

# 平安大华安心保本混合型证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2018 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华安心保本混合
场内简称	-
基金主代码	002304
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 1 月 15 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
报告期末基金份额总额	741,652,480.86 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安大华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	王永民
	联系电话	0755-22626828	010-66594896
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566

传真	0755-23997878	010-66594942
----	---------------	--------------

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年 1 月 15 日 (基金合同生效日)– 2016 年 12 月 31 日	2015 年
本期已实现收益	19,232,689.46	20,306,477.09	-
本期利润	18,373,985.64	13,300,198.76	-
加权平均基金份额本期利润	0.0188	0.0094	-
本期基金份额净值增长率	1.68%	0.90%	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0261	0.0087	-
期末基金资产净值	760,980,400.45	1,299,908,219.47	-
期末基金份额净值	1.026	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. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上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 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	份额净值 增长率①	份额净值 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
----	--------------	---------------------	--------------------	-----------------------	-----	-----

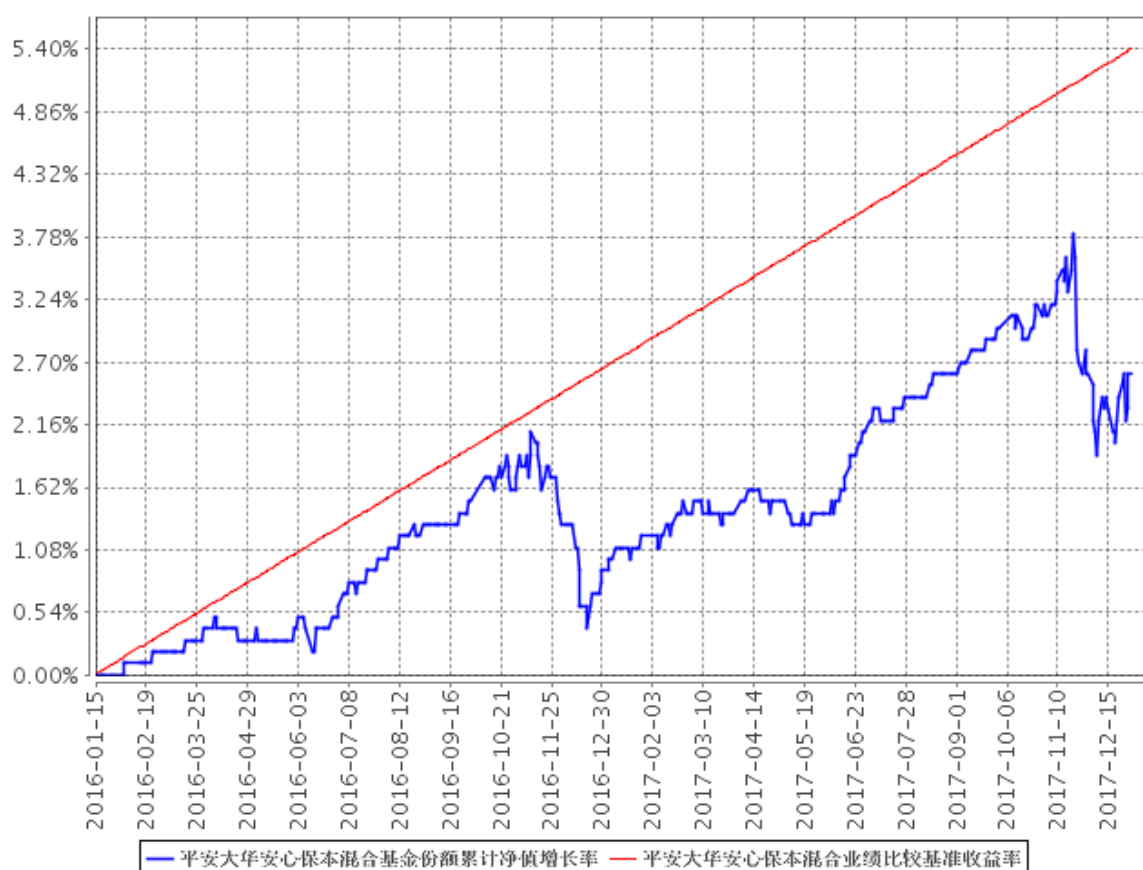
过去三个月	-0.39%	0.17%	0.66%	0.01%	-1.05%	0.16%
过去六个月	0.49%	0.12%	1.33%	0.01%	-0.84%	0.11%
过去一年	1.68%	0.10%	2.68%	0.01%	-1.00%	0.09%
自基金合同生效起至今	2.60%	0.08%	5.40%	0.01%	-2.80%	0.07%

