

平安大华量化精选混合型发起式证券投资  
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 2 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	平安大华量化精选混合	
场内简称	-	
基金主代码	005486	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 1 日	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	225,109,755.07 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	-	
下属分级基金的基金简称:	平安大华量化精选混合 A	平安大华量化精选混合 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	005486	005487
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	117,106,722.84 份	108,003,032.23 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,本基金通过量化模型进行资产配置、精选股票,力求在有效分散风险的同时实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金在投资过程中主要运用量化投资策略进行投资管理,减少人为主观情绪及个人判断的失误概率,使投资过程富有纪律性和规范性,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。本基金的投资策略主要包括两部分:一是,采取数量化方法,运用行业轮动投资时钟的资产配置策略,确定资产配置的具体比例;二是,在股票投资过程中,本基金将保持通过模型选股构建股票投资组合的投资策略,强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。	
	平安大华量化精选混合 A	平安大华量化精选混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

## 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	郭明
	联系电话	0755-22626828	010-66105798
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105799

## 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

基金级别	平安大华量化精选 A	平安大华量化精选 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 2 月 1 日- 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 2 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,511,883.49	-3,659,636.87
本期利润	-9,709,428.95	-9,443,460.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0802	-0.0835
本期基金份额净值增长率	-8.04%	-8.35%
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	-0.0804	-0.0835
期末基金资产净值	107,689,870.22	98,982,390.68
期末基金份额净值	0.9196	0.9165

注：1. 本基金基金合同于 2018 年 2 月 1 日正式生效，截至报告期末未满半年；

2. 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；

3. 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）；

4. 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

平安大华量化精选 A

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	-3.14%	0.68%	-5.22%	0.90%	2.08%	-0.22%
过去三个月	-4.00%	0.60%	-6.44%	0.79%	2.44%	-0.19%
自基金合同生效起至今	-8.04%	0.56%	-11.78%	0.85%	3.74%	-0.29%

平安大华量化精选 C

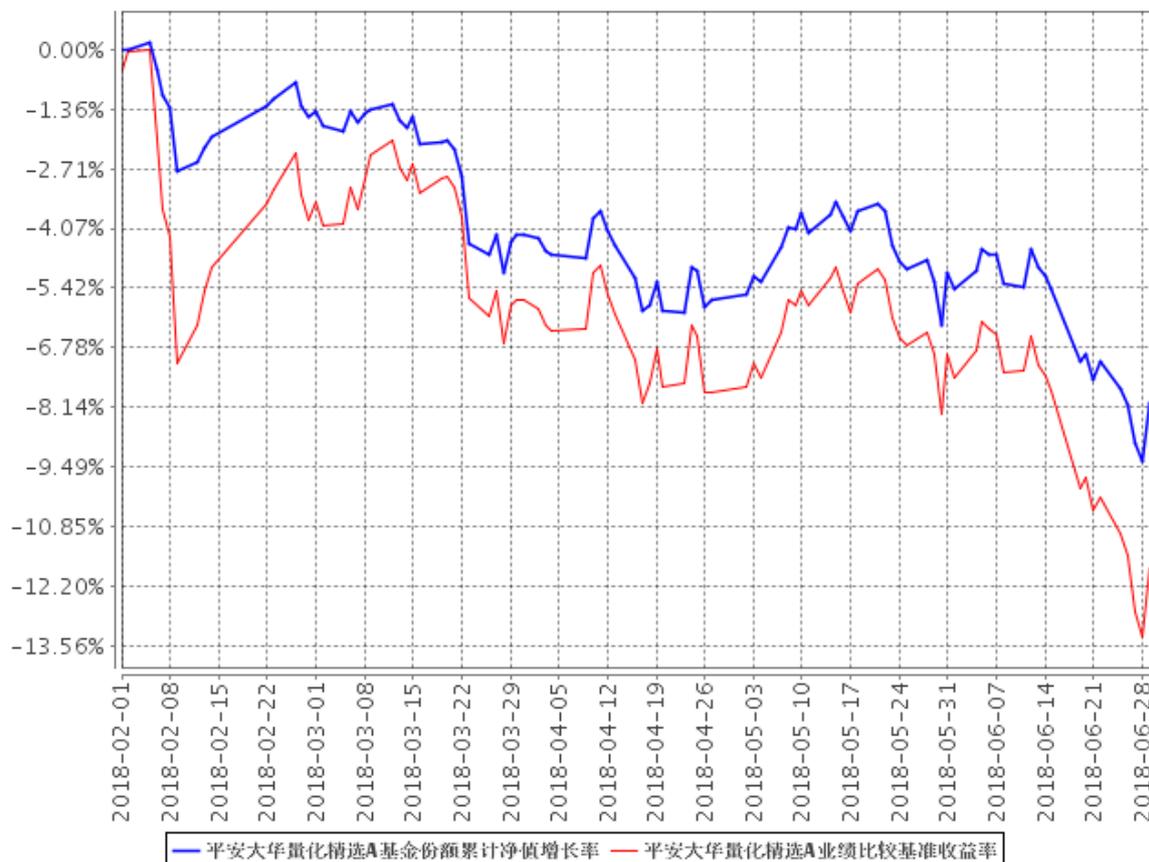
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.20%	0.68%	-5.22%	0.90%	2.02%	-0.22%
过去三个月	-4.20%	0.60%	-6.44%	0.79%	2.24%	-0.19%
自基金合同生效起至今	-8.35%	0.56%	-11.78%	0.85%	3.43%	-0.29%

