

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证  
券投资基金  
2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 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 10 月 25 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 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	平安大华中证沪港深高股息
场内简称	-
交易代码	003702
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	2017 年 1 月 25 日
报告期末基金份额总额	24,268,298.25 份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证沪港深高股息精选指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、

	跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证沪港深高股息精选指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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7月1日—2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	75,410.80
2. 本期利润	552,593.27
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0214
4. 期末基金资产净值	25,592,127.14
5. 期末基金份额净值	1.0545

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

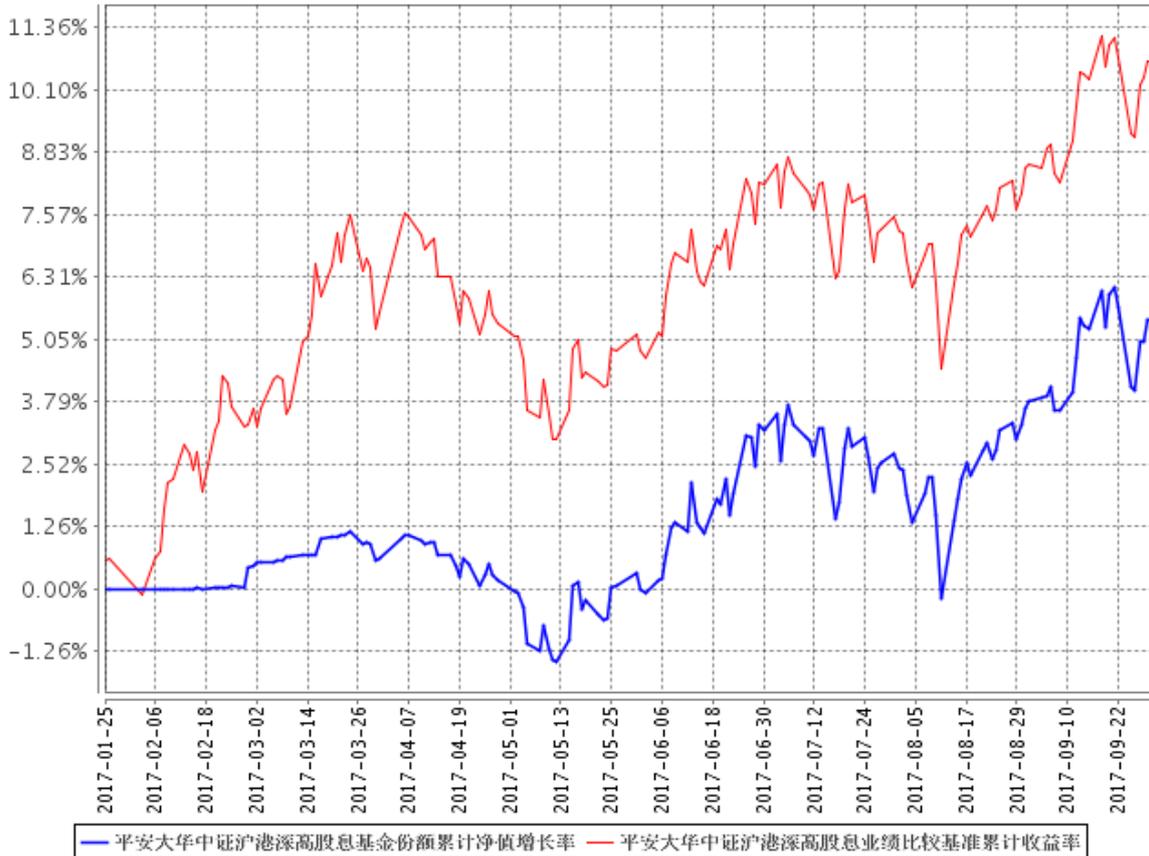
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.18%	0.59%	2.29%	0.59%	-0.11%	0.00%

业绩比较基准：中证沪港深高股息精选指数收益率\*95%+银行人民币活期存款利率（税后）\*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

平安大华中证沪港深高股息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 2017 年 1 月 25 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，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
施旭	平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金的基金经理	2017年1月25日	-	7	施旭先生，哥伦比亚大学金融数学硕士，曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券，于 2015 年加入平安大华基金，任衍生品投资中心量化研究员，现任平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票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解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华中证沪港深高股息精选指数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

