

# 平安大华安享保本混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告

2018 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 7 月 18 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 7 月 17 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 2018 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	273,980,239.03 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（2018年4月1日—2018年6月30日）
1. 本期已实现收益	-4,419,250.74
2. 本期利润	-1,753,597.97
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0060
4. 期末基金资产净值	277,901,987.43
5. 期末基金份额净值	1.014

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

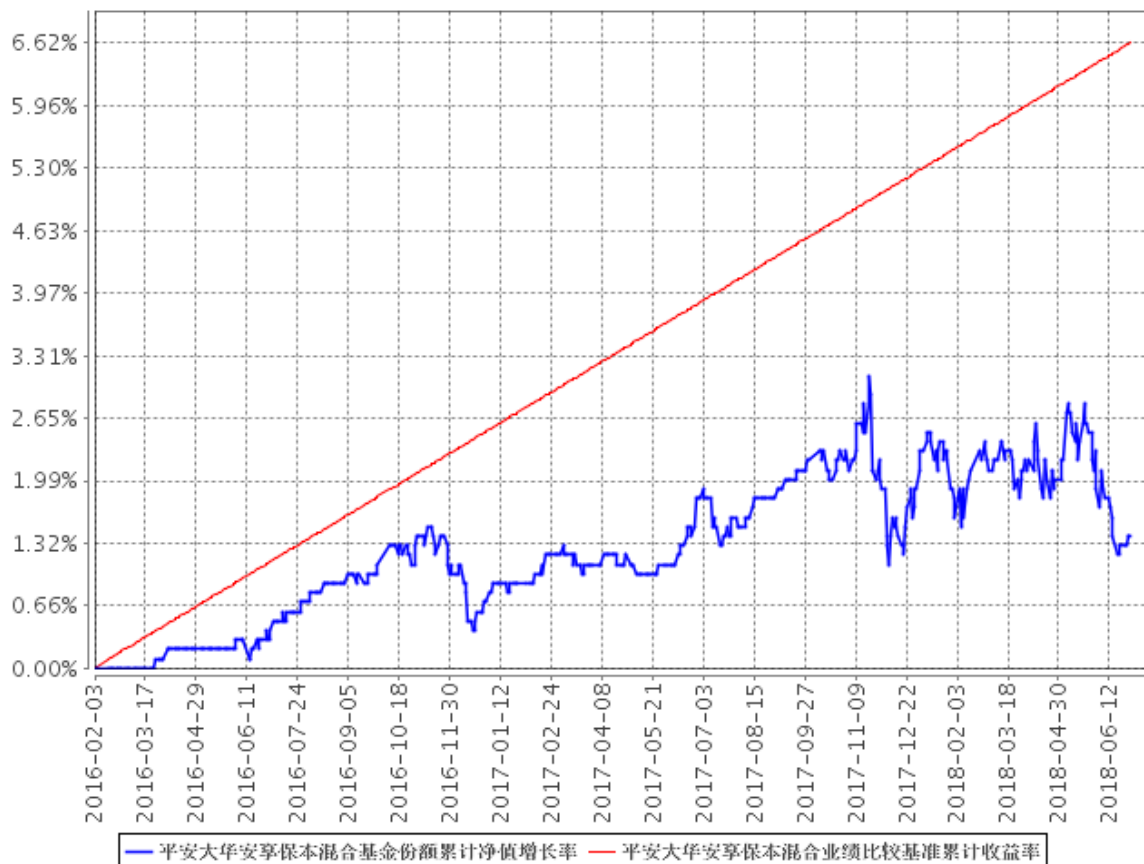
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.69%	0.18%	0.65%	0.01%	-1.34%	0.17%

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，截至报告期末已满两年；
- 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基金合同约定。

### 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		
张恒	平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理	2018 年 2 月 8 日	-	6	张恒，西南财经大学硕士研究生。曾先后任职于华泰证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫基金、景顺长城基金，2015 年起在第一创业证券历任投资经理、高级投资经理、投资主办人。2017 年 11 月加入平安大华基金管理有限公司，任固定收益投资部投资经理。现任“平安大华鑫荣混合型证券投资基金”、“平安大华惠融纯债债券型证券投资基金”、“平安大华惠益纯债债券型证券投资基金”、“平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金”、“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”、“平安大华惠安纯债债券型证券投资基金”基金经理。

