

# 平安惠诚纯债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 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

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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，于 2019 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、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及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2019 年 1 月 31 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	平安惠诚纯债
场内简称	-
基金主代码	006316
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
报告期末基金份额总额	100,016,330.26 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
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。
业绩比较基准	中债综合指数（总财富）收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	朱巍
	联系电话	0755-22626828	0571-87659806
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	zhuwei@czbank.com

客户服务电话	400-800-4800	95527
传真	0755-23997878	0571-88268688

#### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月31日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	1,096,252.13
本期利润	1,020,228.99
加权平均基金份额本期利润	0.0066
本期基金份额净值增长率	0.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0053
期末基金资产净值	100,666,561.80
期末基金份额净值	1.0065

注：1. 本基金基金合同于 2019 年 01 月 31 日正式生效，截至报告期末未满半年；

2. 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；

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. 上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 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
过去一个月	0.23%	0.02%	0.49%	0.03%	-0.26%	-0.01%
过去三个月	0.19%	0.03%	0.62%	0.05%	-0.43%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.65%	0.03%	1.00%	0.05%	-0.35%	-0.02%

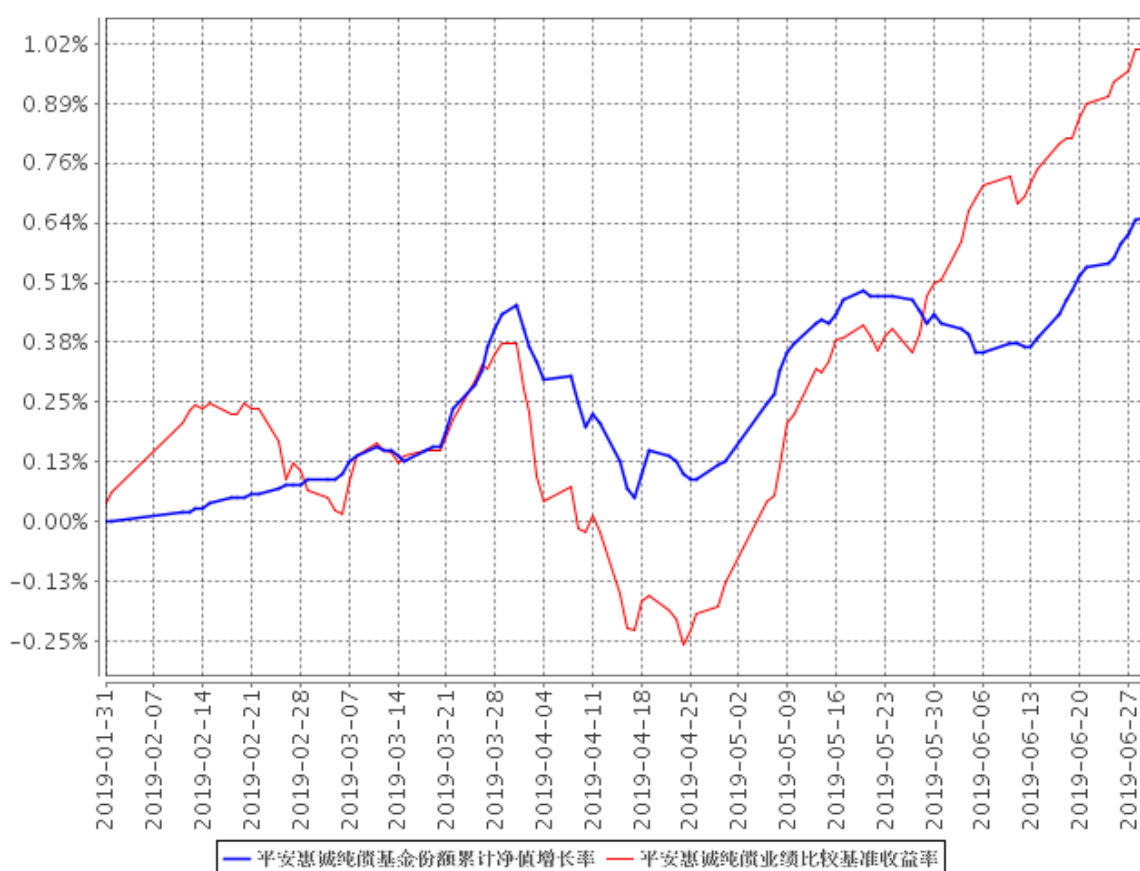
1、业绩比较基准：中债综合指数(总财富)收益率\*90%+1 年期定期存款利率(税后)\*10%。本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金是通过债券资产的配置和个券的选择来增强债券投资的收益。中债综合指数(总财富)由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，适合作为市场债券投资收益率的衡量标准；由于本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，

