

平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金
2017 年第 2 季度报告

2017 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 7 月 20 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 7 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安大华鼎信定期开放债券型
场内简称	-
交易代码	002988
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 7 月 21 日
报告期末基金份额总额	500,034,307.94 份
投资目标	在谨慎投资的前提下，力争战胜业绩比较基准，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。
投资策略	从我国宏观层面（经济转型、通货膨胀和利率的预期）出发，依据工业增加值与 CPI 的变动划分经济周期的不同阶段（复苏、扩张、滞涨、萧条），依据产业的生命周期把产业分为概念、导入、萌芽、成长、繁荣、衰退六个阶段。同时将行业非系统风险均值与其分布的 GINI 系数结合运用，全面准确地判断大类资产风险程度和收益前景，统筹考量短、中、长期资产配置比例。股票投资在投资时钟与产业生命周期策略基础上秉持自上而下与自下而上相结合的选股理念，精选有成长潜力的优质股票构建投资组合。债券投资以目标久期管理和品种选择策略为主，以收益率利差策略、债券置换策略为辅，构造能获取稳定收益的固定收益类投资品种组合。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+1.5%

风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险均高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§ 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4月1日—2017年6月30日）
1. 本期已实现收益	4,812,115.63
2. 本期利润	6,309,431.45
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0126
4. 期末基金资产净值	511,997,461.05
5. 期末基金份额净值	1.0239

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

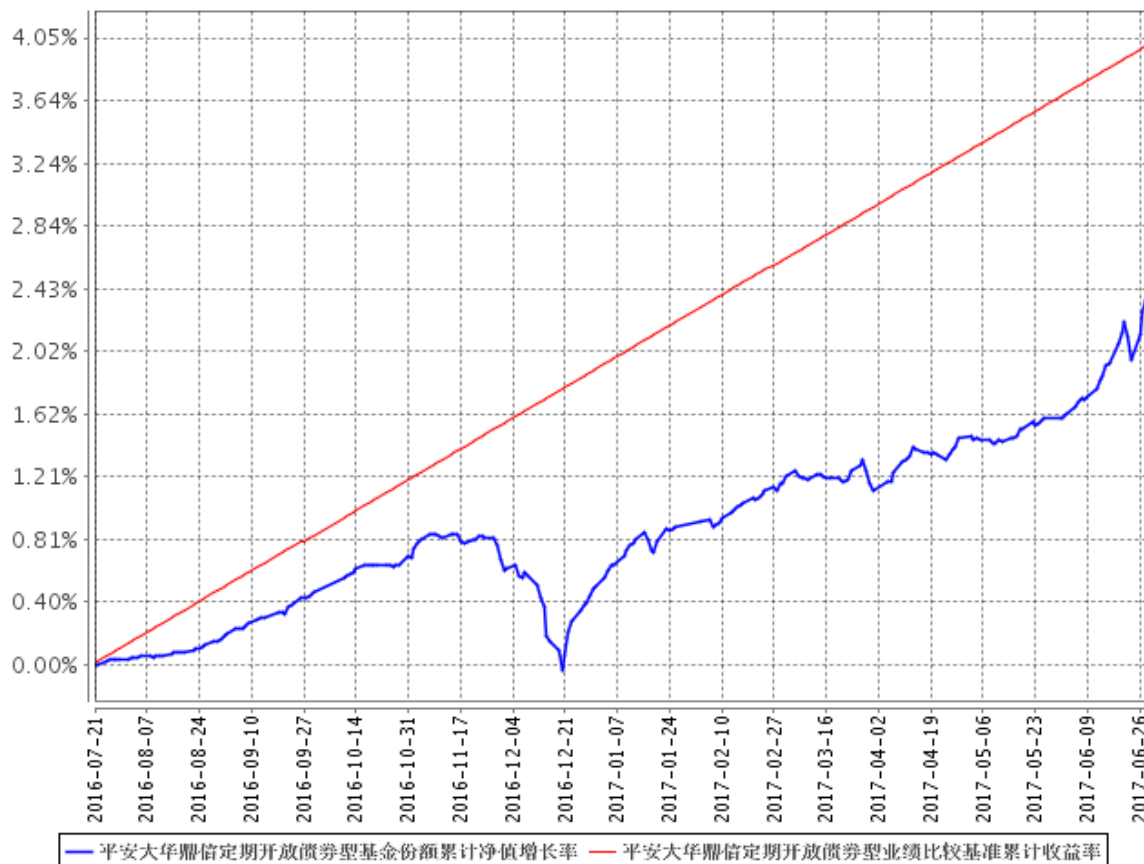
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.25%	0.05%	1.03%	0.01%	0.22%	0.04%

