

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证  
券投资基金  
2018 年第 3 季度报告

2018 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：2018 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 2018 年 10 月 24 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 2018 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 | 15,832,826.60 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 | 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。 |
| 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（2018年7月1日—2018年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | -65,824.27                |
| 2. 本期利润         | -1,063,212.96             |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0677                   |
| 4. 期末基金资产净值     | 14,650,834.35             |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9253                    |

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

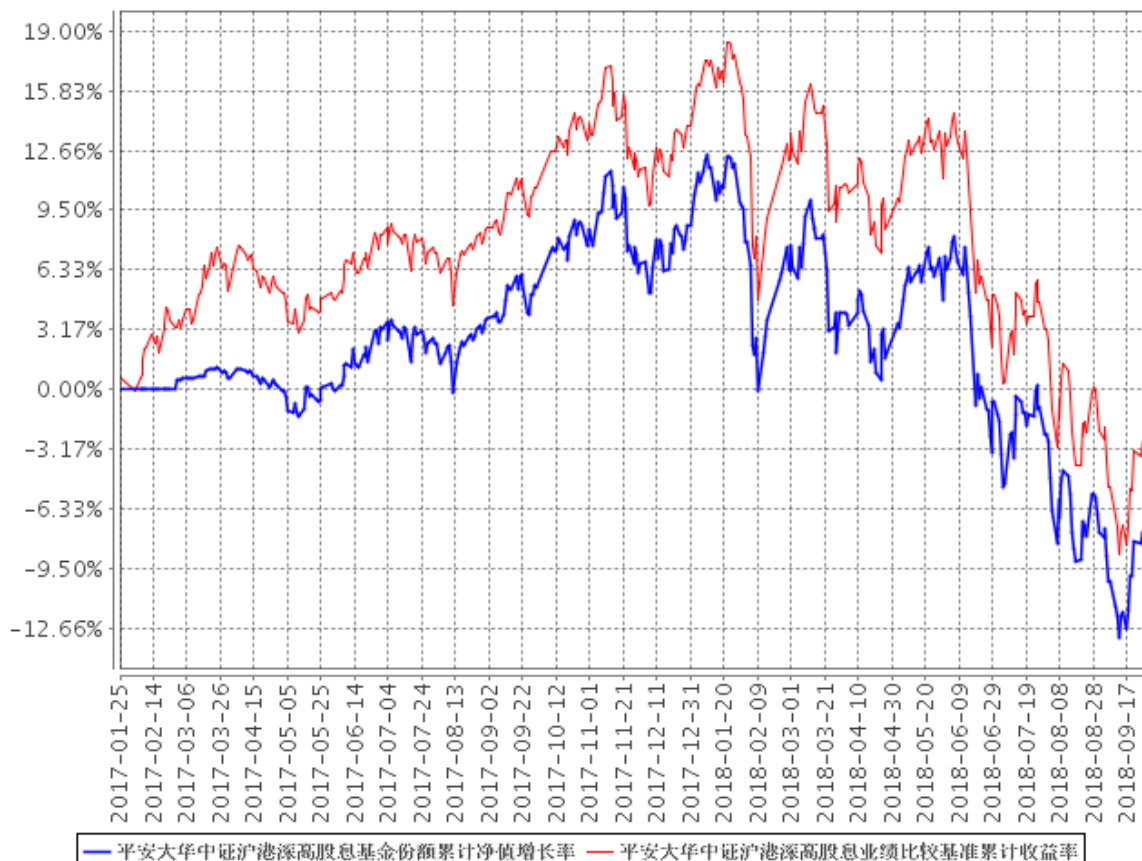
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -6.84%     | 1.23%         | -7.28%         | 1.24%                 | 0.44% | -0.01% |

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，截至报告期末已满一年；
- 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，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、平安大华港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 |
| 钱晶 | 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经理  | 2018 年 3 月 26 日 | -    | 6      | 钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安大华基金管理有限公司，任资产配置事业部 ETF 指数部投资经理。现任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 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数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