持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，采用 90%作为业绩比较基准中债券投资所代表的权重，10%作为现金资产所对应的权重可以较好的反映本基金的风险收益特征。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

平安惠诚纯债基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



1、本基金基金合同于 2019 年 1 月 31 日正式生效，截至报告期末未满半年；

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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股份 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股份 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份 14.3%。

平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，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“以专业承载信赖”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，平安基金共管理 83 只公募基金，公募基金管理总规模 2877 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张恒	平安惠诚纯债债券型证券投资基金的基金经理	2019 年 1 月 31 日	-	7	张恒先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于华泰证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫基金、景顺长城基金，2015 年起在第一创业证券历任投资经理、高级投资经理、投资主办人。2017 年 11 月加入平安基金管理有限公司，任固定收益投资部投资经理。现任平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金、平安惠锦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、平安合盛 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安高等级债债券型证券投资基金、平安惠添纯债债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安惠诚纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，为基金持有人谋求最大利益。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。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占比等因素进行



了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度货币政策继续维持相对宽松的态势，但开始强调防止“流动性幻觉”，货币政策可能开始进入观察期；而随着宽信用的不断推进、社融的企稳回升、基建的反弹等，再加上权益市场的较好表现，整体都抬升了市场风险偏好，债市呈现出区间震荡的格局。二季度货币政策一波两折，前半季货币政策边际收紧，后半季监管推进金融供给侧改革、托管包商银行，引发银行间市场流动性分层和信任危机，央行最终再度边际放松并疏导该现象，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，基金净值稳定上涨。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0065 元，份额累计净值为 1.0065 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 0.65%，同期业绩基准增长率为 1.00%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济下行压力依然较大，在全球货币政策进入宽松格局的背景下，国内货币政策大概率继续维持相对宽松的态势，资金面维持在合理充裕的水平，通胀也整体在可接受的范围内，甚至三季度会呈现会呈现逐步走低的态势。综合来看，下半年债市环境整体相对偏利好，不过由于债市收益率整体处在历史较低水平，未来债市可能呈现利率中枢震荡下行的格局。

#### 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企业会计准则、《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和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。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相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、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年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能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签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债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润分配情况的说明**

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### **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**

本基金本报告期未出现连续 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 5,000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对平安惠诚纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，平安惠诚纯债债券型证券投资基金的管理人——平安基金管理有限公司在平安惠诚纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，平安惠诚纯债债券型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的平安惠诚纯债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：平安惠诚纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,551,349.52	-
结算备付金		-	-
存出保证金		2,423.22	-
交易性金融资产	6.4.7.2	100,783,800.00	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		100,783,800.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,327,669.85	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		104,665,242.59	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,879,874.18	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,774.81	-
应付托管费		8,258.29	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,125.77	-
应交税费		-	-

应付利息		2,021.28	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	76,626.46	-
负债合计		3,998,680.79	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	100,016,330.26	-
未分配利润	6.4.7.10	650,231.54	-
所有者权益合计		100,666,561.80	-
负债和所有者权益总计		104,665,242.59	-

注：1. 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0065 元，基金份额总额 100,016,330.26 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 31 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间，无上年度可比期间。

## 6.2 利润表

会计主体：平安惠诚纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 31 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 2019 年 1 月 31 日(基 金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,511,055.80	-
1.利息收入		2,295,501.82	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	172,621.90	-
债券利息收入		1,918,984.99	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		203,894.93	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-708,422.88	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-708,422.88	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.17	-76,023.14	-

号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
<b>减:二、费用</b>		490,826.81	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	194,425.17	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,808.44	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,090.11	-
5. 利息支出		147,976.63	-
其中: 卖出回购金融资产支出		147,976.63	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	78,526.46	-
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		1,020,228.99	-
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		1,020,228.99	-

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 平安惠诚纯债债券型证券投资基金

本报告期: 2019年1月31日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月31日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	200,015,449.76	-	200,015,449.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,020,228.99	1,020,228.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-99,999,119.50	-369,997.45	-100,369,116.95
其中: 1.基金申购款	9.97	0.02	9.99
2.基金赎回款	-99,999,129.47	-369,997.47	-100,369,126.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	100,016,330.26	650,231.54	100,666,561.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗春风	_____ 林婉文	_____ 张南南
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安惠诚纯债债券型证券投资基金(原名为平安大华惠诚纯债债券型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]817号《关于核准平安大华惠诚纯债债券型证券投资基金募集的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于2018年10月25日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华惠诚纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,015,448.50元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0044号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华惠诚纯债债券型证券投资基金基金合同》于2019年1月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,015,449.76份基金份额,其中认购资金利息折合1.26份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华惠诚纯债债券型证券投资基金于2019年2月13日起更名为平安惠诚纯债债券型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安惠诚纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资范围主要包括债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、次级债、可分离

