

平安大华安心保本混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
7.6 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.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
7.8 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.....	55
7.9 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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.3 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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
10.2 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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	63
§11 备查文件目录.....	65

11.1 备查文件目录.....	65
11.2 存放地点.....	65
11.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华安心保本混合型证券投资基金
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	490,982,169.63 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。

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
注册地址		深圳市福田区福田街道益田	北京市西城区复兴门内大街 1

	路 5033 号平安金融中心 34 层	号
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	罗春风	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司	北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦写字楼 9 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-4,077,252.36
本期利润	1,693,342.38
加权平均基金份额本期利润	0.0029
本期加权平均净值利润率	0.28%
本期基金份额净值增长率	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	12,151,768.50
期末可供分配基金份额利润	0.0247
期末基金资产净值	504,441,740.29
期末基金份额净值	1.027
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.70%

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

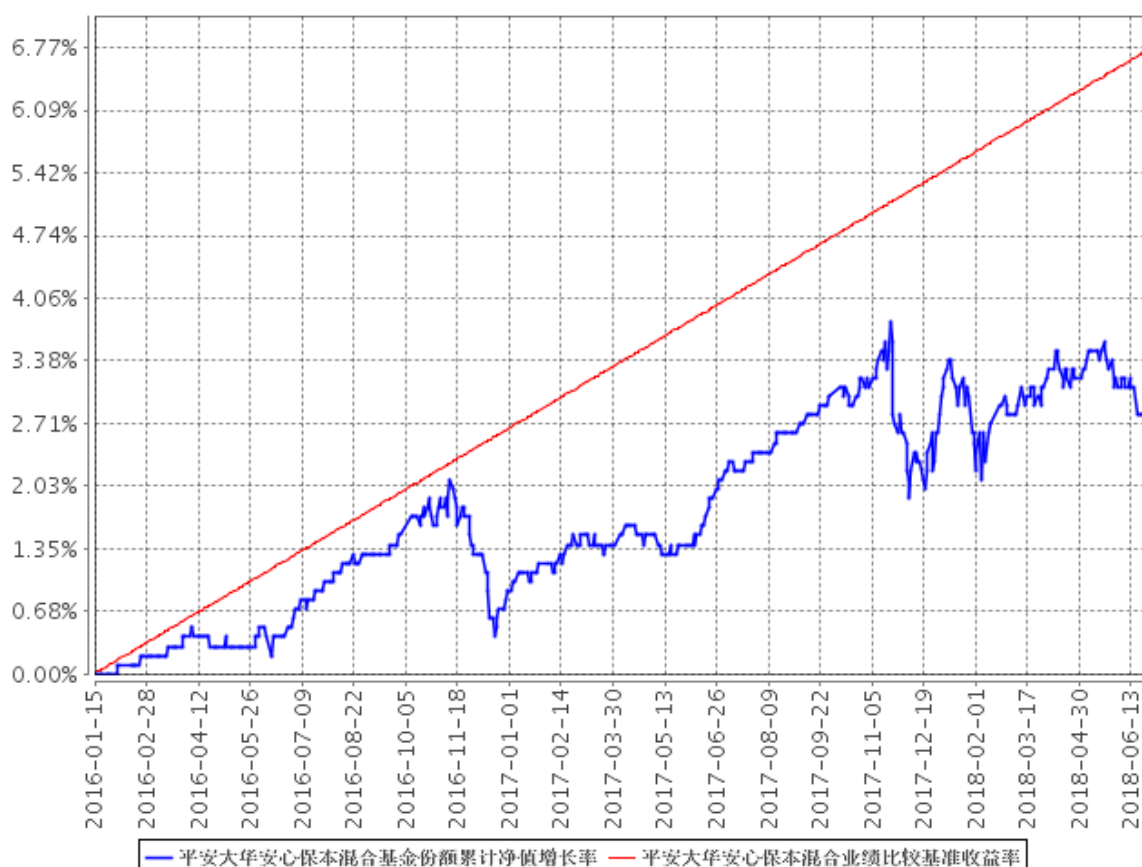
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.48%	0.11%	0.21%	0.01%	-0.69%	0.10%
过去三个月	-0.39%	0.10%	0.65%	0.01%	-1.04%	0.09%
过去六个月	0.10%	0.13%	1.29%	0.01%	-1.19%	0.12%
过去一年	0.59%	0.13%	2.64%	0.01%	-2.05%	0.12%
自基金合同生效起至今	2.70%	0.10%	6.77%	0.01%	-4.07%	0.09%

注：1、本基金是保本型基金，保本周期为三年，保本但不保证收益率。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“平安大华基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917号文批准设立。平安大华基金总部位于深圳，注册资本为 3 亿元人民币，是目前中国内地基金业注册资本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%。平安大华基金秉承“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 2018 年 6 月 30 日，平安大华基金共管理 57 只公募基金，资产管理总规模 2442 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		
张恒	平安大华安心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。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。
刘俊廷	平安大华安心保本混合型证券投资基金的基金经理	2018年6月29日	-	6	刘俊廷先生，中国科学院研究生院硕士，曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎弘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、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华保本混合型证券投资基金基金经理。
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	2018年3月6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公司，任投资研究部固定收益研究员，曾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

