平安日增利货币市场基金

2018年第四季度报告

基金管理人:平安基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月18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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安日增利货币
场内简称	-
交易代码	000379
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	2013年12月3日
报告期末基金份额总额	149,573,457.021.39份
投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§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10月1日 - 2018年12月31日)
1. 本期已实现收益	1,216,003,842.60
2. 本期利润	1,216,003,842.60
3. 期末基金资产净值	149,573,457,021.39

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(不含公允价值变动损益)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损益，由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金按日结转份额。

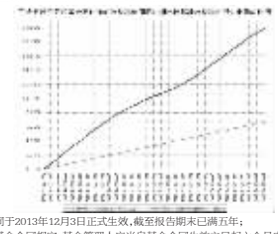
3.2 基金净值表现

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	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7361%	0.0007%	0.3450%	0.0000%	0.3911%	0.0007%

业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2013年12月3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。

§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		
申俊华	平安日增利货币市场基金基金经理	2017年12月5日	-	10	申俊华女士，湖南大学金融学博士，曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员。2012年加入平安基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员。现担任平安财富宝货币市场基金、平安日增利货币市场基金、平安合赢定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。
周琛	平安日增利货币市场基金基金经理	2017年12月1日	-	10	周琛女士，拉夫堡大学硕士，先后担任五矿证券有限公司助理研究员、交易员。2012年8月加入平安基金管理有限公司，曾任基金运营部交易岗、投资研究部固定收益研究员。现任平安财富宝货币市场基金、平安日增利货币市场基金、平安合赢定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。
张文平	固定收益投资中心投资执行总经理,平安日增利货币市场基金的基金经理	2018年8月10日	-	7	张文平先生,南京大学硕士，先后担任毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公司，现任固定收益投资中心投资执行总经理。同时担任平安短债债券型证券投资基金、平安鑫安定期开放债券型证券投资基金、平安日增利货币市场基金、平安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安鑫稳定期开放纯债债券型证券投资基金、平安金颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安鑫利纯债债券型证券投资基金、平安鑫稳定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安鑫利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、《平安日增利货币市场基金基金合同》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

四季度债券市场整体走强。宏观经济走弱进一步得到确认,基建、减税等托底政策效果尚未显现,基本面支持了债市走强。货币政策方面,10月份市场迎来央行年内的第四次降准,12月央行推出TMLF(定向中期借贷便利),并下调操作利率15bp,数量工具和价格工具并用,为市场提供了充裕的流动性。仅在年末跨年因素的影响下,短端资产价格上行迅速,配置机会显现。报告期内,本基金的投资操作以加强流动性管理为主要原则,适度加大杠杆比例,择机拉长组合剩余期限,调整大类资产的配置比例,尽力提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为0.7361%,业绩比较基准收益率为0.3450%。

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	固定收益投资	70,316,337,408.28	44.30
	其中:债券	68,424,677,770.90	43.10
	资产支持证券	1,891,659,637.38	1.19
2	买入返售金融资产	12,237,343,516.07	7.71
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	75,410,649,147.60	47.50
4	其他资产	779,960,588.49	0.49
5	合计	158,744,290,660.44	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.78	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	8,989,550,285.70	6.01
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	12.29	6.01
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.24	-
2	30天(含)-60天	10.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	39.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	5.54	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	37.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		105.61	6.01

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	99,994,058.04	0.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,902,271,235.42	5.95
	其中:政策性金融债	8,902,271,235.42	5.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,480,269,908.38	2.33
6	中期票据	-	-
7	同业存单	55,942,142,569.06	37.40
8	其他	-	-
9	合计	68,424,677,770.90	45.75
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	358,358,662.66	0.24

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180207	18国开07	22,100,000	2,209,887,281.31	1.48
2	180404	18农发04	19,300,000	1,931,257,379.83	1.29
3	180201	18国开01	15,600,000	1,560,467,143.32	1.04
4	111816367	18上海银行CD367	15,000,000	1,491,769,863.39	1.00
5	111816378	18上海银行CD378	14,000,000	1,391,293,034.54	0.93
6	111817242	18光大银行CD242	12,000,000	1,192,582,975.77	0.80
7	111811327	18平安银行CD327	10,000,000	995,627,190.20	0.67
8	111803221	18农业银行CD221	10,000,000	991,845,017.02	0.66
9	111809427	18浦发银行CD427	10,000,000	991,474,749.62	0.66
10	111810654	18兴业银行CD654	10,000,000	978,564,767.03	0.65

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1294%
报告期内偏离度的最低值	0.0330%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0907%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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十名资产支持证券投资明细