注：1、本基金是保本型基金，保本周期为三年。在目前国内金融市场环境下，银行定期存款类似保本定息产品，因此，本基金以每个保本期起始日的三年银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，可以合理地衡量比较基金保本的有效性，能够使投资人理性判断本基金产品的风险收益特征。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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

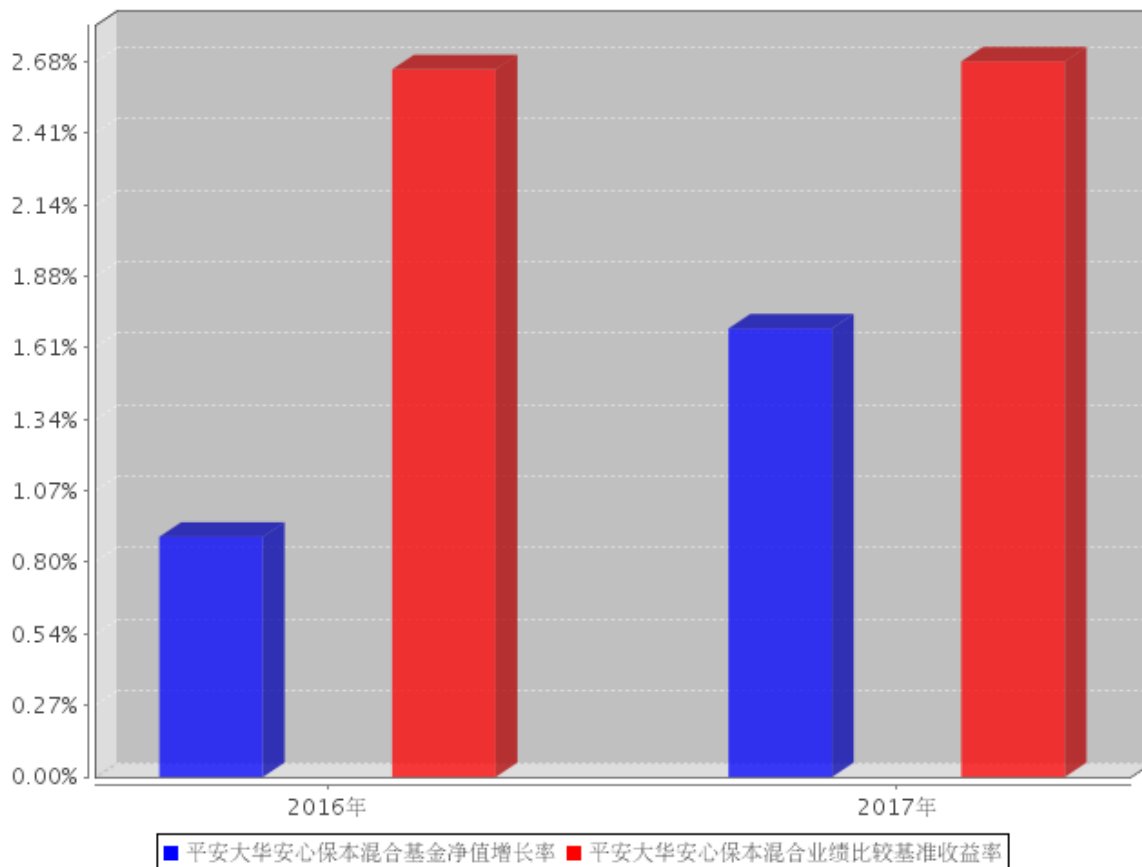
平安大华安心保本混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2016 年 1 月 15 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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安大华安心保本混合自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



1. 本基金合同于 2016 年 1 月 15 日正式生效，截止报告期末已满一年。
2. 2016 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
合计	-	-	-	-	

本基金合同于 2016 年 1 月 15 日正式生效，自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可

【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 3 亿元人民币，是目前中国内地基金业注册资本金最高的基金公司之一。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股权 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。

