

平安短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：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。

基金托管人中国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 1 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	平安短债		
场内简称	-		
基金主代码	005754		
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	2018 年 5 月 16 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		
报告期末基金份额总额	19,285,351,254.13 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	-		
下属分级基金的基金简称	平安短债 A	平安短债 C	平安短债 E
下属分级基金场内简称	-	-	-
下属分级基金的交易代码	005754	005755	005756
报告期末下属分级基金份额总额	6,734,164,984.08 份	41,203,269.58 份	12,509,983,000.47 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过重点投资短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	为保持本基金明显的收益风险特征，本基金将通过分析宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、远期利率水平、市场短期资金流向、央行公开市场操作力度、货币供应量变动等）、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。同时，本基金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。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。		
业绩比较基准	中国人民银行公布的 1 年期定期存款利率（税后）		
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，低于混合型基金、股票型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	-	-	-

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	王永民
	联系电话	0755-22626828	010-66594896
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

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	http://www.fund.pingan.com
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

基金级别	平安短债 A	平安短债 C	平安短债 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	142,396,230.42	2,090,868.54	185,418,659.77
本期利润	147,553,896.46	2,205,077.15	189,038,008.11
加权平均基金份额本期利润	0.0179	0.0194	0.0164
本期基金份额净值增长率	1.80%	1.76%	1.69%
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	0.0231	0.0221	0.0206
期末基金资产净值	6,960,612,179.49	42,546,641.44	12,898,299,579.33
期末基金份额净值	1.0336	1.0326	1.0310

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. 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）；

3. 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

平安短债 A

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	0.29%	0.02%	0.12%	0.00%	0.17%	0.02%
过去三个月	0.75%	0.02%	0.37%	0.00%	0.38%	0.02%
过去六个月	1.80%	0.02%	0.74%	0.00%	1.06%	0.02%
过去一年	4.70%	0.02%	1.50%	0.00%	3.20%	0.02%
自基金合同生效起至今	5.38%	0.02%	1.69%	0.00%	3.69%	0.02%

平安短债 C

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	0.29%	0.01%	0.12%	0.00%	0.17%	0.01%
过去三个月	0.72%	0.02%	0.37%	0.00%	0.35%	0.02%
过去六个月	1.76%	0.02%	0.74%	0.00%	1.02%	0.02%
过去一年	4.62%	0.02%	1.50%	0.00%	3.12%	0.02%
自基金合同生效起至今	5.28%	0.02%	1.69%	0.00%	3.59%	0.02%