业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税后）+1.5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

平安大华鼎信定期开放债券型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 7 月 21 日正式生效，截至报告期末未满一年；
- 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。

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		
WANG AO	平安大华鼎信定期	2016 年 7 月 21 日	-	5	WANG AO 先生, CAIA、FRM, CFA, 澳大利亚

	<p>开放债券型证券投资基金基金经理</p>			<p>莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士，曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012年9月加入平安大华基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益研究员。现任平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠裕债券型证券投资基金、平安大华添益债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	------------------------	--	--	---

- 1、此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《平安大华鼎信定期开放债券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

二季度国内宏观经济继续保持了一定的韧性，补库存带动下，工业产出、投资与盈利继续维持了不错的增长。四月份金融去杠杆监管政策不断的加码是导致金融市场下跌的主因，股、债均出现大幅调整。期间货币政策总体维持了中性的态度，但在临近半年末的时间点加大了投放力度，主动呵护资金面，季末资金面波动大幅小于预期。资金面的好转下，市场情绪也有所好转，股、债均出现反弹。报告期内本基金增持了部分仓位的中等久期信用债券，但主要仓位由短久期信用债组成。本基金也配置了部分偏债性的可转债，并积极参与可转债申购。本基金未参与权益类投资，总体来看二季度基金净值保持了稳步增长。

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 1.0239 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.25%，业绩比较基准收益率为 1.03%。

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	465,345,716.81	87.74
	其中：债券	465,345,716.81	87.74
	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	38,160,150.24	7.20
	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	20,430,917.96	3.85
8	其他资产	6,405,383.66	1.21
9	合计	530,342,168.67	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

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
合计	-	-

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	53,771,825.00	10.50
5	企业短期融资券	270,066,000.00	52.75
6	中期票据	129,979,000.00	25.39

7	可转债（可交换债）	11,528,891.81	2.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	465,345,716.81	90.89

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	101782001	17 河钢集 MTN007	400,000	40,392,000.00	7.89
2	011755031	17 淮南矿 SCP004	400,000	40,156,000.00	7.84
3	041664036	16 中航租 赁 CP001	400,000	40,100,000.00	7.83
4	101651019	16 天津航 空 MTN001	400,000	40,072,000.00	7.83
5	041758001	17 鲁宏桥 CP001	400,000	39,704,000.00	7.75

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资情况。

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情况。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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投资。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,848.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,403,535.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,405,383.66

5.10.4 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	123001	蓝标转债	8,043,224.21	1.57
2	128013	洪涛转债	2,035,117.00	0.40

5.10.5 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持有股票。

5.10.6 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	500,034,307.94
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	500,034,307.94

§ 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运用固有资金投资本基金。

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，基金管理不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170401-20170630	500,008,000.00	0.00	0.00	500,008,000.00	99.99%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险
流动性风险

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第四十一次会议通过，同意推荐李兆良先生、李娟娟女士、刘雪山先生、潘汉腾先生为公司第三届董事会独立非执行董事候选人；推荐姚波先生、陈敬达先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生为公司第三届董事会非执行董事；推荐罗春风先生、肖宇鹏先生为公司第三届董事会执行董事，并同意提交股东会审议。

2、经平安大华基金管理有限公司第二届监事会第九次会议通过，同意推荐巢傲文先生、冯方女士为公司第三届监事会股东监事候选人，并同意提交股东会审议。

3、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议通过，选举姚波先生、罗春风先生、陈敬达先生、肖宇鹏先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生、李兆良先生、李娟娟女士、刘雪生先生、潘汉腾先生为第三届董事会董事。

4、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议通过，选举巢傲文先生、冯方女士为第三届监事会监事。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华鼎信定期开放债券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) 报告期内平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）。

平安大华基金管理有限公司

2017 年 7 月 20 日