

# 平安大华保本混合型证券投资基金 2017 年半年度报告 摘要

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                     |
|--------------|---------------------|
| 基金简称         | 平安大华保本混合            |
| 场内简称         | -                   |
| 基金主代码        | 700004              |
| 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      | 2012 年 9 月 11 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        |
| 报告期末基金份额总额   | 384, 251, 668. 24 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   | 采用投资组合保险技术，以保本期到期时本金安全为目标，通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，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   | 采用恒定比例组合保险策略（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）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              | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 陈特正                       | 田青                   |
|         | 联系电话 | 0755-22626828             | 010-67595096         |
|         | 电子邮箱 | fundservice@pingan.com.cn | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话  |      | 400-800-4800              | 010-67595096         |
| 传真      |      | 0755-23997878             | 010-66275853         |

## 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半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> |
| 基金半年度报告备置地点          | 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 3,230,371.55                |
| 本期利润          | 4,555,656.56                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0107                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.08%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日)            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2231                      |
| 期末基金资产净值      | 393,859,695.17              |
| 期末基金份额净值      | 1.025                       |

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. 本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，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

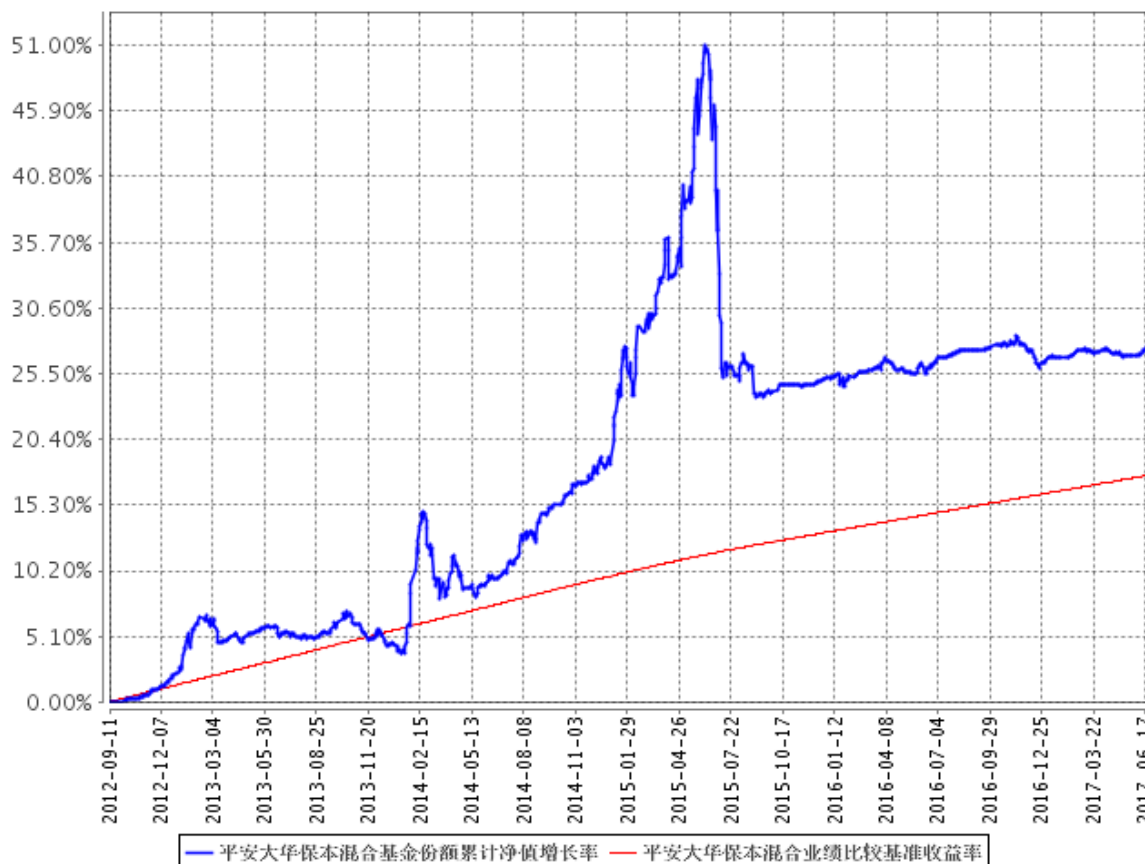
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.69%    | 0.05%       | 0.21%      | 0.01%         | 0.48%  | 0.04% |
| 过去三个月      | 0.49%    | 0.06%       | 0.64%      | 0.01%         | -0.15% | 0.05% |
| 过去六个月      | 1.08%    | 0.06%       | 1.28%      | 0.01%         | -0.20% | 0.05% |
| 过去一年       | 1.08%    | 0.07%       | 2.62%      | 0.01%         | -1.54% | 0.06% |
| 过去三年       | 16.41%   | 0.42%       | 9.31%      | 0.01%         | 7.10%  | 0.41% |
| 自基金合同生效起至今 | 27.82%   | 0.38%       | 17.69%     | 0.01%         | 10.13% | 0.37% |