平安短债 E

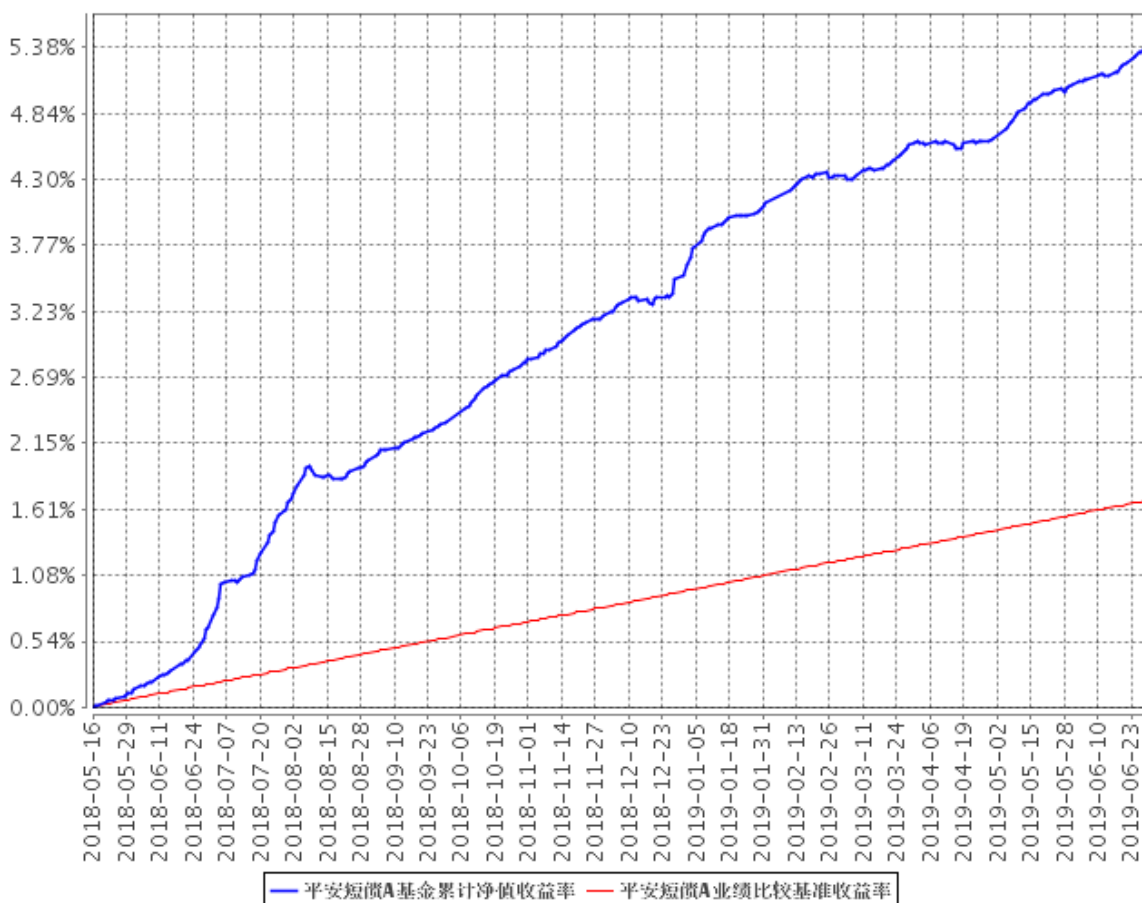
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.27%	0.01%	0.12%	0.00%	0.15%	0.01%
过去三个月	0.69%	0.02%	0.37%	0.00%	0.32%	0.02%
过去六个月	1.69%	0.02%	0.74%	0.00%	0.95%	0.02%
过去一年	4.47%	0.02%	1.50%	0.00%	2.97%	0.02%
自基金合同生效起至今	5.12%	0.02%	1.69%	0.00%	3.43%	0.02%

注：1、中国人民银行公布的 1 年期定期存款利率（税后）。其中，本基金是债券型基金，主要投资于短期债券，争取基金资产的稳定增值，以中国人民银行公布的 1 年期定期存款利率（税后）作为业绩比较基准，符合本基金的风险收益特征。

