

平安大华鑫安混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告

2017 年 6 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：2017 年 7 月 20 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 2017 年 7 月 19 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华鑫安混合
场内简称	-
交易代码	001664
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 11 日
报告期末基金份额总额	261,887,012.08 份
投资目标	本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求在严格控制风险的基础上，实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金将在资产配置允许的范围内，采取相对灵活的资产配置策略，使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整，以规避或分散市场风险，提高基金风险调整后的收益。本基金以自上而下的投资策略，大类资产，动态控制组合风险，力争长期、稳定的回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于中高风险收益水平的基金，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	
基金保证人	-	
下属分级基金的基金简称	平安大华鑫安 A	平安大华鑫安 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	001664	001665
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	249,165,157.37 份	12,721,854.71 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（2017年4月1日—2017年6月30日）	
	平安大华鑫安 A	平安大华鑫安 C
1. 本期已实现收益	22,107.75	-98,730.86
2. 本期利润	5,837,100.02	298,081.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0231	0.0174
4. 期末基金资产净值	259,042,647.69	13,148,712.37
5. 期末基金份额净值	1.040	1.034

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

平安大华鑫安 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	2.36%	0.39%	2.50%	0.26%	-0.14%	0.13%

平安大华鑫安 C

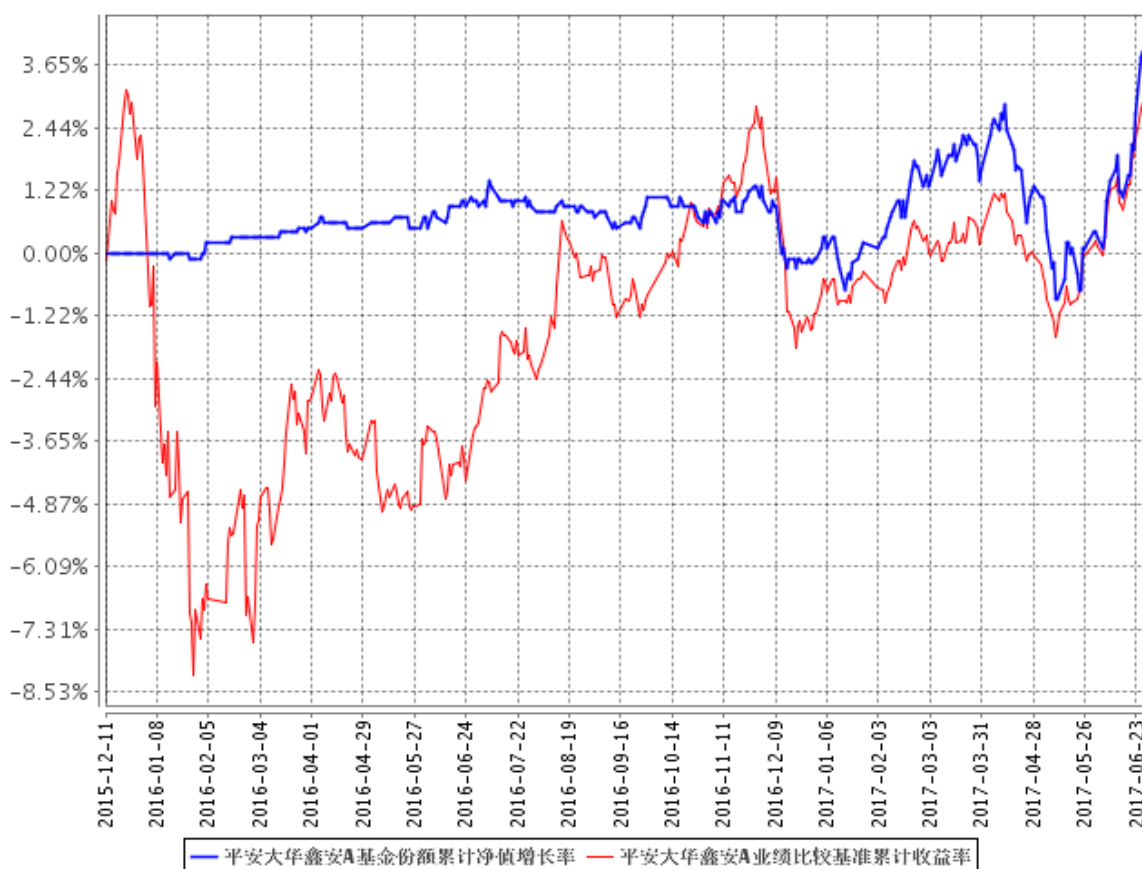
阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	①-③	②-④
----	------	-------	-------	---------	-----	-----

	率①	标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去三个月	2.17%	0.41%	2.50%	0.26%	-0.33%	0.15%

