平安大华安享保本混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：平安大华基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	平安大华安享保本混合
场内简称	–
交易代码	002282
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
报告期末基金份额总额	253,258,622.93份
投资目标	本基金以本金安全为目标，通过有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增长和保本期收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略和时间不变性投资组合保险策略，建立和运用严格的动态资产数量模型，动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例，以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标，并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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）
1.本期已实现收益	3,216,645.54
2.本期利润	4,315,976.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0164
4.期末基金资产净值	260,954,344.30
5.期末基金份额净值	1.030

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。

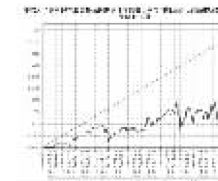
3.2 基金净值表现

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

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	1.58%	0.12%	0.65%	0.01%	0.93%	0.11%

业绩比较基准：每个保本期起始日的三年期银行定期存款收益率（税后）

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、本基金基金合同于2016年02月03日正式生效，截至报告期末已满两年；

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		
张恒	平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理	2018年2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。
高勇标	平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理	2018年3月16日	–	7	高勇标先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017年4月加入平安大华基金管理有限公司，任投资研究部固定收益组投资经理，现任平安大华鼎弘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、平安大华安盈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、平安大华鑫安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、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华合锦定期开放债券型发起式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遵规守信情况的说明

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、《平安大华安享保本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，并本着诚实信用、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

三季度宏观经济平稳下行，通胀中枢水平略有抬升。由于货币政策坚持"保持流动性合理充裕"，债券短端下行较快，而长端则在经济下行、通胀预期、地方债巨量供给、政策托底、贸易战发酵这几大因素的影响下碰撞徘徊，走势比较犹豫。此外，各种政策出台导引市场预期，中低等级信用债利率总体呈下行走势。本基金主要配置资质较优的高等级信用债和部分利率债，基金净值表现相对平稳。

权益市场方面，由于经济仍然维持稳中趋降的态势，外部贸易摩擦加剧，三季度市场表现偏弱。9月份由于贸易战2000亿美元商品关税落地，且10%的征税力度不及预期，投资情绪驱动股指反弹，但持续性存疑。本基金股票仓位总体较低，主要参与科技创新方面的投资标的。

4.5 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1.030元；本报告期基金份额净值增长率为1.58%，业绩比较基准收益率为0.65%。

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5000万元的情形。

§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	18,472,665.58	4.00
	其中：股票	18,472,665.58	4.00
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	403,557,604.50	87.45
	其中：债券	383,557,604.50	83.11
	资产支持证券	20,000,000.00	4.33
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	2,200,000.00	0.48
	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	11,119,896.62	2.41
8	其他资产	26,145,623.89	5.67
9	合计	461,495,790.59	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	260,130.00	0.10
B	采矿业	269,048.00	0.10
C	制造业	11,430,854.58	4.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	295,212.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,143,580.00	0.82
J	金融业	1,466,491.00	0.56
K	房地产业	238,329.00	0.09
L	租赁和商务服务业	795,834.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	541,707.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	268,550.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	762,930.00	0.29
S	综合	–	–
	合计	18,472,665.58	7.08

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投资港股通股票。

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	601398	工商银行	208,300	1,201,891.00	0.46
2	600867	通化东宝	44,000	798,160.00	0.31
3	601888	中国国旅	11,700	795,834.00	0.30
4	300659	中孚信息	33,700	736,008.00	0.28
5	300212	易华录	26,600	622,440.00	0.24
6	601799	星宇股份	10,300	539,308.00	0.21
7	600285	羚锐制药	64,500	534,705.00	0.20
8	600038	中直股份	13,200	526,152.00	0.20
9	603986	兆易创新	5,900	523,507.00	0.20
10	002901	大博医疗	17,800	521,540.00	0.20

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	16,096,000.00	6.17
	其中：政策性金融债	16,096,000.00	6.17
4	企业债券	235,466,000.00	90.23
5	企业短期融资券	80,338,000.00	30.79
6	中期票据	50,598,000.00	19.39
7	可转债（可交换债）	1,059,604.50	0.41
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	383,557,604.50	146.98

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	112196	13苏宁债	200,000	20,324,000.00	7.79
2	1182338	11方正MTN2	200,000	20,248,000.00	7.76
3	011800856	18鲁钢铁SCP007	200,000	20,158,000.00	7.72
4	011801284	18大唐新能SCP003	200,000	20,098,000.00	7.70
5	112419	16河钢01	200,000	20,094,000.00	7.70

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

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	149380	18花06A1	200,000	20,000,000.00	7.66

