

平安大华安享保本混合型证券投资基金 2018 年半年度报告 摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：平安大华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 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。

基金托管人建设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。

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	平安大华安享保本混合
场内简称	-
基金主代码	002282
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 日
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	273,980,239.03 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	tianqing1.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	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

§ 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	-3,316,647.33
本期利润	-1,174,832.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0037
本期基金份额净值增长率	-0.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0118
期末基金资产净值	277,901,987.43
期末基金份额净值	1.014

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

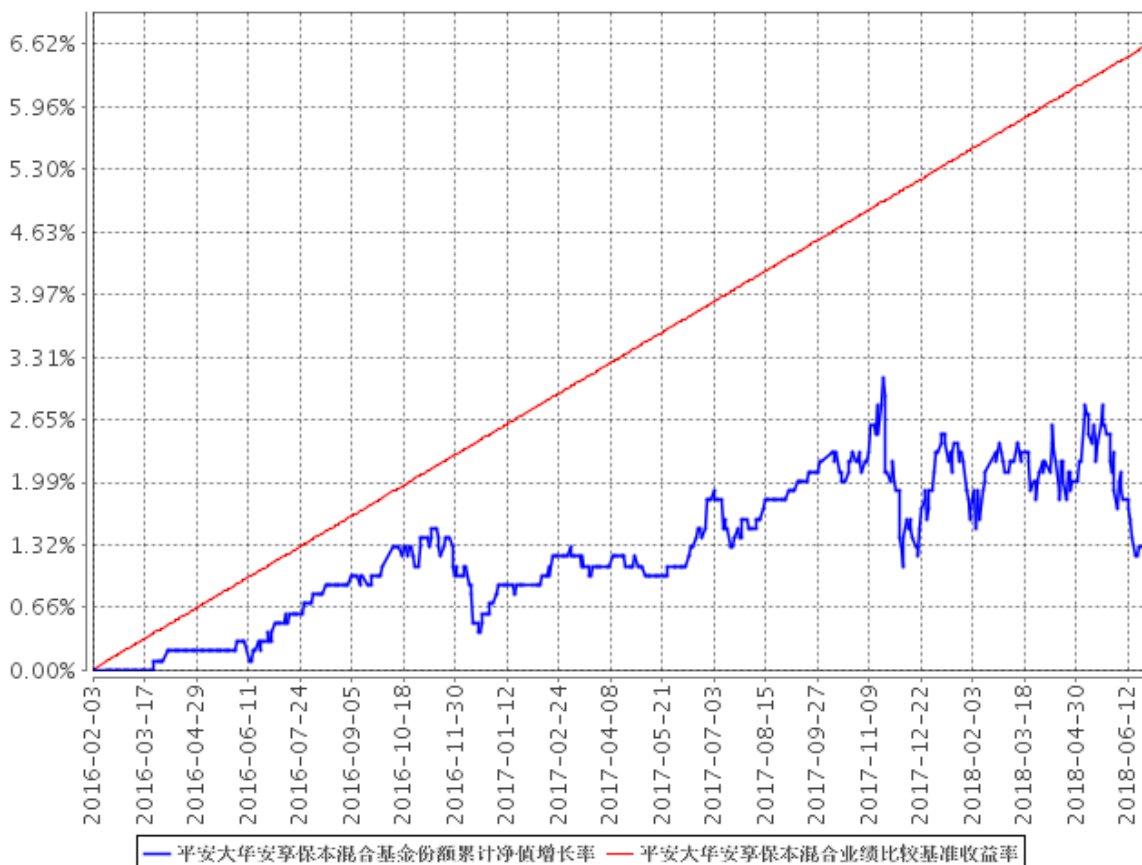
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.88%	0.14%	0.21%	0.01%	-1.09%	0.13%
过去三个月	-0.69%	0.18%	0.65%	0.01%	-1.34%	0.17%
过去六个月	-0.49%	0.16%	1.30%	0.01%	-1.79%	0.15%
过去一年	-0.39%	0.15%	2.65%	0.01%	-3.04%	0.14%
自基金合同生效起至今	1.40%	0.11%	6.62%	0.01%	-5.22%	0.10%

