

平安中短债债券型证券投资基金

2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 日

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。其中平安鑫荣混合型证券投资基金的报告期自 2019 年 1 月 1 日至 1 月 22 日，平安中短债债券型证券投资基金的报告期自 2019 年 1 月 23 日至 3 月 31 日。

§2 基金产品概况

转型后：

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 平安中短债债券 |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 004827 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 1 月 23 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,113,744,826.90 份 |
| 投资目标 | 本基金将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 | 本基金将在分析宏观经济指标和财政货币政策等的基础上，对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测，决定组合的久期，并通过不同债券剩余期限的合理分布，有效地控制利率波动对基金净值波动的影响，并尽可能提高基金收益率。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。 |
| 业绩比较基准 | 中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20% |

| | | | |
|-----------------|--|-----------------|--------------------|
| 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。 | | |
| 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 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 平安中短债债券 A | 平安中短债债券 C | 平安中短债债券 E |
| 下属分级基金的场内简称 | - | - | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 004827 | 004828 | 006851 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 661,927,876.14 份 | 54,038,202.86 份 | 2,397,778,747.90 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | - | - | - |

转型前：

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| 基金简称 | 平安鑫荣混合 | |
| 场内简称 | - | |
| 交易代码 | 004827 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 8 月 23 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 74,029,241.69 份 | |
| 投资目标 | 本基金主要通过合理配置大类资产和精选投资标的，在严格控制下行风险和保持资产流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金将采取主动的类属资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合财富（总值）指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款利率×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 平安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 平安鑫荣混合 A | 平安鑫荣混合 C |
| 下属分级基金的场内简称 | - | - |
| 下属分级基金的交易代码 | 004827 | 004828 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,529,428.50 份 | 62,499,813.19 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（转型后）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2019年1月23日—2019年3月31日） | | |
|---------------------|----------------------------|---------------|------------------|
| | 平安中短债债券 A | 平安中短债债券 C | 平安中短债债券 E |
| 1. 本期已实现收益 | 2,172,316.72 | 382,211.40 | 6,832,919.28 |
| 2. 本期利润 | 2,400,741.46 | 409,966.61 | 6,503,788.53 |
| 3. 加权平均基金份额 本期利润 | 0.0056 | 0.0084 | 0.0044 |
| 4. 期末基金资产净值 | 668,163,005.27 | 54,539,262.77 | 2,420,314,290.69 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0094 | 1.0093 | 1.0094 |

注：

1. 本基金基金合同于 2019 年 1 月 23 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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2019年1月1日—2019年1月22日） | |
|---------------------|---------------------------|---------------|
| | 平安鑫荣混合 A | 平安鑫荣混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 145,416.90 | 1,311,692.49 |
| 2. 本期利润 | 122,506.67 | 1,236,041.57 |
| 3. 加权平均基金份额 本期利润 | 0.0106 | 0.0134 |
| 4. 期末基金资产净值 | 11,347,767.58 | 61,139,575.04 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9842 | 0.9782 |

- 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（转型后）

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

平安中短债债券 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 | 0.94% | 0.05% | 0.50% | 0.02% | 0.44% | 0.03% |

平安中短债债券 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 | 0.93% | 0.05% | 0.50% | 0.02% | 0.43% | 0.03% |

