

平安大华安盈保本混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 月 31 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：2017 年 4 月 24 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 2017 年 4 月 20 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 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华安盈保本混合
场内简称	-
交易代码	002537
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 4 月 22 日
报告期末基金份额总额	1,586,664,043.05 份
投资目标	本基金以本金安全为目标，通过有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增长和保本期收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略和时间不变性投资组合保险策略，建立和运用严格的动态资产数量模型，动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例，以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标，并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。

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
基金保证人	-

§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（2017年1月1日—2017年3月31日）
1. 本期已实现收益	6,444,832.87
2. 本期利润	10,732,121.74
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0065
4. 期末基金资产净值	1,601,379,081.24
5. 期末基金份额净值	1.009

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

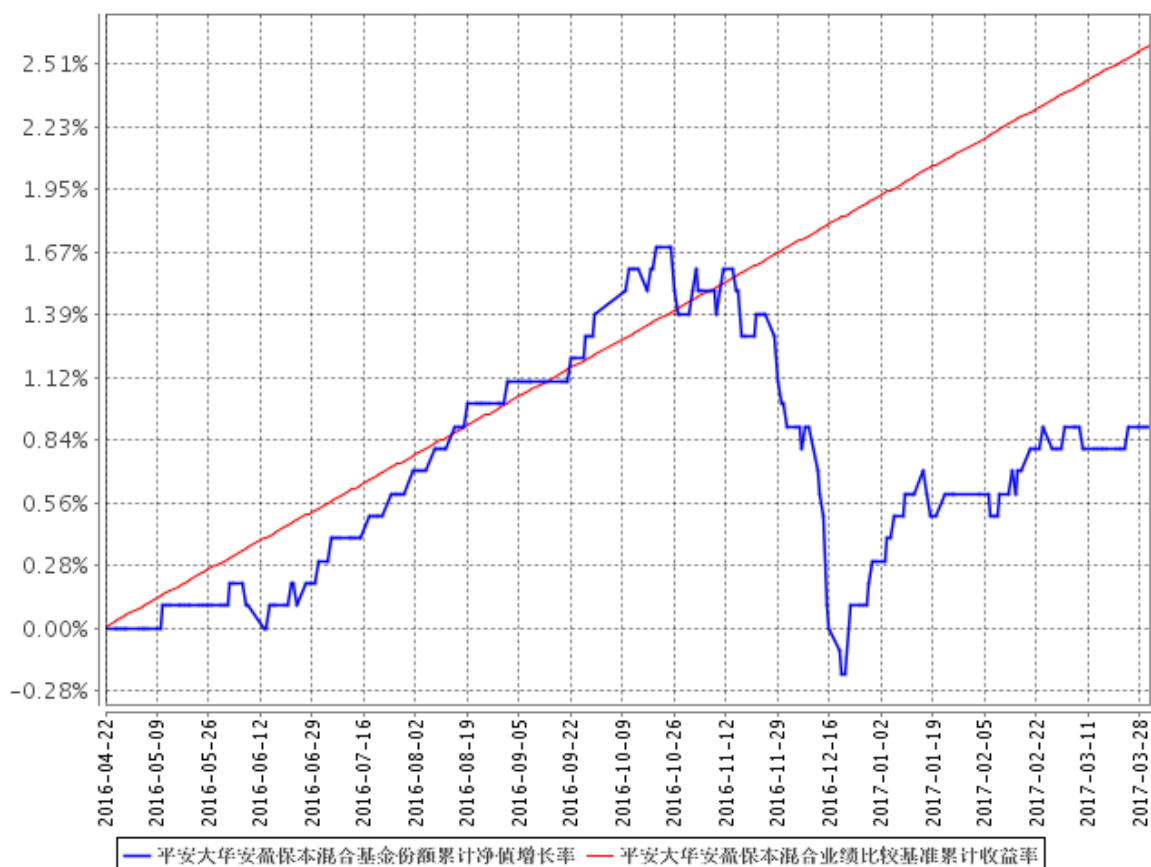
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.60%	0.05%	0.67%	0.01%	-0.07%	0.04%

业绩比较基准：每个保本期起始日的三年期银行定期存款收益率（税后）

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

平安大华安盈保本混合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 4 月 22 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		
孙健	本基金的基金经理	2016 年 4 月 22 日	-	16	硕士，1975 年生。曾任湘财证券有限责任公司资产管理总部投资经理，中国太平人寿保险有