平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2017 年 12 月 31 日，平安基金共管理 46 只公募基金，资产管理总规模 1795 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙健	平安大华安心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 1 月 15 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。
- 3、自 2018 年 3 月 6 日起孙健不再担任本基金的基金经理，该事项已按规定在中国基金业协会办理注销手续。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华安心保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安大华基金管理有限责任公司公平交易管理制度》、《平安大华基金管理有限责任公司异常交易监控及报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重



大非公开投资信息相互隔离。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期连续四个季度期间内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金 2017 年操作主要以调整债券持仓结构，提升债券信用等级为主，缩短平均债券存续期限至保本剩余周期左右，将大部分债券信用提升至 AAA，进行了利率债券和可转债波段操作。由于全年债券市场一直处于利率上行环境，利率债券缺乏趋势性投资机会，信用债券调仓有较大的流动性摩擦成本，对本基金净值有一定损失。市场监管环境日趋严厉，对资产管理行业和流动性监管的政策使得未来债券市场仍将延续调整格局。2017 年全年经济增速回升至接近 7% 的较高水平，随着十九大胜利召开，中国未来政治和经济格局达到全新的稳定预期，经济数据回暖和社会信心增强使得风险偏好提升，风险资产特别是低估值稳定增长预期的风险资产出现较大价值回归之路，预计 2018 年仍将延续这一价值主线投资风格。随着再融资政策和减持政策新规出台，大量企业发行可转债融资，给可转债市场提供了非常多的可投资标的，在风险预期提升的市场环境，可转债投资将是增强基金组合收益的重要来源。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.026 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.68%，业绩比较基准收益率为 2.68%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年预计债券收益率和股票收益率重新达到新的平衡，市场偏好使得风险资产仍有上冲空间，包括美联储加息进程，国内金融去杠杆进程，通货膨胀回升进程，都将延续债券收益高位震荡的时间，随着风险资产长期估值到位并且泡沫化，将迎来债券类资产中期布局的机会，未来做好风险资产和无风险资产的转化是配置重点。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值工作组的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约

定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华安心保本混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### **§ 6 审计报告**

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 22930 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安大华安心保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了平安大华安心保本混合基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安大华安心保本混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	平安大华安心保本混合基金的基金管理人平安大华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安大华安心保本混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算平安大华安心保本混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督平安大华安心保本混合基金的财务报

	告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对平安大华安心保本混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致平安大华安心保本混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审</p>

	计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	曹翠丽	边晓红
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2018 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安大华安心保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		4,665,029.50	200,347,232.07
结算备付金		1,611,585.38	3,026,638.97
存出保证金		56,253.08	167,052.65
交易性金融资产		699,720,967.90	1,085,578,763.00
其中：股票投资		72,513,800.06	2,555,965.40
基金投资		-	-
债券投资		627,207,167.84	1,057,977,797.60
资产支持证券投资		-	25,045,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		48,550,132.83	50,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		8,265,141.88	15,732,596.40
应收股利		-	-
应收申购款		199.28	13,456.99
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		762,869,309.85	1,354,865,740.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	50,000,000.00
应付赎回款		560,765.83	2,284,439.12
应付管理人报酬		785,907.09	1,344,078.99
应付托管费		130,984.54	224,013.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		119,847.25	877,030.40
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		291,404.69	227,958.94
负债合计		1,888,909.40	54,957,520.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		741,652,480.86	1,288,664,201.70
未分配利润		19,327,919.59	11,244,017.77
所有者权益合计		760,980,400.45	1,299,908,219.47
负债和所有者权益总计		762,869,309.85	1,354,865,740.08

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.026 元，基金份额总额 741,652,480.86 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安大华安心保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 15 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		35,178,086.14	35,023,507.83
1. 利息收入		38,967,415.73	34,231,864.99
其中：存款利息收入		340,907.76	5,303,886.58
债券利息收入		37,943,060.03	22,363,750.55
资产支持证券利息收入		407,113.56	712,678.12
买入返售金融资产收入		276,334.38	5,851,549.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,058,246.35	6,382,741.36
其中：股票投资收益		5,570,898.03	2,606,606.76