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。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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 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

上半年债券市场是在货币政策边际宽松与社会融资需求走弱的两条主逻辑下，同时叠加中美

贸易摩擦与权益市场波动率上升等因素，利率债和高等级收益债收益率一路下行，而低等级和城投、民企等信用债收益率则大幅攀升，债市呈现出结构性牛市。随着货币政策的继续放松及监管的边际转向，中低等级信用债收益率也开始出现下行，债市开始呈现全面牛市的格局。本报告期内，本基金以高等级债券配置为主，同时配以一定杠杆率，适度参与利率债波段交易操作。

权益市场方面，目前 A 股不再是典型普涨普跌牛熊市，个股区间涨幅已是南辕北辙。资本市场改革及国际化正在深刻改变 A 股原有生态，“劣币驱逐良币”的历史一去不复返，绩优股的牛市仍在进行，绩劣股熊市愈演愈烈。因此在报告期内的投资标的选择上，本基金更关注主板中绩优、低估、高分红的蓝筹龙马，或者是中小创中业绩真实、内生成长的新经济领军企业。

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 1.027 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.10%，业绩比较基准收益率为 1.29%。

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 年上半年，伴随国内金融强监管、中美贸易摩擦、汇率变化等因素，市场震荡下跌，风险偏好回落。在此背景下，经济增速或将有所放缓，但更加高质量、可持续。经济总体稳中趋缓、稳中有进、均衡发展。我国经济有韧性、外汇储备充足、汇率预期稳定，也决定了人民币汇率贬值空间有限。短期极端悲观的情绪使得市场已经处于中期的底部区域。风雨之后，彩虹可期。展望 2018 年下半年，投资风格上，追求业绩的确定性依旧是市场的主线，市场风格之争将逐步淡化，业绩为王依旧为贯穿全年的投资逻辑。本基金认为经济基本面在中长期仍然面临较大的下行压力，但政策的边际转向将会在一定程度上有助于社融的企稳甚至回升，再加上财政政策未来可能加大力度，今年表现较弱的基建投资有望企稳、反弹。上半年融资收缩导致债市走牛的主逻辑可能遭到破坏，未来长端利率债波动有望加大；而信用环境则可能边际改善，信用债环境相对较上半年更为友善，信用债尤其是中等资质信用债性价比有望提升。

4.6 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委员会，成员由投资管理部门、研究中心、资本市场风控监控室、基

金运营部基金会计室及法律合规监察部相关人员组成。基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。

估值委员会的职责主要包括有：制订健全有效的估值政策和程序；定期对估值政策和程序进行评价等；保证基金估值的公平、合理；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；估值委员会成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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 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 万元的情形。

§ 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	66,032,342.11	4,665,029.50
结算备付金		101,611.07	1,611,585.38
存出保证金		36,077.79	56,253.08
交易性金融资产	6.4.7.2	433,181,536.25	699,720,967.90
其中：股票投资		38,313,397.95	72,513,800.06
基金投资		-	-
债券投资		394,868,138.30	627,207,167.84
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	48,550,132.83
应收证券清算款		106,030.90	-
应收利息	6.4.7.5	7,168,226.49	8,265,141.88
应收股利		-	-
应收申购款		298.92	199.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		506,626,123.53	762,869,309.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		843,133.39	-
应付赎回款		465,880.30	560,765.83
应付管理人报酬		506,702.25	785,907.09
应付托管费		84,450.38	130,984.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	63,815.40	119,847.25

应交税费		16,955.13	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	203,446.39	291,404.69
负债合计		2,184,383.24	1,888,909.40
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	490,982,169.63	741,652,480.86
未分配利润	6.4.7.10	13,459,570.66	19,327,919.59
所有者权益合计		504,441,740.29	760,980,400.45
负债和所有者权益总计		506,626,123.53	762,869,309.85

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.027 元，基金份额总额 490,982,169.63 份。

6.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		6,980,957.11	22,948,366.55
1.利息收入		13,124,126.24	20,984,400.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	71,477.70	259,468.09
债券利息收入		12,952,885.08	20,245,167.89
资产支持证券利息收入		-	298,114.57
买入返售金融资产收入		99,763.46	181,650.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-12,581,810.80	-297,173.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,696,582.58	3,506,550.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-9,224,741.83	-3,815,518.08
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	339,513.61	11,794.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,770,594.74	917,526.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	668,046.93	1,343,613.24
减：二、费用		5,287,614.73	9,111,763.03

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,551,910.81	6,805,047.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	591,985.13	1,134,174.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	253,901.00	474,366.26
5. 利息支出		642,275.41	465,383.32
其中：卖出回购金融资产支出		642,275.41	465,383.32
6. 税金及附加		17,742.30	-
7. 其他费用	6.4.7.20	229,800.08	232,791.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,693,342.38	13,836,603.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,693,342.38	13,836,603.52

6.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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）	741,652,480.86	19,327,919.59	760,980,400.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,693,342.38	1,693,342.38
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）	-250,670,311.23	-7,561,691.31	-258,232,002.54
其中：1.基金申购款	300,352.78	9,187.08	309,539.86
2.基金赎回款	-250,970,664.01	-7,570,878.39	-258,541,542.40
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）	490,982,169.63	13,459,570.66	504,441,740.29

