

平安大华股息精选沪港深股票型证券投资  
基金  
2017 年第 3 季度报告

2017 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：2017 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 2017 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 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	平安大华股息精选沪港深
场内简称	-
交易代码	004403
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 17 日
报告期末基金份额总额	59,110,366.63 份
投资目标	本基金主要通过股息价值策略构建股票组合，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量、定性相结合的方法分析宏观经济、财政及货币政策、资金供需情况等因素综合分析以及对资本市场发展趋势的判断，在评价未来一段时间各类的预期风险收益率、相关性的基础上，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，并将重点关注债券资产的收益率。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×35%+中证综合债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。
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	平安大华股息精选沪港深 A	平安大华股息精选沪港深 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	004403	004404
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	53,632,581.64 份	5,477,784.99 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7月1日—2017年9月30日）	
	平安大华股息精选沪港深 A	平安大华股息精选沪港深 C
1. 本期已实现收益	2,419,879.83	210,753.97
2. 本期利润	3,048,860.53	212,516.93
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0303	0.0209
4. 期末基金资产净值	55,782,838.31	5,661,874.03
5. 期末基金份额净值	1.0401	1.0336

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

平安大华股息精选沪港深 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	2.59%	0.52%	3.49%	0.40%	-0.90%	0.12%

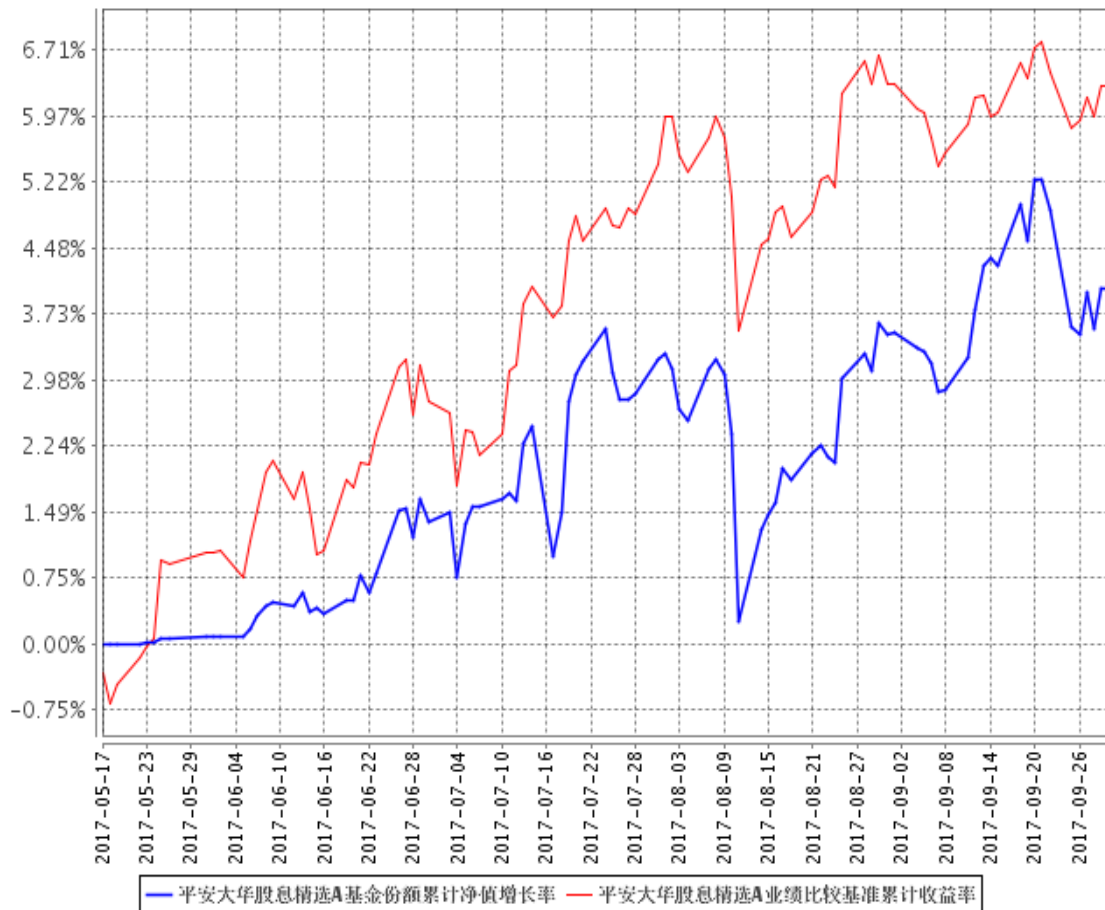
平安大华股息精选沪港深 C

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	2.11%	0.52%	3.49%	0.40%	-1.38%	0.12%

