

平安大华安盈保本混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

等信用指标总体呈下行走势。本基金主要配置资质优良的高等信用债和利率债，基金净值表现相对平稳。

回顾报告期内,2018年前三季度中国经济韧性较强,但经济下行压力下仍处在企稳复苏中,经济持续承压,以及“中印”进入下行期,工业企业和利润增速持续放缓,伴随国内通胀高企,中短期债利率、利率化等承压,市场震荡下,短债和收益债的持续低利率的性价比大都已经处于历史的较低水平。

目前,A股不再是典型普涨行情,个股区间涨幅已是缩量缩量,资本市场改革及国际化在持续推进,A股有望企稳,“否极泰来”的拐点一去不复返,投资风格上,追求业绩的确定性仍是市场的主线,市场风格之争逐步淡化,绩优的牛市仍在进行,绩劣股面临调整,因此在报告期间的投资标的选择上,本基金更关注主板中盘绩优、低估值、高分红的蓝筹龙头,或是在行业中占据领先地位、内生成长性较强的经济领军企业。

截至本报告期末本基金份额净值为1.026元;本报告期基金份额净值增长率为0.88%,业绩比较基准收益率为0.8%。

4.0 报告期内基金份额持有人人数或基金资产净值变动说明

截至本报告期末未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人,基金资产净值低于5000万的情形。

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 34,243,408.78 | 2.37 |
| 2 | 其中:股票 | 34,243,408.78 | 2.37 |
| 3 | 固定收益投资 | 1,342,340,365.62 | 92.68 |
| 4 | 其中:债券 | 1,302,340,165.82 | 90.12 |
| 5 | 资产支持证券 | 40,000,000.00 | 2.77 |
| 6 | 贵金属投资 | - | - |
| 7 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 8 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 9 | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 10 | 银行存款和结算备付金合计 | 43,708,774.51 | 3.02 |
| 11 | 其他资产 | 24,865,040.34 | 1.72 |
| 12 | 合计 | 1,444,777,389.15 | 100.00 |

| 代码 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 189,289.00 | 0.02 |
| B | 采矿业 | 822,454.00 | 0.07 |
| C | 制造业 | 17,138,897.38 | 1.44 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,600,734.00 | 0.22 |
| E | 建筑业 | 733,777.00 | 0.06 |
| F | 交通运输、仓储和邮政业 | 899,363.00 | 0.08 |
| G | 信息传输和金融业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 电信、广播电视和信息技术服务业 | 940,144.00 | 0.08 |
| J | 金融业 | 6,027,152.00 | 0.50 |
| K | 房地产业 | 1,062,674.66 | 0.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,561,229.20 | 0.13 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 500,300.00 | 0.05 |
| O | 医药制造业、医药批发和零售业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 42,968.00 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 346,316.00 | 0.03 |
| S | 综合 | - | - |
| 合计 | | 34,243,408.78 | 2.87 |

| 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 | 111814009 | 18广发银行CD009 | 800,000 | 77,160,000.00 | 6.47 |
| 2 | 011800936 | 18国债09 | 600,000 | 60,468,000.00 | 5.07 |
| 3 | 011801248 | 18国债08 | 600,000 | 60,234,000.00 | 5.06 |
| 4 | 1626038 | 16国债08 | 600,000 | 59,664,000.00 | 5.05 |
| 5 | 111814002 | 18广发银行CD002 | 600,000 | 57,456,000.00 | 4.82 |

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 149687 | 18国债14 | 200,000 | 20,000,000.00 | 1.68 |
| 2 | 149688 | 18国债15 | 200,000 | 20,000,000.00 | 1.68 |

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 111814009 | 18广发银行CD009 | 800,000 | 77,160,000.00 | 6.47 |
| 2 | 011800936 | 18国债09 | 600,000 | 60,468,000.00 | 5.07 |
| 3 | 011801248 | 18国债08 | 600,000 | 60,234,000.00 | 5.06 |
| 4 | 1626038 | 16国债08 | 600,000 | 59,664,000.00 | 5.05 |
| 5 | 111814002 | 18广发银行CD002 | 600,000 | 57,456,000.00 | 4.82 |

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 149687 | 18国债14 | 200,000 | 20,000,000.00 | 1.68 |
| 2 | 149688 | 18国债15 | 200,000 | 20,000,000.00 | 1.68 |

| 序号 | 贵金属代码 | 贵金属名称 | 数量 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------|-------|----|---------|--------------|
| 1 | 99999 | 黄金 | - | - | - |
| 2 | 99999 | 白银 | - | - | - |
| 3 | 99999 | 铂金 | - | - | - |
| 4 | 99999 | 钯金 | - | - | - |
| 5 | 99999 | 铑金 | - | - | - |

