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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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300ETF联接
场内简称	–
交易代码	005639
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年4月4日
报告期末基金份额总额	690,430,633.17份
投资目标	本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金以目标ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF,获取基金份额净值上涨带来的收益;在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下,也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金的目标ETF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、债券型基金与货币市场基金。本基金为ETF联接基金,通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。
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

下属分级基金的基金简称	平安300ETF联接A	平安300ETF联接C
下属分级基金的场内简称	–	–
下属分级基金的交易代码	005639	005640
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	404,666,405.57份	285,764,227.60份
下属分级基金的风险收益特征	–	–

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510390
基金运作方式	交易型、开放式
基金合同生效日	2017年12月25日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018年1月26日
基金管理人名称	平安大华基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法、即完全按照标的指数的成分股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成分股发生调整和成分股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金,采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

§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300ETF联接A	平安300ETF联接C
1. 本期已实现收益	–21,389.40	–192,887.07
2. 本期利润	–3,419,261.44	113,011.49
3. 加权平均基金份额本期利润	–0.0084	0.0005
4. 期末基金资产净值	369,517,681.60	260,466,893.44
5. 期末基金份额净值	0.9131	0.9115

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300ETF联接A

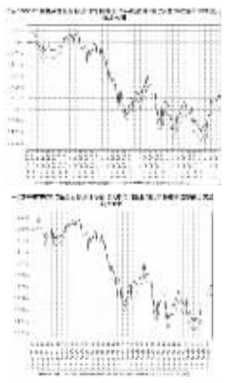
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	–0.87%	1.28%	–1.92%	1.29%	1.05%	–0.01%

平安300ETF联接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	–0.93%	1.28%	–1.92%	1.29%	0.99%	–0.01%

沪深300指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%

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2018年04月04日正式生效,截至报告期末未满半年;

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		
成钧	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的基金经理、ETF指数中心指数投资总监	2018年4月4日	–	7	成钧先生,上海交通大学博士,南京大学和上海证券交易所博士后。曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017年2月加入平安大华基金管理有限公司,现任平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金、平安大华中证500交易型开放式指数证券投资基金、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、平安大华MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安大华MSCI中国A股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安大华MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安大华中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

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、《平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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

(1)投资策略

本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪,也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金在投资管理上,利用量化科技系统进行精细化组合管理,高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用,勤勉尽责,严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。

(2)运作分析

截至报告期末,在本基金自建仓完毕起的跟踪期内,本基金的日均跟踪误差为0.04%,年化跟踪误差0.59%,较好地实现了本基金的投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安300ETF联接A基金份额净值为0.9131元,本报告期基金份额净值增长率为–0.87%;截至本报告期末平安300ETF联接C基金份额净值为0.9115元,本报告期基金份额净值增长率为–0.93%;同期业绩比较基准收益率为–1.92%。

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个工作日基金持有人数低于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	174,896.98	0.03
	其中:股票	174,896.98	0.03
2	基金投资	597,873,637.40	94.49
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	33,663,082.70	5.32
8	其他资产	1,022,126.56	0.16
9	合计	632,733,743.64	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	–	–
C	制造业	123,421.40	0.02
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	51,475.58	0.01
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	174,896.98	0.03

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	600271	航天信息	1,100	30,613.00	0.00
2	600867	通化东宝	1,500	27,210.00	0.00
3	600085	同仁堂	800	25,400.00	0.00
4	600482	中国动力	1,000	23,170.00	0.00
5	600036	招商银行	700	21,483.00	0.00
6	601198	东兴证券	1,483	15,215.58	0.00
7	600196	复星医药	300	9,465.00	0.00
8	600999	招商证券	700	9,191.00	0.00
9	603858	步长制药	260	7,563.40	0.00
10	600390	五矿资本	700	5,586.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	平安300	股票型	交易型开放式	平安大华基金管理有限公司	597,873,637.40	94.90

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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。

对上述股票的投资决策程序的说明:本基金为指数基金,为有效跟踪标的指数,控制跟踪偏离和跟踪误差,对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	107,945.59
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	6,187.41
5	应收申购款	907,993.56
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,022,126.56

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.12.6 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300ETF联接A	平安300ETF联接C
报告期期初基金份额总额	413,834,828.91	202,256,620.28
报告期期间基金总申购份额	20,282,879.83	110,257,531.82
减:报告期期间基金总赎回份额	29,451,303.17	26,749,924.50
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	404,666,405.57	285,764,227.60

§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沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件

(2)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

(3)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) 报告期内平安大华沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接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

平安大华添利债券型证券投资基金

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	平安大华添利债券
场内简称	–
交易代码	700005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月27日
报告期末基金份额总额	1,162,595,132.20份
投资目标	在严格控制投资风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略,在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上,主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种,构建及调整固定收益投资组合,以期获得和产品期限匹配的债券收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于债券型基金,预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