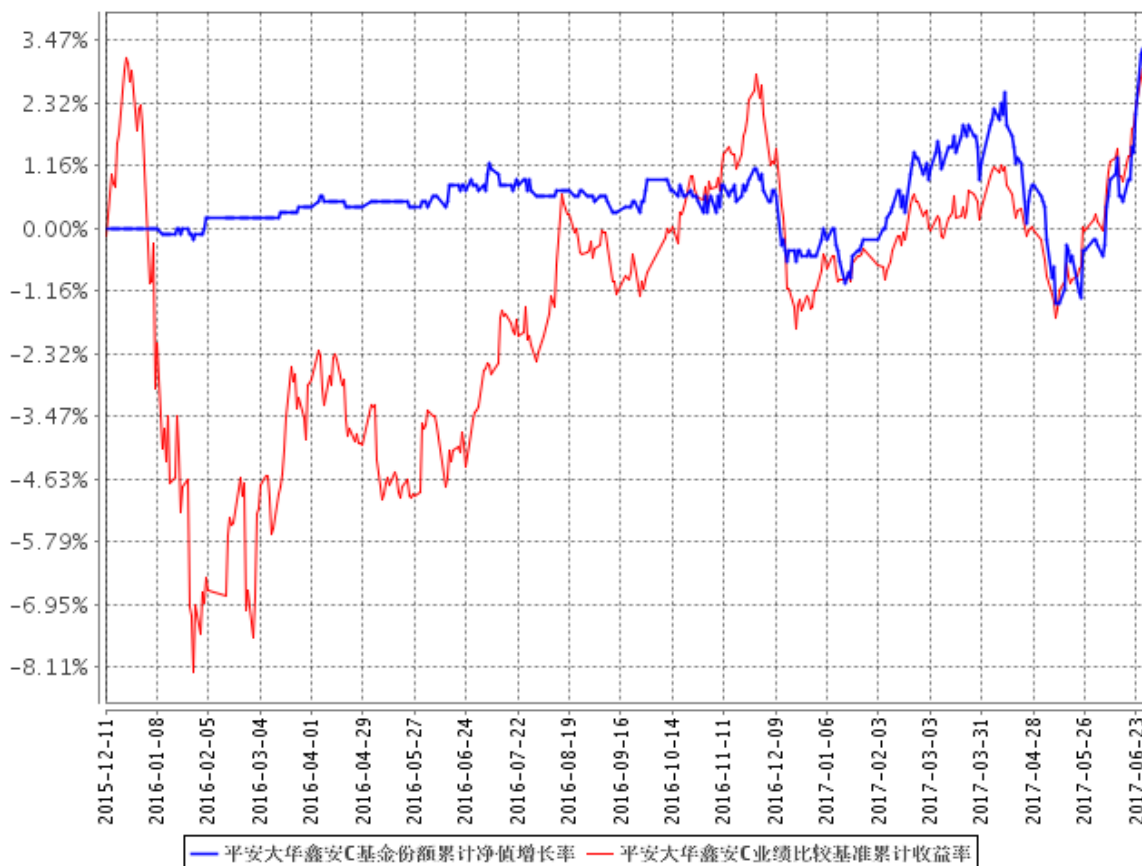
业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%

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

平安大华鑫安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



平安大华鑫安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 2015 年 12 月 11 日正式生效，截至报告期末已满一年；
- 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		
李黄海	平安大华鑫安混合型	2016 年 7 月 20 日	-	14	李黄海先生，美国南加州大学博士，曾先后任职于民生加银基金金融工程与

	证券投资基金 基金经理				产品开发部执行总监，易方达基金投资发展部总监助理，摩根士丹利华鑫基金数量化投资部投资经理。2015 年 9 月加入平安大华基金管理有限公司，现任平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
黄维	平安大华鑫安 混合型 证券投资 基金 基金 经理	2016 年 8 月 18 日	-	6	北京大学微电子学硕士，6 年证券从业经验，曾先后任广发证券资产管理（广东）有限公司研究员、投资经理，2016 年 5 月加入平安大华基金管理公司，现任平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华睿享文娱灵活配置混合性证券投资基金、平安大华鼎弘混合型证券投资基金基金经理。
施旭	平安大华鑫安 混合型 证券投资 基金 基金 经理	2016 年 12 月 27 日	-	7	施旭先生，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，任衍生品投资中心量化研究员，现任平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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，并本着诚实守信、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

回顾二季度，打新策略仍获得了不错的收益，新股上市基本都能获得一个不错的涨幅；虽然由于市场出现了小幅震荡回调导致新股发行速度有所减缓，但新股持续发行的趋势仍未改变，并且由于新股发行数量减少，单个新股收益有望抬升。