回顾 2017 年三季度 A 股市场，在监管力度有所放缓，海外资金及杠杆资金逐步入市的环境下，整体市场逐步震荡上行，并且沪指突破 3300 点，成交量整体趋势性放大。同时，随着大宗商品上涨，带动了周期股出现了一轮趋势性上涨，并且沪深 300、中证 500 中的一些优质企业如人工智能、新能源汽车等板块都出现明显上涨，整体市场行情从原本相对防守性的大市值蓝筹股逐步向二线蓝筹及优质成长企业扩散，市场情绪得到明显改善。今年以来，新增开户数逐步增加，三季度以来两融规模更是逐步抬升，市场赚钱效应开始逐步显现，对吸引资金持续入市起到积极左右。报告期间，海外主要股票市场也相继创出新高，整体市场环境仍相对较好。A 股目前市场流动性较为稳定，市场整体情绪较好。

回顾港股市场，港股三季度出现大幅上涨，恒生指数突破 28000 点，一方面受海外市场较好影响，美股同期也创出新高；另一方面受国内 A 股影响，三季度 A 股周期股持续上涨，恒生国企指数涨幅较大，对整体港股形成较大带动效应。

报告期内，本基金作为被动操作的指数基金，严格执行基金合同的投资策略，按照规定的投资策略和方法进行投资操作，努力拟合标的指数，减少跟踪误差，报告期内跟踪误差误差控制在 0.22%。报告期跟踪误差主要是由于基金申购赎回和标的指数成分股定期调整等因素导致。

## 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 1.0545 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.18%，业绩比较基准收益率为 2.29%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2017 年 6 月 9 日至 2017 年 9 月 29 日,出现连续 81 个工作日基金资产净值低于 5000 万的情形。截止本报告期末,以上情形未消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件,予以披露,且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

### § 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	23,244,630.19	89.22
	其中:股票	23,244,630.19	89.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	2,621,837.65	10.06
8	其他资产	186,115.96	0.71
9	合计	26,052,583.80	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	237,160.00	0.93
C	制造业	10,341,791.20	40.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	556,874.00	2.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	94,094.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	1,114,266.00	4.35

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	209,206.00	0.82
J	金融业	577,617.00	2.26
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	44,880.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	75,847.20	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	142,824.47	0.56
R	文化、体育和娱乐业	203,649.00	0.80
S	综合	-	-
	合计	13,598,208.87	53.13

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
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	742.00	0.00
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	742.00	0.00

### 5.2.3 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	436,704.00	1.71
B 消费者非必需品	4,246,218.33	16.59
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	778,526.46	3.04
F 医疗保健	372,409.38	1.46
G 工业	551,157.44	2.15
H 信息技术	1,435,878.67	5.61
I 电信服务	-	-
J 公用事业	1,526,962.22	5.97
K 房地产	297,822.82	1.16
合计	9,645,679.32	37.69

### 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

#### 5.3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600660	福耀玻璃	39,000	994,110.00	3.88
2	000895	双汇发展	36,100	898,890.00	3.51
3	02380	中国电力	347,000	757,718.29	2.96
4	01999	敏华控股	118,400	704,198.21	2.75
5	00868	信义玻璃	102,000	669,056.27	2.61
6	00303	VTECH HOLDINGS	6,600	638,162.63	2.49
7	02020	安踏体育	20,000	558,226.62	2.18
8	02018	瑞声科技	5,000	557,376.96	2.18
9	02333	长城汽车	65,000	530,187.84	2.07
10	00425	敏实集团	14,000	486,515.32	1.90

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600050	中国联通	100	742.00	0.00

#### **5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末无债券投资情况。

#### **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**

本基金本报告期末无债券投资。

#### **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股指期货交易情况说明**

##### **5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无股指期货投资情况。

##### **5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### **5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### **5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### **5.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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。

### 5.11.2

基金投资的前十名股票没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	167,350.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	18,414.78
4	应收利息	351.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	186,115.96

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	32,127,393.08
报告期期间基金总申购份额	390,732.81
减：报告期期间基金总赎回份额	8,249,827.64
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	24,268,298.25

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 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
个人	1	20170701-20170930	10,011,200.00	0.00	0.00	10,011,200.00	41.25%
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三届董事会第二次会议通过，同意选举罗春风先生为第三届董事会董事长；同意聘任肖宇鹏先生为总经理；同意聘任付强先生、林婉文女士、汪涛先生为副总经理；同意聘任陈特正先生为督察长兼董事会秘书。

2、根据《通过港股通机制参与香港股票市场交易的公募基金注册审核指引》等相关法律规定，平安大华基金管理有限公司经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，本基金管理人决定对平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同中部分条款进行修订，进一步全面揭示投资港股的相关风险，修订后的《基金合同》于 2017 年 7 月 12 日生效。

## § 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中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华中证沪港深高股息精选指数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) 报告期内平安大华中证沪港深高股息精选指数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 10 月 25 日