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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(本期利润)	-	13,836,603.52	13,836,603.52
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)	-343,736,500.22	-4,895,955.08	-348,632,455.30
其中：1.基金申购款	189,856.61	2,619.89	192,476.50
2.基金赎回款	-343,926,356.83	-4,898,574.97	-348,824,931.80
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)	944,927,701.48	20,184,666.21	965,112,367.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗春风	_____ 林婉文	_____ 胡明
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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”)。

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。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	66,032,342.11
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	66,032,342.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	40,931,517.51	38,313,397.95	-2,618,119.56
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	19,735,138.30	-261,334.71
	银行间市场	375,133,000.00	785,066.86
	合计	394,868,138.30	523,732.15
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	435,275,923.66	433,181,536.25	-2,094,387.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	7,104.65
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	41.13
应收债券利息	7,161,066.13
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	14.58
合计	7,168,226.49

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	54,564.13
银行间市场应付交易费用	9,251.27
合计	63,815.40

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,529.40
预提费用	199,916.99
合计	203,446.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	741,652,480.86	741,652,480.86
本期申购	300,352.78	300,352.78
本期赎回(以“-”号填列)	-250,970,664.01	-250,970,664.01
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	490,982,169.63	490,982,169.63

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,527,757.18	-5,199,837.59	19,327,919.59
本期利润	-4,077,252.36	5,770,594.74	1,693,342.38
本期基金份额交易产生的变动数	-8,298,736.32	737,045.01	-7,561,691.31
其中：基金申购款	9,160.53	26.55	9,187.08
基金赎回款	-8,307,896.85	737,018.46	-7,570,878.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,151,768.50	1,307,802.16	13,459,570.66

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	68,366.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,758.35
其他	353.28
合计	71,477.70

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	98,324,369.55
减：卖出股票成本总额	102,020,952.13
买卖股票差价收入	-3,696,582.58

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,224,741.83
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-9,224,741.83

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总	593,180,405.55

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	589,994,226.04
减：应收利息总额	12,410,921.34
买卖债券差价收入	-9,224,741.83

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及无衍生工具投资。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	339,513.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	339,513.61

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	5,770,594.74
——股票投资	-1,659,820.13
——债券投资	7,430,414.87
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	5,770,594.74

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	666,759.22
转换费收入	1,287.71
合计	668,046.93

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对持续持有期少于 30 天的投资人收取的赎回费，100%归入基金资产；对持续持有期超过 30 天(含)但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，75%归入基金资产；对持续持有期超过 3 个月(含)但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，50%归入基金资产；对持续持有期超过 6 个月(含)的投资人收取的赎回费，25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费按注 1 中约定的比例计入基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	247,978.50
银行间市场交易费用	5,922.50
合计	253,901.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	42,151.28
信息披露费	148,765.71
其他	600.00
银行间账户维护费	27,000.00
银行费用	11,283.09
合计	229,800.08

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无须作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“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	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	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	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	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的联营公司、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	-	-	42,181,289.17	12.86%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	9,715,512.32	8.74%	21,893,898.92	23.29%

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	39,283.50	14.28%	740.98	8.77%

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。权证交易不计佣金。

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。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	3,551,910.81	6,805,047.09
其中：支付销售机构的客户维护费	1,208,367.69	2,337,792.04

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	591,985.13	1,134,174.56

注：支付基金托管人中国银行的托管费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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30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	66,032,342.11	68,366.07	773,862.85	248,970.72

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期内未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项	7.47	2018年8月20日	7.25	13,800	103,144.02	103,086.00	-
300229	拓尔思	2018年4月17日	重大事项	15.88	2018年7月17日	14.29	5,600	86,408.00	88,928.00	-
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项	17.08	-	-	2,900	60,378.00	49,532.00	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项	13.08	-	-	3,700	71,979.44	48,396.00	-
601118	海南橡胶	2018年5月24日	重大事项	6.62	-	-	3,800	20,889.50	25,156.00	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因重大事项可能产生重大影响被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制订了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	10,009,000.00	90,359,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	130,518,000.00	159,940,000.00
合计	140,527,000.00	250,299,000.00

注：以上按短期信用评级的债券投资未评级的债券投资为国债、政策性金融债、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	164,467,000.00	193,061,000.00
合计	164,467,000.00	193,061,000.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	59,891,138.30	19,322,000.00
AAA 以下	19,732,000.00	92,173,167.84
未评级	10,251,000.00	72,352,000.00
合计	89,874,138.30	183,847,167.84

注：以上按长期信用评级的债券投资未评级债券为政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2018 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。本基金主动投资于流

动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.06%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 66032342.11 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年 6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	66,032,342.11	-	-	-	-	-	66,032,342.11
结算备付金	101,611.07	-	-	-	-	-	101,611.07
存出保证金	36,077.79	-	-	-	-	-	36,077.79
交易性金融资产	68,961,000.00	97,720,000.00	158,045,000.00	70,139,000.00	3,138.30	38,313,397.95	433,181,536.25
应收证券清算款	-	-	-	-	-	106,030.90	106,030.90
应收利息	-	-	-	-	-	7,168,226.49	7,168,226.49