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

本基金本报告期末无贵金属投资。

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

本基金本报告期末无权证投资。

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情况。

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

本基金本报告期末无国债期货持仓。

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	136,143.52
2	应收证券清算款	19,917,112.68
3	应收股利	–
4	应收利息	6,091,873.62
5	应收申购款	494.07
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	26,145,623.89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	123006	东财转债	576,450.00	0.22
2	123009	星源转债	483,154.50	0.19

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

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

报告期期初基金份额总额	273,980,239.03
报告期期间基金总申购份额	415,283.19
减：报告期期间基金总赎回份额	21,136,899.29
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	253,258,622.93

§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安享保本混合型证券投资基金设立的文件

（2）平安大华安享保本混合型证券投资基金基金合同

（3）平安大华安享保本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）报告期内平安大华安享保本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

平安大华安心保本混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：平安大华基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
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	平安大华安心保本混合
场内简称	–
交易代码	002304
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月15日
报告期末基金份额总额	458,578,057.82份
投资目标	本基金以本金安全为目标，通过有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增长和保本期收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略和时间不变性投资组合保险策略，建立和运用严格的动态资产数量模型，动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例，以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标，并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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）
1.本期已实现收益	3,620,911.56
2.本期利润	2,570,293.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0054
4.期末基金资产净值	473,643,642.39
5.期末基金份额净值	1.033

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。

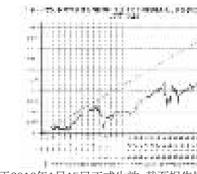
3.2 基金净值表现

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

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	0.58%	0.12%	0.65%	0.01%	–0.07%	0.11%

业绩比较基准：每个保本期起始日的三年期银行定期存款收益率（税后）

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、本基金基金合同于2016年1月15日正式生效，截至报告期末已满两年；

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经完成建仓。

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		
张恒	平安大华安心保本混合型证券投资基金基金经理	2018年2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。
刘俊廷	平安大华安心保本混合型证券投资基金的基金经理	2018年6月29日	–	6	刘俊廷先生，中国科学院研究生院硕士。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。2014年12月加入平安大华基金管理有限公司，现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎弘混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、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基金经理。
曹力	平安大华安心保本混合型证券投资基金基金经理	2018年8月9日	–	9	曹力先生，马里兰大学博士。曾先后担任美国联邦政府交通部统计分析中心统计分析师、华泰联合证券高级分析师、华泰证券投资经理、中国中投证券有限责任公司量化投资总监。2014年9月加入平安大华基金管理有限公司，曾担任资本市场专户投资部投资经理。现担任平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合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遵规守信情况的说明

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、《平安大华安心保本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，并本着诚实信用、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。本基金由于将在明年1月份到期，因此主要配置剩余期限年底前的同业存单、短融等短端品种。

4.5 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1.033元；本报告期基金份额净值增长率为0.58%，业绩比较基准收益率为0.65%。

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5000万元的情形。

§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	35,840,561.22	6.22
	其中：股票	35,840,561.22	6.22
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	524,950,000.00	91.17
	其中：债券	524,950,000.00	91.17
	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	3,573,048.91	0.62
8	其他资产	11,433,074.82	1.99
9	合计	575,796,684.95	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	190,018.00	0.04
B	采矿业	1,393,271.00	0.29
C	制造业	16,735,142.82	3.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,345,806.00	0.28
E	建筑业	604,398.60	0.13
F	批发和零售业	1,336,751.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	962,120.40	0.20
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,220,351.40	0.26
J	金融业	8,362,097.40	1.77
K	房地产业	1,981,316.00	0.42
L	租赁和商务服务业	885,110.40	0.19
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	272,008.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	145,017.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	407,153.20	0.09
S	综合	–	–
	合计	35,840,561.22	7.57

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	600036	招商银行	57,500	1,764,675.00	0.37
2	002032	苏泊尔	29,029	1,566,985.42	0.33
3	600519	贵州茅台	1,500	1,095,000.00	0.23
4	600030	中信证券	63,500	1,059,815.00	0.22
5	601166	兴业银行	58,400	931,480.00	0.20
6	600690	青岛海尔	55,300	913,556.00	0.19
7	600276	恒瑞医药	13,050	828,675.00	0.17
8	002419	天虹股份	64,950	732,636.00	0.15
9	601288	农业银行	187,500	729,375.00	0.15
10	601328	交通银行	122,900	717,736.00	0.15

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	30,112,000.00	6.36
	其中：政策性金融债	30,112,000.00	6.36
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	291,648,000.00	61.58
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	203,190,000.00	42.90
9	其他	–	–
10	合计	524,950,000.00	110.83