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 2012 年 9 月 11 日正式生效，截至报告期末已满四年；
- 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。

## § 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”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安大华总部位于深圳，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，持有股份 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股份 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份 14.3%。

平安大华秉承“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。截至到 2017 年二季度末，公司旗下共有 39 只公募基金，公募基金管理规模突破 1200 亿元人民币。

#### 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 | 2012 年 9 月 11 日 | -    | 16 年   | 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，现担任“平安大华添利债券型证券投资基金”、“平安大华日增利货币市场基金”、“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”、“平安大华安盈保本混合型证券投资基金”、“平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金”、“平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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。

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。

### 4.3.2 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

今年上半年债券市场延续了调整的走势，波动较大，保本基金受到避险策略基金新政指导进行债券结构和信用结构调整。本基金信用债券投资以中高等级债券和短期企业债券为主，在市场调整中逐步增加较高收益银行存单投资，减持了 AA+以下信用债券。债券市场 5 月份收益率达到历史中高水平，短期银行存单和债券收益率具备较高投资价值，6 月份央行提前续做 MLF 给市场宽松预期，银行行业自查报告截止时间延后 3 个月，都表明了缓解市场情绪的态度。前期发债收益率大幅上升至企业信贷成本以上，造成大量债券取消发行，影响实体融资。M2 数据、理财数据都显著下行取得去杠杆阶段性成果。

### 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 1.025 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.08%，业绩比较基准收益率为 1.28%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金认为政策将以稳定为主，不会再加码；中长期经济增速面临下行压力，投资增速回落是大概率，全球央行在紧缩的道路上继续前行，将给中国债券造成基本面和政策面的背离机会，债券具备较好的配置价值。未来将加大利率债券的波段操作，投资与保本剩余期限相近的中高等级债券，在股票市场安全区域内增加价值型稳定增长个股投资，获得债券稳定收益和股票超额收益。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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，特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同

业市场交易的债券品种的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

遵照本基金基金合同的规定，本报告期内未进行利润分配。

#### **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 万人民币的情形。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：平安大华保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            |            | 443,956.08                     | 95,479,230.10                    |
| 结算备付金           |            | 110,070.96                     | 1,620,072.99                     |
| 存出保证金           |            | 37,389.70                      | 122,688.23                       |
| 交易性金融资产         |            | 472,996,326.00                 | 370,268,300.89                   |
| 其中：股票投资         |            | 434,826.00                     | 906,451.09                       |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 472,561,500.00                 | 369,361,849.80                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          |            | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        |            | -                              | 50,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | 3,024,086.90                   | -                                |
| 应收利息            |            | 6,078,408.74                   | 4,862,050.22                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            |            | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 482,690,238.38                 | 522,352,342.43                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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       |            | 83,087,679.87                  | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | 50,000,000.00                    |
| 应付赎回款           |            | 1,744,463.54                   | 3,633,516.75                     |
| 应付管理人报酬         |            | 393,839.67                     | 486,272.78                       |
| 应付托管费           |            | 65,639.95                      | 81,045.46                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          |            | 5,893.24                       | 476,906.19                       |
| 应交税费            |            | 3,278,063.81                   | 2,822,287.81                     |

