

平安大华鑫荣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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	平安大华鑫荣混合	
场内简称	-	
交易代码	004827	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 23 日	
报告期末基金份额总额	50,896,512.92 份	
投资目标	本基金主要通过合理配置大类资产和精选投资标的，在严格控制下行风险和保持资产流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金将采取主动的类属资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合财富（总值）指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款利率×5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安大华鑫荣混合 A	平安大华鑫荣混合 C
下属分级基金的场内简称	-	-

下属分级基金的交易代码	004827	004828
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	12,327,847.85 份	38,568,665.07 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）	
	平安大华鑫荣混合 A	平安大华鑫荣混合 C
1. 本期已实现收益	74,278.36	136,794.98
2. 本期利润	-133,677.38	-486,904.05
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0101	-0.0124
4. 期末基金资产净值	12,035,622.27	37,384,131.10
5. 期末基金份额净值	0.9763	0.9693

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

平安大华鑫荣混合 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	-1.24%	0.41%	0.96%	0.20%	-2.20%	0.21%

平安大华鑫荣混合 C

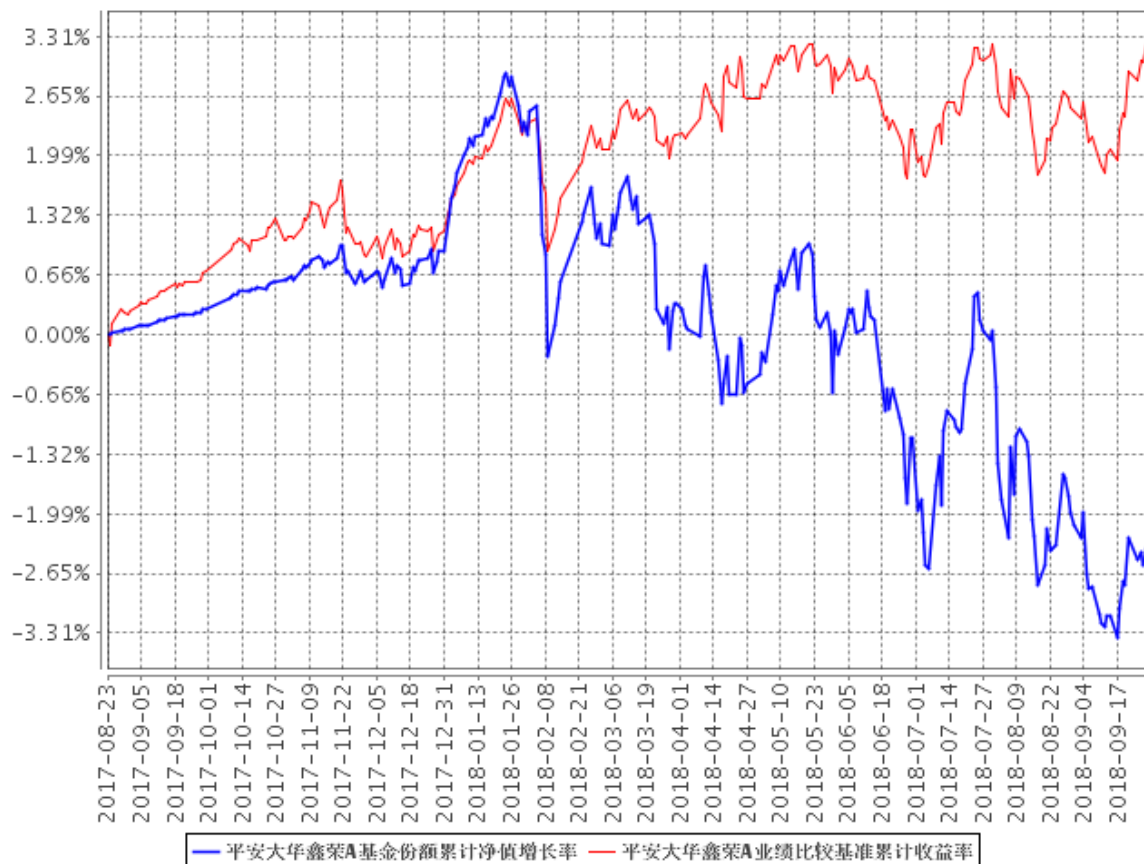
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.39%	0.41%	0.96%	0.20%	-2.35%	0.21%