应收申购款	-	-	-	-	-	298.92	298.92
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	135,131,030.97	97,720,000.00	158,045,000.00	70,139,000.00	3,138.30	45,587,954.26	506,626,123.53
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	843,133.39	843,133.39
应付赎回款	-	-	-	-	-	465,880.30	465,880.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	506,702.25	506,702.25
应付托管费	-	-	-	-	-	84,450.38	84,450.38
应付交易费	-	-	-	-	-	63,815.40	63,815.40

用							
其他						220,401.52	220,401.52
负债							
总计						2,184,383.24	2,184,383.24
利率	135,131,030.97	97,720,000.00	158,045,000.00	70,139,000.00	3,138.30	43,403,571.02	504,441,740.29
敏感							
度缺							
口							
上年							
度末							
2017	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
年 12 月 31 日							
资产							
银行	4,665,029.50						4,665,029.50
存款							
结算	1,611,585.38						1,611,585.38
备付							
金							
存出	56,253.08						56,253.08
保证							
金							
交易	20,110,000.00	140,372,000.00	292,879,000.00	108,485,747.50	65,360,420.34	72,513,800.06	699,720,967.90

性金融资产							
买入返售金融资产	48,550,132.83	-	-	-	-	-	48,550,132.83
应收利息	-	-	-	-	-	8,265,141.88	8,265,141.88
应收申购款	-	-	-	-	-	199.28	199.28
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	74,993,000.79	140,372,000.00	292,879,000.00	108,485,747.50	65,360,420.34	80,779,141.22	762,869,309.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	560,765.83	560,765.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	785,907.09	785,907.09

应付托管费	-	-	-	-	-	130,984.54	130,984.54
应付交易费用	-	-	-	-	-	119,847.25	119,847.25
其他负债	-	-	-	-	-	291,404.69	291,404.69
负债总计	-	-	-	-	-	1,888,909.40	1,888,909.40
利率敏感度缺口	74,993,000.79	140,372,000.00	292,879,000.00	108,485,747.50	65,360,420.34	78,890,231.82	760,980,400.45

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	530,502.86	1,321,594.44
	市场利率上升 25 个基点	-526,834.85	-1,306,768.16

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金在保本期内投资稳健资产占基金资产的比例不低于 60%；基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；投资风险资产占基金资产的比例不高于 40%；基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	38,313,397.95	7.60	72,513,800.06	9.53
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—

其他	-	-	-	-
合计	38,313,397.95	7.60	72,513,800.06	9.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值仅占基金净资产的 7.60%（2017 年 12 月 31 日：9.53%），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（2017 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 08 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	38,313,397.95	7.56
	其中：股票	38,313,397.95	7.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	394,868,138.30	77.94
	其中：债券	394,868,138.30	77.94
	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	66,133,953.18	13.05
8	其他各项资产	7,310,634.10	1.44
9	合计	506,626,123.53	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	181,498.00	0.04
B	采矿业	1,355,390.00	0.27
C	制造业	18,750,338.54	3.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,327,638.00	0.26
E	建筑业	795,450.40	0.16
F	批发和零售业	1,614,127.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	997,983.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,515,006.20	0.30
J	金融业	8,024,729.41	1.59
K	房地产业	1,950,684.00	0.39
L	租赁和商务服务业	940,987.80	0.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	202,972.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	183,073.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	473,520.60	0.09
S	综合	-	-
	合计	38,313,397.95	7.60

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600036	招商银行	57,500	1,520,300.00	0.30
2	002032	苏泊尔	29,029	1,494,993.50	0.30
3	000333	美的集团	22,400	1,169,728.00	0.23
4	600519	贵州茅台	1,500	1,097,190.00	0.22
5	600030	中信证券	63,500	1,052,195.00	0.21
6	600690	青岛海尔	54,100	1,041,966.00	0.21
7	600276	恒瑞医药	13,050	988,668.00	0.20
8	002419	天虹股份	64,950	948,270.00	0.19
9	601166	兴业银行	58,400	840,960.00	0.17
10	002415	海康威视	21,700	805,721.00	0.16
11	601328	交通银行	122,900	705,446.00	0.14
12	002027	分众传媒	68,040	651,142.80	0.13
13	601288	农业银行	187,500	645,000.00	0.13
14	601155	新城控股	20,300	628,691.00	0.12
15	002008	大族激光	11,300	601,047.00	0.12
16	601939	建设银行	87,800	575,090.00	0.11