					<p>限公司投资部、太平资产管理有限公司组合投资经理，摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理，银华货币市场证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金基金经理。2011 年 9 月加入平安大华基金公司，任投资研究部固定收益研究员，现担任“平安大华添利债券型证券投资基金”、“平安大华日增利货币市场基金”、“平安大华保本混合型证券投资基金”、“平安大华安心保本混合型证券投资基金”、“平安大华安享保本混合型证券投资基金”、“平安大华安盈保本混合型证券投资基金”、“平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金”、“平安大华智能生活灵活配置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、《平安大华安盈保本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

度过了 2016 年市场流动性极度紧张的年关之后，2017 年债券市场并未引来新年配置行情，债券收益率震荡上行并突破了 2016-12-20 的绝对水平，货币政策总基调收紧、贯穿全年的 MPA 考核、金融机构去杠杆监管思路成为引发债券市场调整的主要原因，虽然 1 季度随着债券市场收益率的上行，逐步达到部分配置型机构的合意投资价位，但由于金融机构总体规模扩张受限、新增资金不足和存量资产调整困难，导致 1 季度债券市场交易机会可循，但趋势配置难觅。本基金在保本基金投资新规出台之后进行调仓，卖出投资组合中信用评级偏低的债券，同时增持 AAA 评级的债券和存单。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 3 月 31 日，本基金份额净值为 1.009 元，份额累计净值为 1.009 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 0.60%，同期业绩基准增长率为 0.67%。

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	14,355,426.00	0.89
	其中：股票	14,355,426.00	0.89

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,460,549,892.76	90.88
	其中：债券	1,440,549,892.76	89.63
	资产支持证券	20,000,000.00	1.24
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	70,000,225.00	4.36
	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	39,184,138.39	2.44
8	其他资产	23,065,329.92	1.44
9	合计	1,607,155,012.07	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	2,720.00	0.00
B	采矿业	85,800.00	0.01
C	制造业	12,258,266.00	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,020.00	0.00
E	建筑业	28,330.00	0.00
F	批发和零售业	68,230.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,012.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,573,791.00	0.10
J	金融业	274,550.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,605.00	0.00
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	6,102.00	0.00
S	综合	-	-

	合计	14,355,426.00	0.90
--	----	---------------	------

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

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	600372	中航电子	200,000	3,860,000.00	0.24
2	600894	广日股份	200,000	2,692,000.00	0.17
3	600343	航天动力	100,000	2,165,000.00	0.14
4	600835	上海机电	100,000	2,163,000.00	0.14
5	600850	华东电脑	67,300	1,572,128.00	0.10
6	300101	振芯科技	30,000	540,900.00	0.03
7	002465	海格通信	30,000	352,200.00	0.02
8	601229	上海银行	3,000	71,940.00	0.00
9	601198	东兴证券	3,000	55,170.00	0.00
10	600030	中信证券	3,000	48,330.00	0.00

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	25,972,400.00	1.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	118,470,000.00	7.40
	其中：政策性金融债	60,312,000.00	3.77
4	企业债券	152,743,945.60	9.54
5	企业短期融资券	421,031,000.00	26.29
6	中期票据	178,309,000.00	11.13
7	可转债（可交换债）	54,433,547.16	3.40
8	同业存单	489,590,000.00	30.57
9	其他	-	-
10	合计	1,440,549,892.76	89.96

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	111794791	17 宁波银	1,000,000	98,890,000.00	6.18

		行 CD064			
2	111718104	17 华夏银行 CD104	1,000,000	97,840,000.00	6.11
3	111609501	16 浦发 CD501	1,000,000	97,750,000.00	6.10
4	041656021	16 云投 CP002	700,000	70,098,000.00	4.38
5	140440	14 农发 40	600,000	60,312,000.00	3.77

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	131801	花呗 01A1	200,000	20,000,000.00	1.25

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

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	638,369.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,426,960.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,065,329.92

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128010	顺昌转债	6,782,040.30	0.42
2	128011	汽模转债	2,664,539.08	0.17
3	128013	洪涛转债	181,615.00	0.11

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,693,667,568.63
报告期期间基金总申购份额	533,348.85
减:报告期期间基金总赎回份额	107,536,874.43
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	1,586,664,043.05

§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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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	20170101~20170331	581,000,000.00	0	0	581,000,000.00	36.62%
	..						
个人							

产品特有风险

流动性风险

注：

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第三十八次会议审议通过，付强先生新任公司副总经理职务，任职日期为 2017 年 1 月 20 日，该事项已于 2017 年 1 月 23 日公告。

§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大华安盈保本混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华安盈保本混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华安盈保本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) 报告期内平安大华安盈保本混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

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
2017 年 4 月 24 日