高勇标	平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理	2018 年 3 月 16 日	-	7	高勇标先生，西南财经大学硕士研究生，曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017 年 4 月加入平安大华基金管理有限公司，任投资研究部固定收益组投资经理，现任平安大华鼎弘混合型证券投资基金、平安大华惠悦纯债债券型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、平安大华鼎洋纯债债券型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华鑫安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

二季度宏观经济运行平稳，但社会融资余额增速低于预期；通胀水平维持较低水平，资金面保持相对宽松。政策方面，央行在 4 月份宣布降准并部分用于置换 MLF，之后央行扩大 MLF 担保品范围，6 月并未跟随美国加息，并且再次宣布定向降准；在此期间，中美贸易战持续发酵，市场避险情绪升温，利率债和高等级信用债收益率持续下行。而低等级信用债受金融强监管，债务违约等影响，信用利差反而不断扩大，基金净值表现相对平稳。

权益市场方面，二季度在金融去杠杆背景下，企业资金骤然收紧，信用风险上升，叠加中美贸易战，投资者风险偏好出现明显下降，市场也出现较大幅度下调。目前我国正处在经济转型的关键时期，只有依靠创新，提升经济的活力和效率，才能帮助我国经济实现顺利转型、保持平稳增长。因此，创新领域或将是股市在中长期内的投资主线。

### 4.5 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 1.014 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.69%，业绩比较基准收益率为 0.65%。

### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	308,890,072.30	81.96
	其中：债券	288,890,072.30	76.65
	资产支持证券	20,000,000.00	5.31
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	52,321,926.69	13.88
8	其他资产	15,664,359.29	4.16
9	合计	376,876,358.28	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。



#### 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	35,848,800.00	12.90
	其中：政策性金融债	16,060,800.00	5.78
4	企业债券	64,234,272.30	23.11
5	企业短期融资券	70,283,000.00	25.29
6	中期票据	80,221,000.00	28.87
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	38,303,000.00	13.78
9	其他	-	-
10	合计	288,890,072.30	103.95

#### 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	111771238	17 宁波银行 CD243	300,000	28,650,000.00	10.31
2	101456010	14 云城投 MTN001	200,000	20,318,000.00	7.31
3	1182338	11 方正 MTN2	200,000	20,238,000.00	7.28
4	011800410	18 西安高新 SCP003	200,000	20,118,000.00	7.24
5	011800037	18 晋煤 SCP001	200,000	20,110,000.00	7.24

#### 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	149380	18 花 06A1	200,000	20,000,000.00	7.20

#### 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。

## 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

2017 年 12 月 22 日，根据上海证券交易所《关于对方正科技集团股份有限公司、控股股东北方方正集团有限公司及其一致行动人和有关责任人予以纪律处分的决定》，方正集团、武汉国兴未披露一致行动人关系，该行为严重违反了《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 2 号—年度报告的内容与格式（2016 年修订）式》第四十条、第四十六条和《上海证券交易所股票上市规则》第 1.4 条、第 2.1 条、第 2.3 条、第 2.5 条、第 2.7 条、第 2.22 条、第 10.2.5 条等有关

规定。对方正科技集团股份有限公司、控股股东北大方正集团有限公司及其一致行动人武汉国兴科技发展有限公司、方正集团有限公司主要负责人李友、方正科技集团股份有限公司时任董事长方中华、易梅予以公开谴责；对历任董事会秘书、副总裁、董事、总裁侯郁波，时任财务总监兼董事李晓勤，时任董事兼北大方正集团有限公司财务部副总裁徐文彬、千新国，时任董事长刘欲晓，时任总裁朱兆庆，时任副总经理胡永栓、贾朝心，时任副总裁黄肖锋，时任独立董事傅林生、何明珂、王善迈、董黎明，时任监事邱泽珺、蒋艳华予以通报批评。

本基金管理人认为，该事项对公司的生产经营不会造成重大不利影响，我们对该证券的投资严格执行了内部投资决策流程，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。

#### 5.11.2

本基金本报告期末未投资股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	63,882.71
2	应收证券清算款	10,100,589.90
3	应收股利	-
4	应收利息	5,499,886.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,664,359.29

#### 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

本基金本报告期末未投资股票。

### 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	313,474,419.67
报告期期间基金总申购份额	56,729.86
减：报告期期间基金总赎回份额	39,550,910.50
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	273,980,239.03

## §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 7 月 18 日