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

平安大华安享保本混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2016 年 02 月 03 日正式生效，截至报告期末已满两年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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	平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理	2018 年 2 月 8 日	-	6	张恒先生，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。
高勇标	平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理	2018 年 3 月 16 日	-	7	高勇标先生，西南财经大学硕士，曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017 年 4 月加入平安大华基金管理有限公司，任投资研究部固定收益组投资经理，现任平安大华鼎弘混合型证券投资基金、平安大华惠悦纯债债券型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、平安大华鼎沅纯债债券型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金基金经理。
孙健	平安大华安享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 2 月 3 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遵规守信情况的说明

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、《平安大华安享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，两两组合间单日、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、交易占优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

上半年宏观经济运行平稳，但社会融资余额增速低于预期；通胀水平维持较低水平，资金面

保持相对宽松。政策方面，央行在 4 月份宣布降准并部分用于置换 MLF，之后央行扩大 MLF 担保品范围，6 月并未跟随美国加息，并且再次宣布定向降准；在此期间，中美贸易战持续发酵，市场避险情绪升温，利率债和高等级信用债收益率持续下行。而低等级信用债受金融强监管，债务违约等影响，信用利差反而不断扩大，基金净值表现相对平稳。

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

4.4.2 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 1.014 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.49%，业绩比较基准收益率为 1.30%。

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，预计地产投资缓慢下行、制造业投资复苏有限，消费方面对经济拉动边际力量减弱，贸易摩擦制约出口，宏观经济下行压力仍在；但受更加积极的财政政策带动，基建托底，体现下半场的宽信用方向。预计货币政策仍会维持边际放松，整体流动性保持合理充裕。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。

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，中国建设银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华安享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。本基金本报告期末进行利润分配，符合基金合同的约定。

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

本报告期内，由平安大华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、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）、投资组合报告等内容真实、准确、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：平安大华安享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		48,054,927.03	4,972,091.21
结算备付金		4,266,999.66	421,384.27
存出保证金		63,882.71	28,984.01
交易性金融资产		308,890,072.30	374,831,796.75
其中：股票投资		-	35,801,905.31
基金投资		-	-
债券投资		288,890,072.30	339,029,891.44
资产支持证券投资		20,000,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	3,000,000.00
应收证券清算款		10,100,589.90	-
应收利息		5,499,886.68	4,789,821.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	296.44
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		376,876,358.28	388,044,374.37
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		-	-
卖出回购金融资产款		91,652,222.52	-
应付证券清算款		1,001,017.39	-
应付赎回款		1,206,495.47	1,548,161.34
应付管理人报酬		278,094.11	394,498.14
应付托管费		46,349.01	65,749.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		234,841.04	67,705.90
应交税费		4,236,073.89	4,004,931.62
应付利息		122,618.82	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		196,658.60	277,669.98
负债合计		98,974,370.85	6,358,716.67
所有者权益：			
实收基金		273,980,239.03	374,410,484.41
未分配利润		3,921,748.40	7,275,173.29
所有者权益合计		277,901,987.43	381,685,657.70
负债和所有者权益总计		376,876,358.28	388,044,374.37

报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.014 元，基金份额总额 273,980,239.03 份。

6.2 利润表

会计主体：平安大华安享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		3,184,104.83	14,617,809.53
1.利息收入		7,711,300.68	11,723,500.69
其中：存款利息收入		60,990.96	472,684.11
债券利息收入		7,447,156.38	10,662,554.76
资产支持证券利息收入		176,173.33	235,622.17
买入返售金融资产收入		26,980.01	352,639.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,960,025.20	-1,277,623.88
其中：股票投资收益		-2,476,719.51	2,049,922.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-4,563,319.59	-3,336,682.00
资产支持证券投资收益		-	-0.05
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		80,013.90	9,135.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		2,141,814.67	2,273,999.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		291,014.68	1,897,933.54
减：二、费用		4,358,937.49	6,650,436.00
1. 管理人报酬		1,933,142.65	5,214,919.12
2. 托管费		322,190.47	869,153.15

3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		491,362.70	329,755.82
5. 利息支出		1,382,112.73	16,489.85
其中：卖出回购金融资产支出		1,382,112.73	16,489.85
6. 其他费用		219,372.56	220,118.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,174,832.66	7,967,373.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,174,832.66	7,967,373.53