中债新综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+金融机构人民币活期存款利率

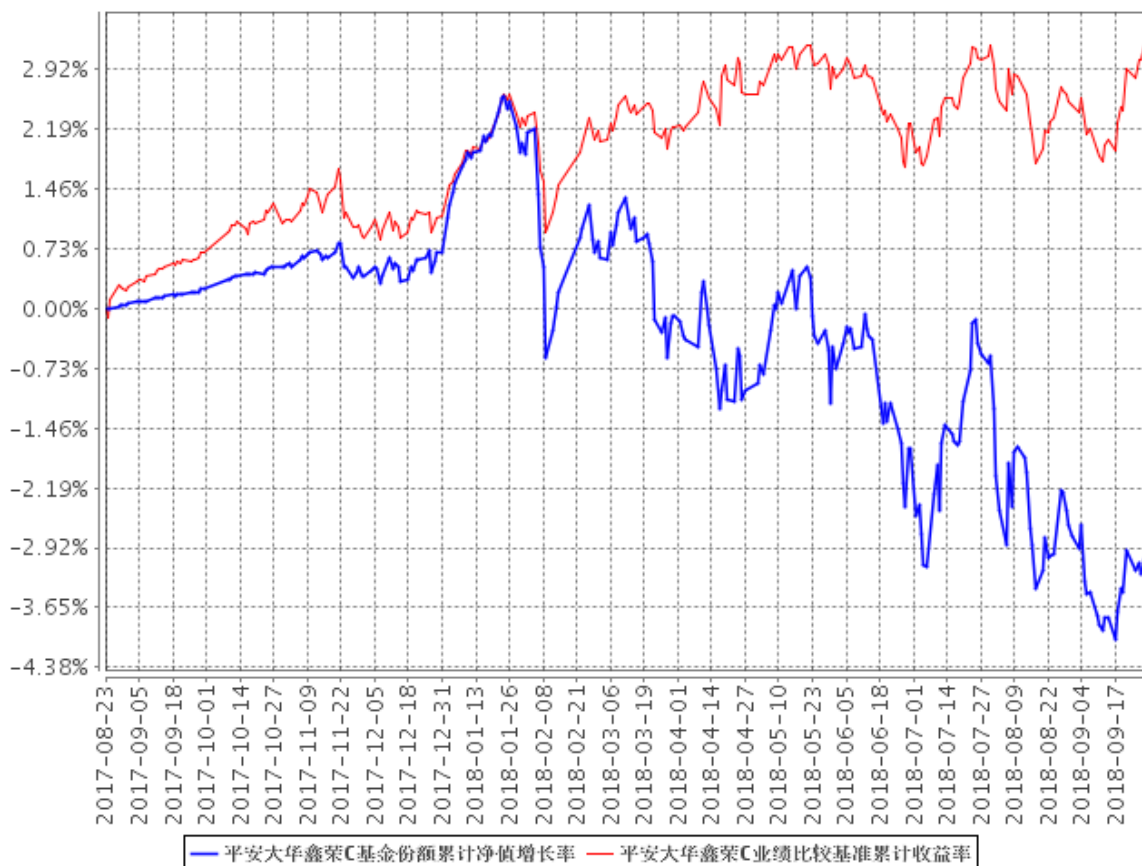
*5%

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

平安大华鑫荣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



平安大华鑫荣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 2017 年 08 月 23 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		
申俊华	平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金经理	2017年8月23日	-	9	申俊华女士，湖南大学金融学博士。曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员。2012年加入平安大华基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员。现担任平安大华财富宝货币市场基金、平安大华交易型货币市场基金、平安大华金管家货币市场基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫荣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、平安大华日增利货币市场基金基金经理。
DANIEL DONGNING SUN	平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金经理、衍生品投资中心投资执行总经理	2017年9月12日	-	13	DANIEL DONGNING SUN 先生，美国籍，北京大学硕士，美国哥伦比亚大学博士，约翰霍普金斯大学博士后。先后担任瑞士再保险自营交易部量化分析师、花旗集团投资银行高级副总裁、瑞士银行投资银行交易量化总监、德意志银行战略科技部量化服务负责人。2014年10月加入平安大华基金管理有限公司，任衍生品投资中心投资执行总经理。现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金、平安大华沪深300指数量化增强证券投资基金、平安大华鑫荣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、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。
张恒	平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金经理	2018 年 1 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、平安大华惠兴纯债债券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、《平安大华鑫荣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

三季度资金面依然宽松，融资收缩逻辑在发酵至极致后由于政策的纠偏开始受到一定的挑战，在此背景下债券收益率整体先下后上，短端表现优于长端。本基金债券部分主要配置利率债、剩余期限 2 年内的同业存单等短端品种。

权益市场方面，考虑到三季度房地产数据和消费数据都不及预期乐观，中美贸易格局不明朗，而股票市场估值已经接近历史最低位置，保持中性的仓位，同时注重所持有股票的现金流稳定，未来经营受宏观经济影响较小，主要布局交运、电力、快消品、OTC 医药、银行等防御性板块。

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荣 A 基金份额净值为 0.9763 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.24%；截至本报告期末平安大华鑫荣 C 基金份额净值为 0.9693 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.39%；同期业绩比较基准收益率为 0.96%。

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 20 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。

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	10,052,952.20	20.22
	其中：股票	10,052,952.20	20.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,069,900.00	64.51
	其中：债券	32,069,900.00	64.51
	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	6,967,797.58	14.02
8	其他资产	619,712.49	1.25
9	合计	49,710,362.27	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

