平安大华鼎越灵活配置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	平安大华鼎越混合
场内简称	平安鼎越
交易代码	167002
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2016年9月20日
报告期末基金份额总额	81,869,562.72份
投资目标	本基金转型为上市开放式基金(LOF)后,将灵活运用多种投资策略,在严格控制风险的前提下,充分挖掘市场投资机会,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金转型为上市开放式基金(LOF)后,将灵活运用多种投资策略,在严格控制风险的前提下,充分挖掘市场投资机会,力争实现资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。
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

备注:本基金转型日期为2018年6月20日,该日起原"平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金"转型为"平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金"。

§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	-72,170.25
2.本期利润	-403,048.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0044
4.期末基金资产净值	70,471,737.61
5.期末基金份额净值	0.8608

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。

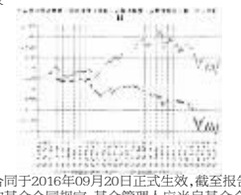
3.2 基金净值表现

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	-0.19%	0.84%	-0.23%	0.67%	0.04%	0.17%

沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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09月20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		
WANG AO	平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2018年3月16日	-	5	WANG AO先生,澳大利亚籍,CAIA,FRM,CFA,澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士,曾任职国家发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012年9月加入平安大华基金管理有限公司,担任投资研究部固定收益研究员。现任平安大华鼎信债券型证券投资基金、平安大华鼎享混合型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华鼎利灵活配置混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安大华特型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安大华双债资益债券型证券投资基金基金经理。
刘俊廷	平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016年9月20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)、平安大华鼎弘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、《平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(转型前:《平安大华鼎越定期开放灵活配置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

2018年前三季度中国经济韧性较强,但经济平缓下行压力仍然存在,随着年内经济持续承压,以及PPI进入下行周期,工业企业利润增速或将延续放缓。伴随国内金融强监管、中美贸易摩擦、汇率变化等因素,市场震荡下跌,短期极端悲观的情绪使得市场的估值水平已经处于历史的较低水平。

目前A股不再是典型普涨普跌牛熊市,个股区间涨幅已是南辕北辙。资本市场改革及国际化正在深刻改变A股原有生态,"劣币驱逐良币"的历史一去不复返,投资风格上,追求业绩的确定性依旧是市场的主线,市场风格之争将逐步淡化。绩优股的牛市仍在进行,绩劣股熊市愈演愈烈。因此在报告期内的投资标的选择上,本基金更关注主板中绩优、低估、高分红的监筹龙马,或者是中小创中业绩真实、内生成长的新经济领军企业。报告期内,本基金未参与新的定向增发。本基金持有的已经解禁的定增股票,基金管理人已经开始择机进行减持。

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0.8608元;本报告期基金份额净值增长率为-0.19%,业绩比较基准收益率为-0.23%。

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	52,234,596.23	73.43
	其中:股票	52,234,596.23	73.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,854,500.00	5.42
	其中:债券	3,854,500.00	5.42
	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	10,000,000.00	14.06
	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	4,880,643.56	6.86
8	其他资产	170,098.04	0.24
9	合计	71,139,836.83	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	169,796.00	0.24
B	采矿业	962,441.00	1.37
C	制造业	17,336,717.96	24.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,992,430.34	9.92
E	建筑业	1,429,162.20	2.03
F	批发和零售业	848,843.00	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	906,984.68	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,798,670.00	2.55
J	金融业	10,654,524.13	15.12
K	房地产业	2,171,225.00	3.08
L	租赁和商务服务业	7,834,062.26	11.12
M	科学研究和技术服务业	45,826.86	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	256,120.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	437,601.60	0.62
R	文化、体育和娱乐业	390,200.20	0.55
S	综合	-	-
	合计	52,234,596.23	74.12