注：1、中证综合债指数收益率×30%+沪深 300 指数收益率×70%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证综合债券指数是反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债、和企业债、该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场标准。根据本基金的投资范围约束，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

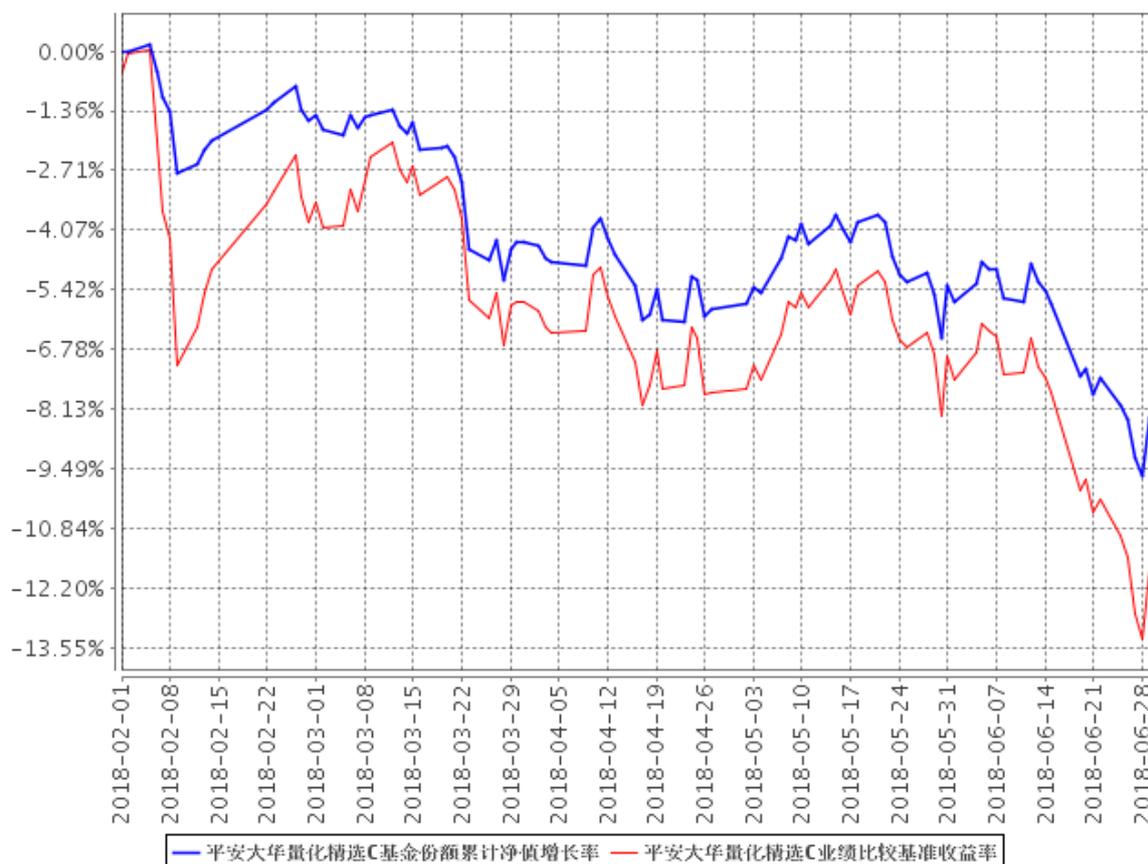
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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

