平安大华安盈保本混合型证券投资基金

2017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：平安银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月25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2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华安盈保本混合
场内简称	–
交易代码	002537
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	2016年4月22日
报告期末基金份额总额	1,389,390,290.89份
投资目标	本基金以本金安全为目标，通过有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增长和保本期收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略和时间不变性投资组合保险策略，建立和运用严格的动态资产数量模型，动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例，以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标，并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司

§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（2017年7月1日 － 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	5,328,535.22
2.本期利润	11,856,833.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0083
4.期末基金资产净值	1,423,900,072.19
5.期末基金份额净值	1.025

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。

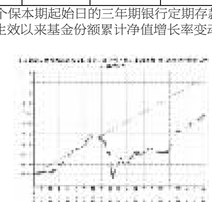
3.2 基金净值表现

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	0.89%	0.05%	0.67%	0.01%	0.22%	0.04%

业绩比较基准：每个保本期起始日的三年期银行定期存款收益率（税后）

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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4月22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。

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		
孙健	平安大华安盈保本混合型证券投资基金基金经理、投资研究部执行总经理	2016年4月22日	–	16	孙健先生，投资研究部执行总经理，基金经理，硕士。曾任湘财证券有限责任公司资产管理总部投资经理，中国太平人寿保险有限公司投资部、太平资产管理有限公司组合投资经理，摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理，银华基金管理有限公司固定收益部副总监，银华货币市场基金基金经理、银华信用债券型基金基金经理。2011年9月加入平安大华基金管理有限公司，现担任“平安大华添利债券型证券投资基金”、“平安大华日增利货币市场基金”、“平安大华保本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”、“平安大华安享保本混合型证券投资基金”、“平安大华安盈保本混合型证券投资基金”、“平安大华惠盈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、《平安大华安盈保本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

2017年三季度债券市场呈现出高位震荡走势，但较前两个季度有所修复，市场整体收益为正，短期信用债券表现最佳。保本基金在年初避险策略基金新规执行后一直处于调整稳健资产的状态，不断加大投资AAA等级短期信用债券、银行CD和政策性银行金融债券，本基金截止报告期末AAA等级的债券资产比例已达到71%，组合信用高等级和高流动性特性提高。年内宏观经济数据韧性仍强，美联储年底再次加息预期确定性较大，年底资金面和金融去杠杆监管导致的资金扰动对于债券仍有影响，短期利率已经具备投资价值，中长期债券收益率面临经济基本面和通货膨胀数据影响，债市收益率仍处于震荡筑顶过程。未来本基金将做好配置型债券的投资，加大交易型债券的投资比例，在稳健资产达标后加大权益资产包括可转债和股票的投资比例，进一步提升基金收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日，本基金份额净值为1.025元，份额累计净值为1.025元。报告期内，本基金份额净值增长率为0.89%，同期业绩基准增长率为0.67%。

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	37,937,272.27	2.66
	其中：股票	37,937,272.27	2.66
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	1,239,520,528.00	86.83
	其中：债券	1,239,520,528.00	86.83
	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	130,000,000.00	9.11
	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	6,339,410.82	0.44
8	其他资产	13,727,340.33	0.96
9	合计	1,427,524,551.42	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	131,700.00	0.01
B	采矿业	20,850.00	0.00
C	制造业	28,971,903.95	2.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,180.00	0.00
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	2,775.00	0.00
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	8,798,863.32	0.62
J	金融业	–	–
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	37,937,272.27	2.66

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	002597	金禾实业	274,493	6,080,019.95	0.43
2	300166	东方国信	393,783	5,922,496.32	0.42
3	300476	胜宏科技	191,100	4,834,830.00	0.34
4	601222	林洋能源	495,000	4,390,650.00	0.31
5	002217	合力泰	330,000	3,712,500.00	0.26
6	600845	宝信软件	168,900	2,876,367.00	0.20
7	002185	华天科技	330,000	2,768,700.00	0.19
8	603228	景旺电子	50,000	2,720,500.00	0.19
9	601966	玲珑轮胎	120,000	2,388,000.00	0.17
10	000700	模塑科技	205,200	1,448,712.00	0.10

