平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

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4月19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4月18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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安合锦定开债
场内简称	-
交易代码	006412
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型、定期开放方式运作。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(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,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9月21日
报告期末基金份额总额	2,509,998,000.00份
投资目标	本基金在严格控制风险及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。本基金将灵活运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	中证全债指数收益率
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	杭州银行股份有限公司

§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1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	33,720,749.83
2.本期利润	44,949,477.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0179
4.期末基金资产净值	2,565,259,903.66
5.期末基金份额净值	1.0220

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。

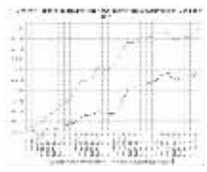
3.2 基金净值表现

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	1.78%	0.06%	1.42%	0.06%	0.36%	0.00%

业绩比较基准:中证全债指数收益率

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09月21日正式生效,截至报告期末未满一年;

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		
高勇标	平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理	2018年9月21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,现任平安鑫弘混合型证券投资基金(LOF)、平安康悦纯债债券型证券投资基金、平安安盈保本混合型证券投资基金、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、平安惠鸿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经理。
WANG AO	平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理	2018年10月17日	-	6	WANG AO先生,澳大利亚籍,CAIA,FRM,CFA,澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士,曾任职于深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012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研究员。现任平安鑫信债券型证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安惠新债券型证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安鑫越灵活配置混合型证券投资基金、平安惠益混合型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安惠瑞纯债债券型证券投资基金、平安惠诚纯债债券型证券投资基金、平安0-3年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安季添盈三个月定期开放债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金经理。

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、《平安合锦定期开放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

2019年上半年,经济基本面仍有持续的下行压力,财政政策较为积极,权益市场风险偏好抬升,而债市走出震荡的行情。报告期内,本基金的投资操作较为灵活,保持了较高的杠杆水平,根据市场情绪灵活调整久期,获得部分资本利得收益,基金净值有较好的涨幅。

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1.0220元;本报告期基金份额净值增长率为1.78%,业绩比较基准收益率为1.42%。

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5000万元的情形。

§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	3,065,326,400.00	93.06
	其中:债券	3,065,326,400.00	93.06
	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	27,237,514.05	0.83
8	其他资产	201,194,546.51	6.11
9	合计	3,293,758,460.56	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投票。

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	215,457,500.00	8.40
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,158,696,400.00	45.17
5	企业短期融资券	516,884,500.00	20.15
6	中期票据	1,174,288,000.00	45.78
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,065,326,400.00	119.49

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	112781	18华铜01	2,000,000	199,440,000.00	7.77
2	101801529	18中银投资MTN001	1,500,000	151,875,000.00	5.92
3	143889	18华证01	1,500,000	151,815,000.00	5.92
4	156221	19民装02	1,500,000	150,600,000.00	5.87
5	112857	19广发03	1,500,000	150,270,000.00	5.86

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

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。

5.10.2

本基金本报告期未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	495,268.16
2	应收证券清算款	169,649,281.25
3	应收股利	-
4	应收利息	31,049,997.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	201,194,546.51

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	2,509,998,000.00
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	2,509,998,000.00

§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	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
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(%)	0.40

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	0.40	10,000,000.00	0.40	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	0.40	10,000,000.00	0.40	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	2019/01/01---2019/03/31	2,499,998,000.00	-	-	2,499,998,000.00	99.60%
产品持有风险							
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额确认时,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期间内基金资产受损冲击或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5000万元,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大华合锦定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件

(2)平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同

(3)平安合锦定期开放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)平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金2019年第1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4月19日

平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

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4月19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4月18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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安沪深300ETF
场内简称	平安300
交易代码	510390
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年12月25日
报告期末基金份额总额	1,323,649,992.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些持续情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,同时本基金为交易型开放式指数基金,采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。
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1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-64,123,148.97
2.本期利润	1,216,743,470.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.8767
4.期末基金资产净值	5,206,629,674.96
5.期末基金份额净值	3.9335

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。

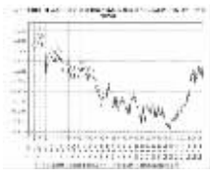
3.2 基金净值表现

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	28.38%	1.56%	28.62%	1.55%	-0.24%	0.00%