平安大华量化精选A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



平安大华量化精选C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 2018 年 2 月 01 日正式生效，截至报告期末未满半年；
- 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未完成建仓。

## § 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		
施旭	平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金的基金经理	2018 年 2 月 1 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，2015 年加入平安大华基金管理有限公司，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、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化先锋

					混合型发起式证券投资基金、平安大华量化精选混合型发起式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、《平安大华量化精选混合型发起式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

回顾 2018 上半年，A 股市场发生了明显的变化，风格切换较以前加快，一季度市场的波动幅度加大，去年强势的白马蓝筹在一月份走出强势冲高行情后回落，出现较大幅震荡；同时，中小创等成长股出现部分结构性反弹，部分成长股投资价值逐渐显现；进入二季度后，受国内去杠杆和对美贸易战不断发酵的影响，市场风险偏好下降，包括本基金在内，市场对下半年国内经济形势持谨慎态度，各指数均出现较大幅震荡和下跌，估值回落，一定程度超出市场预期。上半年出于对市场各项风险叠加以及上市公司业绩的面临经济回落和去杠杆考验的担忧，本基金在控制总体仓位的前提下，收紧组合行业和风格暴露，利用量化多因子选股模型为框架，精选防御性个股为主要配置策略，争取超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金 A 份额净值为 0.9196 元，报告期内本基金份额净值增长率为-8.04%；本基金 C 份额净值为 0.9165 元，报告期内本基金份额净值增长率为-8.35%；同期业绩基准增长率为-11.78%。

## 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，国内政策底有望探明，去杠杆的节奏也有可能发生变化，但是外部风险依旧，整体经济较上半年难言有大的改观，市场的个股和结构性机会大于整体的系统性机会，本基金的投资也将做相应调整以应对未来市场变化。

## 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，本基金托管人在对平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金的管理人——平安大华基金管理有限公司在平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金 2018 年 2 月 8 日持有基金托管人股票，经本托管人的函件提示后，平安大华基金管理有限公司对平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金的投资组合进行了调整。本报告期内，平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金未进行利润分配，符合基金合同约定。

### 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

本托管人依法对平安大华基金管理有限公司编制和披露的平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、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：平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款		14,715,075.78	-
结算备付金		8,018,475.74	-
存出保证金		51,897.00	-
交易性金融资产		121,331,119.24	-
其中：股票投资		102,760,819.24	-
基金投资		-	-
债券投资		18,570,300.00	-
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		68,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		154,939.32	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		212,271,507.08	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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		-	-
应付证券清算款		4,954,950.68	-
应付赎回款		54,445.54	-
应付管理人报酬		262,569.45	-
应付托管费		43,761.57	-
应付销售服务费		66,813.96	-
应付交易费用		117,766.19	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		98,938.79	-
负债合计		5,599,246.18	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		225,109,755.07	-
未分配利润		-18,437,494.17	-
所有者权益合计		206,672,260.90	-
负债和所有者权益总计		212,271,507.08	-

注：1、本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止期间；

2、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，平安大华量化精选 A 基金份额净值 0.9196 元，基金份额总额 117,106,722.84 份；平安大华量化精选 C 基金份额净值 0.9165 元，基金份额总额 108,003,032.23 份。平安大华量化精选混合型发起式份额总额合计为 225,109,755.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 2 月 1 日(基金 合同生效日)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
<b>一、收入</b>		-16,628,238.61	-
1.利息收入		1,510,784.16	-
其中：存款利息收入		129,503.56	-
债券利息收入		220,160.27	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,161,120.33	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,171,571.72	-
其中：股票投资收益		-7,333,662.54	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		518.54	-
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		1,161,572.28	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-11,981,368.63	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		13,917.58	-
<b>减：二、费用</b>		2,524,650.38	-
1. 管理人报酬		1,378,025.80	-
2. 托管费		229,670.97	-
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	354,889.86	-
4. 交易费用		460,323.57	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		101,740.18	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-19,152,888.99	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-19,152,888.99	-

