平安创业板交易型开放式指数证券投资基金

2019 第二季度 报告

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
报告送出日期:2019年7月16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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安创业板ETF
场内简称	创业板PA
交易代码	159964
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	2019年3月15日
报告期末基金份额总额	105,481,881.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
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。在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	创业板指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪创业板指数,其风险收益特征与标的指数所表现的市场组合的风险收益特征相似。
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

§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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,280,844.41
2.本期利润	-10,435,995.46
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0727
4.期末基金资产净值	95,058,031.00
5.期末基金份额净值	0.9012

注:

1. 本基金基金合同于2019年3月15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. 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	-9.93%	1.89%	-10.75%	1.95%	0.82%	-0.06%

业绩比较基准:创业板指数收益率

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2019年3月15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	平安创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;ETF指数中心指数投资总监	2019年3月15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ETF指数中心指数投资总监,同时担任平安沪深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基金经理。
钱晶	平安创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;	2019年3月15日	-	8	钱晶先生,美国纽约大学理工学院硕士,曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017年10月加入平安基金管理有限公司,任资产配置事业部ETF指数部投资经理,现任平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安MSCI中国A股波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业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MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数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、《平安创业板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

由于一季度地方债发行前置和财政支出发力,宏观经济在4月份达到了年内高位。与此同时,通胀水平因为猪肉价格上涨而出现小幅上升。经济和通胀水平上升,导致货币政策在4月份出现边际收紧,推动债券收益率上行。而5月中美贸易战反复性再起,美联储年内降息预期发酵,欧日经济持续疲弱,叠加国内在5月底出现银行破刚兑事件,再一次引发风险偏好回落,货币政策重新边际放松,央行向中小银行和非银机构定向流动性支持,债券收益率也跟随下行。本基金在符合基金合同约定的投资范围和投资限制的基础上,近期主要投资于利率债和中短期限信用债等资产,致力于获得稳健的投资收益。

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1.0123元;本报告期基金份额净值增长率为0.59%,业绩比较基准收益率为0.63%。

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5,000万元的情形。

§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	93,398,996.06	98.12
	其中:股票	93,398,996.06	98.12
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	1,498,493.27	1.57
8	其他资产	290,649.43	0.31
9	合计	95,188,138.76	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	10,630,445.98	11.18
B	采矿业	-	-
C	制造业	45,986,532.19	48.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,961,623.42	24.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	592,249.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	1,864,910.56	1.96
N	水利、环境和公共设施管理业	1,448,256.00	1.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,444,112.60	5.73
R	文化、体育和娱乐业	4,274,977.00	4.50
S	综合	-	-
	合计	93,203,106.75	98.05

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

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	172,782.71	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	195,889.31	0.21

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股票。

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	300498	温氏股份	296,443	10,630,445.98	11.18
2	300059	东方财富	395,502	5,359,052.10	5.64
3	300750	宁德时代	57,800	3,981,264.00	4.19
4	300015	爱尔眼科	93,780	2,904,366.60	3.06
5	300142	沃森生物	98,500	2,793,460.00	2.94
6	300347	泰格医药	26,400	2,035,440.00	2.14
7	300003	乐普医疗	88,400	2,034,968.00	2.14
8	300124	汇川技术	84,800	1,942,768.00	2.04
9	300760	迈瑞医疗	10,008	1,633,305.60	1.72
10	300408	三环集团	82,400	1,602,680.00	1.69

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

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	300775	三角防务	2,020	59,388.00	0.06
2	300782	卓胜微	495	53,915.40	0.06
3	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.03
4	300780	德恩精工	935	27,676.00	0.03
5	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.02

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券中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	75,453.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	304.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	214,892.01
8	其他	-
9	合计	290,649.43

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

本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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	245,481,881.00
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	140,000,000.00
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	105,481,881.00

§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	2019/04/01---2019/06/30	200,052,999.00	-	137,441,695.00	62,611,304.00	59.36%
产品持有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5,000万元,基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形,持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。						

"申购份额"含买入份额,"赎回份额"含卖出份额。

§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创业板交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

(2)平安创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同

(3)平安创业板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)平安创业板交易型开放式指数证券投资基金2019年第2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7月16日

平安高端制造混合型证券投资基金

2019 第二季度 报告

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
报告送出日期:2019年7月16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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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4月24日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安高端制造混合
场内简称	-
交易代码	007082
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年4月24日
报告期末基金份额总额	677,368,231.16份
投资目标	在严格控制风险的前提下,重点投资于高端制造业主题相关的优质证券,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略,其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;个股精选策略用于挖掘优质的高端制造相关证券。
业绩比较基准	中证高端制造主题指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
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
基金保证人	-
下属分级基金的基金简称	平安高端制造混合A	平安高端制造混合C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	007082	007083
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	848,022,454.38份	29,345,776.78份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§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4月24日-2019年6月30日)	
	平安高端制造混合A	平安高端制造混合C
1.本期已实现收益	958,101.95	-71,640.29
2.本期利润	46,671,373.11	1,935,421.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0510	0.0392
4.期末基金资产净值	891,063,492.06	30,776,675.15
5.期末基金份额净值	1.0508	1.0488