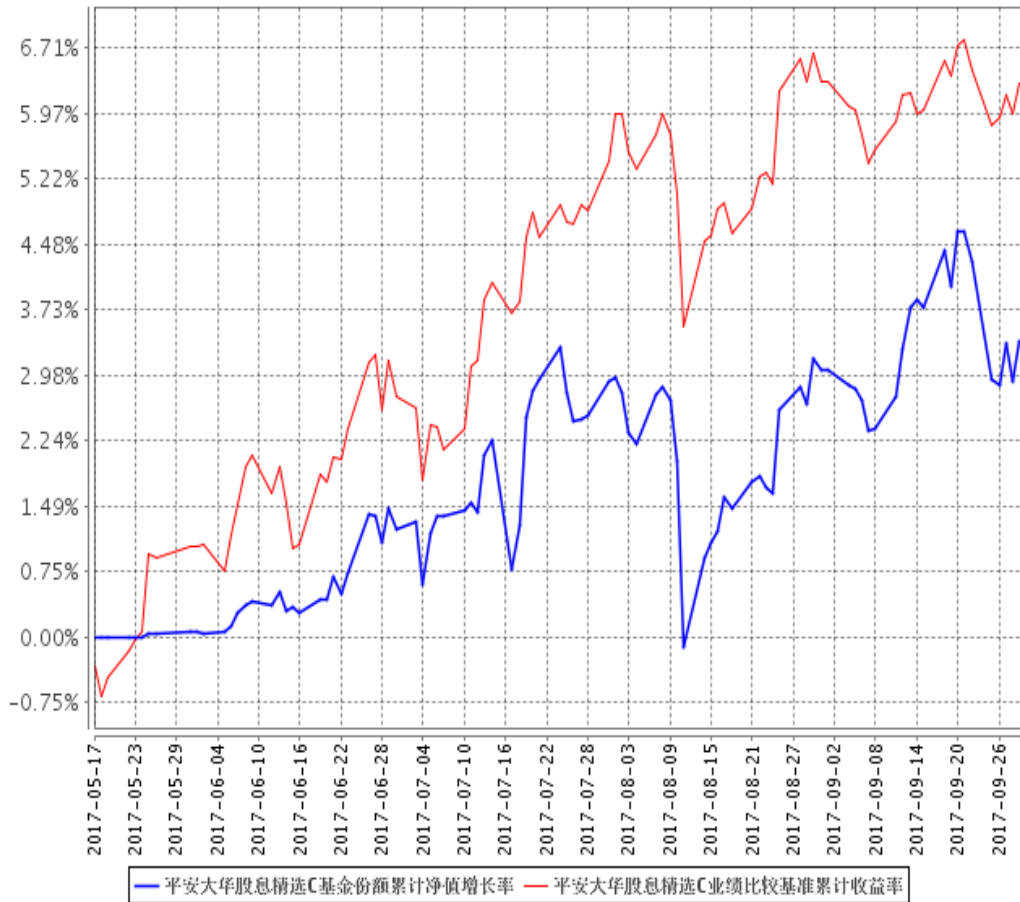
沪深 300 指数收益率\*35%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)\*35%+中证综合债券指数收益率\*30%

### 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

平安大华股息精选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



平安大华股息精选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 05 月 17 日正式生效，截至报告期末未满半年；
- 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

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		
施旭	平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理	2017 年 5 月 17 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。

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、《平安大华股息精选沪港深股票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

回顾 2017 年三季度 A 股市场，在监管力度有所放缓，海外资金及杠杆资金逐步入市的环境下，整体市场逐步震荡上行，并且沪指突破 3300 点，成交量整体趋势性放大。同时，随着大宗商品上涨，带动了周期股出现了一轮趋势性上涨，并且沪深 300、中证 500 中的一些优质企业如人工智能、新能源汽车等板块都出现明显上涨，整体市场行情从原本相对防守性的大市值蓝筹股逐步向二线蓝筹及优质成长企业扩散，市场情绪得到明显改善。今年以来，新增开户数逐步增加，三季度以来两融规模更是逐步抬升，市场赚钱效应开始逐步显现，对吸引资金持续入市起到积极左右。报告期间，海外主要股票市场也相继创出新高，整体市场环境仍相对较好。A 股目前市场流动性较为稳定，市场整体情绪较好。