注：本基金于 2018 年 2 月 1 日成立，故无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 1 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 2 月 1 日(基金合同生效日)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）	239,043,619.41	-	239,043,619.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-19,152,888.99	-19,152,888.99
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）	-13,933,864.34	715,394.82	-13,218,469.52
其中：1.基金申购款	59,392.85	-3,364.00	56,028.85
2.基金赎回款	-13,993,257.19	718,758.82	-13,274,498.37

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）	225,109,755.07	-18,437,494.17	206,672,260.90

注：本基金于 2018 年 2 月 1 日成立，故无上年度可比期间数据。

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

平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金（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[2017]1066 号。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2017 年 12 月 25 日至 2018 年 1 月 26 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 238,882,090.36，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 239,043,619.41 份基金份额，其中认购资金利息折合 161,529.05 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他 中国证监会允许基金投资的股票），权证，股指期货，国债期货，债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。股票占基金资产的比例范围为 45-90%，其中每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

## 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》、《平安大华量化精选混合型发起式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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 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 2 月 1 日(基金合同生效日)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

### 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(2) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，但本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；(3) 基金合同生效不满三个月，收益可不分配；(4) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；(5) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金进行分红，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中

证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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估计变更。

### 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) 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，包括买卖债券的差价收入，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 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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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

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

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的股票交易

#### 6.4.8.1.2 债券交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的债券交易

### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方佣金。

## 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 2018年2月1日(基金合同生效日) 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	1,378,025.80	-
其中：支付销售机构的客户维护费	902,413.40	-

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 1.50% 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 × 1.50% / 当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月1日(基金合同生效日) 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托管费	229,670.97	-

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----

各关联方名称	2018 年 2 月 1 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华量化精选 A	平安大华量化精选 C	合计
平安银行	-	156.51	156.51
平安大华基金	-	125.61	125.61
平安证券	-	32.05	32.05
工商银行	-	345,439.16	345,439.16
合计	-	345,753.33	345,753.33

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安大华基金管理有限公司，再由平安大华基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

#### 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

本基金本报告期内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

份额单位：份

项目	本期	
	2018 年 2 月 1 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	平安大华量化精选 A	平安大华量化精选 C
基金合同生效日（ 2018 年 2 月 1 日）持有的 基金份额	10,005,417.21	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,005,417.21	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.4400%	-

比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）

##### 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2月1日(基金合同生效日)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
工商银行-活期存款	14,715,075.78	76,161.62	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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

本基金于本期末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

本基金于本期无须作说明的其他关联交易事项。

## 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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

### 6.4.9.2 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	60,400	459,404.06	451,188.00	-

注：本基金截至 2018 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。

### 6.4.9.3 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

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。

#### 6.4.9.3.2 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 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	102,760,819.24	48.41
	其中：股票	102,760,819.24	48.41
2	固定收益投资	18,570,300.00	8.75
	其中：债券	18,570,300.00	8.75
	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	68,000,000.00	32.03
	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	22,733,551.52	10.71
7	其他各项资产	206,836.32	0.10
8	合计	212,271,507.08	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	4,643,586.00	2.25
C	制造业	48,037,135.94	23.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,015,173.85	1.46
E	建筑业	2,697,760.00	1.31
F	批发和零售业	4,687,279.00	2.27
G	交通运输、仓储和邮政业	3,515,889.60	1.70
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,518,972.00	0.73
J	金融业	26,249,468.00	12.70
K	房地产业	4,199,835.00	2.03
L	租赁和商务服务业	591,426.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	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	2,192,967.71	1.06
R	文化、体育和娱乐业	1,330,100.00	0.64
S	综合	-	-
	合计	102,760,819.24	49.72

## 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	600519	贵州茅台	5,910	4,322,928.60	2.09
2	000651	格力电器	77,900	3,672,985.00	1.78
3	000338	潍柴动力	345,000	3,018,750.00	1.46
4	600018	上港集团	452,760	2,698,449.60	1.31
5	000333	美的集团	51,000	2,663,220.00	1.29
6	000776	广发证券	189,800	2,518,646.00	1.22
7	600837	海通证券	245,400	2,323,938.00	1.12
8	601288	农业银行	649,600	2,234,624.00	1.08
9	600030	中信证券	134,400	2,227,008.00	1.08
10	600036	招商银行	82,900	2,191,876.00	1.06

