平安大华量化灵活配置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	平安大华量化混合	
场内简称	–	
交易代码	003959	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年1月23日	
报告期末基金份额总额	20,019,338.56份	
投资目标	本基金利用数量化投资模型,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取数量化方法,运用行业轮动投资时钟的资产配置逻辑,形成对大类资产预期收益及风险的判断,确定资产配置的具体比例,并相应采取灵活或防守的投资风格,力求有效降低基金投资系统性风险。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金、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	平安银行股份有限公司	
基金保证人	–	
下属分级基金的基金简称	平安大华量化混合A	平安大华量化混合C
下属分级基金的场内简称	–	–
下属分级基金的交易代码	003959	003960
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	19,999,814.09份	19,524.47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(2017年7月1日 – 2017年9月30日)	
	平安大华量化混合A	平安大华量化混合C
1. 本期已实现收益	142,760.22	99.56
2. 本期利润	89,697.19	48.31
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0024
4. 期末基金资产净值	20,466,525.63	19,447.65
5. 期末基金份额净值	1.0233	0.9961

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

平安大华量化混合A

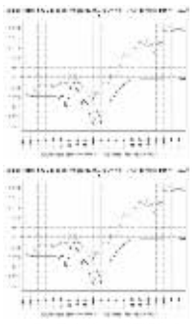
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.43%	0.03%	3.04%	0.35%	-2.61%	-0.32%

平安大华量化混合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	0.24%	0.03%	3.04%	0.35%	-2.80%	-0.32%

沪深300指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%

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1月23日正式生效,截至报告期末未满一年;

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		
李黄海	平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017年1月23日	2017年9月13日	14	李黄海先生,美国南加州大学博士,曾先后任职于民生加银基金融工程与产品开发部执行总监,易方达基金投资发展部总监助理,摩根士丹利华鑫基金数量化投资策略投资经理。2015年9月加入平安大华基金管理有限公司,曾任平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫常混合型证券投资基金基金经理。
刘俊廷	平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017年9月6日	–	6	刘俊廷先生,中国科学院研究生院硕士,曾担任国泰君安证券股份有限公司分析师。2014年12月加入平安大华基金管理有限公司,任行业研究员。现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、平安大华施越定期开放灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎弘混合型证券投资基金、平安大华鼎沣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎弘灵活配置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、《平安大华量化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

宏观层面,2017年三季度中国经济平稳增值,通胀相对温和,制造业景气回暖,但上游价格维持高企。微观层面,国内市场竞争和供给侧结构性改革促使行业内集中度提升、龙头ROE逐步提升。货币政策维持中性,资金面先松后紧,债券市场收益率在三季度初延续下行,但随后受资金面影响,出现冲高回落走势。

本报告期内,根据定量和定性的分析采取了审慎的基金操作,以银行间回购、参与新股申购为主,股票一直保持低仓位运行。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末量化灵活配置A基金份额净值为1.0233元,本报告期基金份额净值增长率为0.43%;同期业绩比较基准收益率为3.04%。截至本报告期末量化灵活配置C基金份额净值为0.9961元,本报告期基金份额净值增长率为0.24%;同期业绩比较基准收益率为3.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2017年6月6日至2017年9月29日,出现连续84个工作日基金资产净值低于5000万的情形。截止本报告期末,以上情形未消除。根据2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件,予以披露,且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

§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	1,227,517.00	5.93
	其中:股票	1,227,517.00	5.93
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	16,500,000.00	79.77
	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	2,711,827.71	13.11
8	其他资产	245,093.23	1.18
9	合计	20,684,437.94	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	598,957.00	2.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	628,560.00	3.07
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	–	–
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	1,227,517.00	5.99

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	002504	*ST弘高	77,600	628,560.00	3.07
2	002070	*ST众和	42,100	428,157.00	2.09
3	600100	同方股份	14,000	170,800.00	0.83

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投资。

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

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	230,773.68
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	14,319.55
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	245,093.23

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	002504	*ST弘高	628,560.00	3.07	重大事项
2	002070	*ST众和	428,157.00	2.09	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	平安大华量化混合A	平安大华量化混合C
报告期期初基金份额总额	20,001,810.19	20,125.46
报告期期间基金总申购份额	9,754.81	–
减:报告期期间基金总赎回份额	11,750.91	600.99
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	19,999,814.09	19,524.47

§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	19,999,000.00	0.00	0.00	19,999,000.00	99.90%
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量化灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华量化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)报告期内平安大华量化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

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

平安大华日增利货币市场基金

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	103,188,803,968.66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	981,717,631.57
2. 本期利润	981,717,631.57
3. 期末基金资产净值	103,188,803,968.66

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。

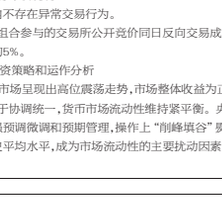
3.2 基金净值表现

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	1.0079%	0.0004%	0.3450%	0.0000%	0.6629%	0.0004%