|               |  |                |                |
|---------------|--|----------------|----------------|
| 应付利息          |  | 52,843.52      | -              |
| 应付利润          |  | -              | -              |
| 递延所得税负债       |  | -              | -              |
| 其他负债          |  | 202,119.61     | 211,427.19     |
| 负债合计          |  | 88,830,543.21  | 57,711,456.18  |
| <b>所有者权益：</b> |  |                |                |
| 实收基金          |  | 308,123,381.21 | 367,398,325.93 |
| 未分配利润         |  | 85,736,313.96  | 97,242,560.32  |
| 所有者权益合计       |  | 393,859,695.17 | 464,640,886.25 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 482,690,238.38 | 522,352,342.43 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.025 元，基金份额总额 384,251,668.24 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安大华保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|-----|--|---|
| <b>一、收入</b>           |     | 8,120,300.12                             | 10,310,204.07                                 |
| 1.利息收入                |     | 7,204,400.28                             | 7,556,865.22                                  |
| 其中：存款利息收入             |     | 156,214.20                               | 495,943.87                                    |
| 债券利息收入                |     | 6,933,025.24                             | 6,902,329.77                                  |
| 资产支持证券利息收入            |     | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |     | 115,160.84                               | 158,591.58                                    |
| 其他利息收入                |     | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |     | -657,799.63                              | 1,773,312.30                                  |
| 其中：股票投资收益             |     | 1,333,144.38                             | 525,751.69                                    |
| 基金投资收益                |     | -  | -   |
| 债券投资收益                |     | -1,995,192.81                            | 1,129,855.04                                  |
| 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                  |     | 4,248.80                                 | 117,705.57                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |     | 1,325,285.01                             | 811,992.13                                    |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |     | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     |     | 248,414.46                               | 168,034.42                                    |
| <b>减：二、费用</b>         |     | 3,564,643.56                             | 4,683,575.90                                  |
| 1. 管理人报酬              |     | 2,577,207.19                             | 3,397,499.54                                  |
| 2. 托管费                |     | 429,534.55                               | 566,249.93                                    |

|                            |           |                     |                     |
|----------------------------|-----------|---------------------|---------------------|
| 3. 销售服务费                   | 6.4.8.2.3 | -                   | -                   |
| 4. 交易费用                    |           | 191,733.99          | 480,840.73          |
| 5. 利息支出                    |           | 155,744.81          | -                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |           | 155,744.81          | -                   |
| 6. 其他费用                    |           | 210,423.02          | 238,985.70          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | <b>4,555,656.56</b> | <b>5,626,628.17</b> |
| 减：所得税费用                    |           | -                   | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |           | <b>4,555,656.56</b> | <b>5,626,628.17</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>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）                        | 367,398,325.93                             | 97,242,560.32  | 464,640,886.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -  | 4,555,656.56   | 4,555,656.56   |
| 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）      | -59,274,944.72                             | -16,061,902.92 | -75,336,847.64 |
| 其中：1.基金申购款                             | 659,910.30                                 | 178,988.39     | 838,898.69     |
| 2.基金赎回款                                | -59,934,855.02                             | -16,240,891.31 | -76,175,746.33 |
| 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）                        | 308,123,381.21                             | 85,736,313.96  | 393,859,695.17 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 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）                        | 470,937,173.23 | 118,447,223.11 | 589,384,396.34 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -              | 5,626,628.17   | 5,626,628.17   |
| 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）      | -36,778,585.36 | -9,453,908.16  | -46,232,493.52 |
| 其中：1.基金申购款                             | 5,231,401.70   | 1,336,823.73   | 6,568,225.43   |
| 2.基金赎回款                                | -42,009,987.06 | -10,790,731.89 | -52,800,718.95 |
| 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）                        | 434,158,587.87 | 114,619,943.12 | 548,778,530.99 |

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  
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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安大华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[2012]566号《关于核准平安大华保本混合型证券投资基金募集的批复》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，首次募集期间为2012年8月13日至2012年9月7日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,019,088,309.57元，业经安永华明会计师事务所有限公司(2012)验字第60937497\_B02号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华保本混合型证券投资基金基金合同》于2012年9月11日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,019,276,286.73份基金份额，其中认购资金利息折合187,977.16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