平安中短债债券 E

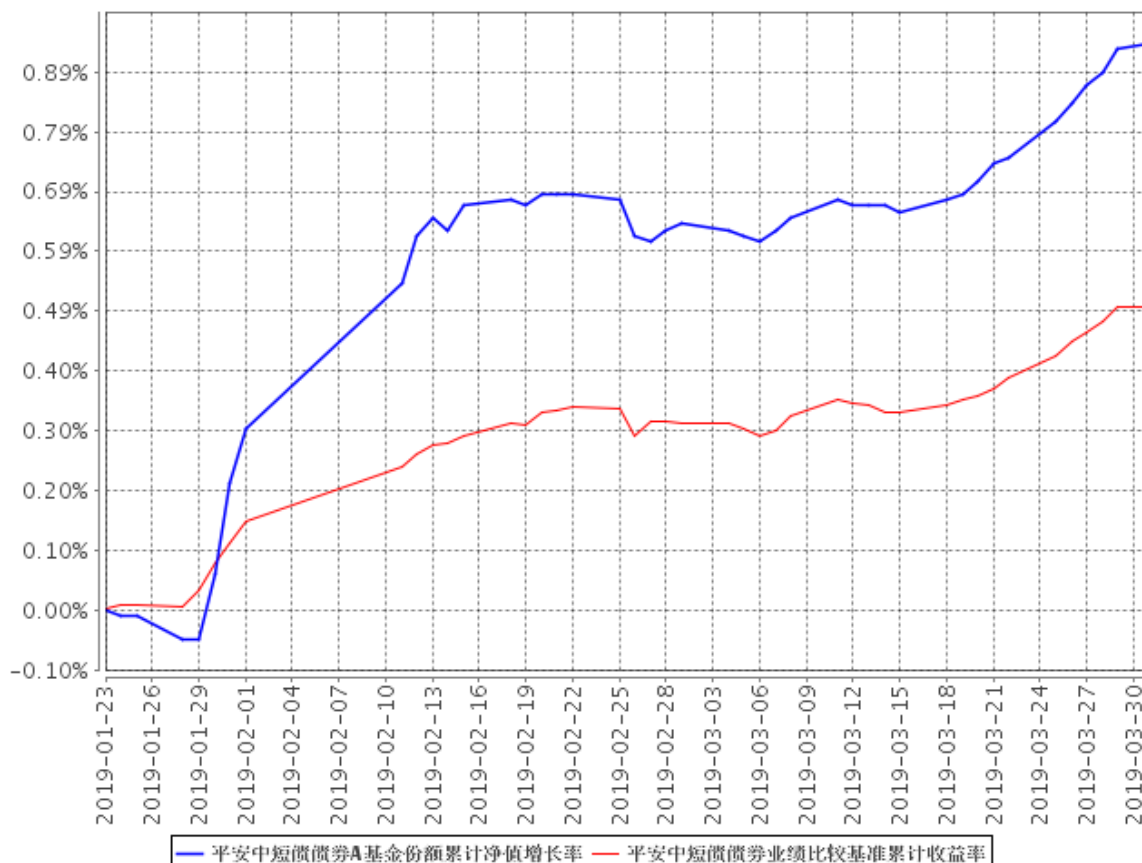
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 0.94% | 0.05% | 0.50% | 0.02% | 0.44% | 0.03% |

注：1、业绩比较基准：中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%

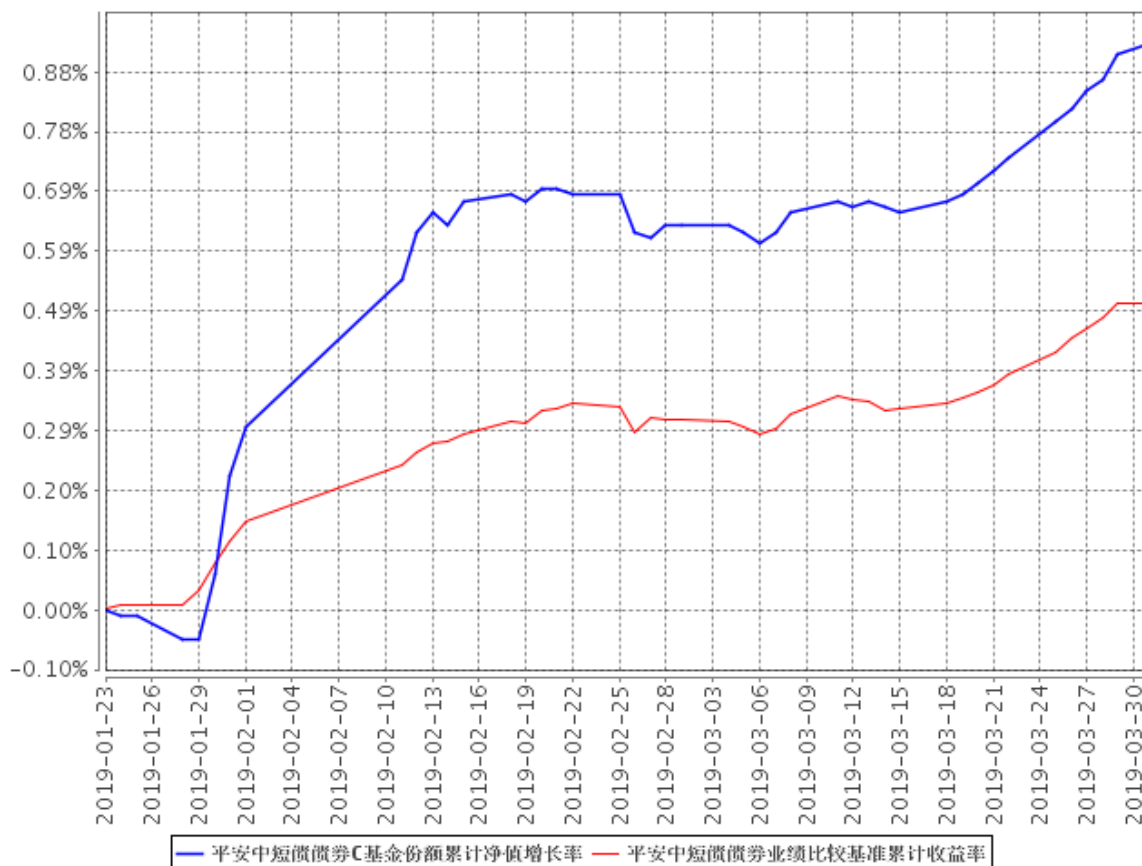
2、本基金于 2019 年 1 月 23 日转型，过去三个月为 2019 年 1 月 23 日至报告期末。