业绩比较基准:沪深300指数收益率

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2017年12月25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		
成钧	平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理、ETF指数中心指数投资总监	2017年12月25日	-	8	成钧先生,上海交通大学博士,南京大学和上海证券交易所博士后,曾任职于上海证券交易所,国泰基金管理有限公司,嘉实基金管理有限公司。中国平安人寿保险股份有限公司2017年2月加入平安基金管理有限公司,现任平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金、平安中证500交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安MSCI中国A股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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、《平安沪深300交易型开放式指数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

(1)投资策略

作为一只投资于沪深300指数的被动型产品,基金在投资管理上,继续采取完全复制的管理办法跟踪指数,利用量化科技系统进行精细化组合管理,高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用,勤勉尽责,严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。

(2)运作分析

报告期内,本基金的日均偏离度为0.01%,年化跟踪误差0.09%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过2%的投资目标。

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3.9335元;本报告期基金份额净值增长率为28.38%,业绩比较基准收益率为28.62%。

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5000万元的情形。

§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	5,201,278,010.85	99.42
	其中:股票	5,201,278,010.85	99.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	28,141,852.52	0.54
8	其他资产	2,281,894.50	0.04
9	合计	5,231,701,757.87	100.00

投资组合报表中股票投资市值与按行业分类股票投资组合报表中股票总市值之间的差异是由于可退替代款估值增值引起的。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	16,954,547.60	0.33
B	采矿业	168,337,298.05	3.23
C	制造业	2,103,552,329.19	40.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	129,193,260.58	2.48
E	建筑业	177,061,063.08	3.40
F	批发和零售业	82,889,576.92	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	160,486,694.81	3.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	204,931,161.45	3.94
J	金融业	1,789,202,432.46	34.19
K	房地产业	255,540,340.93	4.91
L	租赁和商务服务业	60,371,187.44	1.16
M	科学研究和技术服务业	4,128,080.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	12,373,048.60	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,930,253.42	0.56
R	文化、体育和娱乐业	16,316,736.32	0.31
S	综合	-	-
	合计	5,201,278,010.85	99.90

5.2.2 报告期末积极投资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积极投资股票。

5.2.3 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投票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	4,664,568	359,638,192.80	6.91
2	600519	贵州茅台	216,202	184,634,345.98	3.56
3	600036	招商银行	4,442,235	150,680,611.20	2.89
4	000651	格力电器	2,073,516	97,890,690.36	1.88
5	601166	兴业银行	5,371,879	97,607,041.43	1.87
6	000333	美的集团	1,997,898	97,357,569.54	1.87
7	600030	中信证券	3,386,400	83,914,992.00	1.61
8	000858	五粮液	836,100	79,429,500.00	1.53
9	600887	伊利股份	2,618,982	76,238,566.02	1.46
10	600276	恒瑞医药	1,141,258	74,661,098.36	1.43

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1906	IF1906	3	3,483,720.00	125,820.00	-
公允价值变动总额合计(元)					125,820.00
股指期货投资本期收益(元)					988,932.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					436,968.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金,主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金以套期保值为目的开展股指期货投资,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货,旨在配合基金日常投资管理需要,更有效地进行流动性管理,实现跟踪标的指数的投资目标。

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

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

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情况。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本组合投资的前十名证券之一招商银行,于2018年2月12日被中国银监会处罚,主要违法违规事实包括:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三) 同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六) 为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九) 未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款。

本组合投资的前十名证券之一兴业银行,于2018年4月19日被银保监会处罚,主要违法违规事实包括:(一) 重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七) 个人理财资金违规投资;(八) 提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。

对上述股票的投资决策程序的说明:本基金为指数基金,为有效跟踪标的指数,控制跟踪偏离和跟踪误差,对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,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。

5.11.2

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	459,749.61
2	应收证券清算款	779,919.42
3	应收股利	-
4	应收利息	4,029.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	289,473.70
8	其他	748,722.62
9	合计	2,281,894.50

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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积极投资股票。

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	1,402,849,992.00
报告期期间基金总申购份额	71,100,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	150,300,000.00
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	1,323,649,992.00

§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

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	20190131-20190325	49,999,000.00	0.00	49,999,000.00	0.00	0.00%
	2	20190131-20190331	50,000,000.00	0.00	0.00	50,000,000.00	33.33%
	3	20190131-20190331	49,999,000.00	0.00	0.00	49,999,000.00	33.33%
	4	20190131-20190331	50,000,000.00	0.00	0.00	50,000,000.00	33.33%
产品持有风险							
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额确认时,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期间内基金资产受损冲击或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5000万元,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大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

(2)平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同

(3)平安沪深300交易型开放式指数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)平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金2019年第1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4月19日

平安惠诚纯债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期:2019年4月19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、