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	002344	海宁皮城	1,580,989	7,557,751.66	10.72
2	000875	吉电股份	2,242,285	6,413,645.04	9.10
3	601166	兴业银行	163,400	2,606,230.00	3.70
4	300421	力星股份	161,690	2,317,083.25	3.29
5	600036	招商银行	60,900	1,869,021.00	2.65
6	600030	中信证券	67,700	1,129,913.00	1.60
7	601328	交通银行	163,800	956,592.00	1.36
8	600276	恒瑞医药	14,884	945,134.00	1.34
9	601668	中国建筑	168,980	927,700.20	1.32
10	601939	建设银行	124,900	904,276.00	1.28

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,854,500.00	5.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,854,500.00	5.47

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	112473	16海普瑞	30,000	2,852,700.00	4.05
2	124078	12云城建	10,000	1,001,800.00	1.42

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投资情况说明

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

本组合投资的前十名证券之一招商银行于2018年2月12日被中国银监会公开处罚,主要违法违规事实包括:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三) 同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六) 为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九) 未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款。中国银监会决定罚款招商银行6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。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盈利情况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。

本组合投资的前十名证券之一兴业银行于2018年4月19日被银保监会开处罚,主要违法违规事实包括:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。中国银行保险监督管理委员会决定罚款兴业银行5870万元。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盈利情况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八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	42,653.26
2	应收证券清算款	9,876.72
3	应收股利	-
4	应收利息	117,568.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	170,098.04

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	002344	海宁皮城	7,532,261.86	10.69	非公开发行,流通受限
2	000875	吉电股份	6,383,928.98	9.06	非公开发行,流通受限
3	300421	力星股份	2,312,073.85	3.28	非公开发行,流通受限

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	102,143,902.09
报告期期间基金总申购份额	6,098.21
减:报告期期间基金总赎回份额	20,280,437.58
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	81,869,562.72

§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鼎越灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华鼎越灵活配置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) 报告期内平安大华鼎越灵活配置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

平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金

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	平安大华股息精选沪港深
场内简称	-
交易代码	004403
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年5月17日
报告期末基金份额总额	15,440,200.97份
投资目标	本基金主要通过股息价值策略构建股票组合,在严格控制风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的收益,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量、定性相结合的方法分析宏观经济、财政及货币政策、资金供需情况等因素综合分析以及对资本市场发展趋势的判断,在评价未来一段时间各类的预期风险收益率、相关性的基础上,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,并将重点关注债券资产的收益率。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×35%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×35%+中证综合债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。
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

下属分级基金的基金简称	平安大华股息精选沪港深A	平安大华股息精选沪港深C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	004403	004404
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	13,768,121.14份	1,672,079.83份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§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)	
	平安大华股息精选沪港深A	平安大华股息精选沪港深C
1. 本期已实现收益	49,783.03	2,239.14
2. 本期利润	-380,599.62	-54,248.54
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0278	-0.0316
4. 期末基金资产净值	14,372,589.44	1,716,703.01
5. 期末基金份额净值	1.0439	1.0267

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

平安大华股息精选沪港深A

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	-2.62%	1.07%	-0.14%	0.77%	-2.48%	0.30%

平安大华股息精选沪港深C

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	-2.82%	1.07%	-0.14%	0.77%	-2.68%	0.30%

沪深300指数收益率*35%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*35%+中证综合债券指数收益率*30%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2017年05月17日正式生效,截至报告期末已满一年;

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		
施旭	平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理	2017年5月17日	-	7	施旭先生,哥伦比亚大学金融数学硕士。曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquiaMetrics Inc.国信证券,2015年加入平安大华基金管理有限公司,任研究部中心量化研究员。现任平安大华保证300指数增强型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎享混合型证券投资基金、平安大华惠享混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安大华特型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金、平安大华股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
DANIEL DONGNING SUN	衍生品投资中心投资执行总经理、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理	2018年3月7日	-	13	DANIEL DONGNING SUN先生,美国籍,北京大学硕士,美国哥伦比亚大学博士,约翰霍普金斯大学博士后,先后担任瑞士再保险自营交易部量化分析师、花旗集团投资银行高级副总裁、瑞士银行投资银行交易量化总监、德意志银行战略科技部量化服务负责人。2014年10月加入平安大华基金管理有限公司,任衍生品投资中心投资执行总经理。现任平安大华保证300指数增强型证券投资基金、平安大华沪深300指数量化增强证券投资基金、平安大华鼎享混合型证券投资基金、平安大华惠享混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票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、《平安大华股息精选沪港深股票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