交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款)、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(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,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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%。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数(总财富)收益率 $\times$ 90%+1 年期定期存款利率(税后) $\times$ 10%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、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业务指引》、《平安惠诚纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 31 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2019 年 1 月 31 日(基金合同生效日)起至 2019 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。



### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发

行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金的收益分配政策为：（1）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；（2）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；（3）每一基金份额享有同等分配权；（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除

外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
平安证券股份有限公司	基金管理人的股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金于本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月31日(基金合同生效日)至 2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
平安证券	12,192,793.90	100.00%	-	-

**6.4.8.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月31日(基金合同生效日)至 2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
平安证券	209,000,000.00	100.00%	-	-

**6.4.8.1.4 权证交易**

本基金于本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金于本报告期内无应支付关联方的佣金。

**6.4.8.2 关联方报酬****6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月31日(基金合同生 效日)至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	194,425.17	-
其中：支付销售机构的客 户维护费	-	-

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.3% / 当年天数。

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月31日(基金合同生效 日)至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付 的托管费	64,808.44	-

注：支付基金托管行浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每

月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.1%/ 当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

无

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	50,000,000.00	49.9918%	-	-

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月31日(基金合同生效日) 至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行	2,551,349.52	92,694.43	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,879,874.18 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
190201	19 国开 01	2019 年 7 月 2 日	99.96	40,000	3,998,400.00
合计				40,000	3,998,400.00

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未从事交易所市场债券正回购交易，无质押债券。

## 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 6.4.10.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

### 6.4.10.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	100,783,800.00	96.29
	其中：债券	100,783,800.00	96.29
	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	2,551,349.52	2.44
8	其他各项资产	1,330,093.07	1.27
9	合计	104,665,242.59	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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。

#### 7.2.2 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股票。

### 7.3 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。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期内未进行股票买卖交易。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期内未进行股票买卖交易。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期内未进行股票买卖交易。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,479,800.00	80.94
	其中：政策性金融债	66,203,800.00	65.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	19,304,000.00	19.18
9	其他	-	-
10	合计	100,783,800.00	100.12

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	190201	19 国开 01	300,000	29,988,000.00	29.79
2	190402	19 农发 02	260,000	25,955,800.00	25.78
3	111819503	18 恒丰银行 CD503	200,000	19,304,000.00	19.18
4	180203	18 国开 03	100,000	10,260,000.00	10.19
5	1820009	18 宁波银行 01	50,000	5,157,000.00	5.12

## 7.7 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。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 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情况。

### 7.10.2 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。

### 7.10.3 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情况。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

银保监会于 2018 年 11 月 9 日做出银保监银罚决字（2018）8 号处罚决定，由于中国民生银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺。根据相关规定对公司罚款 3160 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

银保监会于 2018 年 11 月 9 日做出银保监银罚决字（2018）5 号处罚决定，由于中国民生银

行股份有限公司（以下简称“公司”）：贷款业务严重违反审慎经营规则。根据相关规定对公司罚款 200 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。

我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，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。

### 7.11.2

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,423.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,327,669.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,330,093.07

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 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。

### 7.11.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
214	467,366.03	99,999,000.00	99.98%	17,330.26	0.02%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,881.89	0.0039%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年1月31日）基金份额总额	200,015,449.76
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9.97
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	99,999,129.47
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	100,016,330.26

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2、经平安基金管理有限公司（以下简称“公司”）2019 年第三次股东会议审议通过，由薛世峰先生接替李兆良先生任职公司的独立董事，任职日期为 2019 年 6 月 7 日。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，公司收到监管机构对我司采取责令改正措施的决定、对相关责任人出具警示函的决定。公司高度重视，制定并实施相关整改措施，及时向监管机构提交整改报告。报告期内，公司已完成整改。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
平安证券	2	-	-	-	-	-

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

3、本基金本报告期合同生效，上述租用席位均为本期新增所用。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券	12,192,793.90	100.00%	209,000,000.00	100.00%	-	-



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	2019/01/31--2019/03/25	49,999,000.00	-	49,999,000.00	-	-
	2	2019/01/31--2019/05/28	50,000,000.00	-	50,000,000.00	-	-
	3	2019/01/31--2019/06/30	49,999,000.00	-	-	49,999,000.00	49.99%
	4	2019/01/31--2019/06/30	50,000,000.00	-	-	50,000,000.00	49.99%

#### 产品特有风险

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部确认时，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短期内基金资产变现冲击成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。

平安基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日