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

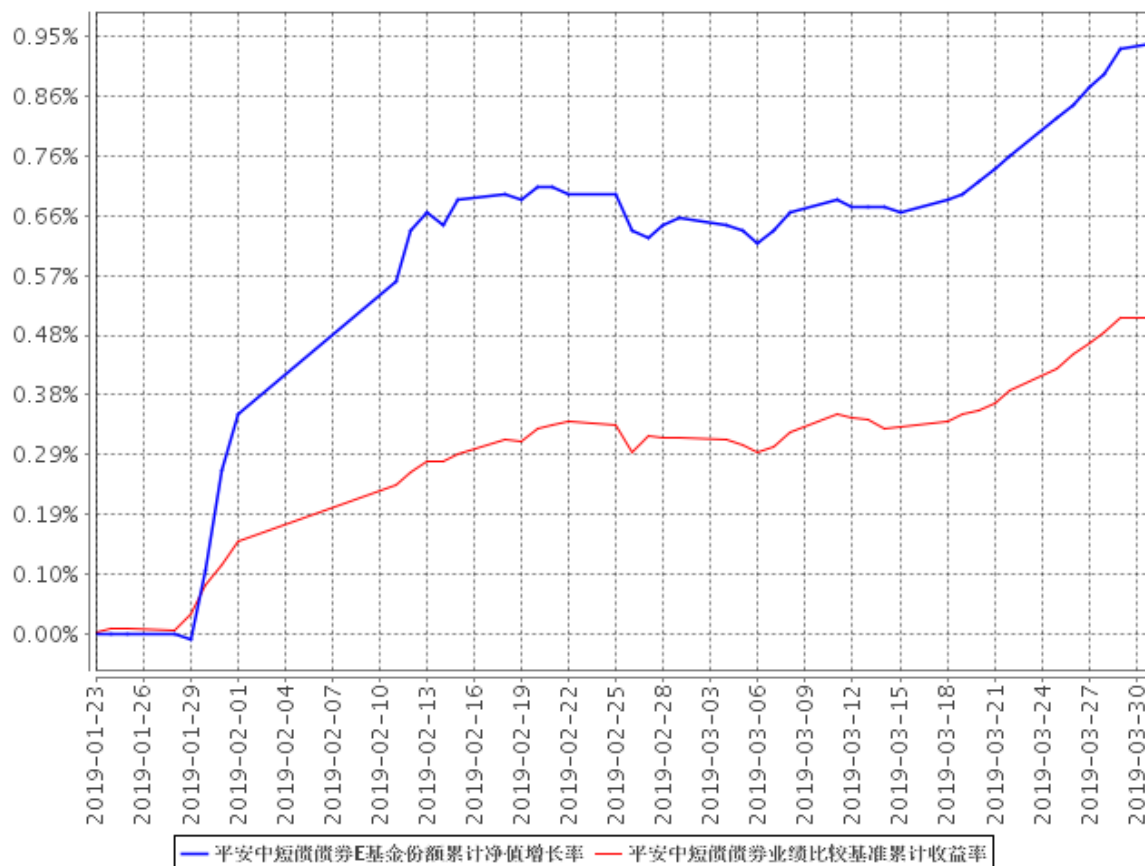
平安中短债债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安中短债债券C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