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

平安高端制造混合A

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	5.08%	0.76%	-7.48%	1.47%	12.56%	-0.71%

平安高端制造混合C

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	4.88%	0.76%	-7.48%	1.47%	12.36%	-0.71%

业绩比较基准:中证高端制造主题指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%

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

平安高端制造混合A

平安高端制造混合C

1、本基金基金合同于2019年4月24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		
李化松	平安高端制造混合型证券投资基金的基金经理;权益投资中心投资董事总经理;	2019年4月24日	-	13	李化松先生,北京大学硕士,先后担任国信证券有限责任公司经济研究所分析师,华宝兴业基金管理有限公司研究部分析师、副实基金管理有限公司研究部高级研究员、基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公司,现任权益投资中心投资董事总经理,同时担任平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安核心优势混合型证券投资基金、平安高端制造混合型证券投资基金、平安安盈灵活配置混合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、《平安高端制造混合型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不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

在基金成立以来,A股市场出现了较大的波动,一方面是因为前期上涨过快的客观调整因素,另一方面,贸易摩擦和外部环境出现了一些变化,市场担心对经济基本面会造成负面影响,对前期较乐观的市场情绪造成了较大影响。

面对市场的大幅波动,我们沉着应对,立足长远、深入研究,认为中国经济和A股市场的中长期向好的趋势并没有发生改变,新一轮以新能源、5G、人工智能、IOT为代表的技术创新周期没有发生变化,外部因素反而会加快这一进程。

外部冲击会激发企业家的创新和奋斗精神,尽快补齐短板,积极适应环境变化,在更大范围内配置资源。这将会促进中国优秀企业成长为世界级的企业。另一方面,我们欣喜的看到,尽管部分国家的逆全球化风潮越演越烈,但是我们的政策反而更加开放,加速出台改革开放政策。我们相信,中国经济和优秀企业将会经过外部风雨的洗礼,获得更健康的成长。因此我们积极把握市场波动的机会,认真筛选股票,去伪存真,增加了长期优质企业的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安高端制造混合A基金份额净值为1.0508元,本报告期基金份额净值增长率为5.08%;截至本报告期末平安高端制造混合C基金份额净值为1.0488元,本报告期基金份额净值增长率为4.88%;同期业绩比较基准收益率为-7.48%。

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5,000万元的情形。

§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	838,812,375.58	84.91
	其中:股票	838,812,375.58	84.91
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	121,291,025.27	12.28
8	其他资产	27,742,355.32	2.81
9	合计	987,845,756.17	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

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	30,498,930.00	3.31
B	采矿业	-	-
C	制造业	564,688,901.58	61.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	53,314,407.00	5.78
G	交通运输、仓储和邮政业	23,806,237.00	2.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,614,711.60	7.55
J	金融业	6,411,636.00	0.70
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	43,779,069.40	4.75
M	科学研究和技术服务业	27,766,800.00	3.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,931,683.00	2.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	838,812,375.58	90.99

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末持有港股通股票。

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

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	000858	五粮液	416,836	49,165,806.20	5.33
2	002127	南极电商	3,894,935	43,779,069.40	4.75
3	002475	立讯精密	1,747,358	43,317,004.82	4.70
4	600438	通威股份	2,948,084	41,450,061.04	4.50
5	000568	泸州老窖	484,085	39,128,590.55	4.24
6	002271	东方雨虹	1,592,200	36,079,252.00	3.91
7	000661	长春高新	96,552	32,634,576.00	3.54
8	002311	海大集团	1,045,098	32,293,528.20	3.50
9	600570	恒生电子	469,948	32,026,956.20	3.47
10	603233	大参林	709,387	31,922,415.00	3.46

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投资。

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投资。

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 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

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	188,404.44
2	应收证券清算款	27,106,370.95
3	应收股利	-
4	应收利息	43,485.75
5	应收申购款	404,094.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,742,355.32

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

本基金本报告期末前十名股票中不在在流通受限的情况。

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

项目	平安高端制造混合A	平安高端制造混合C
基金合同生效日(2019年4月24日)基金份额总额	940,586,161.18	52,058,538.89
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	510,774.34	648,257.87
减:基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	93,074,481.14	23,361,019.98
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	848,022,454.38	29,345,776.78

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安高端制造混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安高端制造混合型证券投资基金基金合同

(3)平安高端制造混合型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)平安高端制造混合型证券投资基金2019年第2季度报告原文

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

8.3 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7月16日

平安合意定期开放债券型发起式证券投资基金

2019 第二季度 报告

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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安合意定开债
场内简称	-
交易代码	004632
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起(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,期间可以办理申购与赎回业务,本基金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	2019年1月24日
报告期末基金份额总额	508,564,883.76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