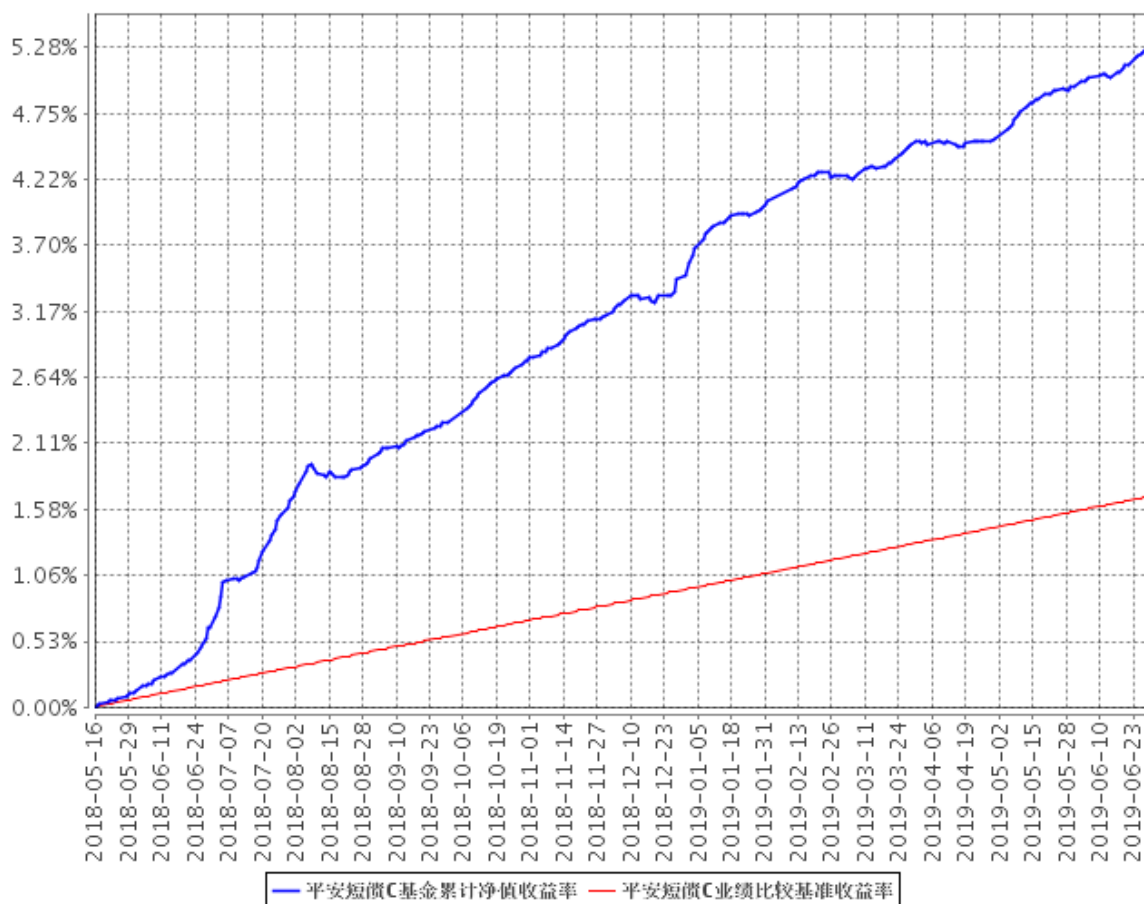
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

平安短债A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安短债C基金累计净值收益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 2018 年 05 月 16 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		
段玮婧	平安短债债券型证券投资基金的基金经理	2018 年 5 月 16 日	-	12	段玮婧女士，中山大学硕士。曾担任中国中投证券有限责任公司投资经理。2016 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组投资经理。2017 年 1 月起担任平安交易型货币市场基金、平安金管家货币市场基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安短债债券型证券投资基金、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平

					安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金基金经理。
张文平	固定收益投资中心投资执行总经理、平安短债债券型证券投资基金的基金经理	2018 年 8 月 10 日	-	8	张文平先生，南京大学硕士。先后担任毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。2018 年 3 月加入平安基金管理有限公司，现任固定收益投资中心投资执行总经理。同时担任平安短债债券型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠轩纯债债券型证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安惠安纯债债券型证券投资基金、平安惠裕债券型证券投资基金、平安如意中短债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、平安交易型货币市场基金基金经理。

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、《平安短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、交易占优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

报告期内，名义 GDP 持续走低，经济基本面偏弱；货币政策强调“不搞大水漫灌”但整体相对宽松；财政政策适度刺激，基建企稳回升；受阶段性通胀回升、贸易谈判反复等影响，债市预期出现摇摆，债券市场震荡为主。报告期内，本基金的投资操作相对稳健，中高水平的杠杆、中低水平的久期，信用风险偏好控制在中低水平，同时积极寻找一二级市场错误定价的投资机会，在兼顾安全性、流动性和收益性的情况下，本基金净值稳定增长。

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 A 份额净值为 1.0336 元，份额累计净值为 1.0536 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 1.80%，同期业绩基准增长率为 0.74%。本基金 C 份额净值为 1.0326 元，份额累计净值为 1.0526 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 1.76%，同期业绩基准增长率为 0.74%。本基金 E 份额净值为 1.031 元，份额累计净值为 1.051 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 1.69%，同期业绩基准增长率为 0.74%。