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	111819135	18恒丰银行CD135	500,000	48,545,000.00	10.25
2	111892636	18南京银行CD032	500,000	48,355,000.00	10.21
3	041751029	17重汽CP001	300,000	30,384,000.00	6.41
4	011800307	18沪临港SCP001	300,000	30,246,000.00	6.39
5	011800424	18武汉地铁SCP001	300,000	30,234,000.00	6.38

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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

银监会于2017年12月29日做出银监罚决字〔2017〕30号处罚决定，由于恒丰银行股份有限公司（以下简称"公司"）未经银监会批准违规开展员工股权激励计划、提供虚假统计报表、理财资金投资非标准化债权资产余额超比例等原因，根据相关规定对公司没收违法所得7566.106815万元，并处1倍罚款7566.106815万元，对其他违规行为罚款1560万元，罚没合计16692.21363万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	51,601.09
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	11,381,274.45
5	应收申购款	199.28
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	11,433,074.82

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

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

报告期期初基金份额总额	490,982,169.63
报告期期间基金总申购份额	26,175.37
减：报告期期间基金总赎回份额	32,430,287.18
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	458,578,057.82

§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安心保本混合型证券投资基金设立的文件

（2）平安大华安心保本混合型证券投资基金基金合同

（3）平安大华安心保本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）报告期内平安大华安心保本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

平安大华保本混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：平安大华基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	平安大华保本混合
场内简称	–
交易代码	700004
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月11日
报告期末基金份额总额	224,930,412.05份
投资目标	采用投资组合保险技术，以保本期到期时本金安全为目标，通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增长和保本期收益的最大化。
投资策略	采用恒定比例组合保险策略，动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例，以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标，并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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）
1.本期已实现收益	1,701,207.72
2.本期利润	1,666,159.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0072
4.期末基金资产净值	228,483,384.11
5.期末基金份额净值	1.016

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。

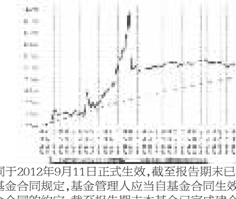
3.2 基金净值表现

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

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	0.69%	0.04%	0.63%	0.01%	0.06%	0.03%

业绩比较基准：每个保本期起始日的三年期银行定期存款收益率（税后）

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、本基金基金合同于2012年9月11日正式生效，截至报告期末已满六年；

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		
刘俊廷	平安大华保本混合型证券投资基金的基金经理	2018年6月29日	–	6	刘俊廷先生，中国科学院研究生院硕士。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师，现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎弘混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、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基金经理。
张恒	平安大华保本混合型证券投资基金的基金经理	2018年2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遵规守信情况的说明

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、《平安大华保本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，并本着诚实信用、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。本基金由于将在10月份到期，因此主要配置剩余期限在产品到期前的同业存单、短融等短端品种。

4.5 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1.016元；本报告期基金份额净值增长率为0.69%，业绩比较基准收益率为0.63%。

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5000万元的情形。

§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	133,928.00	0.06
	其中：股票	133,928.00	0.06
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	227,905,000.00	97.70
	其中：债券	227,905,000.00	97.70
	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	305,523.67	0.13
8	其他资产	4,918,699.89	2.11
9	合计	233,263,151.56	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	28,466.00	0.01
B	采矿业	–	–
C	制造业	105,462.00	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	133,928.00	0.06

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投资港股通股票。

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	002450	康得新	6,200	105,462.00	0.05
2	601118	海南橡胶	4,300	28,466.00	0.01

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	40,096,000.00	17.55
	其中：政策性金融债	40,096,000.00	17.55
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	100,465,000.00	43.97
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	87,344,000.00	38.23
9	其他	–	–
10	合计	227,905,000.00	99.75

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	180207	18国开07	400,000	40,096,000.00	17.55
2	111812017	18北京银行CD017	400,000	38,592,000.00	16.89
3	011800037	18晋煤SCP001	200,000	20,158,000.00	8.82
4	111813053	18浙商银行CD053	200,000	19,590,000.00	8.57
5	111895276	18宁波银行CD058	200,000	19,586,000.00	8.57

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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

本基金本报告期末无贵金属投资。

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

本基金本报告期末无权证投资。

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

本基金本报告期末无国债期货持仓。

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	18,993.97
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,899,506.64
5	应收申购款	199.28
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,918,699.89

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	002450	康得新	105,462.00	0.05	重大事项
2	601118	海南橡胶	28,466.00	0.01	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

报告期期初基金份额总额	235,162,654.53
报告期期间基金总申购份额	155,231.43
减：报告期期间基金总赎回份额	10,387,473.91
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	224,930,412.05

§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保本混合型证券投资基金设立的文件

（2）平安大华保本混合型证券投资基金基金合同

（3）平安大华保本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）报告期内平安大华保本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