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		
孙健	平安大华日增利货币市场基金的基金经理、投资研究部执行总经理	2013年12月3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投资总监,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,任投资研究部固定收益研究员,期间任“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”“平安大华安享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

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1.0079%,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	30,511,363,775.04	29.26
	其中:债券	30,056,933,072.38	28.82
	资产支持证券	454,430,702.66	0.44
2	买入返售金融资产	7,709,172,283.77	7.39
	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	65,374,555,461.36	62.69
4	其他资产	685,607,893.99	0.66
5	合计	104,280,699,414.16	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	0.48	
	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	995,197,947.20	0.96
	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	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	100
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

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	11.21	0.96
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.44	–
2	30天(含)-60天	22.65	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.19	–
3	60天(含)-90天	41.80	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)-120天	2.68	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.22	–
5	120天(含)-397天(含)	22.05	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
合计		100.39	0.96

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	39,622,720.06	0.04
2	央行票据	–	–
3	金融债券	5,226,321,899.32	5.06
	其中:政策性金融债	5,226,321,899.32	5.06
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	10,485,810,864.73	10.16
6	中期票据	–	–
7	同业存单	14,305,177,588.27	13.86
8	其他	–	–
9	合计	30,056,933,072.38	29.13
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	885,002,414.82	0.86

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	170207	17国开07	6,000,000	598,971,087.30	0.58
2	111783482	17长沙银行CD089	6,000,000	596,071,179.29	0.58
3	170410	17农发10	5,200,000	518,954,775.02	0.50
4	170204	17国开04	5,100,000	508,580,151.31	0.49
5	111785246	17郑州银行CD156	5,000,000	495,296,566.86	0.48
5	111785253	17厦门国际银行CD174	5,000,000	495,296,566.86	0.48
6	111785278	17青岛银行CD162	5,000,000	495,227,188.82	0.48
7	111785237	17盛京银行CD252	5,000,000	495,180,500.58	0.48
8	111785190	17河北银行CD085	5,000,000	489,469,723.69	0.47
9	111785380	17九江银行CD153	5,000,000	489,341,301.21	0.47
10	111785344	17广州农村商业银行CD167	5,000,000	483,861,074.46	0.47

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	0.0837%
报告期内偏离度的最低值	0.0364%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0614%

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	142274	花呗10A1	1,100,000.00	110,000,000.00	0.11
2	146421	借呗31A1	1,000,000.00	100,000,000.00	0.10
2	116418	万科3A1	1,000,000.00	100,000,000.00	0.10
3	1789219	17惠益2A1	800,000.00	79,970,131.66	0.08
4	1789045	17上和1A1	1,000,000.00	35,870,000.00	0.03
5	1789164	17惠益1A1	500,000.00	28,590,571.00	0.03

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	628,462,976.36
4	应收申购款	57,144,917.63
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	685,607,893.99

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	72,490,711,499.06
报告期期间基金总申购份额	240,487,762,316.21
报告期期间基金总赎回份额	209,789,669,846.61
报告期期末基金份额总额	103,188,803,968.66

§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日增利货币市场基金设立的文件

(2)平安大华日增利货币市场基金基金合同

(3)平安大华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)报告期内平安大华日增利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

平安大华睿享文娱灵活配置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:广发证券股份有限公司
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。

基金托管人广发证券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	平安大华睿享文娱混合	
场内简称	–	
交易代码	002450	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年3月29日	
报告期末基金份额总额	39,517,365.87份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金通过股票与债券等资产的合理配置,重点投资与文体娱乐主题相关的优质证券,力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取“灵活资产配置、主动投资管理”的投资策略,一方面通过大类资产配置,降低系统性风险,把握市场波动中的投资机会;另一方面利用平安大华研究平台优势,重点研究、投资与文体娱乐主题相关的证券资产,构建在中长期能修入经济转型、产业升级中受益的投资组合。	
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,属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
基金保证人	–	
下属分级基金的基金简称	平安大华睿享文娱混合A	平安大华睿享文娱混合C
下属分级基金的场内简称	–	–
下属分级基金的交易代码	002450	002451
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	4,557,788.32份	34,959,577.55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(2017年7月1日 – 2017年9月30日)	
	平安大华睿享文娱混合A	平安大华睿享文娱混合C
1. 本期已实现收益	404,987.26	2,704,786.64
2. 本期利润	366,973.87	2,478,433.81
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0638	0.0625
4. 期末基金资产净值	4,933,238.68	37,297,548.32
5. 期末基金份额净值	1.082	1.067

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

平安大华睿享文娱混合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	6.60%	0.69%	2.64%	0.29%	3.96%	0.40%

平安大华睿享文娱混合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	6.59%	0.69%	2.64%	0.29%	3.95%	0.40%

沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收