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华安享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）	374,410,484.41	7,275,173.29	381,685,657.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-1,174,832.66	-1,174,832.66
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）	-100,430,245.38	-2,178,592.23	-102,608,837.61
其中：1.基金申购款	809,474.28	19,107.74	828,582.02
2.基金赎回款	-101,239,719.66	-2,197,699.97	-103,437,419.63
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）	273,980,239.03	3,921,748.40	277,901,987.43
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)	965,637,312.72	7,153,143.25	972,790,455.97
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	7,967,373.53	7,967,373.53
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)	-494,469,728.74	-6,675,435.40	-501,145,164.14
其中: 1.基金申购款	150,962.03	1,771.81	152,733.84
2.基金赎回款	-494,620,690.77	-6,677,207.21	-501,297,897.98
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)	471,167,583.98	8,445,081.38	479,612,665.36

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

平安大华安享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]2902号《关于准予平安大华安享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《平安大华安享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2016年1月11日至2016年1月29日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,078,041,098.02元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验字(2016)第132号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华安享保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年2月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,078,207,032.81份基金份额,其中认购资金利息折合165,934.79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《平安大华安享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》、《平安大华安享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 6 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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(“中国建设银行”)	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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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
平安证券股份有限公司	122,612,020.40	36.62%	11,854,056.40	4.81%

6.4.8.1.2 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
平安证券股份有限公	259,662,537.00	71.39%	34,273,606.41	32.07%

6.4.8.1.3 债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
平安证券股份有限	1,491,700,000.00	89.99%	-	-

6.4.8.1.4 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 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
平安证券股份有限公司	114,187.55	51.80%	114,187.55	51.80%
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
平安证券股份有限公司	11,039.64	6.19%	-	-

6.4.8.2 关联方报酬**6.4.8.2.1 基金管理费**

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管理费	1,933,142.65	5,214,919.12
其中：支付销售机构的客户维护费	645,207.58	1,156,148.34

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 × 1.20% / 当年天数。

6.4.8.2.2 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	2017年1月1日至2017年6月

	6 月 30 日	30 日
当期发生的基金应支付的托管费	322, 190. 47	869, 153. 15

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。

6.4.8.2.3 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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期末未运用自有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	建设银行一活期存款	48, 054, 927. 03	52, 198. 44	19, 888, 491. 42

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 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其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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
011800126	18 桂投资 SCP002	2018 年 7 月 2 日	100.71	93,000	9,366,030.00
111770148	17 贵阳银 行 CD184	2018 年 7 月 2 日	96.53	100,000	9,653,000.00
111771238	17 宁波银 行 CD243	2018 年 7 月 2 日	95.50	300,000	28,650,000.00
1620038	16 徽商银 行 01	2018 年 7 月 2 日	98.94	129,000	12,763,260.00
011800037	18 晋煤 SCP001	2018 年 7 月 3 日	100.55	200,000	20,110,000.00
101800366	18 越秀金 融 MTN002	2018 年 7 月 4 日	101.08	100,000	10,108,000.00
101800395	18 津保投 MTN002	2018 年 7 月 4 日	97.89	27,000	2,643,030.00
合计				949,000	93,293,320.00

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 8 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	308,890,072.30	81.96
	其中：债券	288,890,072.30	76.65
	资产支持证券	20,000,000.00	5.31
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	52,321,926.69	13.88
7	其他各项资产	15,664,359.29	4.16
8	合计	376,876,358.28	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	300010	立思辰	5,107,882.00	1.34
2	300059	东方财富	3,550,972.65	0.93
3	601857	中国石油	3,502,677.28	0.92
4	600521	华海药业	3,265,837.00	0.86
5	002384	东山精密	3,057,703.00	0.80
6	601233	桐昆股份	3,051,401.28	0.80
7	002157	正邦科技	2,999,962.00	0.79
8	300601	康泰生物	2,995,785.30	0.78
9	002456	欧菲科技	2,978,560.00	0.78
10	601799	星宇股份	2,324,175.00	0.61
11	603228	景旺电子	2,317,564.00	0.61
12	300178	腾邦国际	2,139,584.00	0.56
13	002600	领益智造	2,037,664.00	0.53
14	300226	上海钢联	1,959,672.00	0.51
15	300164	通源石油	1,957,502.00	0.51
16	300357	我武生物	1,923,956.20	0.50
17	600741	华域汽车	1,839,580.00	0.48
18	300003	乐普医疗	1,822,546.00	0.48
19	603233	大参林	1,716,723.00	0.45
20	300296	利亚德	1,711,468.00	0.45