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	9,838,000.00	0.69
2	央行票据	–	–
3	金融债券	330,158,500.00	23.19
	其中：政策性金融债	272,054,500.00	19.11
4	企业债券	118,209,878.00	8.30
5	企业短期融资券	230,389,000.00	16.18
6	中期票据	48,980,000.00	3.44
7	可转债（可交换债）	1,221,150.00	0.09
8	同业存单	500,724,000.00	35.17
9	其他	–	–
10	合计	1,239,520,528.00	87.05

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	111710302	17兴业银行CD302	1,600,000	156,368,000.00	10.98
2	111715193	17民生银行CD193	1,500,000	146,595,000.00	10.30
3	011763006	17首钢SCP003	600,000	60,276,000.00	4.23
4	041759022	17昆山国创CP001	600,000	59,964,000.00	4.21
5	1620038	16徽商银行01	600,000	58,104,000.00	4.08

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股指期货交易情况说明

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

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。

5.11.2

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	98,132.76
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	13,629,207.57
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	13,727,340.33

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

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	1,463,998,206.64
报告期期间基金总申购份额	144,515.11
减：报告期期间基金总赎回份额	74,752,430.86
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	1,389,390,290.89

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	581,000,000.00	0.00	0.00	581,000,000.00	41.82%
产品特有风险							
流动性风险							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

经平安大华基金管理有限公司第三届董事会第二次会议通过，同意选举罗春风先生为第三届董事会董事长；同意聘任肖宇鹏先生为总经理；同意聘任付强先生、林婉文女士、汪涛先生为副总经理；同意聘任陈特正先生为督察长兼董事会秘书。

§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大华安盈保本混合型证券投资基金设立的文件

（2）平安大华安盈保本混合型证券投资基金基金合同

（3）平安大华安盈保本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）报告期内平安大华安盈保本混合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

2017年10月25日

平安大华保本混合型证券投资基金

2017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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月25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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华保本混合
场内简称	–
交易代码	700004
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	2012年9月11日
报告期末基金份额总额	353,159,109.38份
投资目标	采用投资组合保险技术，以保本期到期时本金安全为目标，通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增长。
投资策略	采用恒定比例组合保险策略，动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例，以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标，并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司

§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（2017年7月1日 － 2017年9月30日）
1.本期已实现收益	-446,548.30
2.本期利润	2,572,355.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0070
4.期末基金资产净值	364,467,232.81
5.期末基金份额净值	1.032

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。

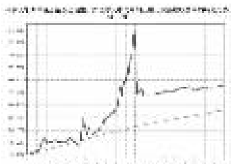
3.2 基金净值表现

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	0.68%	0.04%	0.64%	0.01%	0.04%	0.03%

业绩比较基准：每个保本期起始日的三年期银行定期存款收益率（税后）

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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9月11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		
孙健	平安大华保本混合型证券投资基金基金经理、投资研究部执行总经理	2012年9月11日	–	16	孙健先生，投资研究部执行总经理，基金经理，硕士。曾任湘财证券有限责任公司资产管理总部投资经理，中国太平人寿保险有限公司投资部、太平资产管理有限公司组合投资经理，摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理，银华基金管理有限公司固定收益部副总监、银华货币市场基金基金经理，银华信用债券型基金基金经理。2011年9月加入平安大华基金公司，任投资研究部固定收益研究员，现担任“平安大华添利债券型证券投资基金”、“平安大华日增利货币市场基金”、“平安大华保本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”、“平安大华安享保本混合型证券投资基金”、“平安大华安盈保本混合型证券投资基金”、“平安大华惠盈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、《平安大华保本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

2017年三季度债券市场呈现出高位震荡走势，但较前两个季度有所修复，市场整体收益为正，短期信用债券表现最佳。保本基金在年初避险策略基金新规执行后一直处于调整稳健资产的状态，不断加大投资AAA等级短期信用债券、银行CD和政策性银行金融债券，本基金截止报告期末AAA等级的债券资产比例已达到78%，组合信用高等级和高流动性特性提高。年内宏观经济数据韧性仍强，美联储年底再次加息预期确定性较大，年底资金面和金融去杠杆监管导致的资金扰动对于债券仍有影响，短期利率已经具备投资价值，中长期债券收益率面临经济基本面和通货膨胀数据影响，债市收益率仍处于震荡筑顶过程。未来本基金将做好配置型债券的投资，加大交易型债券的投资比例，在稳健资产达标后加大权益资产包括可转债和股票的投资比例，进一步提升基金收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日，本基金份额净值为1.032元，份额累计净值为1.287元。报告期内，本基金份额净值增长率为0.68%，同期业绩基准增长率为0.64%。