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，全球经济走弱，各国货币政策再次步入宽松格局；国内经济增长动力依然不足，下行压力持续；政策倾向于结构性调节为主，慎搞总量刺激；降低实体融资成本仍将持续，需维持相对宽松的资金面格局；地产行业监管趋严，销售、投资均有望走弱；由此，债市整体偏友好；不过，考虑到债市收益率已经处于历史低位，预计下行将不会顺畅。我们将保持中性偏多的组合特征，灵活操作，力争在兼顾安全性、流动性的情况下，为客户创造稳定良好的收益。

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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及本基金合同的规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金本报告期末出现连续 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安短债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：平安短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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,523,284.12	9,065,074.47
结算备付金		19,261,496.05	867,566.49
存出保证金		51,357.69	27,090.51
交易性金融资产	6.4.7.2	21,014,220,918.53	22,197,386,969.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		20,981,210,792.50	21,369,188,283.60
资产支持证券投资		33,010,126.03	828,198,685.40
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
贵金属投资		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	305,526,418.30	70,000,305.00
应收证券清算款		20,098,828.63	-
应收利息	6.4.7.5	286,231,592.13	336,512,667.32
应收股利		-	-
应收申购款		79,345,454.28	37,983,404.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		21,731,259,349.73	22,651,843,077.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
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		1,817,365,024.01	5,896,552,475.13
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	910,697.55
应付管理人报酬		5,042,920.04	4,544,005.13
应付托管费		1,680,973.36	1,514,668.38
应付销售服务费		2,599,089.61	2,181,171.18
应付交易费用	6.4.7.7	162,569.17	259,369.15
应交税费		2,221,714.49	2,280,999.21

应付利息		606,066.10	7,065,492.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	122,592.69	236,664.32
负债合计		1,829,800,949.47	5,915,545,542.99
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	19,285,351,254.13	16,180,761,586.80
未分配利润	6.4.7.10	616,107,146.13	555,535,947.45
所有者权益合计		19,901,458,400.26	16,736,297,534.25
负债和所有者权益总计		21,731,259,349.73	22,651,843,077.24

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 19,285,351,254.13 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0336 元，基金份额 6,734,164,984.08 份；下属 C 类基金份额净值 1.0326 元，基金份额 41,203,269.58 份；下属 E 类基金份额净值 1.0310 元，基金份额 12,509,983,000.47 份。

6.2 利润表

会计主体：平安短债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 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 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 5 月 16 日(基 金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		420,596,268.78	13,212,044.12
1.利息收入		470,426,325.57	9,071,314.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	247,098.01	1,545,297.91
债券利息收入		465,197,821.18	5,167,124.34
资产支持证券利息收入		3,181,078.88	-
买入返售金融资产收入		1,800,327.50	2,358,892.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-62,411,247.25	677,593.01
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	-62,695,653.33	677,593.01
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	284,406.08	-
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“-”号填列）	6.4.7.17	8,891,222.99	3,463,136.32
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	3,689,967.47	-

减：二、费用		81,799,287.06	2,052,512.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	30,444,553.67	620,733.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,148,184.53	206,911.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,715,586.02	66,599.53
4. 交易费用	6.4.7.19	299,312.59	23,325.00
5. 利息支出		24,468,055.53	1,072,290.88
其中：卖出回购金融资产支出		24,468,055.53	1,072,290.88
6. 税金及附加		1,545,043.33	16,120.38
7. 其他费用	6.4.7.20	178,551.39	46,533.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		338,796,981.72	11,159,531.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		338,796,981.72	11,159,531.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安短债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 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）	16,180,761,586.80	555,535,947.45	16,736,297,534.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	338,796,981.72	338,796,981.72
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）	3,104,589,667.33	188,294,398.70	3,292,884,066.03
其中：1.基金申购款	29,639,387,526.77	919,924,062.16	30,559,311,588.93
2.基金赎回款	-26,534,797,859.44	-731,629,663.46	-27,266,427,522.90
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）	-	-466,520,181.74	-466,520,181.74
五、期末所有者权益（基	19,285,351,254.13	616,107,146.13	19,901,458,400.26

