

平安大华安享保本混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告

2017 年 12 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 1 月 19 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华安享保本混合
场内简称	-
交易代码	002282
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 2 月 3 日
报告期末基金份额总额	374,410,484.41 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	中国建设银行股份有限公司
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司

§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（2017年10月1日—2017年12月31日）
1. 本期已实现收益	1,363,857.62
2. 本期利润	-928,989.92
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0023
4. 期末基金资产净值	381,685,657.70
5. 期末基金份额净值	1.019

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

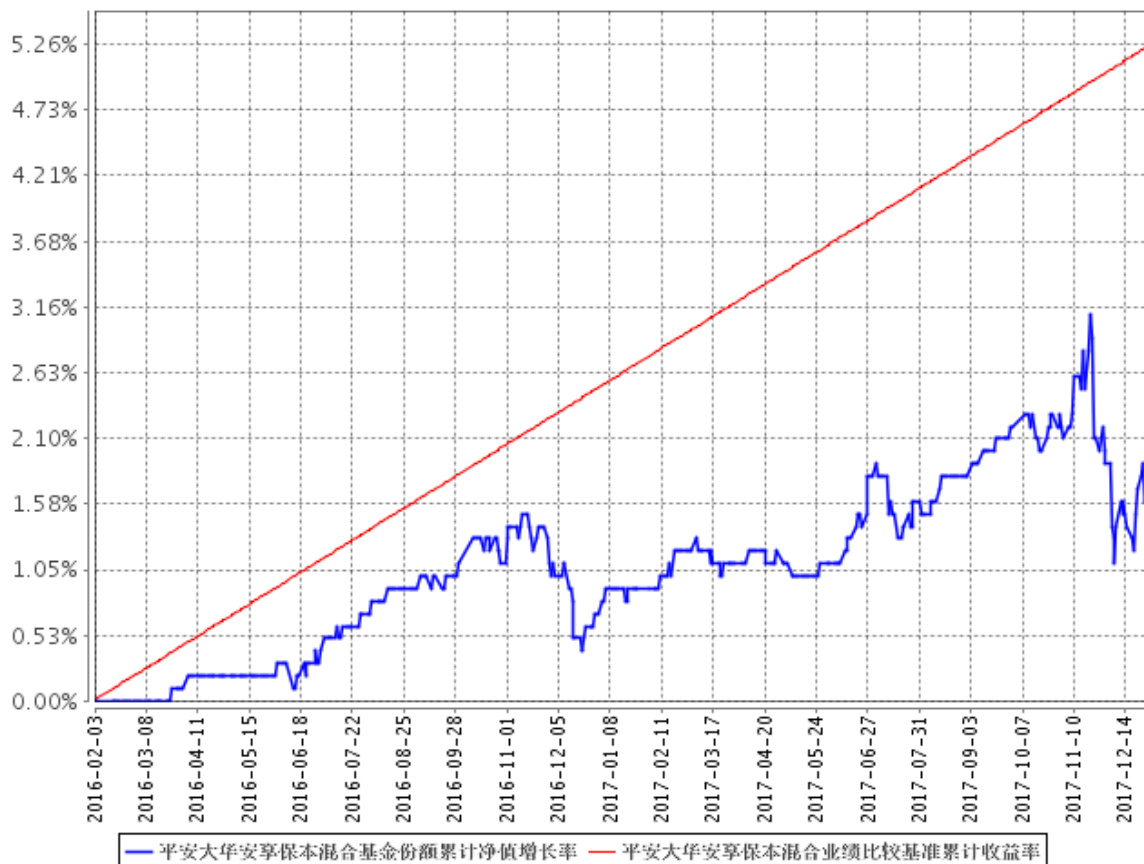
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.29%	0.19%	0.66%	0.01%	-0.95%	0.18%

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

平安大华安享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 02 月 03 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		
孙健	平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理、投资研究部执行总经理	2016 年 2 月 3 日	-	16	孙健先生，投资研究部执行总经理，基金经理，硕士。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，银华基金管理有限公司固定收益部副总监，银华货币市场基金基金经理、银华信用债券型基金基金经理。2011 年 9 月加入平安大华基金管理有限公司，现担任“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”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聘任日期和解聘日期。

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、《平安大华安享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