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	14,564.00	0.03
B	采矿业	392,419.00	0.79
C	制造业	4,672,579.00	9.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	72,633.40	0.15
E	建筑业	692,150.60	1.40
F	批发和零售业	740,882.00	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	99,196.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,731.00	0.12
J	金融业	1,815,594.00	3.67
K	房地产业	737,840.00	1.49
L	租赁和商务服务业	245,913.20	0.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	421,110.00	0.85

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	87,340.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	10,052,952.20	20.34

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	600030	中信证券	40,000	667,600.00	1.35
2	600285	羚锐制药	59,400	492,426.00	1.00
3	002713	东易日盛	20,000	353,000.00	0.71
4	600048	保利地产	25,100	305,467.00	0.62
5	600036	招商银行	9,900	303,831.00	0.61
6	000333	美的集团	7,500	302,250.00	0.61
7	002271	东方雨虹	20,000	290,600.00	0.59
8	600028	中国石化	39,200	279,104.00	0.56
9	000501	鄂武商A	26,000	275,340.00	0.56
10	601939	建设银行	36,900	267,156.00	0.54

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	7,949,900.00	16.09
	其中：政策性金融债	7,949,900.00	16.09
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	24,120,000.00	48.81
9	其他	-	-
10	合计	32,069,900.00	64.89

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	111787087	17 杭州银行 CD214	100,000	9,556,000.00	19.34
2	108602	国开 1704	50,000	5,032,500.00	10.18
3	111815459	18 民生银行 CD459	50,000	4,869,500.00	9.85
4	111883774	18 南京银行 CD105	50,000	4,869,000.00	9.85
5	111808198	18 中信银行 CD198	50,000	4,825,500.00	9.76

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中，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	5,905.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	613,807.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	619,712.49

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	000333	美的集团	302,250.00	0.61	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	平安大华鑫荣混合 A	平安大华鑫荣混合 C
报告期期初基金份额总额	14,956,741.65	41,664,330.78
报告期期间基金总申购份额	2,500.53	4,118,273.26
减：报告期期间基金总赎回份额	2,631,394.33	7,213,938.97
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	12,327,847.85	38,568,665.07

§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荣混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华鑫荣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荣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