

平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年8月27日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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法律责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2018年8月24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预示其未来表现,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基金更新。
本报告期内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完成建仓。
本报告期内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完成建仓。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金管理人, 基金托管人, etc.

2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: 基金名称, 基金类型, 基金运作方式, 基金存续期限, etc.

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人, 基金管理人名称, 基金托管人名称, etc.

2.4 信息披露方式

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人, 基金管理人名称, 基金托管人名称, etc.

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

Table with 2 columns: 项目, 2018年1-6月, 2017年1-6月, 2018年1-6月, 2017年1-6月, etc.

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

Table with 2 columns: 期间, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc.

3.2.2 基金合同生效以来基金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

注:1、沪深300指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%,其中,沪深300指数的成分股未选沪深300两个证券市场,覆盖了沪深市场60%左右的市值,是中国A股市场代表性最强、流动性高、可投资性大的投资组合,能够反映A股市场总体发展趋势。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、本基金合同生效以来基金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

注:1、沪深300指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%,其中,沪深300指数的成分股未选沪深300两个证券市场,覆盖了沪深市场60%左右的市值,是中国A股市场代表性最强、流动性高、可投资性大的投资组合,能够反映A股市场总体发展趋势。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

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”为根据合同约定确认的解聘日期;此后历任的非任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别根据合同约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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信情的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》和其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和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 管理人报告期内基金交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易控制指导意见》,完善相应制度及流程,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,公平对待旗下所有投资组合。

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。

4.3.3 所有交易行为的专项说明

本报告期内,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收盘价的5%。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年上半年,随着中美贸易摩擦加剧和“去杠杆”政策的推进,市场情绪出现波动,波动率显著提升。截至2018年6月底,沪深300、中证500和中证1000分别下跌12.90%、16.53%和20.08%,大盘跌幅小于小盘股。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

截至本报告期末平安300ETF联接A基金份额净值为0.9211元,本报告期基金份额净值增长率为-7.89%;截至本报告期末平安300ETF联接C基金份额净值为0.9201元,本报告期基金份额净值增长率为-7.99%;同期业绩比较基准收益率为-8.64%。

4.4.3 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,中国宏观增长面临来自外部和内部的不确定性,但新结构性机会还在且具备高成长性和操作空间,全年依然有望实现与2017年相似的经济增速。近期向降准等宽松政策的陆续推出,旨在稳步推进结构去杠杆的同时防范系统性金融风险,下半年金融风险进一步恶化的概率将大幅下降。经过今年2月以来的持续调整,截至2018年6月30日,沪深300市盈率为11.89倍,估值已回落至2016年初市场启动后的水平,市场上行空间大于下行空间。在城镇化能级放大、新老经济结构转换的背景下,消费升级与产业升级仍是重点长期投资大趋势。

4.4.4 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.6 管理人报告期内基金估值程序

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估值业务的指导意见等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的规定,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责任。

4.7 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.8 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.9 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.10 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.11 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.12 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.13 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.14 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.15 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.16 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.17 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.18 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.19 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.20 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.21 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.22 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.23 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.24 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.25 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.26 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.27 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.28 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.29 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.30 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.31 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.32 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.33 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.34 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.35 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.36 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.37 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.38 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.39 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.40 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.41 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.42 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.43 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.44 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.45 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.46 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.47 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.48 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.49 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.50 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.51 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.52 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.53 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.54 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.55 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。

4.56 基金管理人对于未来投资策略的展望

作为基金管理人,我们将继续围绕投资目标ETF,紧密跟踪标的指数的投资目标,追求与业绩比较基准相近的回报。