金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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，包括国内依法发行交易的债券、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）、权证、货币市场工具以及法律法规允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。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%。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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.4.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### **6.4.4.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### **6.4.4.3 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。

#### **6.4.5 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。

## 6.4.6 关联方关系

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 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 |
| 中国建设银行股份有限公司     | 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、基金代销机构 |

|                  |               |
|------------------|---------------|
| 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       | 基金销售机构        |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                  |
|------------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|            | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 平安证券股份有限公司 | 9,502,012.00               | 6.72%            | -                               | -                |

#### 6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称     | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                  |
|-----------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|           | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 平安证券股份有限公 | 13,023,850.39              | 13.75%           | 10,221,700.00                   | 3.42%            |

#### 6.4.7.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                |          |                  |
|----------------|----------------------------|----------------|----------|------------------|
|                | 当期<br>佣金                   | 占当期佣金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 平安证券股份有限公<br>司 | 8,849.21                   | 8.62%          | -        | -                |

| 关联方名称      | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                |                              |
|------------|---------------------------------|----------------|------------------------------|
|            | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额<br>占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 平安证券股份有限公司 | -                               | -              | -                            |

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。

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                       | 上年度可比期间                  |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
|                 | 2017年1月1日至2017年6月<br>30日 | 2016年1月1日至2016年6月30<br>日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,577,207.19             | 3,397,499.54             |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 859,069.70               | 1,266,921.85             |

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人管理费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：

日管理人管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                       | 上年度可比期间                  |
|----------------|--------------------------|--------------------------|
|                | 2017年1月1日至2017年6月<br>30日 | 2016年1月1日至2016年6月30<br>日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 429,534.55               | 566,249.93               |

注：支付基金托管人建设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 × 0.20% / 当年天数。

### 6.4.7.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给关联方的销售服务费。

### 6.4.7.3 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无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.7.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期及上年度可比期间均未投资本基金。

### 6.4.7.5 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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016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     |
| 深圳建行活期存款 | 443,956.08                 | 151,668.29 | 108,999,947.80                  | 488,225.62 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.7.6 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.7.7 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无其他关联交易事项。

## 6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.8.1 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/增发证券而持有的流通受限证券。

### 6.4.8.2 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 |
|--------|------|------------|------|--------|----------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 601069 | 西部黄金 | 2017年4月18日 | 重大事项 | 26.26  | -        | -      | 1,000 | 24,278.95 | 26,260.00 | -  |
| 300367 | 东方网力 | 2016年12月   | 重大事项 | 20.00  | 2017年7月3 | 18.01  | 100   | 2,525.36  | 2,000.00  | -  |

|  |  |      |  |  |   |  |  |  |  |
|--|--|------|--|--|---|--|--|--|--|
|  |  | 15 日 |  |  | 日 |  |  |  |  |
|--|--|------|--|--|---|--|--|--|--|

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，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。

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 80,087,679.87 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|---------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 111710302 | 17 兴业银行 CD302 | 2017 年 7 月 4 日 | 97.83  | 500,000 | 48,915,000.00 |
| 111715193 | 17 民生银行 CD193 | 2017 年 7 月 4 日 | 97.83  | 352,000 | 34,436,160.00 |
| 合计        |               |                |        | 852,000 | 83,351,160.00 |

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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。

#### 6.4.9.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 08 月 25 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              | 434,826.00     | 0.09          |
|    | 其中：股票             | 434,826.00     | 0.09          |
| 2  | 固定收益投资            | 472,561,500.00 | 97.90         |
|    | 其中：债券             | 472,561,500.00 | 97.90         |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 554,027.04     | 0.11          |
| 7  | 其他各项资产            | 9,139,885.34   | 1.89          |
| 8  | 合计                | 482,690,238.38 | 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       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -             |
| B  | 采矿业              | 26,260.00  | 0.01          |
| C  | 制造业              | 19,632.00  | 0.00          |
| 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  | 388,934.00 | 0.10          |
| 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            | 434,826.00 | 0.11 |