平安中短债债券E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、平安中短债由平安鑫荣转型而来，转型日期为 2019 年 1 月 23 日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满半年；
- 2、自 2019 年 1 月 23 日起在现有份额的基础上增设 E 类份额；
- 3、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未完成建仓。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

平安鑫荣混合 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 | 1.09% | 0.16% | 1.26% | 0.16% | -0.17% | 0.00% |

平安鑫荣混合 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 | 1.35% | 0.17% | 1.26% | 0.16% | 0.09% | 0.01% |

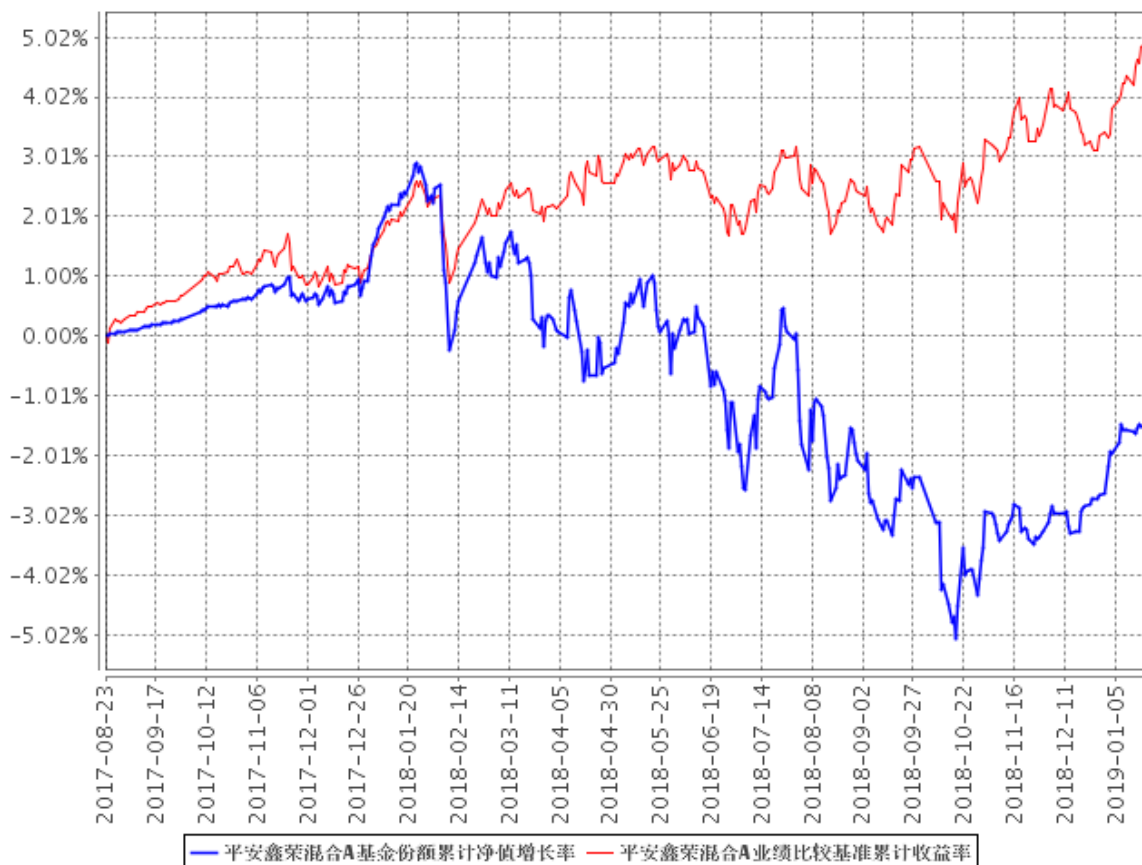
注：1、业绩比较基准：中债新综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+金融

