

平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：平安大华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 25 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 2016 年 10 月 23 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 平安大华深证 300 指数增强 |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 700002 |
| 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 | 2011 年 12 月 20 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 37,719,062.05 份 |
| 投资目标 | 采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪深证 300 指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。 |
| 投资策略 | 采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过全样本复制的方式拟合、跟踪深证 300 指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理。以有效降低基金运作成本并提高本基金的投资收益率。 其中指数复制策略采用全样本复制的方式，即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合以拟合标的指 |

| | |
|--------|--|
| | 数的业绩表现。股票增强策略在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上，辅以有限度的增强操作及一级市场股票投资，以求获取超越标的指数的收益率表现。 |
| 业绩比较基准 | 深证 300 指数收益率 x95%+商业银行活期存款利率（税后）x5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |
| 基金管理人 | 平安大华基金管理有限公司 |
| 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（2016年7月1日—2016年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 5,623,167.47 |
| 2. 本期利润 | 2,776,668.60 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0746 |
| 4. 期末基金资产净值 | 57,378,151.39 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.521 |

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 | 5.11% | 0.93% | 1.12% | 0.96% | 3.99% | -0.03% |

业绩比较基准：深证 300 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

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

平安大华深证300指数增强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 2011 年 12 月 20 日正式生效，截至报告期末已满四年；
- 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。

3.3 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 | | |
| 乔海英 | 本基金的基金经理 | 2014 年 9 月 12 日 | - | 5 | 南开大学金融学硕士，曾先后任职于博时基金管理有限公司、民生加银基金管理有限公司担任行业研究员，2013 年加入平安大 |

| | | | | | |
|----|----------|-----------------|---|---|--|
| | | | | | 华基金管理有限公司，现任平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金、平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金经理。 |
| 施旭 | 本基金的基金经理 | 2016 年 5 月 19 日 | - | 7 | 哥伦比亚大学金融数学硕士，曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券，于 2015 年加入平安大华基金管理有限公司，现任平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金基金经理。 |

1、此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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、《平安大华深证 300 指数增强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

报告期内，A 股经历了持续震荡，市场风险偏好暂趋稳定平缓，投资者在震荡行情下主要关注于题材股。但整体上，市场信心仍不稳固，其间由于二季度经济数据并未有效改善，房地产市

场的持续火爆和相关政策的动荡，以及外围美联储议息会议及大选的影响，市场仍有较大波动，但市场参与者较为理性，并未发生严重的非理性的抛盘，主要还是区间震荡。市场开始自发地追逐一些热点，对于 PPP 概念的政策扶持，机器人、新能源汽车、OLED 等一些事件性热点，市场都始终给与关注，传统周期行业表现平平，主要以区间震荡为主，表明市场仍然以存量资金博弈为主。本季度开始，本基金依然采用量化多因子选股管理组合，通过成长，估值，分析师等数据对个股进行综合打分，同时利用优化器和风险模型对组合的跟踪误差和投资限制进行控制，试图在保持跟踪误差的前提下，超越基准，取得超额收益。

我们判断后市指数将有一定的上涨空间，一方面目前政府强力打击房地产市场，中央多位领导直接批示，政策频出，使得房地产市场参与者投机氛围减弱，有望部分炒房资金回流股市。另一方面，国内资金面依然偏宽松，货币政策应会继续趋于稳定，各行业资金有望一部分进入股市；美国大选前应以维稳为主，预计美联储大选前暂不会有新的动作，市场将会有一段消息面平稳的时期，但仍需警惕国际金融风险对 A 股市场造成的冲击。本基金将继续采用量化多因子模型管理指数增强组合，通过成长，估值，分析师等几个角度对个股进行打分，同时通过风险模型控制组合跟踪误差，利用优化器，在满足成交量，投资比例限制，跟踪误差限制等条件下，产生超额收益最佳的组合。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.521 元，份额累计净值为 1.601 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 5.11%，同期业绩基准增长率为 1.12%。

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 | 53,977,408.59 | 93.28 |
| | 其中：股票 | 53,977,408.59 | 93.28 |
| 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 | 3,850,341.82 | 6.65 |
| 8 | 其他资产 | 36,805.55 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 57,864,555.96 | 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 | 1,117,780.60 | 1.95 |
| B | 采矿业 | 499,200.00 | 0.87 |
| C | 制造业 | 22,478,895.52 | 39.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,659,088.00 | 2.89 |
| E | 建筑业 | 543,355.00 | 0.95 |
| F | 批发和零售业 | 1,561,634.25 | 2.72 |
| 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 | 7,308,165.77 | 12.74 |
| J | 金融业 | 3,896,968.00 | 6.79 |
| K | 房地产业 | 2,342,380.00 | 4.08 |
| L | 租赁和商务服务业 | 660,580.00 | 1.15 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,823,229.00 | 3.18 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 649,944.00 | 1.13 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,757,819.16 | 4.81 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 47,299,039.30 | 82.43 |

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 | 采掘业 | 881,431.87 | 1.54 |
| C | 制造业 | 3,690,509.92 | 6.43 |

| | | | |
|---|------------------|--------------|-------|
| 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 | 312,000.00 | 0.54 |
| 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 | 1,211,411.50 | 2.11 |
| L | 租赁和商务服务业 | 583,016.00 | 1.02 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 6,678,369.29 | 11.64 |

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

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 | 000776 | 广发证券 | 99,200 | 1,623,904.00 | 2.83 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 45,000 | 1,215,450.00 | 2.12 |
| 3 | 001979 | 招商蛇口 | 58,400 | 933,232.00 | 1.63 |
| 4 | 300070 | 碧水源 | 47,900 | 886,629.00 | 1.55 |
| 5 | 300017 | 网宿科技 | 12,000 | 837,600.00 | 1.46 |
| 6 | 000686 | 东北证券 | 64,000 | 782,720.00 | 1.36 |
| 7 | 002142 | 宁波银行 | 50,000 | 782,500.00 | 1.36 |
| 8 | 000069 | 华侨城 A | 109,100 | 763,700.00 | 1.33 |
| 9 | 000630 | 铜陵有色 | 281,000 | 724,980.00 | 1.26 |

| | | | | | |
|----|--------|-----|--------|------------|------|
| 10 | 000876 | 新希望 | 89,400 | 720,564.00 | 1.26 |
|----|--------|-----|--------|------------|------|

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 | 600415 | 小商品城 | 71,800 | 583,016.00 | 1.02 |
| 2 | 000980 | 金马股份 | 55,100 | 580,754.00 | 1.01 |
| 3 | 600469 | 风神股份 | 53,450 | 515,258.00 | 0.90 |
| 4 | 002182 | 云海金属 | 24,652 | 505,119.48 | 0.88 |
| 5 | 002217 | 合力泰 | 32,300 | 493,867.00 | 0.86 |

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 | 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 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | - | - |

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

本基金本报告期末无贵金属投资。

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情况。

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

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

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

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 | 5,397.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 789.59 |
| 5 | 应收申购款 | 30,618.67 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|-----------|
| 9 | 合计 | 36,805.55 |
|---|----|-----------|

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 300070 | 碧水源 | 886,629.00 | 1.55 | 重大事项 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 000980 | 金马股份 | 580,754.00 | 1.01 | 重大事项 |

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 | 37,708,028.88 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,943,864.55 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,932,831.38 |
| 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 | 37,719,062.05 |

§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 | 9,999,000.00 |
| 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 | 9,999,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 26.51 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§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大华深证 300 指数增强型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华深证 300 指数增强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) 报告期内平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

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大华基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安大华基金管理有限公司
2016 年 10 月 25 日