展望二季度，在市场集体配置白马蓝筹权重的环境下，此类股票有望继续上行，市场下行可能不大，底仓应仍能保持一个良好的状态，新股依然可以获得一个较为可观的收益。本基金的运作，主要运用量化多因子模型，精选低估值具有安全边际和成长价值的蓝筹和白马个股，将上市公司的现金分红比例、波动特性、行业发展的空间纳入研究范畴，在货币政策不断收紧的预期下，力争把握市场的结构性的行情，构建具备稳健增长潜力的投资组合。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金 A 份额净值为 1.040 元，份额累计净值为 1.040 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 2.36%，同期业绩基准增长率为 2.50%。本基金 C 份额净值为

1.034 元，份额累计净值为 1.034 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 2.17%，同期业绩基准增长率为 2.50%。

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	126,975,689.85	41.52
	其中：股票	126,975,689.85	41.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	153,660,450.80	50.25
	其中：债券	153,660,450.80	50.25
	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	16,108,243.09	5.27
8	其他资产	9,048,866.74	2.96
9	合计	305,793,250.48	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	-	-
B	采矿业	4,039,168.00	1.48
C	制造业	49,799,555.20	18.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,863,392.00	1.05
E	建筑业	6,873,320.24	2.53
F	批发和零售业	6,413,588.30	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	1,882,716.00	0.69

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,828,720.62	1.04
J	金融业	38,073,554.49	13.99
K	房地产业	8,393,613.00	3.08
L	租赁和商务服务业	2,200,929.00	0.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,328,890.00	0.86
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	1,278,243.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	126,975,689.85	46.65

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
合计	-	-

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

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	276,000	4,761,000.00	1.75
2	600036	招商银行	183,000	4,375,530.00	1.61
3	000651	格力电器	96,500	3,972,905.00	1.46
4	601169	北京银行	374,600	3,435,082.00	1.26
5	601668	中国建筑	343,400	3,324,112.00	1.22
6	600104	上汽集团	103,900	3,226,095.00	1.19
7	600028	中国石化	539,600	3,199,828.00	1.18

8	000333	美的集团	67,600	2,909,504.00	1.07
9	000876	新希望	332,900	2,736,438.00	1.01
10	601166	兴业银行	159,800	2,694,228.00	0.99

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	13,666,730.00	5.02
	其中：政策性金融债	13,666,730.00	5.02
4	企业债券	49,737,720.80	18.27
5	企业短期融资券	80,146,000.00	29.44
6	中期票据	10,110,000.00	3.71
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	153,660,450.80	56.45

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	112098	11 新野 02	130,530	13,055,610.60	4.80
2	122310	13 苏新城	101,200	10,138,216.00	3.72
3	1282537	12 美凯龙 MTN2	100,000	10,110,000.00	3.71
4	041666010	16 三星 CP002	100,000	10,070,000.00	3.70
5	011698624	16 川能投 SCP001	100,000	10,035,000.00	3.69

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情况。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

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

1、广发证券股份有限公司于 2016 年 11 月 25 日收到了中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]128 号）。证监会依据有关规定对广发证券未按规定审查、了解客户真实身份的违法违规行为作出了行政处罚，给予警告、责令改正、没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。

本基金管理人对该公司进行了深入的研究和分析，认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部决策流程，符合法律法规和公司制度规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券发行主体没有被监管部门立案调查或者

在编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	64,515.89
2	应收证券清算款	5,976,304.93
3	应收股利	-
4	应收利息	3,000,867.58
5	应收申购款	7,178.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,048,866.74

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

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	平安大华鑫安 A	平安大华鑫安 C
报告期期初基金份额总额	261,732,515.91	19,029,106.74
报告期期间基金总申购份额	98,874,582.63	12,125.35
减：报告期期间基金总赎回份额	111,441,941.17	6,319,377.38
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	249,165,157.37	12,721,854.71

§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。

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,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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	20170401-20170427	99,086,498.12	0.00	99,086,498.12	0.00	0.00%
	2	20170401-20170630	90,089,089.09	0.00	0.00	90,089,089.09	34.40%
	3	20170428-20170630	0.00	98,813,241.11	0.00	98,813,241.11	37.73%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
流动性风险							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第四十一次会议通过,同意推荐李兆良先生、李娟娟女士、刘雪山先生、潘汉腾先生为公司第三届董事会独立非执行董事候选人;推荐姚波先生、陈敬达先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生为公司第三届董事会非执行董事;

推荐罗春风先生、肖宇鹏先生为公司第三届董事会执行董事，并同意提交股东会审议。

2、经平安大华基金管理有限公司第二届监事会第九次会议通过，同意推荐巢傲文先生、冯方女士为公司第三届监事会股东监事候选人，并同意提交股东会审议。

3、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议通过，选举姚波先生、罗春风先生、陈敬达先生、肖宇鹏先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生、李兆良先生、李娟娟女士、刘雪生先生、潘汉腾先生为第三届董事会董事。

4、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议通过，选举巢傲文先生、冯方女士为第三届监事会监事。

§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鑫安混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华鑫安混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华鑫安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) 报告期内平安大华鑫安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 7 月 20 日