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	149920	18花项6A	2,300,000.00	230,000,000.00	0.15
2	156081	18建花3A	1,600,000.00	160,000,000.00	0.11
3	149808	借项55A1	1,400,000.00	140,483,956.07	0.09
4	149380	18花06A1	1,200,000.00	120,000,000.00	0.08
5	139275	蚁信06A	1,100,000.00	110,000,000.00	0.07
6	149448	18花项2A	1,000,000.00	100,831,174.45	0.07
7	156126	国花01A	1,000,000.00	100,000,000.00	0.07
8	156087	花项66A1	900,000.00	90,000,000.00	0.06
9	139248	万科26A1	800,000.00	80,074,248.12	0.05
10	149086	借项49A1	750,000.00	75,474,248.69	0.05

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值始终保持1.00 元。

5.9.2

银保监会于2018年11月9日做出银保监银罚决字(2018)10号处罚决定,由于中国光大银行股份有限公司(以下简称“公司”):(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)以误导方式违规销售理财产品;(三)以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品;(四)违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务;(五)同业投资违规接受担保;(六)通过同业投资或贷款虚增存款规模。根据相关规定对公司没收违法所得100万元,罚款1020万元,合计1120万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项有利于公司规范开展业务,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。

由于兴业银行股份有限公司(以下简称“公司”):(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)违规向贵州省当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款。监管机构决定对公司罚款5570万元,没收违法所得3024万元,罚没合计8573024万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项有利于公司规范开展业务,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。

银监会于2018年2月12日做出银监罚决字(2018)14号处罚决定,由于上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“公司”):(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款;(三)通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节;(四)理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求;(五)提供不实说明材料、不配合调查取证;(六)以贷转存,虚增存贷款;(七)票据承兑,贴现业务贸易背景审查不严;(八)国内信用证业务贸易背景审查不严;(九)贷款管理严重缺失,导致大额不良贷款;(十)违规通过同业投资转存款方式,虚增存款;(十一)票据资管业务在总行审批股回后仍继续办理;(十二)对代理收付资金的信托计划提供保本承诺;(十三)以存放同业业务名义开办委托定向投资业务,并少计风险资产;(十四)投资多款同业理财产品未尽职审查,涉及金额较大;(十五)陈改总行理财合同标准文本,导致理财资金实际投向与合同约定不符;(十六)为非保本理财产品出具保本承诺函;(十七)向关系人发放信用贷款;(十八)向客户收取服务费,但未提供实质性服务,明显质价不符;(十九)收费超过服务价格目录,向客户转嫁成本。根据相关规定对公司罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元。2018年1月18日,银监会四川监管局对公司成都分行作出行政处罚决定,对成都分行内控管理严重失效、授信管理违规、违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处,执行罚款46.175万元人民币。上海浦东发展银行股份有限公司于2018年7月26日因未按照规定履行客户身份识别义务等,受到中国人民银行处罚(银反洗罚决字(2018年)3号)。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为以上事项有利于公司规范开展业务,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七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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	777,069.60371
4	应收申购款	2,890,984.78
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	779,960,588.49

5.9.4 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	169,381,807,199.97
报告期期间基金总申购份额	159,883,111,150.55
报告期期间基金总赎回份额	179,691,461,329.13
报告期期末基金份额总额	149,573,457,021.39

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2018年10月12日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
2	红利发放	2018年10月15日	121,724.52	121,724.52	0.00%
3	申购	2018年10月15日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
4	申购	2018年10月16日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
5	申购	2018年10月17日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
6	申购	2018年10月18日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
7	申购	2018年10月19日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
8	申购	2018年10月22日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
9	申购	2018年10月23日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
10	申购	2018年10月24日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
11	申购	2018年10月25日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
12	申购	2018年10月26日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
13	红利发放	2018年11月15日	339,830.57	339,830.57	0.00%
14	红利发放	2018年12月17日	406,301.17	406,301.17	0.00%
15	申购	2018年12月18日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
16	申购	2018年12月19日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
17	申购	2018年12月20日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
18	申购	2018年12月21日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
19	申购	2018年12月24日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
20	申购	2018年12月26日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
21	申购	2018年12月27日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
合计			180,867,856.26	180,867,856.26	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、自2018年10月25日起,本基金管理人法定名称由“平安大华基金管理有限公司”变更为“平安基金管理有限公司”。

2、经本基金管理人2017年第六次临时股东会审议通过,并经中国证券监督管理委员会《关于核准平安大华基金管理有限公司变更股权的批复》(证监许可【2018】1595号),公司新增注册资本10亿元人民币。本次增资完成后,本公司注册资本由3亿元人民币增加至13亿元人民币。

3、本基金名称由“平安大华日增利货币市场基金”变更为“平安日增利货币市场基金”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安日增利货币市场基金设立的文件