17	600028	中国石化	71,500	464,035.00	0.09
18	600298	安琪酵母	12,500	446,000.00	0.09
19	001979	招商蛇口	22,100	421,005.00	0.08
20	601009	南京银行	52,700	407,371.00	0.08
21	600104	上汽集团	11,300	395,387.00	0.08
22	002304	洋河股份	3,000	394,800.00	0.08
23	300059	东方财富	29,740	391,973.20	0.08
24	600048	保利地产	30,000	366,000.00	0.07
25	600703	三安光电	18,800	361,336.00	0.07
26	002507	涪陵榨菜	13,968	358,698.24	0.07
27	600809	山西汾酒	5,700	358,473.00	0.07
28	600886	国投电力	48,800	354,776.00	0.07
29	600585	海螺水泥	10,400	348,192.00	0.07
30	600900	长江电力	21,200	342,168.00	0.07
31	600019	宝钢股份	43,500	338,865.00	0.07
32	601601	中国太保	10,500	334,425.00	0.07
33	603589	口子窖	5,200	319,540.00	0.06
34	601225	陕西煤业	37,700	309,894.00	0.06
35	601006	大秦铁路	36,400	298,844.00	0.06
36	601888	中国国旅	4,500	289,845.00	0.06
37	000963	华东医药	6,000	289,500.00	0.06
38	600872	中炬高新	10,200	285,600.00	0.06
39	600309	万华化学	6,200	281,604.00	0.06
40	002024	苏宁易购	18,000	253,440.00	0.05
41	300124	汇川技术	7,600	249,432.00	0.05
42	600487	亨通光电	11,200	246,960.00	0.05
43	000651	格力电器	5,200	245,180.00	0.05
44	600009	上海机场	4,200	233,016.00	0.05
45	603288	海天味业	3,100	228,284.00	0.05
46	002142	宁波银行	13,700	223,173.00	0.04
47	600016	民生银行	29,800	208,600.00	0.04
48	601398	工商银行	39,100	208,012.00	0.04
49	600521	华海药业	7,580	202,310.20	0.04
50	600271	航天信息	7,960	201,149.20	0.04
51	000425	徐工机械	47,200	200,128.00	0.04
52	000961	中南建设	31,400	198,134.00	0.04
53	601229	上海银行	11,900	187,544.00	0.04
54	601668	中国建筑	33,740	184,220.40	0.04
55	002396	星网锐捷	8,900	182,183.00	0.04

56	000402	金融街	22,000	177,100.00	0.04
57	601186	中国铁建	20,200	174,124.00	0.03
58	000069	华侨城A	23,800	172,074.00	0.03
59	600498	烽火通信	6,800	168,980.00	0.03
60	600436	片仔癀	1,500	167,895.00	0.03
61	600050	中国联通	33,800	166,296.00	0.03
62	603799	华友钴业	1,700	165,699.00	0.03
63	000703	恒逸石化	11,000	163,680.00	0.03
64	600660	福耀玻璃	6,300	161,973.00	0.03
65	600027	华电国际	41,100	161,112.00	0.03
66	000661	长春高新	700	159,390.00	0.03
67	300498	温氏股份	7,100	156,342.00	0.03
68	600867	通化东宝	6,100	146,217.00	0.03
69	002128	露天煤业	16,100	145,866.00	0.03
70	002475	立讯精密	6,400	144,256.00	0.03
71	603568	伟明环保	5,600	141,680.00	0.03
72	600352	浙江龙盛	11,600	138,620.00	0.03
73	600771	广誉远	2,500	137,400.00	0.03
74	601877	正泰电器	6,100	136,152.00	0.03
75	000338	潍柴动力	15,300	133,875.00	0.03
76	601111	中国国航	15,000	133,350.00	0.03
77	000002	万科A	5,400	132,840.00	0.03
78	600547	山东黄金	5,500	131,560.00	0.03
79	600763	通策医疗	2,700	131,409.00	0.03
80	000166	申万宏源	29,600	129,352.00	0.03
81	002594	比亚迪	2,600	123,968.00	0.02
82	600392	盛和资源	7,600	123,348.00	0.02
83	601818	光大银行	32,500	118,950.00	0.02
84	300144	宋城演艺	5,000	117,500.00	0.02
85	002202	金风科技	8,700	109,968.00	0.02
86	601998	中信银行	17,000	105,570.00	0.02
87	601390	中国中铁	13,800	103,086.00	0.02
88	603345	安井食品	2,900	101,500.00	0.02
89	601211	国泰君安	6,800	100,232.00	0.02
90	002371	北方华创	2,000	99,340.00	0.02
91	300413	快乐购	2,600	98,644.00	0.02
92	601336	新华保险	2,300	98,624.00	0.02
93	601088	中国神华	4,900	97,706.00	0.02
94	600887	伊利股份	3,500	97,650.00	0.02

