

# 平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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 21 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	平安大华鼎信定期开放债券型
场内简称	-
交易代码	002988
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	2016 年 7 月 21 日
报告期末基金份额总额	500,034,407.16 份
投资目标	在谨慎投资的前提下，力争战胜业绩比较基准，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。
投资策略	本基金在封闭期内，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、折价与套利等积极投资策略，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。 转型为“平安大华鼎信债券证投资基金”后，本基金运用自上而下的宏观分析和市场相结合方法实现大类资产配置，把握不同的经济发

	展阶段各类资产的投资机会，根据宏观、基准利率水平等因素，预测债券类、货币大资产的期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流况分析，进行大配置。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险均高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

### §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21日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	1,583,380.01
2. 本期利润	2,340,645.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0047
4. 期末基金资产净值	502,375,053.03
5. 期末基金份额净值	1.0047

注：1. 本基金基金合同于 2016 年 7 月 21 日正式生效，截至报告期末未满一季度；

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

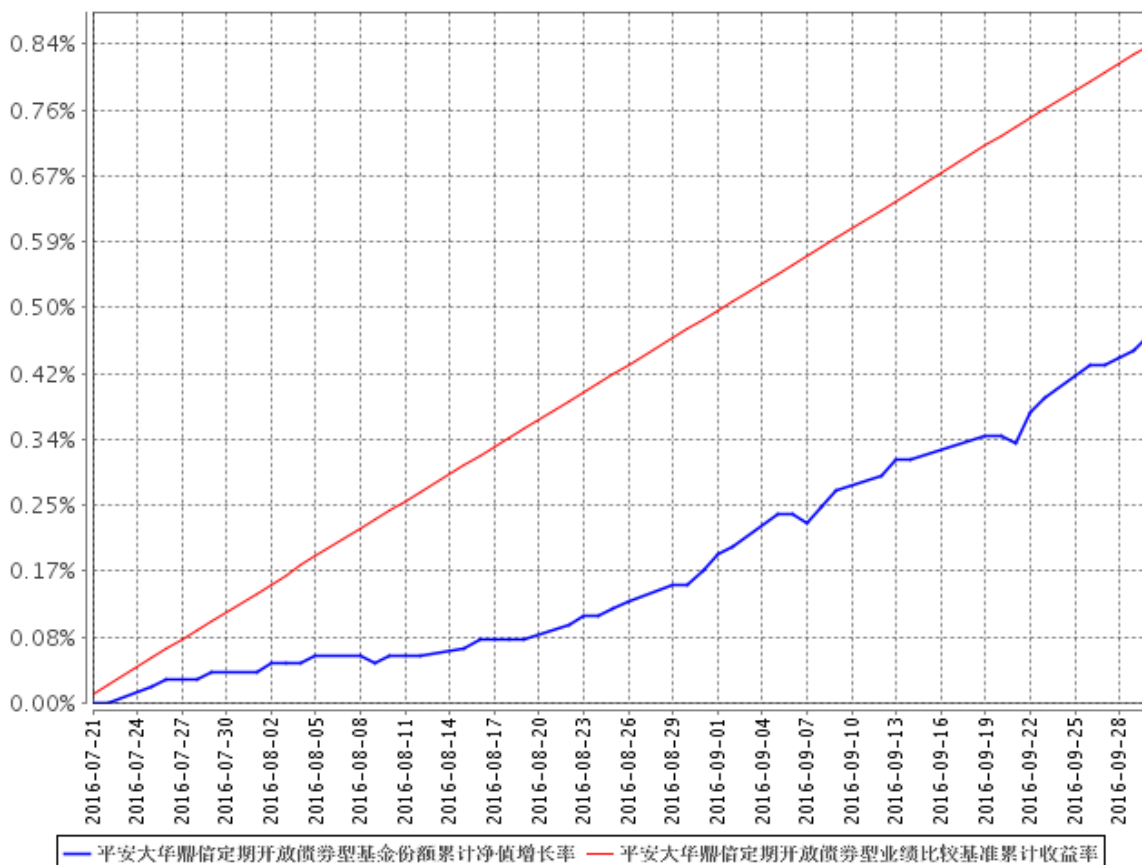
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.47%	0.01%	0.84%	0.01%	-0.37%	0.00%

业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税后）+1.5%

### 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

平安大华鼎信定期开放债券型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 2016 年 7 月 21 日正式生效，截至报告期末未满一年；
- 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尚未完成建仓。

### 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		
WANG A0	本基金的基金经理	2016 年 7 月 21 日	-	3	WANG A0 先生，CAIA、FRM，澳大利亚莫纳什大学商学（金融学、经济学）学士，曾任职原深发展

					<p>银行国际业务部外汇政策管理室。</p> <p>2012 年 9 月加入平安大华基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益研究员。现任任平安大华财富宝货币市场基金、平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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、《平安大华鑫安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

三季度宏观经济疲弱中闪现亮点，货币市场流动性保持紧平衡态势，信贷及社会融资水平有所改善，预计政府将继续以稳增长为基调，施行偏中性的货币政策与积极的财政政策。展望四季

度，房地产调控政策在中长期影响经济的回暖，但利好债市。汇率继续承压使流动性过度宽松预期降低。

自产品于 7 月 21 日成立以来，逐步进行了建仓，投资操作主要以固定收益投资、可转债申购、逆回购等操作为主。目前产品仍处于建仓过程中，故净值表现并不明显。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，本基金净值为 1.0047 元，份额累计净值为 1.0047 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 0.47%，同期业绩基准增长率为 0.84%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	342,389,127.50	68.10
	其中：债券	342,389,127.50	68.10
	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	146,075,539.11	29.05
	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	11,913,400.75	2.37
8	其他资产	2,420,842.60	0.48
9	合计	502,798,909.96	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

### 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

本基金本报告期末无股票投资。

### 5.2.2 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

本基金本报告期末无股票投资。

### 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	270,181,000.00	53.78
6	中期票据	71,993,000.00	14.33
7	可转债（可交换债）	215,127.50	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	342,389,127.50	68.15

### 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（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101651019	16 天津航空 MTN001	400,000	40,820,000.00	8.13
2	041664036	16 中航租赁 CP001	400,000	39,980,000.00	7.96
3	1382152	13 魏桥铝 MTN1	300,000	31,173,000.00	6.21
4	011698346	16 海天建设 SCP003	300,000	30,141,000.00	6.00
5	041664038	16 徐工机械 CP002	300,000	30,021,000.00	5.98
5	011698357	16 京供销 SCP002	300,000	30,021,000.00	5.98

## 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

本基金本报告期末无资产支持证券投资情况。

## 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

本基金本报告期末无权证投资。

## 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 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

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.10.2

基金投资的前十名股票没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,072.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,414,769.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,420,842.60



#### 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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

#### 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016 年 7 月 21 日 ）基金份额总额	500,034,407.16
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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）	-
报告期期末基金份额总额	500,034,407.16

### §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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §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鼎信定期开放债券型证券投资基金设立的文件
- （2）平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金基金合同
- （3）平安大华鼎信定期开放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) 报告期内平安大华鼎信定期开放债券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