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|----|---------|--------------|
| 1 | - | - | - | - | - |
| 2 | - | - | - | - | - |
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|---------|--------------|
| 1 | 沪深300股指期货 | - | - |
| 2 | 中证500股指期货 | - | - |
| 3 | 上证50股指期货 | - | - |
| 4 | 中证1000股指期货 | - | - |
| 5 | 中证2000股指期货 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 国债期货 | - | - |
| 2 | 国债期货 | - | - |
| 3 | 国债期货 | - | - |
| 4 | 国债期货 | - | - |
| 5 | 国债期货 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 期权 | - | - |
| 2 | 期权 | - | - |
| 3 | 期权 | - | - |
| 4 | 期权 | - | - |
| 5 | 期权 | - | - |

| 序号 | 基金名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|--------------|
| 1 | 平安大华货币 | - | - |
| 2 | 平安大华货币 | - | - |
| 3 | 平安大华货币 | - | - |
| 4 | 平安大华货币 | - | - |
| 5 | 平安大华货币 | - | - |

| 序号 | 银行名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 工商银行 | - | - |
| 2 | 建设银行 | - | - |
| 3 | 农业银行 | - | - |
| 4 | 中国银行 | - | - |
| 5 | 交通银行 | - | - |

| 序号 | 权证名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 权证 | - | - |
| 2 | 权证 | - | - |
| 3 | 权证 | - | - |
| 4 | 权证 | - | - |
| 5 | 权证 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|---------|--------------|
| 1 | 沪深300股指期货 | - | - |
| 2 | 中证500股指期货 | - | - |
| 3 | 上证50股指期货 | - | - |
| 4 | 中证1000股指期货 | - | - |
| 5 | 中证2000股指期货 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 国债期货 | - | - |
| 2 | 国债期货 | - | - |
| 3 | 国债期货 | - | - |
| 4 | 国债期货 | - | - |
| 5 | 国债期货 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 期权 | - | - |
| 2 | 期权 | - | - |
| 3 | 期权 | - | - |
| 4 | 期权 | - | - |
| 5 | 期权 | - | - |

| 序号 | 基金名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|--------------|
| 1 | 平安大华货币 | - | - |
| 2 | 平安大华货币 | - | - |
| 3 | 平安大华货币 | - | - |
| 4 | 平安大华货币 | - | - |
| 5 | 平安大华货币 | - | - |

| 序号 | 银行名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 工商银行 | - | - |
| 2 | 建设银行 | - | - |
| 3 | 农业银行 | - | - |
| 4 | 中国银行 | - | - |
| 5 | 交通银行 | - | - |

| 序号 | 权证名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 权证 | - | - |
| 2 | 权证 | - | - |
| 3 | 权证 | - | - |
| 4 | 权证 | - | - |
| 5 | 权证 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|---------|--------------|
| 1 | 沪深300股指期货 | - | - |
| 2 | 中证500股指期货 | - | - |
| 3 | 上证50股指期货 | - | - |
| 4 | 中证1000股指期货 | - | - |
| 5 | 中证2000股指期货 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 国债期货 | - | - |
| 2 | 国债期货 | - | - |
| 3 | 国债期货 | - | - |
| 4 | 国债期货 | - | - |
| 5 | 国债期货 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 期权 | - | - |
| 2 | 期权 | - | - |
| 3 | 期权 | - | - |
| 4 | 期权 | - | - |
| 5 | 期权 | - | - |

| 序号 | 基金名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|--------------|
| 1 | 平安大华货币 | - | - |
| 2 | 平安大华货币 | - | - |
| 3 | 平安大华货币 | - | - |
| 4 | 平安大华货币 | - | - |
| 5 | 平安大华货币 | - | - |

| 序号 | 银行名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 工商银行 | - | - |
| 2 | 建设银行 | - | - |
| 3 | 农业银行 | - | - |
| 4 | 中国银行 | - | - |
| 5 | 交通银行 | - | - |

| 序号 | 权证名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 权证 | - | - |
| 2 | 权证 | - | - |
| 3 | 权证 | - | - |
| 4 | 权证 | - | - |
| 5 | 权证 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|---------|--------------|
| 1 | 沪深300股指期货 | - | - |
| 2 | 中证500股指期货 | - | - |
| 3 | 上证50股指期货 | - | - |
| 4 | 中证1000股指期货 | - | - |
| 5 | 中证2000股指期货 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 国债期货 | - | - |
| 2 | 国债期货 | - | - |
| 3 | 国债期货 | - | - |
| 4 | 国债期货 | - | - |
| 5 | 国债期货 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 期权 | - | - |
| 2 | 期权 | - | - |
| 3 | 期权 | - | - |
| 4 | 期权 | - | - |
| 5 | 期权 | - | - |

| 序号 | 基金名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|--------------|
| 1 | 平安大华货币 | - | - |
| 2 | 平安大华货币 | - | - |
| 3 | 平安大华货币 | - | - |
| 4 | 平安大华货币 | - | - |
| 5 | 平安大华货币 | - | - |

| 序号 | 银行名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 工商银行 | - | - |
| 2 | 建设银行 | - | - |
| 3 | 农业银行 | - | - |
| 4 | 中国银行 | - | - |
| 5 | 交通银行 | - | - |

| 序号 | 权证名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 权证 | - | - |
| 2 | 权证 | - | - |
| 3 | 权证 | - | - |
| 4 | 权证 | - | - |
| 5 | 权证 | - | - |

| 序号 | 品种名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|---------|--------------|
| 1 | 沪深300股指期货 | - | - |
| 2 | 中证500股指期货 | - | - |
| 3 | 上证50股指期货 | - | - |
| 4 | 中证1000股指期货 | - | - |
| 5 | 中证2000股指期货 | - | -</ |