95	000681	视觉中国	3,400	97,580.00	0.02
96	603027	千禾味业	4,300	97,438.00	0.02
97	601566	九牧王	6,500	95,875.00	0.02
98	600188	兖州煤业	7,200	93,888.00	0.02
99	000768	中航飞机	6,000	93,840.00	0.02
100	603096	新经典	1,100	92,158.00	0.02
101	600362	江西铜业	5,800	91,930.00	0.02
102	600681	百川能源	7,000	90,720.00	0.02
103	300470	日机密封	1,900	89,243.00	0.02
104	300136	信维通信	2,900	89,117.00	0.02
105	300229	拓尔思	5,600	88,928.00	0.02
106	300170	汉得信息	5,400	87,696.00	0.02
107	002267	陕天然气	12,500	87,500.00	0.02
108	601117	中国化学	13,000	87,490.00	0.02
109	600483	福能股份	12,700	87,249.00	0.02
110	600282	南钢股份	19,200	84,864.00	0.02
111	600115	东方航空	12,300	81,426.00	0.02
112	002315	焦点科技	5,600	80,976.00	0.02
113	002572	索菲亚	2,500	80,450.00	0.02
114	300017	网宿科技	7,400	79,254.00	0.02
115	601788	光大证券	7,200	79,056.00	0.02
116	300122	智飞生物	1,700	77,758.00	0.02
117	601901	方正证券	11,500	76,935.00	0.02
118	000423	东阿阿胶	1,400	75,334.00	0.01
119	601799	星宇股份	1,200	71,868.00	0.01
120	002050	三花智控	3,800	71,630.00	0.01
121	600066	宇通客车	3,700	71,003.00	0.01
122	002472	双环传动	8,200	70,274.00	0.01
123	601628	中国人寿	3,100	69,812.00	0.01
124	002410	广联达	2,500	69,325.00	0.01
125	300377	赢时胜	5,100	69,309.00	0.01
126	002500	山西证券	10,200	68,748.00	0.01
127	600452	涪陵电力	2,500	68,275.00	0.01
128	002153	石基信息	2,300	66,700.00	0.01
129	600837	海通证券	6,600	62,502.00	0.01
130	600011	华能国际	9,700	61,692.00	0.01
131	300037	新宙邦	2,300	61,617.00	0.01
132	300070	碧水源	4,400	61,292.00	0.01
133	002376	新北洋	3,700	61,198.00	0.01

134	002821	凯莱英	700	61,061.00	0.01
135	300476	胜宏科技	3,800	58,520.00	0.01
136	002230	科大讯飞	1,800	57,726.00	0.01
137	002065	东华软件	6,700	57,620.00	0.01
138	002083	孚日股份	10,200	57,222.00	0.01
139	601766	中国中车	7,400	56,980.00	0.01
140	002126	银轮股份	6,300	56,826.00	0.01
141	601699	潞安环能	6,100	56,486.00	0.01
142	000887	中鼎股份	3,900	56,199.00	0.01
143	601899	紫金矿业	15,500	55,955.00	0.01
144	601872	招商轮船	15,400	55,594.00	0.01
145	000898	鞍钢股份	9,800	54,586.00	0.01
146	300571	平治信息	800	54,560.00	0.01
147	300033	同花顺	1,400	54,418.00	0.01
148	600596	新安股份	3,300	53,361.00	0.01
149	600606	绿地控股	8,100	52,974.00	0.01
150	002624	完美世界	1,700	52,717.00	0.01
151	300258	精锻科技	3,800	52,250.00	0.01
152	601989	中国重工	12,900	52,116.00	0.01
153	601997	贵阳银行	4,200	51,912.00	0.01
154	300015	爱尔眼科	1,600	51,664.00	0.01
155	600398	海澜之家	4,000	50,960.00	0.01
156	600438	通威股份	7,200	49,680.00	0.01
157	002466	天齐锂业	1,000	49,590.00	0.01
158	002450	康得新	2,900	49,532.00	0.01
159	002797	第一创业	7,300	49,421.00	0.01
160	000932	华菱钢铁	5,800	49,300.00	0.01
161	300373	扬杰科技	1,700	48,620.00	0.01
161	603612	索通发展	1,700	48,620.00	0.01
162	002310	东方园林	3,700	48,396.00	0.01
163	002833	弘亚数控	900	47,835.00	0.01
164	000100	TCL 集团	16,400	47,560.00	0.01
165	600782	新钢股份	8,500	47,430.00	0.01
166	002341	新纶科技	3,500	46,515.00	0.01
167	002025	航天电器	2,000	46,200.00	0.01
168	600967	内蒙一机	3,600	45,864.00	0.01
169	600997	开滦股份	8,700	45,588.00	0.01
170	002343	慈文传媒	2,380	44,672.60	0.01
171	300389	艾比森	2,700	44,631.00	0.01

172	002670	国盛金控	4,033	43,435.41	0.01
173	601139	深圳燃气	7,800	43,290.00	0.01
174	002120	韵达股份	800	42,440.00	0.01
175	600999	招商证券	3,100	42,408.00	0.01
176	601021	春秋航空	1,200	42,036.00	0.01
177	600977	中国电影	2,600	41,704.00	0.01
178	603008	喜临门	2,100	41,538.00	0.01
179	600118	中国卫星	2,100	40,110.00	0.01
180	002384	东山精密	1,600	38,400.00	0.01
181	300024	机器人	2,200	38,280.00	0.01
182	600893	航发动力	1,700	37,944.00	0.01
183	300251	光线传媒	3,700	37,666.00	0.01
184	002751	易尚展示	1,200	37,548.00	0.01
185	601238	广汽集团	3,360	37,430.40	0.01
186	601333	广深铁路	8,700	36,975.00	0.01
187	600332	白云山	900	34,245.00	0.01
188	002129	中环股份	4,300	33,669.00	0.01
189	603160	汇顶科技	500	32,445.00	0.01
190	002007	华兰生物	1,000	32,160.00	0.01
191	300315	掌趣科技	7,500	31,350.00	0.01
192	300335	迪森股份	2,900	30,856.00	0.01
193	600004	白云机场	2,300	30,107.00	0.01
194	002531	天顺风能	6,900	30,015.00	0.01
195	002292	奥飞娱乐	3,300	29,469.00	0.01
196	600588	用友网络	1,200	29,412.00	0.01
197	002456	欧菲科技	1,800	29,034.00	0.01
198	002110	三钢闽光	1,800	28,854.00	0.01
199	300027	华谊兄弟	4,500	27,720.00	0.01
200	603019	中科曙光	600	27,522.00	0.01
201	600372	中航电子	2,100	27,426.00	0.01
202	002841	视源股份	500	26,705.00	0.01
203	600570	恒生电子	500	26,475.00	0.01
204	600029	南方航空	3,100	26,195.00	0.01
205	300296	利亚德	2,000	25,760.00	0.01
206	600100	同方股份	2,900	25,462.00	0.01
207	601118	海南橡胶	3,800	25,156.00	0.00
208	000938	紫光股份	400	25,040.00	0.00
209	002013	中航机电	3,300	24,981.00	0.00
210	002179	中航光电	630	24,570.00	0.00