(2)平安日增利货币市场基金基金合同

(3)平安日增利货币市场基金托管协议

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)平安日增利货币市场基金2018年第4季度报告原文

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基金管理有限公司,客户服务电话:4008004800(免长途话费)

平安基金管理有限公司
2019年1月18日

平安深证300指数增强型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:平安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月18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2019年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安深证300指数增强
场内简称	-
交易代码	700002
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	2011年12月20日
报告期末基金份额总额	47,346,954.02份
投资目标	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过指数复制的方法拟合、跟踪深证300指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的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7.75%。
投资策略	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过全样本复制的方式拟合、跟踪深证300指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理,以有效降低基金运作成本并提高本基金的投资收益率。其中指数复制策略采用全样本复制的方式,即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合以拟合标的指数的业绩表现。股票增强策略在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上,辅以有限度的增强操作及一级市场股票投资,以求获取超越标的指数的收益率表现。
业绩比较基准	深证300指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时,本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	平安基金管理有限公司
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10月1日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-4,991,220.28
2.本期利润	-7,710,183.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1660
4.期末基金资产净值	55,528,657.28
5.期末基金份额净值	1.173

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。

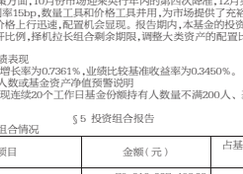
3.2 基金净值表现

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	-12.53%	1.68%	-13.43%	1.74%	0.90%	-0.06%

业绩比较基准:深证300指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(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2011年12月20日正式生效,截至报告期末已满七年;

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	平安深证300指数增强证券投资基金的基金经理	2016年8月19日	-	9	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、EquaMetrics Inc.、国信证券,2016年加入平安基金管理有限公司,任好生品投资中心量化研究员。现任平安深证300指数增强证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安稳型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安量化精选混合型发起式证券投资基金、平安趋势增长中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
DANIEL DONGNINING SUN	衍生品投资中心投资执行总经理，平安深证300指数增强证券投资基金基金经理	2017年9月5日	-	14	DANIEL DONGNINING 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、摩根士丹利市场风险量化服务资青人。2014年10月加入平安基金管理有限公司,任衍生品投资中心投资执行总经理。现任平安深证300指数增强型证券投资基金、平安沪深300指数量化增强证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安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、《平安深证300指数增强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

回顾四季度,一方面,市场盈利进入加速下行阶段,周期、消费等强势行业也受宏观经济下行的影响也逐渐回落,A股市场整体也震荡下行;另一方面,市场也进入了政策维度的集中博弈期,监管层面对流动性、市场监管与预期的引导使得四季度也出现了一定的阶段结构性行情,但总体依然处于风险偏好和估值下行的趋势,市场估值逐渐进入历史估值底部区域。港股市场受外围因素和风险偏好影响,市场的估值先于盈利开始系统性回落,总体也处于震荡下行的趋势,但估值和红利等因子表现尚可。本基金继续以跟踪中证沪港深指数为目标,参与市场估值与分红带来的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.8379元;本报告期基金份额净值增长率为-9.45%,业绩比较基准收益率为-8.72%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内出现连续50个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,截至报告期末,以上情况未消

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	50,215,337.20	89.78
	其中:股票	50,215,337.20	89.78
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	5,674,892.26	10.15
8	其他资产	40,985.35	0.07
9	合计	55,931,214.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按申万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	1,973,352.32	3.55
B	采矿业	885,439.00	1.59
C	制造业	26,016,732.88	46.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	564,079.00	1.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,450,072.00	4.41
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	3,075,315.00	5.54
J	金融业	1,939,922.00	3.49
K	房地产业	6,116,195.00	11.01
L	租赁和商务服务业	454,832.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	695,259.00	1.25
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	601,311.00	1.08
S	综合	-	-
	合计	44,772,509.20	80.63

5.2.2 报告期末积极投资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	483,790.00	0.87
C	制造业	1,424,993.00	2.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	515,280.00	0.93
F	批发和零售业	716,985.00	1.29
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	1,063,446.00	1.92
K	房地产业	1,238,334.00	2.23
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	5,442,828.00	9.80

5.2.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	000651	格力电器	63,500	2,266,315.00	4.08
2	000333	美的集团	55,200	2,034,672.00	3.66
3	000002	万 科A	55,500	1,322,010.00	2.38
4	000338	潍柴动力	167,700	1,291,290.00	2.33
5	000069	华侨城A	202,100	1,283,335.00	2.31
6	300498	温氏股份	46,824	1,225,852.32	2.21
7	000858	五 粮 液	20,800	1,058,304.00	1.91
8	001979