基金投资收益		-	-
债券投资收益		-10,659,011.88	3,684,052.78
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		29,867.50	92,081.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-858,703.82	-7,006,278.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		2,127,620.58	1,415,179.81
<b>减：二、费用</b>		16,804,100.50	21,723,309.07
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	11,999,575.29	16,470,475.72
2. 托管费	7.4.8.2.2	1,999,929.32	2,745,079.26
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		683,340.39	2,074,895.51
5. 利息支出		1,671,075.54	7,878.21
其中：卖出回购金融资产支出		1,671,075.54	7,878.21
6. 其他费用		450,179.96	424,980.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		18,373,985.64	13,300,198.76
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		18,373,985.64	13,300,198.76

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华安心保本混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,288,664,201.70	11,244,017.77	1,299,908,219.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	18,373,985.64	18,373,985.64



三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-547,011,720.84	-10,290,083.82	-557,301,804.66
其中：1. 基金申购款	337,014.98	6,756.29	343,771.27
2. 基金赎回款	-547,348,735.82	-10,296,840.11	-557,645,575.93
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	741,652,480.86	19,327,919.59	760,980,400.45
项目	上年度可比期间 2016年1月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,488,706,962.48	-	1,488,706,962.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	13,300,198.76	13,300,198.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-200,042,760.78	-2,056,180.99	-202,098,941.77
其中：1. 基金申购款	2,768,150.11	11,752.28	2,779,902.39
2. 基金赎回款	-202,810,910.89	-2,067,933.27	-204,878,844.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,288,664,201.70	11,244,017.77	1,299,908,219.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

基金管理人负责人

林婉文

主管会计工作负责人

胡明

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

平安大华安心保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2997号《关于准予平安大华安心保本混合型证券投资基金注册的批复》核准,由平安大华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华安心保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,488,464,952.44元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第050号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华安心保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年1月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,488,706,962.48份基金份额,其中认购资金利息折合242,010.04份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”),担保人为中国投融资担保股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华安心保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、国债期货、股指期货、权证和货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将投资对象主要分为稳健资产和风险资产,其中稳健资产包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、可转换债券(含分离型可转换债券)、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、中期票据、次级债券、中小企业私募债等法律法规和中国证监会允许基金投资的固定收益资产、国债期货、现金等货币市场工具等;风险资产为股票、权证、股指期货等。本基金的业绩比较基准为:每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率。

于2017年12月31日,本基金的保本期安排列示如下:

保本期到期日	份额数	最大保本线	截止2017年 12月31日基金份 额净值
2019年1月14日	739,650,965.29	1.000	1.026

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券

投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安大华安心保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金的会计政策和会计估计详见本基金年报正文。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券

的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理有限公司(“平安大华”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
上海陆金所基金销售有限公司	基金管理人最终控股母公司的联营公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
平安证券	57,030,738.38	11.34%	53,910,347.56	3.80%

#### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
平安证券	184,892,959.46	52.97%	86,714,419.48	52.54%

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
平安证券	77,300,000.00	5.88%	-	-

#### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
平安证券	53,112.57	12.98%	9,154.20	7.85%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日			

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	50,206.91	4.10%	18,844.60	2.15%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月15日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,999,575.29	16,470,475.72
其中：支付销售机构的客户维护费	4,110,682.71	5,613,639.19

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月15日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,999,929.32	2,745,079.26

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

### 7.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方的销售服务费。

## 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月15日(基金合同生效日)至 2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	4,665,029.50	321,736.91	200,347,232.07	1,973,407.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 135,472,967.90 元，属于第二层次的余额为 564,248,000.00 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 8,271,857.70 元，第二层次 1,077,306,905.30 元，无属于第三层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。



## (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	72,513,800.06	9.51
	其中：股票	72,513,800.06	9.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	627,207,167.84	82.22
	其中：债券	627,207,167.84	82.22
	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	48,550,132.83	6.36
	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	6,276,614.88	0.82
8	其他各项资产	8,321,594.24	1.09
9	合计	762,869,309.85	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,502,110.06	9.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,690.00	0.00
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	72,513,800.06	9.53

### 8.2.2 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持有港股通股票。

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	1,455,000	34,847,250.00	4.58
2	002597	金禾实业	785,900	20,370,528.00	2.68
3	603989	艾华集团	303,000	11,641,260.00	1.53
4	002322	理工环科	300,077	5,635,446.06	0.74
5	600856	中天能源	1,000	11,690.00	0.00
6	603228	景旺电子	100	5,377.00	0.00
7	601233	桐昆股份	100	2,249.00	0.00