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	9,621,563.40	2.61
	其中：股票	9,621,563.40	2.61
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	346,902,326.10	93.97
	其中：债券	346,902,326.10	93.97
	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	7,337,656.15	1.99
8	其他资产	5,290,295.60	1.43
9	合计	369,151,841.25	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	20,850.00	0.01
C	制造业	7,351,993.40	2.02
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	2,248,720.00	0.62
J	金融业	–	–
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	9,621,563.40	2.64

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

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	300476	胜宏科技	87,500	2,213,750.00	0.61
2	300166	东方国信	100,600	1,513,024.00	0.42
3	002597	金禾实业	51,700	1,145,155.00	0.31
4	601222	林洋能源	126,600	1,122,942.00	0.31
5	601966	玲珑轮胎	50,000	995,000.00	0.27
6	002217	合力泰	80,000	900,000.00	0.25
7	600845	宝信软件	43,200	735,696.00	0.20
8	000700	模塑科技	52,600	371,356.00	0.10
9	603228	景旺电子	6,000	326,460.00	0.09
10	603737	三棵树	3,000	197,790.00	0.05

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	19,986,000.00	5.48
2	央行票据	–	–
3	金融债券	99,139,000.00	27.20
	其中：政策性金融债	99,139,000.00	27.20
4	企业债券	9,831,000.00	2.70
5	企业短期融资券	90,225,000.00	24.76
6	中期票据	19,988,000.00	5.48
7	可转债（可交换债）	240,326.10	0.07
8	同业存单	107,493,000.00	29.49
9	其他	–	–
10	合计	346,902,326.10	95.18

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	111710302	17兴业银行CD302	500,000	48,865,000.00	13.41
1	111715193	17民生银行CD193	500,000	48,865,000.00	13.41
2	041670006	16怡亚通CP003	300,000	30,195,000.00	8.28
3	170415	17农发15	200,000	20,122,000.00	5.52
4	041753009	17中铝CP001	200,000	20,042,000.00	5.50
5	011764096	17龙源电力SCP006	200,000	20,002,000.00	5.49

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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股指期货交易情况说明

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

本基金本报告期末无国债期货持仓。

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

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。

5.11.2

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	11,627.79
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	5,277,974.46
5	应收申购款	693.35
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,290,295.60

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

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	384,251,668.24
报告期期间基金总申购份额	485,907.86
减：报告期期间基金总赎回份额	31,578,466.72
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	353,159,109.38

§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 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

经平安大华基金管理有限公司第三届董事会第二次会议通过，同意选举罗春风先生为第三届董事会董事长；同意聘任肖宇鹏先生为总经理；同意聘任付强先生、林婉文女士、汪涛先生为副总经理；同意聘任陈特正先生为督察长兼董事会秘书。

§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大华保本混合型证券投资基金设立的文件

（2）平安大华保本混合型证券投资基金基金合同

（3）平安大华保本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）报告期内平安大华保本混合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

2017年10月25日

平安大华财富宝货币市场基金

2017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：平安银行股份有限公司
报告送出日期：2017年10月25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2017年10月23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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华财富宝货币
场内简称	–
交易代码	000759
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	2014年8月21日
报告期末基金份额总额	23,623,919,326.02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，是证券投资基金中的低风险品种。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	平安大华基金管理有限公司
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（2017年7月1日 － 2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	260,946,151.92
2. 本期利润	260,946,151.92
3. 期末基金资产净值	23,623,919,326.02

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。

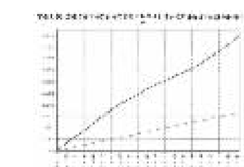
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益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	1.1257%	0.0006%	0.3450%	0.0000%	0.7807%	0.0006%

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2014年8月21日正式生效，截至报告期末已满三年；

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。

§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	平安大华财富宝货币市场基金基金经理	2014年9月25日	–	8	申俊华女士，湖南大学金融学博士，8年证券基金从业经验，曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员。2012年加入平安大华基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员。现担任平安大华财富宝货币市场基金、平安大华交易型货币市场基金、平安大华惠享纯债债券型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、平安大华金管家货币市场基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、平安大华惠元纯债债券型证券投资基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫荣混合型证券投资基金、平安大华惠悦纯债债券型证券投资基金基金经理。
周琛	平安大华财富宝货币市场基金基金经理	2017年9月22日	–	9	英国贝尔法斯特女王大学学士，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月加入平安大华基金管理有限公司，曾任基金运营部交易岗、投资研究部固定收益研究员。现任平安大华财富宝货币市场基金基金经理。