下属分级基金的基金简称	平安大华添利债券A	平安大华添利债券C
下属分级基金的场内简称	–	–
下属分级基金的交易代码	700005	700006
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	992,531,318.50份	170,063,813.70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)	
	平安大华添利债券A	平安大华添利债券C
1. 本期已实现收益	16,836,969.12	2,340,486.59
2. 本期利润	18,341,366.97	2,644,458.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0245	0.0221
4. 期末基金资产净值	1,386,975,500.04	231,556,967.18
5. 期末基金份额净值	1.397	1.362

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

平安大华添利债券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	1.79%	0.06%	1.35%	0.07%	0.44%	–0.01%

平安大华添利债券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	1.90%	0.06%	1.35%	0.07%	0.55%	–0.02%

业绩比较基准:中证全债指数收益率

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2012年11月27日正式生效,截至报告期末已满五年;

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		
WANGAO	平安大华添利债券型证券投资基金基金经理	2017年12月1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。曾任新加坡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、平安大华鑫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、平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华添利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、平安大华港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。

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、《平安大华添利债券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

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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,是投资组合间债券的1笔同日反向,原因为该基金大额申赎引起的流动性管理需要。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年三季度债券市场收益率先下后上,整体出现震荡走势,本基金的主要策略是信用债以配置为主,利率债以把握交易性机会为主。整体基本面因素对债券市场相对友好,但对冲政策的陆续出台,也导致投资者预期出现一定分化。货币政策整体维持宽松格局,短端收益率下行较多。报告期内,本基金仓位转换比较灵活,信用债仓位久期保持中等水平,同时灵活的运用了杠杆,并且参与了利率债的波段机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安大华添利债券A基金份额净值为1.397元,本报告期基金份额净值增长率为1.90%;截至本报告期末平安大华添利债券C基金份额净值为1.362元,本报告期基金份额净值增长率为1.79%;同期业绩比较基准收益率为1.35%。

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	–	–
	其中:股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	2,205,381,925.90	97.83
	其中:债券	2,144,639,684.80	95.14
	资产支持证券	60,742,241.10	2.69
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	6,693,462.56	0.30
8	其他资产	42,235,995.88	1.87
9	合计	2,254,311,384.34	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

本基金本报告期末未持有股票 。

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

本基金本报告期末未持有股票 。

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	231,755,000.00	14.32
	其中:政策性金融债	161,142,000.00	9.96
4	企业债券	359,019,284.80	22.18
5	企业短期融资券	646,649,200.00	39.95
6	中期票据	751,576,200.00	46.44
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	155,640,000.00	9.62
9	其他	–	–
10	合计	2,144,639,684.80	132.51

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	170409	17农发09	700,000	70,392,000.00	4.35
2	180407	18农发07	700,000	70,308,000.00	4.34
3	011801745	18中建材SCP015	700,000	69,986,000.00	4.32
4	111814137	18江苏银行CD137	700,000	68,194,000.00	4.21
5	111883774	18南京银行CD105	700,000	68,166,000.00	4.21

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	146557	借呗35A1	400,000	40,483,095.89	2.50
2	146677	花呗46A1	200,000	20,259,145.21	1.25

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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投资。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,319.99
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	35,370,325.92
5	应收申购款	6,849,349.97
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	42,235,995.88

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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	平安大华添利债券A	平安大华添利债券C
报告期期初基金份额总额	607,932,135.17	89,613,045.98
报告期期间基金总申购份额	421,142,308.09	156,607,081.50
减:报告期期间基金总赎回份额	36,543,124.76	76,156,313.78
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	992,531,318.50	170,063,813.70

§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添利债券型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华添利债券型证券投资基金基金合同

(3)平安大华添利债券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) 报告期内平安大华添利债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 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

平安大华鑫安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	平安大华鑫安混合
场内简称	–
交易代码	001664
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月11日
报告期末基金份额总额	21,329,115.34份
投资目标	本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会,力求在严格控制风险的基础上,实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金将在资产配置允许的范围内,采取相对灵活的资产配置策略,使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测,对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整,以规避或分散市场风险,提高基金风险调整后的收益。本基金以自上而下的投资策略,大类资产,动态控制组合风险,力争长期,稳定的回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%
风险收益特征	本基金是混合型基金,属于中高风险收益水平的基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金,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

下属分级基金的基金简称	平安大华鑫安混合A	平安大华鑫安混合C
下属分级基金的场内简称	–	–
下属分级基金的交易代码	001664	001665
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	18,617,696.10份	2,711,419.24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)	
	平安大华鑫安混合A	平安大华鑫安混合C
1. 本期已实现收益	–524,349.23	–75,896.45
2. 本期利润	–733,523.95	–106,103.29
3. 加权平均基金份额本期利润	–0.0373	–0.0380
4. 期末基金资产