

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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
送出日期：2018年6月24日

§ 1 重要提示

1.1 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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并将董事长签发。

基金管理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。

本半年度报告需摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华中证沪港深高股息
场内简称	-
基金代码	0003702
前缀交易代码	-
后缀交易代码	-
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
报告期末基金份额总额	16,607,36956份
基金合同的终止日期	不适用
基金募集上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金采用价值投资策略，深港通机制下的沪港深高股息精选指数型基金，在正常市场情况下，力争在基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度绝对值控制在0.3%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

投资策略 本基金将被动地跟踪基金，原则上采取指数复制法，按照成份股在标的指数中的权重进行投资；同时根据成份股的特性和行业特征，进行适当的调整以应对市场的变化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等情况的说明
本基金管理人严格按照企业会计准则，《中国证监会关于证券投资基金管理估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定的基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核义务。

本基金管理人设有估值委员会，成员由投资管理部门、研究中心、资本风险管理部、基金运营部基金经理会计室及法律合规监督部相关人员组成。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，从而降低估值误差。

本基金管理人已与平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）签署服务协议，由平安银行股份有限公司按约定提供证券交易所交易的债券品种的估值数据以满足受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金估值政策和方法的说明
本基金估值在报告期内未进行定期份额分派，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
本基金估值在报告期内出现连续两个工作日基金资产净值低于0.95亿元的情形，基金管理人已向相关客户发布风险提示函，提醒客户注意投资风险。

4.9 管理人对本基金年度报告中财务数据的说明
本基金在半年度报告中未出现连续20个工作日基金份额持有人数低于200人的情形。

他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报吿期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的規定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理办法》公平交易制度指导意见》，完善公平交易制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金每季度末在旗下各组合进行股票和债券的同向交易盈亏差额分析，对本报告期内，两两组合间日自3,5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占比优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金在报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合与交易所内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 管理人对报告期内基金的经营业绩的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
回顾2018年上半年，A股市场发生了明显的变化，风格切换较以前加快，一季度市场的波动幅度加大，去年强势的白马蓝筹在一季度走出强势冲高行情后回落，出现较大涨幅震荡；同时A股成长风格出现结构性反转，部分成长股投资价值逐渐显现；进入二季度后，资金又去杠杠和美元贸易战不断发酵的影响，市场风险偏好下降，包括本基金在内的市场对于半年国内经济形势持谨慎态度，各大指数均出现大幅震荡和下跌，估值回撤，一定程度超出市场预期。港股方面，今年上半年，受到美元加息影响，美元持续走强，新兴市场流动性收紧，全球股市表现震荡。受中美贸易摩擦升级，金融去杠杆深化，加息预期持续等因素影响，港股市场风险偏好下降，恒生指数和恒生国企指数均呈现一定幅度下跌。

4.4.2 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0.9332元；本报告期基金份额净值增长率为-0.59%，业绩比较基准收益率为-7.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望下半年，国内金融市场去杠杠和资管新规将继续影响市场的风险偏好，加上外部风险依旧，国内整体经济较上半年有明显大的改善，市场的个股和结构性会大于整体的系统性机会；同时，国际发达国家经济的复苏态势也会加剧行业资金的溢出，香港市场仍然面临较大压力。本基金将继续以跟踪港股深股通指数为目标，参与市场估值与分红带来的净值增长机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等情况的说明
本基金管理人严格按照企业会计准则，《中国证监会关于证券投资基金管理估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定的基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核义务。

本基金管理人设有估值委员会，成员由投资管理部门、研究中心、资本风险管理部、基金运营部基金经理会计室及法律合规监督部相关人员组成。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，从而降低估值误差。

本基金管理人已与平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）签署服务协议，由平安银行股份有限公司按约定提供证券交易所交易的债券品种的估值数据以满足受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金估值政策和方法的说明
本基金估值在报告期内未进行定期份额分派，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
本基金估值在报告期内出现连续两个工作日基金资产净值低于0.95亿元的情形，基金管理人已向相关客户发布风险提示函，提醒客户注意投资风险。

4.9 管理人对本基金年度报告中财务数据的说明
本基金在半年度报告中未出现连续20个工作日基金份额持有人数低于200人的情形。

5.1 报告期内本基金遵规守信情况说明
本基金报告期内不存在违反《基金法》及其他法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的确定以及基金费用开支等方面进行了认真地核查，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金报告期未内未出现违反基金合同的约定。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本基金报告期内，本报告期未内未出现连续20个工作日基金份额持有人数低于200人的情形。

5.3 报告期内基金管理人和基金托管人

5.4 报告期内本基金的利润分配情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.5 报告期内本基金的半年度报告中未出现连续20个工作日基金份额持有人数低于200人的情形。

5.6 报告期内基金管理人报告的其他情况
5.6.1 报告期内本基金遵规守信情况说明
本基金报告期内不存在违反《基金法》及其他法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的确定以及基金费用开支等方面进行了认真地核查，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金报告期未内未出现违反基金合同的约定。

5.6.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本基金报告期内，本报告期未内未出现连续20个工作日基金份额持有人数低于200人的情形。

5.6.3 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.4 报告期内本基金的半年度报告中未出现连续20个工作日基金份额持有人数低于200人的情形。

5.6.5 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.6 报告期内本基金的半年度报告中未出现连续20个工作日基金份额持有人数低于200人的情形。

5.6.7 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.8 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.9 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.10 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.11 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.12 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.13 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.14 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.15 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.16 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.17 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.18 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.19 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.20 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.21 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.22 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.23 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.24 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.25 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.26 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.27 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.28 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.29 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.30 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.31 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.32 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.33 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.34 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.35 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.36 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.37 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.38 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.39 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.40 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.41 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.42 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.43 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.44 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.45 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.46 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.47 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.48 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.49 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和网站上披露。

5.6.50 报告期内基金管理人报告的其他情况
本基金在半年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.funxipg.com 和