项目	上年度可比期间 2018 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	1,584,965,697.04	-	1,584,965,697.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,159,531.19	11,159,531.19
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)	317,598,862.88	1,038,194.00	318,637,056.88
其中：1.基金申购款	317,598,862.88	1,038,194.00	318,637,056.88
2.基金赎回款	-	-	-
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)	1,902,564,559.92	12,197,725.19	1,914,762,285.11

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

平安短债债券型证券投资基金(原名为平安大华短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]161号《关于准予平安大华短债债券型证券投资基金注册的批复》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《平安大华短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1,584,428,900.27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(2018)第0239号验资报告予以验证。经向中国

证监会备案,《平安大华短债债券型证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,584,965,697.04 份基金份额,其中认购资金利息折合 536,796.77 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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

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》,平安大华短债债券型证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安短债债券型证券投资基金。

根据《平安短债债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类、E 类基金份额。本基金 A 类、C 类和 E 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类、E 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、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、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款(包括协议存款、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,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。本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于短期债券的比例不低于非现金资产的 80%;本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公布的 1 年期定期存款利率(税后)。

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》、《平安短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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 1 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

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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
平安证券股份有限公司	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
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
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
中国平安人寿保险股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
上海陆金所基金销售有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
中国平安财产保险股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

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

本基金于本期及上年度可比期间均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1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年5月16日(基金合同生效日)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	3,165,900,528.60	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1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年5月16日(基金合同生效日)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	13,000,806,000.00	100.00%	3,410,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均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1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年5月16日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	30,444,553.67	620,733.04
其中：支付销售机构的客户维护费	7,858,460.54	412,116.17

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 0.30%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 × 0.30%/ 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年5月16日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,148,184.53	206,911.01

注：支付基金托管行中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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 × 0.10%/ 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	平安短债 A	平安短债 C	平安短债 E	合计
平安银行股份有限公司	-	33,732.92	3,429,384.12	3,463,117.04
平安证券股份有限公司	-	-	47,989.04	47,989.04
平安基金管理有限公司	-	25,068.39	3,559,004.32	3,584,072.71
中国平安人寿保险股份有限公司	-	-	115,833.70	115,833.70
上海陆金所基金销售有限公司	-	-	1,864,258.89	1,864,258.89
中国银行股份有限公司	-	-	27,574.13	27,574.13
合计	-	58,801.31	9,044,044.20	9,102,845.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2018年5月16日(基金合同生效日)至2018年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	平安短债 A	平安短债 C	平安短债 E	合计
上海陆金所基金销售有限公司	-	617.77	55,311.27	55,929.04
平安银行股	-	-	8,922.32	8,922.32

份有限公司				
平安证券股 份有限公司	-	-	0.91	0.91
中国银行股 份有限公司	-	-	1,669.76	1,669.76
合计	-	617.77	65,904.26	66,522.03

支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

支付基金销售机构的销售服务费按 E 类基金份额前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 E 类基金份额销售服务费 = 前一日 E 类基金份额基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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

单位：人民币元

本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日						
银行间市场交 易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	210,225,410.15	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2018 年 5 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日						
银行间市场交 易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-

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

平安短债 A				
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
重庆金安小额贷款有限公司	0.00	0.0000%	194,343,601.20	1.2011%
中国平安财产保险股份有限公司	294,839,312.04	1.5288%	294,839,312.04	1.8222%
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	257,470,932.12	1.3351%	777,470,932.12	4.8049%

