

## 平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金

## 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:平安银行股份有限公司

送交日期:2018 年 8 月 24 日

## § 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责任。本基金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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 日复核了本基金报告中的财务指标、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。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本年度报告摘要摘自半年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华惠盈纯债
基金代号	-
基金主代码	002795
前基金代号	-
基金名称	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
报告期末基金总资产	489,599,129.92 元
基金合同存续期间	不定期
基金上市交易的证券交易所	-
上市日期	-

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在谨慎控制组合波动率的前提下，本基金追求基金产品的长期稳定增值，力争在同类基金中取得较好的相对收益。
投资策略	本基金通过深入研究和分析，精选具有较好投资价值的债券品种，构建资产配置组合。本基金将主要投资于国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、央行票据、资产支持证券、货币市场工具等固定收益品种，同时适当参与新股申购、股票二级市场投资、权证投资等权益类资产的投资。本基金将通过久期管理、利率预期、收益率曲线分析等方法，在严格控制风险的前提下，力争获得超越基准的稳定收益。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)*12%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益及风险水平高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。
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	平安银行股份有限公司
法定代表人	周正伟	万方
信息披露负责人	0755-2262628	0755-22160168
电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fang@275@pingan.com.cn
客户服务电话	400-800-4800	95511-3
传真	0755-2397678	0755-8260387

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年报正文的管理人互联网网址: <http://www.fund.pingan.com>

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

3.1.1 利润数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,054,146.98
本期利润	18,903,053.24
加权平均基金份额利润	0.0366
本期期末基金份额总额	394%
期末可供分配基金份额利润	0.0301
期末基金资产净值	504,323,217.96
期末基金份额净值	1.000

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.期末可供分配利润采用期末资产负责表中未分配利润与未分配利润加上本期利润的孰低数(为期末余额,而非当期发生数);

3.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,计算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

阶段 固定期限增长长率 (%) 短期回报率差 (%) 相对回报率差 (%) ①-② ②-④

过去一个月 0.39% 0.08% 0.21% 0.01% 0.16% 0.04%

过去一个季度 1.78% 0.10% 0.65% 0.01% 1.13% 0.09%

过去六个月 3.94% 0.09% 1.30% 0.01% 2.64% 0.08%

过去一年 4.36% 0.07% 2.66% 0.01% 1.70% 0.06%

自基金合同生效日起至今 3.00% 0.09% 5.69% 0.01% -2.60% 0.08%

业绩比较基准 - 1.2% 一年期银行定期存款利率(税后)\*12%

风险收益特征 本基金为债券型基金,预期收益及风险水平高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。

## 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



1.本基金合同于 2016 年 6 月 3 日正式生效,截至报告期末已满两年;

2.按照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。

## 3.4 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,注册资本为 3 亿元人民币,是目前中国内地基金业注册资本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%;三盈亚洲实业有限公司,持有股权 14.3%。平安大华基金秉承“规范、诚信、专业、创新”的企业经营理念,致力于通过持续稳定的投资业绩,不断丰富的客户服务手段和服务内容,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“专业承载信誉”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。

## 4.2 基金经理(或基金经理助理)及基金经理助理简介

报告截止日 2018 年 06 月 30 日,基金份额净值 1.030 元,基金份

额总额 489,599,129.92 元。

## 4.3 涨跌情况

会计主体:平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金

本报告期,2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	附注号	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上期同期
收入		3,066,624.02	3,377,757.77
1.利息收入		12,719,173.18	13,493,286.67
其中:存款利息收入		11,933,600.00	10,496.50
债券利息收入		696,413.01	13,473,792.17
贵金属租赁收入		8,826.57	-
2.投资收益		-2,011,467.04	-886,296.00
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收入		9,848,906.28	-9,229,336.00
5.5.1.4 其他收入		-	-
5.5.1.5 手续费		1160	5910
5.5.1.6 营业收入		1,463,570.78	1,810,242.00
5.5.1.7 其他收入		736,456.98	714,815.09
5.5.1.8 其他费用		279,351.20	707,701.43
5.5.1.9 利息支出		279,351.20	197,118.49
5.5.1.10 其他费用		206,118.49	69.00
5.5.1.11 交易费用		18,903,053.24	1,567,303.37
5.5.1.12 其他费用		-	-
5.5.1.13 其他费用		-	-
5.5.1.14 其他费用		-	-
5.5.1.15 其他费用		-	-
5.5.1.16 其他费用		-	-
5.5.1.17 其他费用		-	-
5.5.1.18 其他费用		-	-
5.5.1.19 其他费用		-	-
5.5.1.20 其他费用		-	-
5.5.1.21 其他费用		-	-
5.5.1.22 其他费用		-	-
5.5.1.23 其他费用		-	-
5.5.1.24 其他费用		-	-
5.5.1.25 其他费用		-	-
5.5.1.26 其他费用		-	-
5.5.1.27 其他费用		-	-
5.5.1.28 其他费用		-	-
5.5.1.29 其他费用		-	-
5.5.1.30 其他费用		-	-
5.5.1.31 其他费用		-	-
5.5.1.32 其他费用		-	-
5.5.1.33 其他费用		-	-
5.5.1.34 其他费用		-	-
5.5.1.35 其他费用		-	-
5.5.1.36 其他费用		-	-
5.5.1.37 其他费用		-	-
5.5.1.38 其他费用		-	-
5.5.1.39 其他费用		-	-
5.5.1.40 其他费用		-	-
5.5.1.41 其他费用		-	-
5.5.1.42 其他费用		-	-
5.5.1.43 其他费用		-	-
5.5.1.44 其他费用		-	-
5.5.1.45 其他费用		-	-
5.5.1.46 其他费用		-	-
5.5.1.47 其他费用		-	-
5.5.1.48 其他费用		-	-
5.5.1.49 其他费用		-	-
5.5.1.50 其他费用		-	-
5.5.1.51 其他费用		-	-
5.5.1.52 其他费用		-	-
5.5.1.53 其他费用		-	-
5.5			