

B367

2018年年度报告摘要

序号	项目	金额	占基金总资产的百分比
1	权益投资	--	--
	其中：股票	--	--
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	3,871,295,871.89	92.40
	其中：债券	3,871,295,871.89	92.40
	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	194,500,611.81	4.64
	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	41,735,679.66	1.00
8	其他各项资产	82,273,447.27	1.96
9	合计	4,189,945,610.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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。

8.2.2 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。

8.3 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。

8.4 报告期末股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末无股票投资。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末无股票投资。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末无股票投资。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--

3	金融资产	3,871,295,871.89	98.32
4	非金融资产	—	—
5	金融资产	3,871,295,871.89	98.32
6	企业短期金融资产	—	—
7	中期票据	—	—
8	可转换(可交换)债	—	—
9	权益类	—	—
10	合计	3,871,295,871.89	98.32

8.6 期末按公允价值计量且其变动计入当期损益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	公允价值占期末公允价值金融资产总额比例(人民币元)

1	180212	180117	6,500,000	667,150,000.00	16.69
2	180203	180116	3,400,000	349,826,000.00	8.88
3	180208	180106	3,100,000	315,733,000.00	8.02
4	172009	172019	3,100,000	314,805,000.00	8.00
5	180215	180112	2,600,000	269,586,000.00	6.87

8.7 期末按公允价值计量且公允价值变动比例大小排序的前十名资产支持证券

8.8 本报告期末未持有资产支持证券

8.9 期末按公允价值计量且公允价值变动比例大小排序的前五名贵金属投资

8.10 本报告期末未持有贵金属投资

8.11 期末按公允价值计量且公允价值变动比例大小排序的前五名权证投资

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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参与国债期货投资。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

8.11.2

本基金本报告期末无股票投资。

8.11.3 期末其他各项资产/负债

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	35,393.10

2	应付证券款	—
3	应收利息	—
4	应收股利	82,238,054.08
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	82,237,417.27

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无股票投资。

8.11.6 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,之和与合计可能有尾差。

8.9 基金业绩指标及其信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

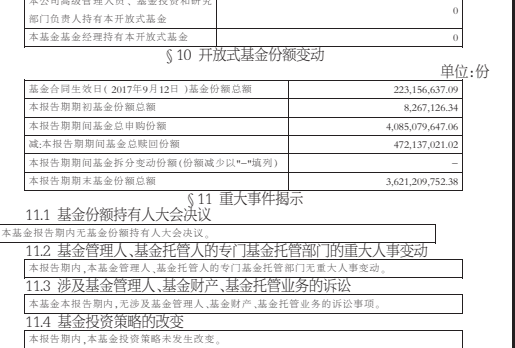
持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例
744	4,867,217.41	3,620,553,532.29	99.98%	665,220.09	0.02%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	-------------------



11.75 基金进行银行间债券市场交易情况						
报告期内基金买卖过银行间债券市场，其中买卖过国债、政府债券及政策性债券(特种金融债除外)已为本基金投资范围，报告期内，本基金未进行过银行间债券市场交易。						
11.76 管理人、托管人及其高级管理人员已受处罚或处罚等情况						
本报告期内，本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员及基金托管人未受有关监管部门处罚或处罚等情况。						
11.77 基金租用证券公司交易单元的有关情况						
11.7.1 基金租用证券公司交易单元用于股票投资及佣金支付情况						
金额单位：人民币元						
券商名称	交易数量	股票交易		债券支付佣金的情况		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
川财证券	2	—	—	—	—	—

券商名称	借券交易		借券回购业务		权证交易	
	成交金额	占当期借券 成交总额 的比例	成交金额	借券回 购交 易总 额 比例	成交金额	占当期权 证交 易总 额 的比例
川财证券	521,206,098.44	100.00%	1,633,300,000.00	100.00%	--	--

12. 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期末持有基金份额变化情况			报告期末持有基金份额情况		
投资者 序号	持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间	期初 份额	期中 份额	期末 份额	持有份额 比例占比
机构 1	20180919 20181128	—	0.00	280,556,438.79	7.75%
2	20180919 20181128	—	0.00	280,557,373.98	7.75%

3	20181127	0.00	185,338,708.18	0.00	185,338,708.18	5.12%
4	20181129	--	0.00	463,090,673.34	463,090,673.34	0.00%
4	20181224	--	0.00	463,090,673.34	0.00	0.00%
5	20181129	--	0.00	463,090,673.34	0.00	0.00%
5	20181225	--	0.00	463,090,673.34	463,090,673.34	12.79%
6	20181225	--	0.00	452,404,210.14	0.00	452,404,210.14
6	20181225	--	0.00	452,404,210.14	0.00	12.49%
7	20181226	--	0.00	928,506,302.58	0.00	928,506,302.58
7	20181231	--	0.00	928,506,302.58	928,506,302.58	25.48%

产品持有风险

本报告期内,本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时,可能引起巨额赎回,发生巨额赎回时本基金是有足够现金的,存在一定流动性风险;为应对巨额赎回进行了投资标的变现,可能在仓位调整期,甚至对基金赎回造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并提前做好流动性管理,当本基金出现巨额赎回并提前确认时,申请赎回的基金份额持有人有可能面临巨额赎回款项支付延迟的风险。未赎回的基金份额持有人有可能承担短期基金份额净值波动或由本为基金份额净值产生的不利影响。

在极端情况下,当持有基金份额比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致

12. 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”, 为维护投资者利益, 避免对投资者造成混淆或误导, 本基金名称由“平安大华现金增利债券型证券投资基金”变更为“平安现金增利债券型证券投资基金”。

2. 经本管理人2017年9月次临时股东大会审议通过, 并经中国证监会备案委员会《关于核准平安大华基金管理有限公司变更股权的议案》(证监许可[2018]1565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。

平安基金管理有限公司
2018年12月27日