平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金 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

平安大华鑫利混合			
_			
003626			
契约型开放式			
2016年12月7日			
181, 428. 79 份			
在严格控制风险的基础上,本基金通过灵活的资产配置,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。			
本基金转型为开放式基金后,将灵活运用多种投资策略,在严格控制风险的前提下,充分挖掘市场投资机会,力争实现基金资产的长期稳健增值。			
沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。			
本基金是混合型证券投资基金,预期风险和预期 收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股 票型基金。			
平安大华基金管理有限公	司		
平安银行股份有限公司			
平安大华鑫利混合 A	平安大华鑫利混合 C		
-	-		
003626 006433			
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 - -			
	一003626 契约型开放式 2016年12月7日 181,428.79份 在严格控制风险的基础上产配置,力求在有效分散产的长期稳健增值。 本基金转型为开放式基金资策略,在严格控制风险场投资机会,力争实现基值。 沙深 300 指数收益率×3益率×70%。 本基金是混合型证券投资收益高于债券型基金和货票型基金。 平安大华基金管理有限公平安大华鑫利混合A		

报告期末下属分级基金的份额总额	176, 612. 76 份	4,816.03 份
下属分级基金的风险收益特征	_	_

备注:为更好地满足投资者的投资需求,本基金管理人在与本基金托管人平安银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案后,决定自 2018 年 9 月 14 日起在现有基金份额的基础上增设 C 类份额。

§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)		
	平安大华鑫利混合 A	平安大华鑫利混合C	
1. 本期已实现收益	7. 97	-0.12	
2. 本期利润	7. 97	-0.12	
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0000	0.0000	
4. 期末基金资产净值	183, 366. 70	4, 999. 88	
5. 期末基金份额净值	1. 0382	1. 0382	

- 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

平安大华鑫利混合 A

_							
	ILV EV	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	(1)-(3)	(a) _(A)
	阶段	率①	标准差②	准收益率③	益率标准差④		2-4
	过去三个 月	0.00%	0.00%	0. 42%	0. 40%	-0. 42%	-0.40%
L							

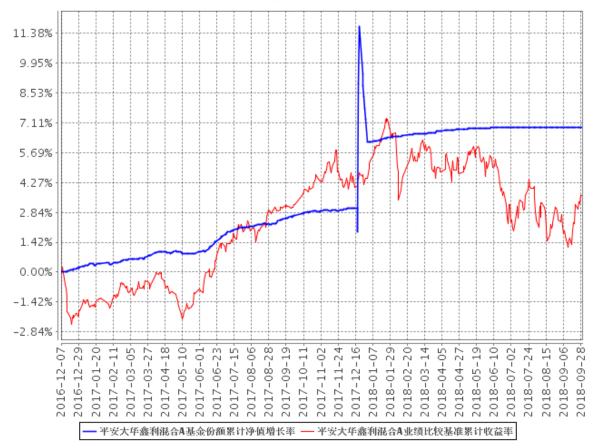
平安大华鑫利混合 C

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	0. 00%	0.00%	2. 09%	0.37%	-2.09%	-0.37%

中证综合债指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*30%

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

平安大华鑫利混合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



2018-09-29

2018-09-28

2018-09-27



平安大华鑫利混合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2016年12月7日正式生效,截至报告期末已满一年;

2018-09-18

2018-09-19

2018-09-20

平安大华鑫利混合C基金份额累计净值增长率 — 平安大华鑫利混合C业绩比较基准累计收益率

2018-09-21

2018-09-22

2018-09-23

2018-09-24

2018-09-26

2018-09-25

- 2、自 2018 年 9 月 14 日起在现有基金份额的基础上增设 C 类份额;
- 3、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。