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	37,394,776.80	2.88
2	002597	金禾实业	17,641,512.67	1.36
3	603328	依顿电子	13,779,574.91	1.06
4	603989	艾华集团	12,769,037.00	0.98
5	601229	上海银行	11,253,986.14	0.87
6	601233	桐昆股份	10,617,944.96	0.82
7	600845	宝信软件	10,412,979.81	0.80
8	601377	兴业证券	9,877,700.00	0.76
9	601788	光大证券	8,651,316.86	0.67
10	000415	渤海金控	8,534,859.00	0.66
11	600120	浙江东方	8,458,600.00	0.65
12	002322	理工环科	8,141,008.30	0.63
13	601098	中南传媒	7,769,127.00	0.60
14	601198	东兴证券	7,300,043.00	0.56

15	600835	上海机电	6,355,827.20	0.49
16	600343	航天动力	6,138,856.00	0.47
17	300101	振芯科技	6,052,147.40	0.47
18	600970	中材国际	5,989,230.00	0.46
19	300166	东方国信	5,513,862.26	0.42
20	601688	华泰证券	4,871,549.00	0.37

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601233	桐昆股份	12,607,723.93	0.97
2	603328	依顿电子	12,435,344.26	0.96
3	601229	上海银行	11,632,708.47	0.89
4	600845	宝信软件	10,762,909.36	0.83
5	601377	兴业证券	9,968,016.00	0.77
6	601788	光大证券	8,703,742.40	0.67
7	600120	浙江东方	8,587,118.00	0.66
8	000415	渤海金控	8,484,022.00	0.65
9	601098	中南传媒	7,968,848.62	0.61
10	601198	东兴证券	7,325,954.34	0.56
11	600835	上海机电	6,591,736.13	0.51
12	600970	中材国际	6,327,572.00	0.49
13	300101	振芯科技	6,243,293.67	0.48
14	600343	航天动力	6,019,153.42	0.46
15	300166	东方国信	5,446,506.62	0.42
16	601688	华泰证券	4,976,147.90	0.38
17	600372	中航电子	4,684,557.52	0.36
18	601766	中国中车	3,919,231.70	0.30
19	002013	中航机电	3,735,172.87	0.29
20	300410	正业科技	3,732,313.22	0.29

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	284,405,994.65
卖出股票收入（成交）总额	218,585,792.14

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	121,582,000.00	15.98
	其中：政策性金融债	102,260,000.00	13.44
4	企业债券	29,214,000.00	3.84
5	企业短期融资券	220,391,000.00	28.96
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	62,959,167.84	8.27
8	同业存单	193,061,000.00	25.37
9	其他	-	-
10	合计	627,207,167.84	82.42

## 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111712285	17 北京银行 CD285	1,000,000	96,270,000.00	12.65
2	041760011	17 京技投 CP001	500,000	50,215,000.00	6.60
3	011766035	17 湘高速 SCP004	500,000	49,970,000.00	6.57
4	111714354	17 江苏银行 CD354	500,000	48,740,000.00	6.40
5	041753009	17 中铝 CP001	400,000	40,144,000.00	5.28

## 8.7 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。

## 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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九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。

### 8.12.2

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	56,253.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,265,141.88
5	应收申购款	199.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,321,594.24

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110034	九州转债	30,852,747.50	4.05
2	128015	久其转债	953,700.00	0.13

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,009	184,996.88	2,982,527.36	0.40%	738,669,953.50	99.60%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	99.10	0.0000%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年1月15日）基金份额总额	1,488,706,962.48
本报告期期初基金份额总额	1,288,664,201.70
本报告期基金总申购份额	337,014.98
减:本报告期基金总赎回份额	547,348,735.82
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	741,652,480.86



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、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，由付强先生任职公司副总经理，任职日期为 2017 年 1 月 20 日。

2、经平安大华基金管理有限公司第四次职工代表大会审议通过，由李峥女士接替毛晴峰为第三届监事会职工监事，任职日期为 2017 年 2 月 17 日。

3、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由李兆良先生、李娟娟女士、刘雪生先生、潘汉腾先生接替曹勇先生、刘茂山先生、郑学定先生、黄士林先生任职公司第三届董事会董事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

