

# 平安大华鑫安混合型证券投资基金 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 10 月 26 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 25 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	平安大华鑫安混合
场内简称	-
交易代码	001664
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 11 日
报告期末基金份额总额	21,329,115.34 份
投资目标	本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求在严格控制风险的基础上，实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金将在资产配置允许的范围内，采取相对灵活的资产配置策略，使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整，以规避或分散市场风险，提高基金风险调整后的收益。本基金以自上而下的投资策略，大类资产，动态控制组合风险，力争长期、稳定的回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于中高风险收益水平的基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安大华鑫安混合 A	平安大华鑫安混合 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	001664	001665
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	18,617,696.10 份	2,711,419.24 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### §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）	
	平安大华鑫安混合 A	平安大华鑫安混合 C
1. 本期已实现收益	-524,349.23	-75,896.45
2. 本期利润	-733,523.95	-106,103.29
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0373	-0.0380
4. 期末基金资产净值	19,944,384.13	2,873,309.59
5. 期末基金份额净值	1.071	1.060

#### 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

平安大华鑫安混合 A

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	-3.25%	0.58%	0.12%	0.54%	-3.37%	0.04%

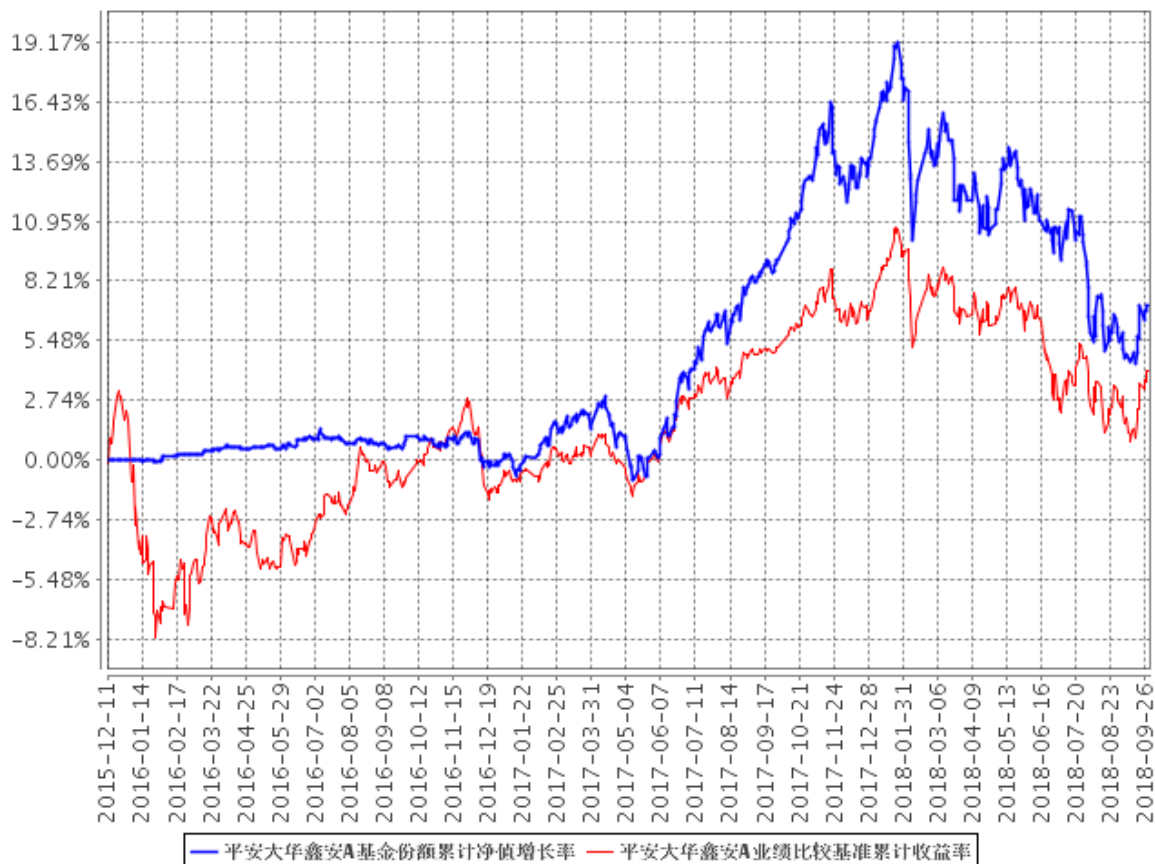
平安大华鑫安混合 C

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	-3.28%	0.59%	0.12%	0.54%	-3.40%	0.05%