回顾港股市场，三季度出现大幅上涨，恒生指数突破 28000 点，一方面受海外市场较好影响，美股同期也创出新高；另一方面受国内 A 股影响，三季度 A 股周期股持续上涨，恒生国企指数涨幅较大，对整体港股形成较大带动效应。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末股息精选沪港深 A 基金份额净值为 1.0401 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.59%；同期业绩比较基准收益率为 3.49%。截至本报告期末股息精选沪港深 C 基金份额净值为 1.0336 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.11%；同期业绩比较基准收益率为 3.49%。

### 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	43,094,250.82	69.64
	其中：股票	43,094,250.82	69.64
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	18,535,557.90	29.95
8	其他资产	249,076.37	0.40
9	合计	61,878,885.09	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	418,594.44	0.68
B	采矿业	583,458.00	0.95
C	制造业	8,401,233.61	13.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	655,201.00	1.07
E	建筑业	761,675.00	1.24
F	批发和零售业	1,264,857.15	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	990,134.00	1.61
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	4,305,847.20	7.01
K	房地产业	3,328,256.00	5.42
L	租赁和商务服务业	76,130.00	0.12



M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	189,016.00	0.31
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	144,000.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	21,118,402.40	34.37

### 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	449,937.45	0.73
B 消费者非必需品	4,889,980.22	7.96
C 消费者常用品	-	-
D 能源	2,196,965.86	3.58
E 金融	799,835.94	1.30
F 医疗保健	416,384.38	0.68
G 工业	731,366.09	1.19
H 信息技术	7,076,384.83	11.52
I 电信服务	1,123,547.90	1.83
J 公用事业	2,067,460.70	3.36
K 房地产	2,223,985.05	3.62
合计	21,975,848.42	35.77

### 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	00700	腾讯控股	17,500	4,998,974.61	8.14
2	00386	中国石油化工股份	442,000	2,196,965.86	3.58
3	00019	太古股份公司A	28,500	1,835,520.50	2.99
4	00868	信义玻璃	136,000	892,075.03	1.45
5	000895	双汇发展	35,300	878,970.00	1.43
6	002304	洋河股份	7,300	740,950.00	1.21
7	600859	王府井	41,028	730,298.40	1.19
8	000488	晨鸣纸业	36,900	723,609.00	1.18
9	01999	敏华控股	118,000	701,819.16	1.14
10	601688	华泰证券	29,300	662,766.00	1.08

#### **5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### **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投资。

#### **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情况。

#### **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

华泰证券股份有限公司于 2016 年 11 月 28 日收到中国证监会《行政处罚决定书》（机构部函[2016]126 号）。华泰证券未按照《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为，获利 18,235,275.00 元。证监会对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所得，并处罚款。

2017 年 1 月 18 日，华泰证券股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）行政监管措施决定书《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2017]3 号），华泰证券股份有限公司营业部及资产管理子公司分别利用同名微信公众号、官方网站向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品。上述行为违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》等相关规定，中国证监会对华泰证券股份有限公司采取责令改正的行政监督管理措施。

本基金管理人对该公司进行了深入的研究和分析，认为上述处罚措施，对公司的经营业绩有一定的影响，但影响有限。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	46,992.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	191,003.16
4	应收利息	11,080.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	249,076.37

#### 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债券投资。

#### 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	平安大华股息精选沪港深 A	平安大华股息精选沪港深 C
报告期期初基金份额总额	147,484,538.56	24,879,002.54
报告期期间基金总申购份额	511,259.62	325,261.43
减：报告期期间基金总赎回份额	94,363,216.54	19,726,478.98
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	53,632,581.64	5,477,784.99

## § 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持有本基金份额。

### 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 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三届董事会第二次会议通过，同意选举罗春风先生为第三届董事会董事长；同意聘任肖宇鹏先生为总经理；同意聘任付强先生、林婉文女士、汪涛先生为副总经理；同意聘任陈特正先生为督察长兼董事会秘书。

2、根据《通过港股通机制参与香港股票市场交易的公募基金注册审核指引》等相关法律规定，平安大华基金管理有限公司经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，本基金管理人决定对平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金合同中部分条款进行修订，进一步全面揭示投资港股的相关风险，修订后的《基金合同》于 2017 年 7 月 12 日生效。

## § 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股息精选沪港深股票型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华股息精选沪港深股票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) 报告期内平安大华股息精选沪港深股票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 10 月 25 日