## 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投资港股通股票。

## 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  | 600850 | 华东电脑 | 18,200 | 388,934.00 | 0.10         |
| 2  | 601069 | 西部黄金 | 1,000  | 26,260.00  | 0.01         |
| 3  | 002185 | 华天科技 | 2,000  | 14,480.00  | 0.00         |
| 4  | 600703 | 三安光电 | 160    | 3,152.00   | 0.00         |
| 5  | 300367 | 东方网力 | 100    | 2,000.00   | 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  | 601229 | 上海银行 | 5,490,012.00 | 1.18           |
| 2  | 600120 | 浙江东方 | 4,530,033.00 | 0.97           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 3  | 601377 | 兴业证券 | 3,654,391.00 | 0.79 |
| 4  | 601198 | 东兴证券 | 3,638,701.00 | 0.78 |
| 5  | 601788 | 光大证券 | 3,197,730.00 | 0.69 |
| 6  | 000415 | 渤海金控 | 3,152,249.00 | 0.68 |
| 7  | 600835 | 上海机电 | 2,743,346.00 | 0.59 |
| 8  | 603328 | 依顿电子 | 2,480,844.35 | 0.53 |
| 9  | 601098 | 中南传媒 | 2,299,801.00 | 0.49 |
| 10 | 600343 | 航天动力 | 2,286,221.00 | 0.49 |
| 11 | 601881 | 中国银河 | 2,255,293.00 | 0.49 |
| 12 | 300101 | 振芯科技 | 2,245,395.00 | 0.48 |
| 13 | 600372 | 中航电子 | 2,242,105.00 | 0.48 |
| 14 | 600970 | 中材国际 | 2,230,389.00 | 0.48 |
| 15 | 601766 | 中国中车 | 1,862,205.00 | 0.40 |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 1,803,177.00 | 0.39 |
| 17 | 002051 | 中工国际 | 1,603,431.68 | 0.35 |
| 18 | 300410 | 正业科技 | 1,415,373.83 | 0.30 |
| 19 | 002013 | 中航机电 | 1,390,424.00 | 0.30 |
| 20 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,388,272.00 | 0.30 |

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  | 601229 | 上海银行 | 5,664,722.46 | 1.22           |
| 2  | 600120 | 浙江东方 | 4,611,146.00 | 0.99           |
| 3  | 601377 | 兴业证券 | 3,692,890.12 | 0.79           |
| 4  | 601198 | 东兴证券 | 3,636,961.00 | 0.78           |
| 5  | 601788 | 光大证券 | 3,215,519.00 | 0.69           |
| 6  | 000415 | 渤海金控 | 3,138,124.00 | 0.68           |
| 7  | 600835 | 上海机电 | 2,836,997.84 | 0.61           |
| 8  | 601881 | 中国银河 | 2,582,714.00 | 0.56           |
| 9  | 603328 | 依顿电子 | 2,411,279.00 | 0.52           |
| 10 | 601098 | 中南传媒 | 2,377,303.10 | 0.51           |
| 11 | 600970 | 中材国际 | 2,358,112.52 | 0.51           |
| 12 | 300101 | 振芯科技 | 2,311,783.14 | 0.50           |
| 13 | 600343 | 航天动力 | 2,240,282.00 | 0.48           |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 600372 | 中航电子 | 2,181,923.00 | 0.47 |
| 15 | 601766 | 中国中车 | 1,948,905.00 | 0.42 |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 1,830,653.00 | 0.39 |
| 17 | 002051 | 中工国际 | 1,751,289.92 | 0.38 |
| 18 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,425,167.00 | 0.31 |
| 19 | 002013 | 中航机电 | 1,399,336.00 | 0.30 |
| 20 | 601872 | 招商轮船 | 1,378,987.22 | 0.30 |

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 | 69,809,833.12 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 71,545,128.57 |

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      | 39,747,000.00  | 10.09        |
|    | 其中：政策性金融债 | 39,747,000.00  | 10.09        |
| 4  | 企业债券      | 55,937,000.00  | 14.20        |
| 5  | 企业短期融资券   | 100,077,000.00 | 25.41        |
| 6  | 中期票据      | 40,232,000.00  | 10.21        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,171,500.00   | 0.30         |
| 8  | 同业存单      | 235,397,000.00 | 59.77        |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 472,561,500.00 | 119.98       |