211	300207	欣旺达	2,700	24,327.00	0.00
212	600153	建发股份	2,700	24,273.00	0.00
213	000786	北新建材	1,200	22,236.00	0.00
214	000627	天茂集团	2,800	19,656.00	0.00
215	002352	顺丰控股	400	18,000.00	0.00
216	002174	游族网络	900	17,910.00	0.00
217	000581	威孚高科	800	17,688.00	0.00
218	600637	东方明珠	1,100	16,566.00	0.00
219	600038	中直股份	400	15,996.00	0.00
220	002555	三七互娱	1,300	15,795.00	0.00
221	600136	当代明诚	1,200	14,520.00	0.00
222	600760	中航沈飞	400	14,416.00	0.00
223	000902	新洋丰	1,200	11,040.00	0.00
224	002078	太阳纸业	1,100	10,659.00	0.00
225	600741	华域汽车	400	9,488.00	0.00
226	601012	隆基股份	500	8,345.00	0.00
227	603179	新泉股份	120	2,634.00	0.00
228	000528	柳 工	100	1,071.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600519	贵州茅台	1,900,036.00	0.25
2	600036	招商银行	1,736,478.00	0.23
3	002032	苏 泊 尔	1,522,774.19	0.20
4	601166	兴业银行	1,392,082.00	0.18
5	601288	农业银行	1,364,965.00	0.18
6	000333	美的集团	1,288,844.00	0.17
7	600690	青岛海尔	1,225,362.00	0.16
8	600030	中信证券	1,224,153.00	0.16
9	600016	民生银行	1,029,463.00	0.14
10	600048	保利地产	990,511.00	0.13
11	600276	恒瑞医药	957,846.86	0.13
12	601328	交通银行	956,084.00	0.13

13	601668	中国建筑	942,459.00	0.12
14	000651	格力电器	941,944.00	0.12
15	601398	工商银行	933,434.00	0.12
16	002419	天虹股份	907,417.50	0.12
17	002415	海康威视	896,309.57	0.12
18	002008	大族激光	872,815.00	0.11
19	001979	招商蛇口	787,020.00	0.10
20	002027	分众传媒	713,838.20	0.09

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。

7.4.2 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	300476	胜宏科技	32,833,101.00	4.31
2	002597	金禾实业	21,070,543.98	2.77
3	603989	艾华集团	12,241,902.00	1.61
4	002322	理工环科	5,281,985.43	0.69
5	600016	民生银行	777,767.00	0.10
6	601668	中国建筑	711,046.00	0.09
7	600519	贵州茅台	682,419.00	0.09
8	601398	工商银行	660,075.00	0.09
9	000651	格力电器	633,954.00	0.08
10	601288	农业银行	579,690.00	0.08
11	000596	古井贡酒	567,251.00	0.07
12	600048	保利地产	559,366.00	0.07
13	600837	海通证券	410,665.48	0.05
14	601166	兴业银行	405,260.00	0.05
15	600000	浦发银行	398,409.07	0.05
16	000895	双汇发展	367,239.00	0.05
17	002044	美年健康	337,698.00	0.04
18	000671	阳光城	306,078.00	0.04
19	601169	北京银行	291,720.00	0.04
20	000069	华侨城 A	282,003.00	0.04

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。

7.4.3 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	69,480,370.15
卖出股票收入（成交）总额	98,324,369.55

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。

7.5 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	80,188,000.00	15.90
	其中：政策性金融债	40,304,000.00	7.99
4	企业债券	19,732,000.00	3.91
5	企业短期融资券	110,474,000.00	21.90
6	中期票据	20,004,000.00	3.97
7	可转债（可交换债）	3,138.30	0.00
8	同业存单	164,467,000.00	32.60
9	其他	-	-
10	合计	394,868,138.30	78.28

7.6 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	111890217	18 徽商银行 CD008	500,000	48,825,000.00	9.68
2	111712285	17 北京银行 CD285	500,000	48,300,000.00	9.57
3	011800342	18 厦国贸 SCP005	300,000	30,114,000.00	5.97
4	111814002	18 江苏银行 CD002	300,000	28,698,000.00	5.69
5	011763026	17 首钢 SCP012	200,000	20,136,000.00	3.99

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内无股指期货投资情况。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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情况。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内无国债期货投资情况。

7.11.3 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情况。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本组合投资的前十名证券之一兴业银行，于 2018 年 4 月 19 日被银保监公开处罚，主要违法