3.3 其他指标

0.00%

-0.23%

本基金本报告期内无其他指标。

2018-09-15

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

州 夕	1117夕	任本基金的	基金经理期限	证券从业	2유 미
姓名	职务	任职日期	离任日期	年限	说明
WANG AO	平华灵置型投金金安鑫活混证资的经工大利配合券基基	2016年12月7日		5	WANG AO 先生,澳大利亚籍,CAIA、FRM,CFA,澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经纳什大学商学(金融学、经济学)学士。曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012年9月加入平安大华基金管理室。2012年9月加入平安大华基金管理的工作。现任平安大华基金研究员。现任平安大华嘉高大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华惠和灵活配置混合型证券投资基金、平安大华和债券型证券投资基金、平安大华和债券型证券投资基金、平安大华和债券型证券投资基金、平安大华和债券型证券投资基金、平安大华和债券型证券投资基金、平安大华双债添益债券型证券投资基金基金经理。
张文平	固益中资总平华灵置型投金金定投心执经安鑫活混证资的经收资投行、大利配合券基基	2018 年 9月 20日	_	7	张文平先生,南京大学硕士。先后担任毕马威(中国) 企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。2018年3月加入平安大华基金管理有限公司,现任固定收益投资中心投资执行总经理,同时担任平安大华短债债券型证券投资基金、平安大华国制货资基金、平安大华日增利货币场基金、平安大华目增利货币市场基金、平安大华各利灵活配置混合型证券投资

		1	<u> </u>		+ A 3. 1 (1 - 1 / 1 / 1 / 1 / 1 / 1 / 1 / 1 / 1 /
					基金、平安大华惠悦纯债债
					券型证券投资基金基金经
					理。
					段玮婧女士,中山大学硕
					士。曾担任中国中投证券有
					限责任公司投资经理。2016
					年9月加入平安大华基金管
					理有限公司,担任投资研究
					部固定收益组投资经理。
					2017年1月起担任平安大华
		2018 年 9月 26日	_	11	交易型货币市场基金、平安
	平华 灵置 型 投安 鑫活混证资基				大华金管家货币市场基金、
					平安大华合正定期开放纯
					债债券型发起式证券投资
段玮婧					基金、平安大华合瑞定期开
					放纯债债券型发起式证券
					投资基金、平安大华合韵定
	金基金				期开放纯债债券型发起式
	经理				证券投资基金、平安大华短
					债债券型证券投资基金、平
					安大华合慧定期开放纯债
					债券型发起式证券投资基
					金、平安大华合丰定期开放
					纯债债券型发起式证券投
					资基金、平安大华鑫利灵活
					配置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

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、《平安大华鑫利灵活配置混合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

今年三季度债券市场收益率先下后上,整体出现震荡走势,本基金的主要策略是以现金管理 为主,未进行权益投资。整体基本面因素对债券市场相对友好,但对冲政策的陆续出台,也导致 投资者预期出现一定分化。货币政策整体维持宽松格局,短端收益率下行较多。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安大华鑫利混合 A 基金份额净值为 1.0382 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.00%;同期业绩比较基准收益率为 0.42%;截至本报告期末平安大华鑫利混合 C 基金份额净值为 1.0382 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.00%;同期业绩比较基准收益率为 2.09%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内已出现连续 60 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。

本基金本报告期未出现连续20个工作日基金持有人数低于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	-	-
	其中: 股票	-	-
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	185, 439. 12	98. 39
8	其他资产	3, 033. 15	1.61
9	合计	188, 472. 27	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 。

5.2.2 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。

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 本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

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 本基金本报告期末未持有债券。 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

- **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** 本基金本报告期末未持有贵金属投资。
- **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** 本基金本报告期末未持有权证。
- 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

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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,或在报告编制目前一

年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	33. 15
5	应收申购款	
6	其他应收款	3, 000. 00
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	3, 033. 15

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

项目	平安大华鑫利混合 A	平安大华鑫利混合C
报告期期初基金份额总额	169, 123. 90	-
报告期期间基金总申购份额	7, 926. 23	4, 816. 03
减:报告期期间基金总赎回份额	437. 37	_
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	176, 612. 76	4, 816. 03

§ 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

		报告期内持有基金	报告期末持有基金情况				
投资者 类别	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
	1	2018/07/012018/09/30	37, 496. 49	1	-	37, 496. 49	20. 67%
个人	2	2018/07/01-2018/09/30	84, 298. 81	186. 17	_	84, 484. 98	46. 57%

产品特有风险

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。

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。

§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鑫利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华鑫利灵活配置混合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) 报告期内平安大华鑫利灵活配置混合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