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、《平安大华财富宝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

2017年三季度，债券市场呈现出高位震荡走势，市场整体收益为正。整个三季度，货币政策保持基本稳定，监管趋于协调统一，货币市场流动性维持紧平衡。央行在公开市场操作上更具前瞻性、灵活性，并加强预调微调和预期管理，操作上“削峰填谷”熨平流动性波动。而缴税和财政存款上缴超出历史平均水平，成为市场流动性的主要扰动因素，造成了市场时点性紧张。本基金的投资操作仍以加强流动性管理为主要原则，在有效控制负偏离度的前提下，增加了债券的投资比例，同时通过优选存款交易对手，提升了协议存款的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为1.1257%，同期业绩基准增长率为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	10,706,603,888.43	43.51
	其中：债券	10,511,525,699.23	42.72
	资产支持证券	195,078,189.20	0.79
2	买入返售金融资产	5,788,943,533.40	23.53
	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	7,958,041,333.52	32.34
4	其他资产	153,354,340.56	0.62
5	合计	24,606,943,095.91	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	3.00	
	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	970,087,944.86	4.11
	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

本报告期内本货币市场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	110
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

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	26.44	4.11
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.21	–
2	30天(含)—60天	8.08	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.25	–
3	60天(含)—90天	28.82	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	2.62	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.21	–
5	120天(含)—397天（含）	37.55	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	103.51	4.11

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

本报告期内本基金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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	1,228,153,685.87	5.20
	其中：政策性金融债	1,228,153,685.87	5.20
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	5,168,122,055.12	21.88
6	中期票据	–	–
7	同业存单	4,115,249,958.24	17.42
8	其他	–	–
9	合计	10,511,525,699.23	44.50
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	159,507,074.30	0.68

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	111785180	17北京农商银行CD079	4,500,000	445,757,910.21	1.89
2	111785009	17常熟农村商行CD187	3,000,000	293,829,827.97	1.24
3	170204	17国开04	2,900,000	289,157,418.14	1.22
4	011761062	17远东租赁SCP003	2,000,000	200,351,983.60	0.85
5	111783482	17长沙银行CD089	2,000,000	198,690,393.07	0.84
6	111784775	17天津银行CD192	2,000,000	198,242,264.99	0.84
7	111719294	17恒丰银行CD294	2,000,000	198,190,387.76	0.84
8	111784021	17东莞银行CD083	2,000,000	196,138,665.71	0.83
9	111784911	17东莞农村商业银行CD076	2,000,000	195,954,265.01	0.83
10	111719291	17恒丰银行CD291	2,000,000	195,935,009.88	0.83

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	0.0820%
报告期内偏离度的最低值	0.0318%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0635%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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	142274	花呗10A1	500,000	50,000,000.00	0.21
1	146421	借呗31A1	500,000	50,000,000.00	0.21
2	116418	万科3A1	300,000	30,000,000.00	0.13
3	1789219	17惠益2A1	300,000	29,988,799.38	0.13
4	1789045	17上和1A1	500,000	17,935,000.00	0.08
5	1789164	17惠益1A1	300,000	17,154,389.82	0.07

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，基金账面份额净值始终保持1.00 元。

5.9.2

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，本期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	132,941,662.86
4	应收申购款	20,412,677.70
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	153,354,340.56

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	22,420,769,622.69
报告期期间基金总申购份额	22,269,920,483.55
报告期期间基金总赎回份额	21,066,770,780.22
报告期期末基金份额总额	23,623,919,326.02

§7 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 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

经平安大华基金管理有限公司第三届董事会第二次会议通过，同意选举罗春风先生为第三届董事会董事长；同意聘任肖宇鹏先生为总经理；同意聘任付强先生、林婉文女士、汪涛先生为副总经理；同意聘任陈特正先生为督察长兼董事会秘书。

§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大华财富宝货币市场基金设立的文件

（2）平安大华财富宝货币市场基金基金合同

（3）平安大华财富宝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）报告期内平安大华财富宝货币市场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

2017年10月25日