机构人民币活期存款利率*5%

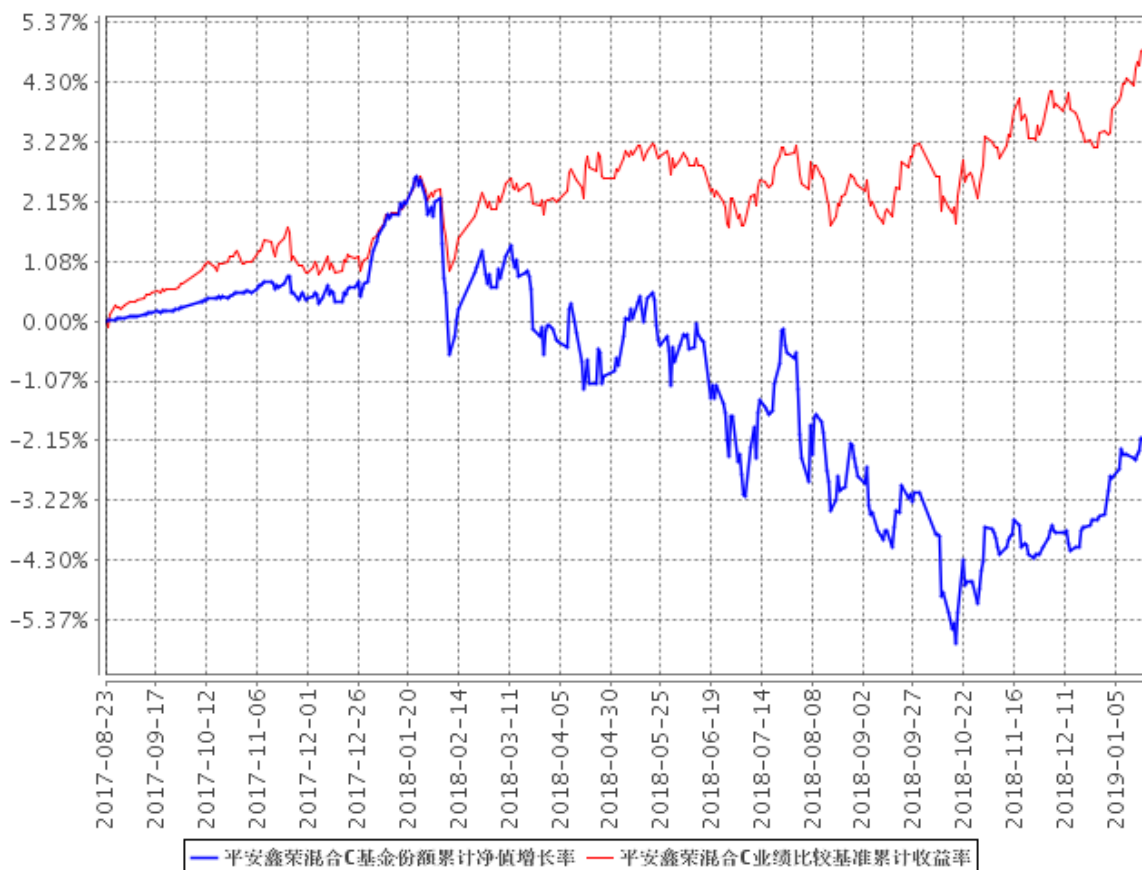
2、本基金于 2019 年 1 月 23 日转型，过去三个月为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 22 日。

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

平安鑫荣混合A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



平安鑫荣混合C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 2017 年 8 月 23 日正式生效，截至 2019 年 1 月 22 日已满一年；
- 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（转型前）

| 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 | | |
| 张恒 | 平安鑫荣混合型证券投资基金基金经理 | 2018 年 1 月 8 日 | 2019 年 1 月 22 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。现任平安鑫荣混合型证券投资基金、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、平安灵活配置混合型证券投资基金、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安安享保本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基金经理。 |
| 高勇标 | 平安鑫荣混合型证券投资基金的基金经理 | 2018 年 11 月 12 日 | 2019 年 1 月 22 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部 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>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，现任平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF)、平安惠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、平安安享保本混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、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、平安鑫荣混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