违规事实包括：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。中国银行保险监督管理委员会决定罚款兴业银行 5870 万元。

本组合投资的前十名证券之一招商银行，于 2018 年 2 月 12 日被中国银监会公开处罚，主要违法违规事实包括：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。中国银监会决定罚款招商银行 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

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。

7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	36,077.79
2	应收证券清算款	106,030.90
3	应收股利	-
4	应收利息	7,168,226.49

5	应收申购款	298.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,310,634.10

7.12.4 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	128024	宁行转债	3,138.30	0.00

7.12.5 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中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
2,959	165,928.41	1,988,471.57	0.40%	488,993,698.06	99.60%

8.2 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%

8.3 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

§ 9 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	741,652,480.86
本报告期基金总申购份额	300,352.78
减：本报告期基金总赎回份额	250,970,664.01
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	490,982,169.63

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 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，本基金管理人、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
西藏东方财富	2	66,660,470.70	39.73%	47,415.44	35.51%	-
长江证券	1	27,362,763.54	16.31%	25,483.23	19.08%	-
招商证券	2	17,278,037.45	10.30%	16,091.15	12.05%	-
中信证券	2	9,923,274.00	5.91%	9,241.57	6.92%	-
华泰证券	1	8,531,142.52	5.08%	6,068.12	4.54%	-
东方证券	2	8,185,969.99	4.88%	5,986.53	4.48%	-
国泰君安	2	7,276,084.00	4.34%	5,175.51	3.88%	-
国金证券	1	5,578,106.50	3.32%	5,196.41	3.89%	-
银河证券	2	3,482,479.50	2.08%	3,243.27	2.43%	-
中银国际	1	3,198,860.00	1.91%	2,275.34	1.70%	-
华信证券	2	2,937,343.00	1.75%	2,089.24	1.56%	-
中泰证券	1	2,486,010.50	1.48%	1,768.26	1.32%	-
南京证券	1	2,184,843.00	1.30%	1,554.07	1.16%	-
西南证券	1	1,336,770.00	0.80%	950.84	0.71%	-
浙商证券	2	784,816.00	0.47%	558.27	0.42%	-
兴业证券	2	597,769.00	0.36%	433.99	0.33%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
申万证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-

1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、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

3、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。

10.7.2 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
西藏东方财富	15,881,123.59	14.29%	28,500,000.00	19.28%	-	-
长江证券	14,541,688.30	13.08%	22,300,000.00	15.08%	-	-
招商证券	6,384,715.86	5.74%	6,600,000.00	4.46%	-	-
中信证券	-	-	250,000.00	0.17%	-	-
华泰证券	1,000,680.00	0.90%	-	-	-	-
东方证券	9,438,826.90	8.49%	-	-	-	-
国泰君安	10,079,452.80	9.07%	24,500,000.00	16.57%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	43,000,000.00	29.08%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华信证券	10,395,690.30	9.35%	5,000,000.00	3.38%	-	-
中泰证券	8,428,174.35	7.58%	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	5,258,673.80	4.73%	-	-	-	-
兴业证券	4,074,047.00	3.67%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-

中投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	664,856.37	0.60%	9,000,000.00	6.09%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	3,000,000.00	2.03%	-	-
中金公司	15,045,764.30	13.54%	2,500,000.00	1.69%	-	-
安信证券	240,672.00	0.22%	3,200,000.00	2.16%	-	-
平安证券	9,715,512.32	8.74%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金新增南京证券为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018年1月12日
2	平安大华安心保本混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018年1月19日
3	关于旗下部分基金在小牛基金销售有限公司开通定投业务的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018年1月31日
4	关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018年2月6日
5	平安大华安心保本混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018年2月9日
6	平安大华安心保本混合型证券投资基金招募说明书更新（2018 年第 1 期）以及摘要	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018年2月27日
7	关于平安大华安心保本混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018年3月7日
8	关于平安大华安心保本混合型证券投资基金修改基金合同的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018年3月24日
9	平安大华基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金赎回费的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018年3月26日
10	平安大华安心保本混合型证券投资基金 2017 年年度报告以及摘要	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018年3月29日
11	关于旗下部分基金新增中民财富	公司网站、证券时	2018年3月30日

	基金销售（上海）有限公司为销售机构公告	报、上海证券报、中国证券报	
12	关于旗下部分基金新增海银基金为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018 年 4 月 16 日
13	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018 年 4 月 19 日
14	平安大华安心保本混合型证券投资基金 2018 年 1 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018 年 4 月 20 日
15	关于旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为销售机构公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018 年 5 月 29 日
16	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018 年 6 月 12 日
17	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018 年 6 月 20 日
18	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018 年 6 月 21 日
19	关于旗下基金所持东方园林（代码 002310）、上海电气（代码 601727）估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018 年 6 月 26 日
20	平安大华安心保本混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2018 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华安心保本混合型证券投资基金的文件；
- 2、平安大华安心保本混合型证券投资基金基金合同；
- 3、平安大华安心保本混合型证券投资基金托管协议；
- 4、平安大华安心保本混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安大华基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内平安大华安心保本混合型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>。

平安大华基金管理有限公司

2018 年 8 月 27 日