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	6,441,273.00	3.12
2	000776	广发证券	5,425,507.00	2.63
3	000651	格力电器	4,867,510.00	2.36
4	600519	贵州茅台	4,586,545.80	2.22
5	600016	民生银行	4,530,442.00	2.19
6	600036	招商银行	4,491,585.62	2.17
7	000338	潍柴动力	4,158,188.00	2.01
8	601166	兴业银行	3,641,785.00	1.76
9	601328	交通银行	3,560,243.00	1.72
10	000333	美的集团	3,556,962.00	1.72
11	600018	上港集团	3,476,777.40	1.68
12	601688	华泰证券	3,349,239.00	1.62
13	600030	中信证券	3,312,104.00	1.60
14	600837	海通证券	3,157,155.00	1.53
15	601012	隆基股份	2,983,708.00	1.44
16	600276	恒瑞医药	2,852,511.00	1.38
17	000858	五粮液	2,835,116.00	1.37
18	600606	绿地控股	2,819,806.00	1.36
19	601186	中国铁建	2,737,184.00	1.32
20	600048	保利地产	2,727,698.00	1.32

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	3,414,070.00	1.65
2	600016	民生银行	3,006,230.00	1.45
3	600606	绿地控股	2,598,290.00	1.26
4	000596	古井贡酒	2,583,577.05	1.25
5	000776	广发证券	2,282,629.00	1.10
6	601328	交通银行	2,010,615.00	0.97
7	600276	恒瑞医药	1,921,869.00	0.93

8	601166	兴业银行	1,725,132.00	0.83
9	601939	建设银行	1,705,557.00	0.83
10	601398	工商银行	1,696,160.00	0.82
11	601006	大秦铁路	1,691,022.00	0.82
12	600036	招商银行	1,686,819.00	0.82
13	601668	中国建筑	1,676,059.00	0.81
14	600019	宝钢股份	1,634,369.00	0.79
15	600170	上海建工	1,625,535.00	0.79
16	600048	保利地产	1,607,448.00	0.78
17	601012	隆基股份	1,585,349.00	0.77
18	600079	人福医药	1,562,008.00	0.76
19	000625	长安汽车	1,431,078.00	0.69
20	600056	中国医药	1,368,820.00	0.66

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	261,683,064.94
卖出股票收入（成交）总额	139,492,345.33

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	18,570,300.00	8.99
	其中：政策性金融债	18,570,300.00	8.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,570,300.00	8.99

## 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	018005	国开 1701	185,000	18,570,300.00	8.99

## 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 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

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	51,897.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	154,939.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	206,836.32

### 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处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况

### 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

份额级别	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
平安大华量化精选 A	616	190,108.32	10,005,417.21	8.54%	107,101,305.63	91.46%
平安大华量化精选 C	563	191,834.87	0.00	0.00%	108,003,032.23	100.00%
合计	1,151	195,577.55	10,005,417.21	4.44%	215,104,337.86	95.56%

上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	平安大华量化精选 A	41,471.39	0.0354%
	平安大华量化精选 C	100.08	0.0001%
	合计	41,571.47	0.0185%

基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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	份额级别	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	平安大华量化精选 A	0
	平安大华量化精选 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安大华量化精选 A	0
	平安大华量化精选 C	0
	合计	0

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,005,417.21	4.19	10,005,417.21	4.19	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,005,417.21	4.19	10,005,417.21	4.19	3 年

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安大华量化精 选 A	平安大华量化精 选 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 1 日）基金份 额总额	122,241,266.21	116,802,353.20
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	33,368.35	26,024.50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	5,167,911.72	8,825,345.47
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	117,106,722.84	108,003,032.23

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
新时代证券	3	126,672,217.21	31.60%	90,101.21	31.60%	-

海通证券	4	101,478,015.01	25.31%	72,180.82	25.31%	-
太平洋证券	2	97,550,826.03	24.33%	69,387.77	24.33%	-
中泰证券	2	43,613,456.94	10.88%	31,022.31	10.88%	-
爱建证券	2	31,560,887.68	7.87%	22,449.41	7.87%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-

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。

3、本基金报告期合同生效，上述租用交易单元均为本期新增所用。

### 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
新时代证券	-	-	889,700,000.00	11.25%	-	-
海通证券	-	-	1,550,000,000.00	19.60%	-	-
太平洋证券	-	-	1,834,000,000.00	23.19%	-	-
中泰证券	-	-	1,265,000,000.00	15.99%	-	-
爱建证券	24,737,660.54	100.00%	2,370,100,000.00	29.97%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

平安大华基金管理有限公司  
2018 年 8 月 27 日