| 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 | 平安中短债债券型证券投资基金基金经理 | 2019 年 1 月 23 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部投资经理。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 |

| | | | | | |
|-----|---|------------------------|---|---|--|
| | | | | | <p>资经理，现任平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安惠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、平安惠融纯债债券型证券投资基金、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基金经理。</p> |
| 张文平 | <p>固定收益投资中心投资执行总经理、平安中短债债券型证券投资基金基金经理</p> | <p>2019 年 1 月 23 日</p> | - | 7 | <p>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</p> |

| | | | | | |
|-----|--------------------|-----------------|---|----|---|
| | | | | | 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基金经理。 |
| 段玮婧 | 平安中短债债券型证券投资基金基金经理 | 2019 年 1 月 23 日 | - | 12 | <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |

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

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、《平安中短债债券型证券投资基金基金合同》（转型前：《平安鑫荣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

一季度宏观经济继续下滑，不过幅度有所放缓。三大需求中，基建投资已经企稳回升，并推动固定资产投资逐步回升；消费震荡回落，但下行放缓；前期抢出口因素消退、中美贸易关系影响显现，出口开始平稳回落；但贸易谈判向好，对未来的预期有所改善。货币政策强调“不搞大水漫灌”、防止“流动性幻觉”，整体宽松，但进一步宽松的可能性不大；社融企稳回升，融资需求改善。受上述因素影响，利率债收益率先下后上，总体呈区间震荡走势。信用债在一系列信用政策的推动下，整体表现较强，中高等级信用利差继续压缩。本基金保持了债券投资组合的流动性，主要配置高等级的中短期信用债和利率债，基金净值表现平稳上升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 3 月 31 日，平安中短债 A 基金份额净值为 1.0094 元，本报告期（2019 年

1 月 23 日至 2019 年 3 月 31 日) 基金份额净值增长率为 0.94%; 截至本报告期末平安中短债 C 基金份额净值为 1.0093 元, 本报告期 (2019 年 1 月 23 日至 2019 年 3 月 31 日) 基金份额净值增长率为 0.93%; 截至本报告期末平安中短债 E 基金份额净值为 1.0094 元, 本报告期 (2019 年 1 月 23 日至 2019 年 3 月 31 日) 基金份额净值增长率为 0.94%; 同期业绩比较基准收益率为 0.50%。

截至 2019 年 1 月 22 日, 平安鑫荣 A 基金份额净值为 0.9842 元, 本报告期 (2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 22 日) 基金份额净值增长率为 1.09%; 平安鑫荣 C 基金份额净值为 0.9782 元, 本报告期 (2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 22 日) 基金份额净值增长率为 1.35%; 同期业绩比较基准收益率为 1.26%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

转型前:

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。

转型后:

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

转型后:

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 | 4,160,991,583.50 | 98.25 |
| | 其中: 债券 | 3,827,064,097.20 | 90.36 |
| | 资产支持证券 | 333,927,486.30 | 7.88 |
| 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 | 13,230,160.47 | 0.31 |
| 8 | 其他资产 | 61,056,728.23 | 1.44 |
| 9 | 合计 | 4,235,278,472.20 | 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

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 | 380,749,097.20 | 12.11 |
| | 其中：政策性金融债 | 214,260,597.20 | 6.82 |
| 4 | 企业债券 | 271,846,400.00 | 8.65 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,096,729,500.00 | 34.89 |
| 6 | 中期票据 | 1,555,103,500.00 | 49.48 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 522,635,600.00 | 16.63 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,827,064,097.20 | 121.76 |

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 190201 | 19 国开 01 | 1,200,000 | 120,000,000.00 | 3.82 |
| 2 | 112845 | 19 中海 01 | 1,150,000 | 114,862,000.00 | 3.65 |
| 3 | 111990194 | 19 宁波银行 CD008 | 1,090,000 | 105,773,600.00 | 3.37 |
| 4 | 112846 | 19 中海 02 | 1,000,000 | 99,070,000.00 | 3.15 |

| | | | | | |
|---|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 5 | 111991656 | 19 汇丰银行 CD004 | 1,000,000 | 97,100,000.00 | 3.09 |
|---|-----------|---------------|-----------|---------------|------|