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 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 5 月 16 日(基金合同生效日)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
中国银行	6,523,284.12	187,516.17	3,522,111.72	91,649.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均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 1,817,365,024.01 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
011900316	19 南航股 SCP002	2019 年 7 月 1 日	100.19	1,053,000	105,500,070.00
011900617	19 东航股 SCP004	2019 年 7 月 1 日	100.00	2,000,000	200,000,000.00
011901188	19 中电投 SCP018	2019 年 7 月 1 日	100.03	926,000	92,627,780.00
180209	18 国开 09	2019 年 7 月 1 日	100.03	1,000,000	100,030,000.00
180216	18 国开 16	2019 年 7 月 1 日	100.03	2,000,000	200,060,000.00
180410	18 农发 10	2019 年 7 月 1 日	100.07	1,800,000	180,126,000.00
190202	19 国开 02	2019 年 7 月 1 日	99.67	242,000	24,120,140.00
190207	19 国开 07	2019 年 7 月 1 日	100.00	1,100,000	110,000,000.00
190402	19 农发 02	2019 年 7 月 1 日	99.83	1,100,000	109,813,000.00
011901194	19 中铝 SCP007	2019 年 7 月 3 日	100.07	687,000	68,748,090.00
101458029	14 珠海华发 MTN001	2019 年 7 月 3 日	101.60	2,100,000	213,360,000.00
011802157	18 首钢 SCP011	2019 年 7 月 5 日	100.57	1,600,000	160,912,000.00
011802200	18 中铝集 SCP015	2019 年 7 月 5 日	100.55	1,500,000	150,825,000.00
011901068	19 光明 SCP002	2019 年 7 月 5 日	100.12	59,000	5,907,080.00
011901180	19 苏交通 SCP007	2019 年 7 月 5 日	100.04	722,000	72,228,880.00
041900162	19 深能源 CP001	2019 年 7 月 5 日	100.12	1,300,000	130,156,000.00
合计				19,189,000	1,924,414,040.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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	21,014,220,918.53	96.70
	其中：债券	20,981,210,792.50	96.55
	资产支持证券	33,010,126.03	0.15
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	305,526,418.30	1.41
	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	25,784,780.17	0.12
8	其他各项资产	385,727,232.73	1.77
9	合计	21,731,259,349.73	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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	188,687,000.00	0.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,284,378,256.10	6.45
	其中：政策性金融债	1,142,478,256.10	5.74
4	企业债券	1,819,965,036.40	9.14
5	企业短期融资券	14,105,031,000.00	70.87
6	中期票据	3,583,149,500.00	18.00
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,981,210,792.50	105.43

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	011901305	19 广州地铁 SCP001	3,000,000	298,770,000.00	1.50
2	041800371	18 义乌国资 CP001	2,200,000	221,870,000.00	1.11
3	101458029	14 珠海华发 MTN001	2,100,000	213,360,000.00	1.07
4	011802375	18 赣高速 SCP008	2,100,000	210,987,000.00	1.06
5	101800892	18 云投 MTN006	2,000,000	203,600,000.00	1.02

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	131922	16 幸福 A5	330,000	33,010,126.03	0.17

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。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	51,357.69
2	应收证券清算款	20,098,828.63
3	应收股利	-
4	应收利息	286,231,592.13
5	应收申购款	79,345,454.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	385,727,232.73

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

份额级别	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
平安短债 A	10,615	634,400.85	5,949,337,075.76	88.35%	784,827,908.32	11.65%
平安短债 C	16	2,575,204.35	24,286,221.34	58.94%	16,917,048.24	41.06%
平安短债 E	878,049	14,247.48	23,475,312.98	0.19%	12,486,507,687.49	99.81%
合计	887,286	21,735.21	5,997,098,610.08	31.10%	13,288,252,644.05	68.90%

上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	平安短债 A	1,771,416.30	0.0263%
	平安短债 C	-	-
	平安短债 E	1,278,958.44	0.0102%
	合计	3,050,374.74	0.0158%

基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	平安短债 A	0
	平安短债 C	0
	平安短债 E	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开	平安短债 A	0

放式基金	平安短债 C	0
	平安短债 E	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安短债 A	平安短债 C	平安短债 E
基金合同生效日（2018 年 5 月 16 日）基金份额总额	1,400,032,504.83	5,000,000.00	179,933,192.21
本报告期期初基金份额总额	6,956,196,667.31	174,717,411.90	9,049,847,507.59
本报告期期间基金总申购份额	7,324,724,526.81	78,290,511.82	22,236,372,488.14
减：本报告期期间基金总赎回份额	7,546,756,210.04	211,804,654.14	18,776,236,995.26
本报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,734,164,984.08	41,203,269.58	12,509,983,000.47

§ 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、2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

南京证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
申万证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、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

3、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。

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	3,165,900,528.60	100.00%	13,000,806,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

中投证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

平安基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日