

## 平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

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、《平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金份额持有人的利益的行为。

## 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

本三季度投资策略思路自下而上选为:以,注重业绩确定性以及估值匹配度,展望未来,我们将以聚焦价值和盈利稳定的格局不会改变,市场主线依然是代表消费升级和制造升级的产业,我们在此基础上,精选个股,聚焦行业龙头,在盈利驱动的市场结构中,成长确定的个股大概率能带来良好的投资回报。

## 4.5 报告期内基金的投资表现

截至本报告期末平安大华睿享文娱灵活配置A基金份额净值为1.0822,本报告期基金份额净值增长率为-6.22%,截至本报告期末平安大华睿享文娱灵活配置C基金份额净值为1.060元,本报告期基金份额净值增长率为-6.65%,同期业绩比较基准收益率为-0.23%。

## 4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值专项说明

本基金本报告期内出现连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。截至报告期末,以上情况未持续。

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低于200人的情形。

## 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	11,492,360.20	26.09
2	其中:股票	11,492,360.20	26.09
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	衍生品投资	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	27,407,752.32	64.97
9	其他资产	3,075,022.94	8.03
9	合计	42,975,135.46	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	制造业	18,901,442.00	21.88
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,492,360.20	13.31
D	建筑业	-	-
E	批发和零售业	-	-
F	金融业	-	-
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	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		17,735,620.80	7.96

## 5.3 报告期末按行业分类的港股股票投资

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	-	-
B	制造业	1,525,980.00	2.88
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,492,360.20	61.11
D	建筑业	-	-
E	批发和零售业	-	-
F	金融业	-	-
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	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		13,018,340.20	30.04

## 5.4 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	制造业	18,901,442.00	21.88
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,492,360.20	13.31
D	建筑业	-	-
E	批发和零售业	-	-
F	金融业	-	-
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	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		17,735,620.80	7.96

## 5.5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	170,226,223.79	79.13
2	其中:股票	170,226,223.79	79.13
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	衍生品投资	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	28,286,476.00	12.81
8	其他资产	10,287,463.01	4.63
9	合计	228,800,162.80	100.00

## 5.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	制造业	1,525,980.00	2.88
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,492,360.20	61.11
D	建筑业	-	-
E	批发和零售业	-	-
F	金融业	-	-
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	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		13,018,340.20	30.04

## 5.7 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	制造业	1,525,980.00	2.88
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,492,360.20	61.11
D	建筑业	-	-
E	批发和零售业	-	-
F	金融业	-	-
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	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		13,018,340.20	30.04

## 5.8 报告期末按行业分类的港股股票投资

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	-	-
B	制造业	1,525,980.00	2.88
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,492,360.20	61.11
D	建筑业	-	-
E	批发和零售业	-	-
F	金融业	-	-
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	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		13,018,340.20	30.04

## 5.9 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,000,469.97	79.58
2	其中:股票	18,000,469.97	79.58
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	1,956,179.60	8.18
5	其中:债券	1,956,179.60	8.18
6	资产支持证券	-	-
7	衍生品投资	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	23,208,210.43	100.00

## 5.10 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	制造业	1,972,611.38	8.84
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,492,360.20	52.89
D	建筑业	-	-
E	批发和零售业	-	-
F	金融业	-	-
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	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		13,018,340.20	30.04

## 5.11 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,000,469.97	79.58
2	其中:股票	18,000,469.97	79.58
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	1,956,179.60	8.18
5	其中:债券	1,956,179.60	8.18
6	资产支持证券	-	-
7	衍生品投资	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	23,208,210.43	100.00

## 5.12 报告期末按行业分类的港股股票投资

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	-	-
B	制造业	1,972,611.38	8.84
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,492,360.20	52.89
D	建筑业	-	-
E	批发和零售业	-	-
F	金融业	-	-
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	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		13,018,340.20	30.04

## 5.13 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,000,469.97	79.58
2	其中:股票	18,000,469.97	79.58
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	1,956,179.60	8.18
5	其中:债券	1,956,179.60	8.18
6	资产支持证券	-	-
7	衍生品投资	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	23,208,210.43	100.00

## 5.14 报告期末按行业分类的港股股票投资

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	-	-
B	制造业	1,972,611.38	8.84
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,492,360.20	52.89
D	建筑业	-	-
E	批发和零售业	-	-
F	金融业	-	-
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	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		13,018,340.20	30.04

基金管理人:平安大华基金管理有限公司  
基金托管人:广发证券股份有限公司  
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。  
基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月26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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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。

本报告中期财务数据未经审计。  
本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金名称	平安大华睿享文娱混合	
场内简称	睿享文娱	
交易代码	002660	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年3月29日	
报告期末基金份额总额	39,521,298.02份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金通过股票与债券等资产的合理配置,重点投资于与实体经济相关的优质企业,力争实现基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略,一方面通过大类资产配置,降低系统性风险,把握市场整体中的投资机会;另一方面通过平安大华睿享文娱混合基金管理人自主研究精选个股,构建中长期稳健增长的资产组合,力争实现基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证全指指数收益率×40%	
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,预期风险和预期收益低于股票型基金和股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中风险收益特征的产品。	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安大华睿享文娱混合A	平安大华睿享文娱混合C
下属分级基金的风险收益特征	本基金A类基金份额的风险收益特征与本基金C类基金份额的风险收益特征一致。	
下属分级基金的交易代码	002660	002661
下属分级基金的场内交易代码	-	-
下属分级基金的投资范围	沪深300、中证全指	
下属分级基金的认购起始日	2016年03月29日	2016年03月29日
下属分级基金的赎回起始日	2016年03月29日	2016年03月29日

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)
1.本期利润总额	平安大华睿享文娱混合A 平安大华睿享文娱混合C
2.本期净利润	-780,199.13 -2,467,734.86
3.本期公允价值变动损益	-780,199.13 -2,516,028.09
4.计提资产减值准备/信用减值准备	-0.00 -0.00