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 139152 | 龙腾优 05 | 750,000 | 75,774,801.37 | 2.41 |
| 2 | 149805 | 借呗 54A1 | 700,000 | 70,903,426.03 | 2.26 |
| 3 | 139027 | 万科优 08 | 700,000 | 70,872,928.77 | 2.25 |
| 4 | 139053 | 深借呗 2A | 600,000 | 60,863,452.05 | 1.94 |
| 5 | 139302 | 链融 01A1 | 250,000 | 25,223,315.07 | 0.80 |
| 6 | 116996 | 万科优 06 | 100,000 | 10,128,876.71 | 0.32 |
| 7 | 149808 | 借呗 55A1 | 100,000 | 10,124,005.48 | 0.32 |
| 8 | 156087 | 花呗 66A1 | 100,000 | 10,036,680.82 | 0.32 |

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 | 14,496.92 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 42,333,602.06 |
| 5 | 应收申购款 | 18,708,629.25 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 61,056,728.23 |

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。

转型前:

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 | 54,597,500.00 | 74.89 |
| | 其中：债券 | 54,597,500.00 | 74.89 |
| | 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 | 6,790,123.40 | 9.31 |
| | 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 | 11,236,191.94 | 15.41 |
| 8 | 其他资产 | 276,436.94 | 0.38 |
| 9 | 合计 | 72,900,252.28 | 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

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 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|---------------|-------|
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 5,013,500.00 | 6.92 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,010,000.00 | 13.81 |
| 6 | 中期票据 | 24,975,500.00 | 34.45 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 14,598,500.00 | 20.14 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 54,597,500.00 | 75.32 |

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 136879 | 16 国电资 | 50,000 | 5,013,500.00 | 6.92 |
| 2 | 011900133 | 19 云投 SCP002 | 50,000 | 5,008,500.00 | 6.91 |
| 3 | 101900023 | 19 河钢集 MTN001 | 50,000 | 5,005,500.00 | 6.91 |
| 4 | 101900046 | 19 重汽 MTN001 | 50,000 | 5,004,500.00 | 6.90 |
| 5 | 011900142 | 19 苏沙钢 SCP001 | 50,000 | 5,001,500.00 | 6.90 |

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 12,327.25 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 263,121.55 |
| 5 | 应收申购款 | 988.14 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 276,436.94 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

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（转型后）

单位：份

| 项目 | 平安中短债债券 A | 平安中短债债券 C | 平安中短债债券 E |
|------------------------------------|------------------|---------------|------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 1 月 23 日）基金份额总额 | 11,529,428.50 | 49,342,633.72 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 1,012,761,571.70 | 29,768,941.71 | 2,885,746,694.91 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 362,181,547.84 | 23,999,483.69 | 487,967,947.01 |
| 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） | -181,576.22 | -1,073,888.88 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 661,927,876.14 | 54,038,202.86 | 2,397,778,747.90 |

本基金转型日期为 2019 年 1 月 23 日，此处合同生效日为 2019 年 1 月 23 日，因份额折算产生的变动记为拆分变动份额。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| 项目 | 平安鑫荣混合 A | 平安鑫荣混合 C |
|---------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 11,512,288.73 | 102,315,484.79 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 30,363.66 | 463,586.22 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 13,223.89 | 53,436,437.29 |
| 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 | 11,529,428.50 | 49,342,633.72 |

本基金转型日期为 2019 年 1 月 23 日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

无

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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 | 20190130-20190131 | - | 15,007,503.75 | - | 15,007,503.75 | 0.48% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</p> <p>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。</p> | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

为进一步满足投资者的需求，优化产品布局，根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安鑫荣混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，平安鑫荣混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人平安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定自 2018 年 12 月 26 日至 2019 年 1 月 17 日以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会审议《关于平安鑫荣混合型证券投资基金转

型相关事项的议案》，本次基金份额持有人大会于 2019 年 1 月 18 日表决通过了《关于平安鑫荣混合型证券投资基金转型相关事项的议案》。本次大会决议自 2019 年 1 月 18 日起生效。详细内容请阅读本公司于 2019 年 1 月 21 日发布的《关于平安鑫荣混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

§9 备查文件目录

备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安中短债债券型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安中短债债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安中短债债券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) 平安中短债债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告原文

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

10.3 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