2017 年四季度国内宏观经济数据继续保持较强的韧性，整体下半年融资需求仍然旺盛，同时监管政策（如资管新规及其细则等）的逐步落地，给市场带来一定的调整压力；资金面整体依然偏紧，超储率仍然偏低，债券市场配置力量仍然较弱，导致整个四季度债券市场大幅调整，各类债券均跌幅惨重。保本基金在年初避险策略基金新规执行后一直处于调整稳健资产的状态，不断加大投资 AAA 等级短期信用债券、同业存单和政策性银行金融债券。本报告期内，本基金进一步置换了存量债券至高等级短期信用债券与同业存单，并且加大了权益资产包括可转债和股票的投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.019 元，份额累计净值为 1.019 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-0.29%，同期业绩基准增长率为 0.66%。

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	35,801,905.31	9.23
	其中：股票	35,801,905.31	9.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	339,029,891.44	87.37
	其中：债券	339,029,891.44	87.37
	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	3,000,000.00	0.77
	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	5,393,475.48	1.39
8	其他资产	4,819,102.14	1.24
9	合计	388,044,374.37	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	-	-
C	制造业	35,801,905.31	9.38
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	-	-
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	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	35,801,905.31	9.38

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

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	002597	金禾实业	568,700	14,740,704.00	3.86
2	300476	胜宏科技	568,400	13,613,180.00	3.57
3	603989	艾华集团	130,000	4,994,600.00	1.31
4	002322	理工环科	130,075	2,442,808.50	0.64
5	603228	景旺电子	100	5,377.00	0.00
6	601233	桐昆股份	169	3,800.81	0.00
7	603328	依顿电子	100	1,435.00	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	19,810,000.00	5.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	76,548,000.00	20.06
	其中：政策性金融债	57,226,000.00	14.99

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,394,000.00	21.06
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	27,969,891.44	7.33
8	同业存单	134,308,000.00	35.19
9	其他	-	-
10	合计	339,029,891.44	88.82

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	111712285	17 北京银行 CD285	500,000	48,135,000.00	12.61
2	111771238	17 宁波银行 CD243	500,000	47,455,000.00	12.43
3	011763006	17 首钢 SCP003	300,000	30,204,000.00	7.91
4	011778002	17 幸福基业 SCP001	200,000	20,110,000.00	5.27
5	041760011	17 京技投 CP001	200,000	20,086,000.00	5.26

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持仓。

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、广东依顿电子科技股份有限公司（以下简称“公司”）于 2017 年 1 月 5 日公告，公司收到中山市环境保护局《行政处罚告知书》（中环罚告字[2016 第 239 号]）。报告书显示公司因排放废水中总磷、总氮浓度超过公司持有的《广东省污染物排放许可证》中的规定的排放限值，中山市环保局依据《广东省环境保护条例》第六十六条第一款的规定：拟对公司罚款人民币十四万元。

本基金管理人对该公司进行了深入的研究和分析，认为该处罚未影响公司正常经营，也未对公司造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

2、宁波理工环境能源科技股份有限公司（以下简称“公司”）于 2017 年 1 月 4 日收到中国证券监督管理委员会宁波监管局《关于对宁波理工环境能源科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》，2015 年 12 月公司全资子公司北京尚洋东方环境科技股份有限公司（以下简称北京尚

洋)与北京汇诚时代投资咨询有限公司(以下简称北京汇诚)签订《债权转让合同》,转让北京尚洋持有的账面原值为 781.83 万元的应收账款。本次债权转让收益 222.39 万元,相应增加 2015 年度净利润 189.03 万元。上述交易性质特殊,且具有偶发性,但公司未将上述收益确认为非经常性损益,导致公司 2016 年 4 月 21 日披露的 2015 年年报中的 2015 年度非经常性损益少计 189.03 万元,归属于上市公司股东的净利润多计 189.03 万元,并导致公司同日披露的《关于北京尚洋东方环境科技有限公司 2015 年度未达成业绩承诺暨相应股份补偿的公告》中北京尚洋 2015 年度经审计的扣除非经常性损益后归属于母公司股东的净利润多计 189.03 万元。中国证券监督管理委员会宁波监管局对公司采取责令改正的监管措施。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项对公司经营及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投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告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	28,984.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,789,821.69
5	应收申购款	296.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,819,102.14

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	110034	九州转债	6,773,940.70	1.77

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

报告期期初基金份额总额	422,369,085.54
报告期期间基金总申购份额	42,257.45
减:报告期期间基金总赎回份额	48,000,858.58
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	374,410,484.41

§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 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安享保本混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华安享保本混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华安享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享保本混合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

2018 年 1 月 19 日