### 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  | 111712077 | 17 北京银行<br>CD077         | 500,000 | 49,470,000.00 | 12.56        |
| 2  | 111710302 | 17 兴业银行<br>CD302         | 500,000 | 48,915,000.00 | 12.42        |
| 2  | 111715193 | 17 民生银行<br>CD193         | 500,000 | 48,915,000.00 | 12.42        |
| 3  | 111794561 | 17 广州农村<br>商业银行<br>CD058 | 500,000 | 48,870,000.00 | 12.41        |
| 4  | 1180165   | 11 佛山公控<br>债             | 300,000 | 31,476,000.00 | 7.99         |
| 5  | 041670006 | 16 怡亚通<br>CP003          | 300,000 | 30,042,000.00 | 7.63         |

## 7.7 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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

## 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

本基金本报告期末无贵金属投资。

## 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

本基金本报告期末无权证投资。

## 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

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 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。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓。

### 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

中国民生银行股份有限公司（以下简称“公司”）于近日收到“京银监罚决字（2017）6号”行政处罚决定书显示，中国民生银行北京分行因存在虚增存款、违规办理同业票据业务严重违反审慎经营规则等违法行为，被北京银监局责令改正，并处罚款 850 万元。

本基金管理人对该公司进行了深入的研究和分析，认为该处罚不对民生银行的信用及还本付息能力造成影响；管理人投资民生银行 CD 已经审慎评估过该行还本付息能力，银行 CD 属于央行备案发行的银行债务工具，目前处于较安全投资领域。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。

### 7.12.2

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。

### 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   | 37,389.70    |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,024,086.90 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 6,078,408.74 |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | -            |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 9,139,885.34 |

#### 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  | 128010 | 顺昌转债 | 1,171,500.00 | 0.30          |

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1  | 601069 | 西部黄金 | 26,260.00   | 0.01          | 重大事项     |
| 2  | 300367 | 东方网力 | 2,000.00    | 0.00          | 重大事项     |

#### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 3,376        | 113,818.62    | 4,999,182.41 | 1.30%      | 379,252,485.83 | 98.70%     |

### 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<br>持有本基金 | 4,887.10  | 0.0013%  |

### 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<br>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（2012年9月11日）基金份额总额 | 1,019,276,286.73 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 458,172,010.69   |
| 本报告期基金总申购份额               | 822,920.86       |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 74,743,263.31    |
| 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               | 384,251,668.24   |

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

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。

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，由巢傲文先生、李峥女士接替张云平、毛晴峰先生为第三届监事会监事，任职日期为2017年6月1日。

### 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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 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例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 信达证券 | 2      | 65,369,473.36 | 46.25%       | 46,497.10 | 45.31%     | 新增 |
| 国信证券 | 1      | 47,286,826.66 | 33.46%       | 33,635.01 | 32.78%     | -  |
| 华创证券 | 2      | 16,794,227.70 | 11.88%       | 11,945.73 | 11.64%     | -  |
| 平安证券 | 1      | 9,502,012.00  | 6.72%        | 8,849.21  | 8.62%      | -  |
| 中信建投 | 1      | 2,378,552.46  | 1.68%        | 1,691.84  | 1.65%      | 新增 |
| 长城证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中投证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |

注：

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。

**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 |
| 信达证券 | 15,142,593.49 | 15.99%       | 22,000,000.00 | 25.29%         | -    | -            |
| 国信证券 | 63,302,668.05 | 66.84%       | 65,000,000.00 | 74.71%         | -    | -            |
| 华创证券 | 1,094,148.00  | 1.16%        | -             | -              | -    | -            |
| 平安证券 | 13,023,850.39 | 13.75%       | -             | -              | -    | -            |
| 中信建投 | 1,963,440.00  | 2.07%        | -             | -              | -    | -            |
| 长城证券 | 174,145.09    | 0.18%        | -             | -              | -    | -            |
| 天风证券 | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 方正证券 | -             | -            | -             | -              | -    | -            |
| 中投证券 | -             | -            | -             | -              | -    | -            |

平安大华基金管理有限公司  
2017年8月28日