回顾三季度，市场风格延续了上半年以来的特征，风格差异明显，市场风险偏好下降，小盘股指数、创业板指数一路下行，三季度下行幅度较上半年更为显著，大市值龙头效应明显，市场整体呈震荡下行的趋势，其中消费、医药类板块跌幅较大，金融板块估值处于历史低位，且具备防御性特征，三季度获得正收益。本基金继续以跟踪中证沪港深指数为目标，参与市场估值与分红带来的净值增长机会。

#### 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 0.9253 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.84%，业绩比较基准收益率为-7.28%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，截至报告期末，以上情况未消除。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》第四十一条的规定，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。

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低于 200 人的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 13,429,683.34 | 90.46        |
|    | 其中：股票             | 13,429,683.34 | 90.46        |
| 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      | 1,389,432.51  | 9.36         |
| 8  | 其他资产              | 27,117.84     | 0.18         |
| 9  | 合计                | 14,846,233.69 | 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      | -            | -            |
| C  | 制造业      | 7,006,540.92 | 47.82        |

|   |                  |              |       |
|---|------------------|--------------|-------|
| 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           | 47,926.00    | 0.33  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 402,126.80   | 2.74  |
| H | 住宿和餐饮业           | -            | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 178,204.00   | 1.22  |
| J | 金融业              | 122,557.60   | 0.84  |
| 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    | 47,671.80    | 0.33  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -     |
| P | 教育               | -            | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | 99,168.75    | 0.68  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 234,730.00   | 1.60  |
| S | 综合               | -            | -     |
|   | 合计               | 8,138,925.87 | 55.55 |

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

### 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（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|--------------|--------------|
| A 基础材料    | 268,314.35   | 1.83         |
| B 消费者非必需品 | 2,755,260.73 | 18.81        |
| C 消费者常用品  | -            | -            |
| D 能源      | -            | -            |
| E 金融      | 308,422.48   | 2.11         |
| F 医疗保健    | 242,602.22   | 1.66         |
| G 工业      | 892,234.11   | 6.09         |
| H 信息技术    | 238,862.43   | 1.63         |
| I 电信服务    | 248,805.86   | 1.70         |
| J 公用事业    | -            | -            |
| K 房地产     | 336,255.29   | 2.30         |
| 合计        | 5,290,757.47 | 36.11        |



### 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  | 000895 | 双汇发展     | 24,500  | 640,675.00 | 4.37         |
| 2  | 01382  | 互太纺织     | 98,000  | 575,188.12 | 3.93         |
| 3  | 00868  | 信义玻璃     | 63,000  | 548,270.45 | 3.74         |
| 4  | 600660 | 福耀玻璃     | 15,800  | 402,110.00 | 2.74         |
| 5  | 00177  | 江苏宁沪高速公路 | 45,500  | 401,978.76 | 2.74         |
| 6  | 00173  | 嘉华国际     | 103,000 | 336,255.29 | 2.30         |
| 7  | 02020  | 安踏体育     | 10,000  | 330,421.23 | 2.26         |
| 8  | 00551  | 裕元集团     | 17,000  | 325,361.51 | 2.22         |
| 9  | 002372 | 伟星新材     | 21,415  | 317,370.30 | 2.17         |
| 10 | 00165  | 中国光大控股   | 25,000  | 308,422.48 | 2.11         |

#### 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  | 00001 | 长和   | 500   | 39,685.75 | 0.27         |

### 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。

### 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

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

### 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 | 376.06 |

|   |         |           |
|---|---------|-----------|
| 2 | 应收证券清算款 | -         |
| 3 | 应收股利    | 26,491.26 |
| 4 | 应收利息    | 250.52    |
| 5 | 应收申购款   | -         |
| 6 | 其他应收款   | -         |
| 7 | 待摊费用    | -         |
| 8 | 其他      | -         |
| 9 | 合计      | 27,117.84 |

#### 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处于转股期的可转换债券。

#### 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

注：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

注：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               | 15,607,359.55 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 443,008.14    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 217,541.09    |
| 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               | 15,832,826.60 |

## § 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              | 20180701-20180930        | 10,011,200.00 | 0.00 | 0.00 | 10,011,200.00 | 63.23% |
| 产品特有风险   |                |                          |               |      |      |               |        |
| <p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> |                |                          |               |      |      |               |        |

## § 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

2018 年 10 月 25 日