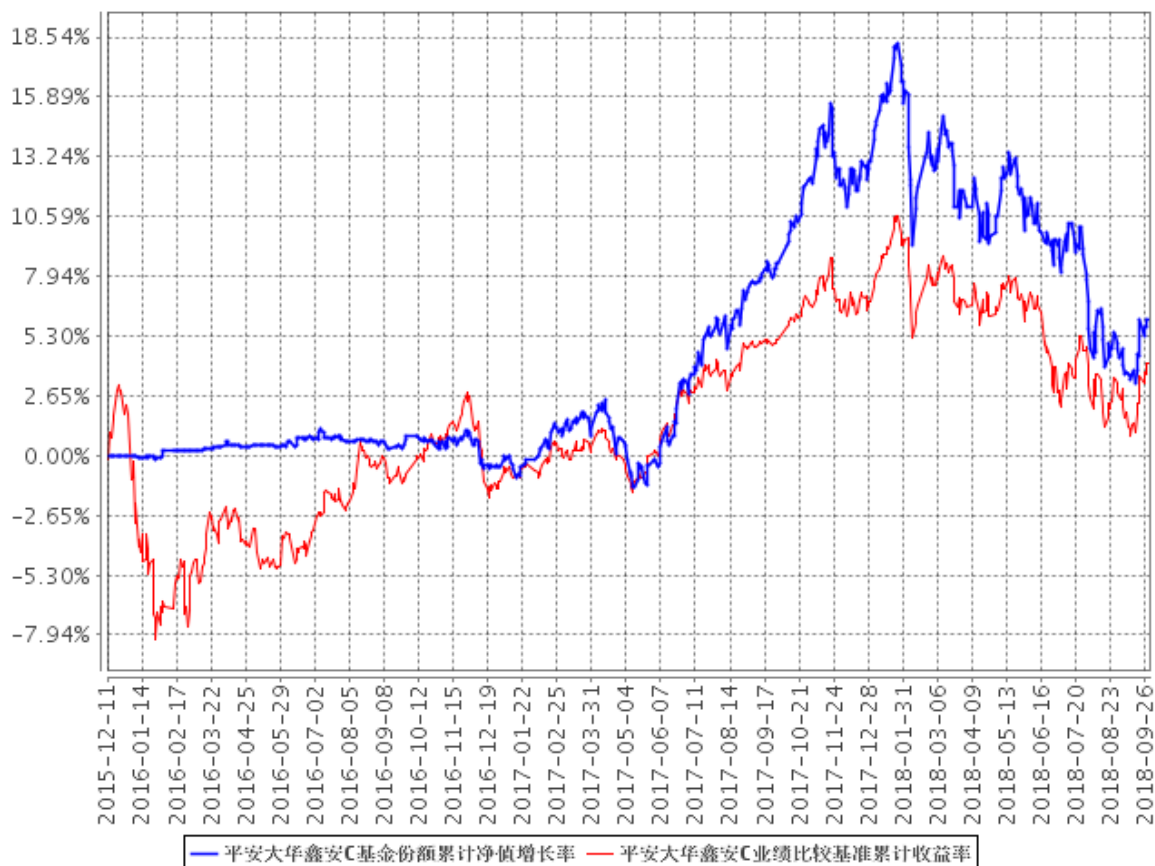
中证全债指数收益率\*60%+沪深 300 指数收益率\*40%

### 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

平安大华鑫安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



平安大华鑫安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 2015 年 12 月 11 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。

### 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	平安大华鑫安混合型证券投资基金基金经理	2016 年 12 月 27 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。
高勇标	平安大华鑫安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、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华合锦定期开放债券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、《平安大华鑫安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，并本着诚实守信、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。三季度，出于对各项内外不确定性的担忧，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，以精选低估值防御性个股为主要配置策略，取得超额收益。

#### 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安 A 基金份额净值为 1.071 元，本报告期基金份额净值增长率为 -3.25%；截至本报告期末平安大华鑫安 C 基金份额净值为 1.060 元，本报告期基金份额净值增长率为 -3.28%；同期业绩比较基准收益率为 0.12%。

#### 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	7,463,020.90	32.27
	其中：股票	7,463,020.90	32.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,066,000.00	47.85
	其中：债券	11,066,000.00	47.85
	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	4,303,697.16	18.61
8	其他资产	291,601.08	1.26
9	合计	23,124,319.14	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

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	6,258,522.90	27.43
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	2,099.00	0.01
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	-	-
J	金融业	203,618.00	0.89
K	房地产业	998,781.00	4.38
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	7,463,020.90	32.71

### 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

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	603156	养元饮品	52,804	2,644,952.36	11.59
2	000540	中天金融	250,950	998,781.00	4.38
3	300713	英可瑞	12,614	339,442.74	1.49
4	600271	航天信息	11,400	317,262.00	1.39
5	600031	三一重工	35,200	312,576.00	1.37
6	600104	上汽集团	9,100	302,848.00	1.33
7	600519	贵州茅台	400	292,000.00	1.28
8	600887	伊利股份	10,700	274,776.00	1.20
9	000858	五粮液	4,000	271,800.00	1.19
10	000651	格力电器	6,600	265,320.00	1.16

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,066,000.00	48.50
	其中：政策性金融债	11,066,000.00	48.50
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	11,066,000.00	48.50

#### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	110,000	11,066,000.00	48.50

#### 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	87,213.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	203,589.02
5	应收申购款	798.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	291,601.08

**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**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603156	养元饮品	2,644,952.36	11.59	流通受限
2	000540	中天金融	998,781.00	4.38	重大事项

**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	平安大华鑫安混合 A	平安大华鑫安混合 C
报告期期初基金份额总额	20,671,538.97	2,887,666.94
报告期期间基金总申购份额	55,537.88	6,468.47
减：报告期期间基金总赎回份额	2,109,380.75	182,716.17
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	18,617,696.10	2,711,419.24

## §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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安大华鑫安混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华鑫安混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华鑫安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安混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

### 8.3 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 26 日