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	002597	金禾实业	14,970,296.00	3.92
2	300476	胜宏科技	13,182,688.01	3.45
3	603989	艾华集团	5,422,979.74	1.42
4	300010	立思辰	5,302,726.00	1.39
5	300059	东方财富	3,571,987.90	0.94
6	601857	中国石油	3,528,170.00	0.92
7	300601	康泰生物	3,231,529.82	0.85
8	002384	东山精密	3,068,990.00	0.80

9	601233	桐昆股份	3,019,535.50	0.79
10	600521	华海药业	3,005,346.84	0.79
11	002456	欧菲科技	2,830,400.00	0.74
12	002157	正邦科技	2,800,880.00	0.73
13	601799	星宇股份	2,351,370.00	0.62
14	603228	景旺电子	2,342,829.50	0.61
15	002322	理工环科	2,287,067.00	0.60
16	300164	通源石油	2,049,599.00	0.54
17	300178	腾邦国际	1,993,222.00	0.52
18	300357	我武生物	1,967,081.80	0.52
19	002600	领益智造	1,961,790.00	0.51
20	300226	上海钢联	1,861,270.00	0.49

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	150,937,253.03
卖出股票收入（成交）总额	183,843,443.21

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

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

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	149380	18 花 06A1	200,000	20,000,000.00	7.20

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

本基金本报告期无贵金属投资情况。

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

本基金本报告期无权证投资情况。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货期货交易情况说明**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

2017 年 12 月 22 日，根据上海证券交易所《关于对方正科技集团股份有限公司、控股股东北大方正集团有限公司及其一致行动人和有关责任人予以纪律处分的决定》，方正集团、武汉国兴未披露一致行动人关系，该行为严重违反了《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 2 号—年度报告的内容与格式（2016 年修订）式》第四十条、第四十六条和《上海证券交易所股票上市规则》第 1.4 条、第 2.1 条、第 2.3 条、第 2.5 条、第 2.7 条、第 2.22 条、第 10.2.5 条等有关规定。对方正科技集团股份有限公司、控股股东北大方正集团有限公司及其一致行动人武汉国兴科技发展有限公司、方正集团有限公司主要负责人李友、方正科技集团股份有限公司时任董事长方中华、易梅予以公开谴责；对历任董事会秘书、副总裁、董事、总裁侯郁波，时任财务总监兼董事李晓勤，时任董事兼北大方正集团有限公司财务部副总裁徐文彬、千新国，时任董事长刘欲晓，时任总裁朱兆庆，时任副总经理胡永栓、贾朝心，时任副总裁黄肖锋，时任独立董事傅林生、何明珂、王善迈、董黎明，时任监事邱泽珺、蒋艳华予以通报批评。

本基金管理人认为，该事项对公司的生产经营不会造成重大不利影响，我们对该证券的投资严格执行了内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金本报告期末未投资股票。

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	63,882.71
2	应收证券清算款	10,100,589.90
3	应收股利	-
4	应收利息	5,499,886.68
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,664,359.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未投资股票。

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
1,759	155,759.09	2,991,043.77	1.09%	270,989,195.26	98.91%

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	0.00	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2月3日）基金份额总额	1,078,207,032.81
本报告期期初基金份额总额	374,410,484.41
本报告期基金总申购份额	809,474.28
减：本报告期基金总赎回份额	101,239,719.66
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	273,980,239.03

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

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	1	122,612,020.40	36.62%	114,187.55	43.07%	-
天风证券	1	95,484,991.69	28.52%	67,918.78	25.62%	-
华创证券	2	79,712,283.85	23.81%	56,699.49	21.39%	-
国信证券	1	23,684,888.29	7.07%	16,849.33	6.36%	-

中信建投	1	13,286,512.01	3.97%	9,450.73	3.56%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	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
平安证券	259,662,537.00	71.39%	1,491,700,000.00	89.99%	-	-
天风证券	37,295,111.99	10.25%	8,208,000.00	0.50%	-	-
华创证券	40,014,738.21	11.00%	151,640,000.00	9.15%	-	-
国信证券	6,962,940.30	1.91%	4,000,000.00	0.24%	-	-
中信建投	6,965,410.93	1.92%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	2,952,929.20	0.81%	2,000,000.00	0.12%	-	-
中投证券	9,855,472.05	2.71%	-	-	-	-

平安大华基金管理有限公司
2018年8月27日