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

六、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。

七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持有人的利益;

2、有利于基金财产的安全与增值;

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

八、投资组合报告

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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,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。

本投资组合报告所载数据截至2020年3月31日, 本财务数据未经审计。

1.1 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 | 2,222,046,200.00 | 95.93 |
| | 其中:债券 | 2,222,046,200.00 | 95.93 |
| | 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 | 24,534,132.27 | 1.06 |
| | 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 | 49,611,774.66 | 2.14 |
| 8 | 其他资产 | 20,084,008.40 | 0.87 |
| 9 | 合计 | 2,316,276,115.33 | 100.00 |

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票。

1.3 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

1.4 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 | 222,167,200.00 | 13.09 |
| | 其中:政策性金融债 | 151,402,200.00 | 8.92 |
| 4 | 企业债券 | 589,011,000.00 | 34.69 |
| 5 | 企业短期融资券 | 180,556,000.00 | 10.63 |
| 6 | 中期票据 | 1,230,312,000.00 | 72.46 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,222,046,200.00 | 130.88 |

1.5 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 | 011902409 | 19陕投集团SCP007 | 1,000,000 | 100,380,000.00 | 5.91 |
| 2 | 102000344 | 20中国旅游MTN001 | 1,000,000 | 99,700,000.00 | 5.87 |
| 3 | 012000605 | 20深圳投控SCP001 | 800,000 | 80,176,000.00 | 4.72 |
| 4 | 163257 | 20陕投G1 | 800,000 | 80,016,000.00 | 4.71 |
| 5 | 190211 | 19国开11 | 650,000 | 65,344,500.00 | 3.85 |

1.6 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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.7 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.8 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

注:本基金本报告期末无权证投资。

1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.9.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配进行灵活操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险指标说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | - |
| 国债期货投资本期收益(元) | | | | | -178,700.00 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | - |

1.9.3 本期国债期货投资评价

本基金参与国债期货的投资交易,符合法律法规规定和基金合同的投资限制,并遵守相关的业务规则,且对基金的总体风险相对可控。

1.10 投资组合报告附注

1.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

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。

1.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

1.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 43,516.96 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 19,975.397.67 |
| 5 | 应收申购款 | 65,093.77 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 20,084,008.40 |

1.10.4 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。

1.10.5 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;。

1.10.6 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。

## 第八部分 基金的业绩

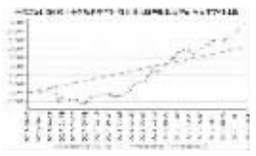
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、自基金合同生效以来(2016年6月3日)至2020年3月31日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① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2016.6.3-2016.12.31 | -1.60% | 0.11% | 1.59% | 0.01% | -3.19% | 0.10% |
| 2017.1.1-2017.12.31 | 0.71% | 0.07% | 2.69% | 0.01% | -1.98% | 0.06% |
| 2018.1.1-2018.12.31 | 9.09% | 0.09% | 2.62% | 0.01% | 6.47% | 0.08% |
| 2019.1.1-2019.12.31 | 4.81% | 0.06% | 2.56% | 0.01% | 2.25% | 0.05% |
| 2020.1.1-2020.3.31 | 2.21% | 0.09% | 0.62% | 0.01% | 1.59% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 15.81% | 0.08% | 10.49% | 0.01% | 5.32% | 0.07% |

本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%

二、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



注:

1、本基金基金合同于2016年6月3日正式生效;

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。

## 第九部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、C类份额的销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券、期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的账户开户费用、账户维护费用;
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.30%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.08%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延。

3、C类份额的销售服务费:

本基金A类份额不收取销售服务费,C类份额的销售服务费按前一日C类份额基金资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.35%÷当年天数

H 为C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为C类份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第4-10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

4、证券账户开户费用:证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后, 自产品成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付,如基金财产余额不足支付该开户费用,由基金管理人于产品成立一个月后的5个工作日内进行垫付,基金托管人不承担垫付开户费用义务。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十部分 其他应披露事项

本基金2019年6月3日至2020年6月2日发布的公告:

| | |
|---|---|
| 2019年6月12日 | 关于平安惠盈纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、定投及转换转入业务的公告 |
| 2019年6月12日 | 平安惠盈纯债债券型证券投资基金分红公告 |
| 2019年6月18日 | 平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告 |
| 2019年6月28日 | 关于平安惠盈纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、定投及转换转入业务的公告 |
| 2019年6月30日 | 平安基金管理有限公司2019年6月30日基金净值披露公告 |
| 2019年7月9日 | 关于子公司深圳平安大华汇通财富管理有限公司名称变更的公告 |
| 2019年7月10日 | 平安惠盈纯债债券型证券投资基金招募说明书更新(2019年第1期)以及摘要 |
| 2019年7月15日 | 平安惠盈纯债债券型证券投资基金2019年第2季度报告 |
| 2019年8月30日 | 平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告 |
| 2019年8月22日 | 平安惠盈纯债债券型证券投资基金2019年半年度报告(摘要) |
| 2019年8月22日 | 平安惠盈纯债债券型证券投资基金2019年半年度报告 |
| 2019年10月24日 | 平安惠盈纯债债券型证券投资基金2019年第3季度报告 |
| 2019年12月10日 | 关于新增上海天天基金销售有限公司为平安惠盈纯债债券型证券投资基金销售机构并参与其费率优惠的公告 |
| 2019年12月24日 | 关于旗下11只基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订相关法律文件的公告 |
| 2019年12月24日 | 平安惠盈纯债债券型基金托管协议 |
| 2019年12月24日 | 平安惠盈纯债债券型证券投资基金基金合同 |
| 2019年12月24日 | 平安惠盈纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新) |
| 2019年12月24日 | 平安惠盈纯债债券型证券投资基金招募说明书更新(摘要) |
| 2020年1月17日 | 平安惠盈纯债债券型证券投资基金2019年第4季度报告 |
| 2020年2月28日 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构的公告 |
| 2020年2月29日 | 平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告 |
| 2020年3月3日 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增京东金融-北京肖特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告 |
| 2020年3月3日 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增弘业期货股份有限公司为销售机构的公告 |
| 2020年3月3日 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为销售机构的公告 |
| 2020年3月3日 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增鹏欣(杭州)基金销售有限公司为销售机构的公告 |
| 2020年3月3日 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告 |
| 2020年3月23日 | 平安基金管理有限公司关于新增平安惠盈纯债债券型证券投资基金销售机构的公告 |
| 2020年3月25日 | 关于新增中国平安人寿保险股份有限公司为平安惠盈纯债债券型证券投资基金销售机构并参加其费率优惠的公告 |
| 2020年3月27日 | 平安基金管理有限公司关于延期披露旗下基金2019年年度报告的公告 |
| 2020年4月7日 | 关于平安