回顾三季度,市场风格延续了上半年以来的特征,风格差异明显,市场风险偏好下降,小盘股指数、创业板指数一路下行,三季度下行幅度较上半年更为显著,大市值龙头效应明显,市场整体呈震荡下行的趋势,其中消费、医药类板块跌幅较大,金融板块估值处于历史低位,且具备防御性特征,三季度获得正收益。港股市场三季度受油价上行和美债收益率上行,以及对国内经济形式的担忧,港股市场整体出现明显调整。本基金继续根据对市场的风险偏好,坚持以低估值和业绩确定性为主线,优选具有高股息属性的上市公司,取得一定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安大华股息精选A基金份额净值为1.0439元,本报告期基金份额净值增长率为-2.62%;截至本报告期末平安大华股息精选C基金份额净值为1.0267元,本报告期基金份额净值增长率为-2.82%;同期业绩比较基准收益率为-0.14%。

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60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	13,921,716.32	85.97
	其中:股票	13,921,716.32	85.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	2,250,098.44	13.90
8	其他资产	21,167.52	0.13
9	合计	16,192,982.28	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	-	-
B	采矿业	316,505.39	1.97
C	制造业	2,274,038.00	14.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	255,528.00	1.59
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	68,935.00	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	74,360.00	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	208,894.00	1.30
J	金融业	1,728,699.00	10.74
K	房地产业	613,713.00	3.81
L	租赁和商务服务业	129,692.40	0.81
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	5,670,354.79	35.24

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
A 基础材料	498,931.65	3.10
B 消费者非必需品	2,205,612.27	13.71
C 消费者常用品	276,744.28	1.72
D 能源	1,034,821.20	6.43
E 金融	121,961.07	0.76
F 医疗保健	374,612.31	2.33
G 工业	737,882.07	4.59
H 信息技术	1,648,647.92	10.25
I 电信服务	248,779.46	1.55
J 公用事业	282,265.96	1.75
K 房地产	821,103.34	5.10
合计	8,251,361.53	51.28

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	00386	中国石油化工股份	150,000	1,034,821.20	6.43
2	00700	腾讯控股	3,500	995,399.44	6.19
3	02313	申洲国际	6,000	530,081.28	3.29
4	00914	海螺水泥	12,000	498,931.65	3.10
5	600036	招商银行	16,200	497,178.00	3.09
6	000540	中天金融	110,850	441,183.00	2.74
7	601288	农业银行	113,300	440,737.00	2.74
8	600519	贵州茅台	600	438,000.00	2.72
9	01999	敏华控股	106,000	437,458.34	2.72
10	02020	安踏体育	13,000	429,547.59	2.67

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资情况。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资情况说明

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情况。

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

本组合投资的前十名证券之一招商银行于2018年2月12日被中国银监会公开处罚,主要违法违规事实包括:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三) 同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六) 为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九) 未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款。中国银监会决定罚款招商银行6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

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盈利情况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	1,847.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	18,916.79
4	应收利息	403.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,167.52

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	000540	中天金融	441,183.00	2.74	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

项目	平安大华股息精选沪港深A	平安大华股息精选沪港深C
报告期期初基金份额总额	13,656,205.48	1,889,522.27
报告期期间基金总申购份额	630,594.57	43,009.30
减:报告期期间基金总赎回份额	518,678.91	240,451.74
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	13,768,121.14	1,672,079.83

§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