4、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由巢傲文先生接替张云平为第三届监事会监事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

5、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，任职日期为 2017 年 7 月 13 日。

6、2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按照相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 85,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	78,696,917.13	15.65%	73,290.16	17.91%	-
民生证券	2	67,668,491.73	13.46%	49,485.19	12.09%	-
平安证券	2	57,030,738.38	11.34%	53,112.57	12.98%	-
兴业证券	2	41,300,792.24	8.21%	29,384.30	7.18%	-
华泰证券	1	34,092,771.75	6.78%	24,250.62	5.93%	-
国信证券	2	28,520,370.07	5.67%	20,857.10	5.10%	-
东方证券	2	24,220,068.47	4.82%	17,711.99	4.33%	-
长江证券	1	21,923,916.12	4.36%	20,417.77	4.99%	-
中泰证券	1	20,466,122.09	4.07%	14,557.46	3.56%	-
中金公司	2	14,787,312.77	2.94%	13,771.31	3.37%	-
西南证券	1	14,375,445.16	2.86%	10,225.27	2.50%	-
浙商证券	2	13,166,433.00	2.62%	9,365.20	2.29%	新增
广发证券	1	13,028,738.40	2.59%	12,133.68	2.97%	-
国泰君安	2	9,579,649.61	1.90%	6,813.65	1.67%	新增
国金证券	1	9,579,085.00	1.90%	8,920.96	2.18%	-
中信证券	2	8,998,111.77	1.79%	8,379.90	2.05%	-
方正证券	2	7,607,339.51	1.51%	7,084.74	1.73%	-
申万证券	2	6,800,483.81	1.35%	6,333.22	1.55%	-
西藏东方财富	2	6,513,277.40	1.30%	4,632.84	1.13%	新增
中信建投	1	6,432,689.00	1.28%	4,704.17	1.15%	-
中银国际	1	5,972,589.00	1.19%	4,248.53	1.04%	-
华信证券	2	4,185,550.96	0.83%	2,977.15	0.73%	新增
银河证券	2	3,625,428.17	0.72%	3,376.44	0.83%	-
安信证券	2	2,679,839.26	0.53%	1,959.76	0.48%	-

南京证券	1	1,630,527.00	0.32%	1,159.78	0.28%	新增
国海证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	15,553,281.20	4.46%	22,000,000.00	1.67%	-	-
民生证券	3,071,859.33	0.88%	134,000,000.00	10.20%	-	-
平安证券	184,892,959.46	52.97%	77,300,000.00	5.88%	-	-
兴业证券	9,273,934.42	2.66%	90,000,000.00	6.85%	-	-
华泰证券	25,300,757.63	7.25%	10,000,000.00	0.76%	-	-
国信证券	2,194,529.74	0.63%	20,000,000.00	1.52%	-	-
东方证券	37,672,068.54	10.79%	99,500,000.00	7.57%	-	-
长江证券	5,448,214.94	1.56%	106,000,000.00	8.07%	-	-
中泰证券	-	-	12,000,000.00	0.91%	-	-
中金公司	-	-	10,000,000.00	0.76%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	1,000,000.00	0.08%	-	-
广发证券	4,966,683.98	1.42%	10,000,000.00	0.76%	-	-
国泰君安	11,360,692.20	3.25%	129,500,000.00	9.85%	-	-
国金证券	4,847,970.75	1.39%	50,000,000.00	3.80%	-	-

中信证券	3,426,411.30	0.98%	49,000,000.00	3.73%	-	-
方正证券	7,249,352.19	2.08%	-	-	-	-
申万证券	203,287.20	0.06%	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	5,521,478.29	1.58%	83,000,000.00	6.32%	-	-
中银国际	8,132,325.40	2.33%	88,000,000.00	6.70%	-	-
华信证券	-	-	56,000,000.00	4.26%	-	-
银河证券	2,646,958.76	0.76%	127,000,000.00	9.66%	-	-
安信证券	14,239,558.71	4.08%	55,000,000.00	4.19%	-	-
南京证券	3,049,579.46	0.87%	14,800,000.00	1.13%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	70,000,000.00	5.33%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

平安大华基金管理有限公司  
2018年3月29日