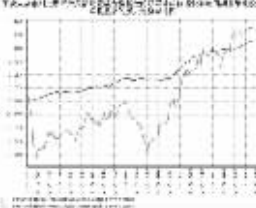


## 平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金

### 2017年第三季度报告

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2016年12月7日正式生效，截至报告期末未滿一年；

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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
WANG AO	基金经理	2016年12月7日	-	5	WANG AO先生，CFA，PJM，CMA，澳大利亚悉尼大学工商管理硕士，曾任澳大利亚普华永道会计师事务所高级经理，2012年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2013年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2014年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2015年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2016年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2017年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理。

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》及其他各项实施规则、《平安大华鑫利定期开放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。

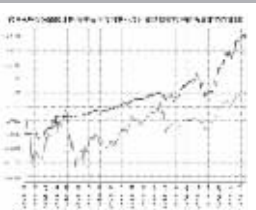
4.3 公平交易专项说明

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。

## 平安大华鑫享混合型证券投资基金

### 2017年第三季度报告



1、本基金基金合同于2015年7月20日正式生效，截至报告期末未滿两年；

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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
WANG AO	基金经理	2015年6月11日	-	5	WANG AO先生，CFA，PJM，CMA，澳大利亚悉尼大学工商管理硕士，曾任澳大利亚普华永道会计师事务所高级经理，2012年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2013年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2014年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2015年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2016年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2017年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理。

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》及其他各项实施规则、《平安大华鑫享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。

## 平安大华行业先锋混合型证券投资基金

### 2017年第三季度报告

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9月20日正式生效，截至报告期末已滿六年；

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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨皓	基金经理	2016年6月18日	-	8	中山大华资产管理有限公司董事，曾任中山大华资产管理有限公司董事，2016年6月加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2017年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2018年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2019年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理，2020年加入平安大华资产管理（香港）有限公司，担任资产管理部副经理。

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》及其他各项实施规则、《平安大华行业先锋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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

三季度是A股市场风格转换较快的一个季度，从季度初期开始，在

今年上半年一直延续的白马股和消费股的行情暂时休整，而以钢铁、有色为代表的周期股行情开始展开，但是周期股行情几经波折，上涨和回调幅度都比较大，操作难度加大。7月份投资组合重仓还是以白马消费为主，也较早参与了部分周期品标的行情，但整体上看调仓速度太慢，不够灵活，7月份的周期板块大行情并没有带来很好的超额收益。

进入8、9月份周期板块出现调整，导致净值出现回调，同时新能源车、5G、智能芯片等新兴成长板块表现活跃，板块轮动明显加快。组合的配置依然以白马股和周期股配置为主，并没有很好的抓住新兴板块的投资机会，组合净值也未能获得很好的超额收益。

4.5 报告期内基金的投资业绩说明

截至2017年9月30日，本基金份额净值为1.132元，份额累计净值为1.412元。报告期内，本基金份额净值增长率为0.35%，同期业绩基准增长率为0.402%。

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）	占基金总资产比例（%）
1	权益投资	239,267,942.46	79.18
2	其中：股票	239,267,942.46	79.18
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	-	-
5	其中：债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	买入返售金融资产	26,000,000.00	8.60
10	其他资产	31,410,698.39	10.80
11	其他资产	5,488,822.68	1.82
12	合计	296,267,942.46	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	行业名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,351,423.00	4.28
B	采矿业	39,760.00	0.01
C	制造业	166,463,871.00	64.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,090,644.00	11.94
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	10,666,060.70	3.72
G	信息传输、软件和信息技术服务业	10,728,124.91	3.79
H	金融业	4,576,420.00	1.69
I	房地产业	7,041,992.00	2.46
J	租赁和商务服务业	27,590,672.00	10.22
K	批发和零售业	61,000.00	0.02
L	科学研究和技术服务业	313,822.77	0.11
M	卫生和社会工作	124,260.00	0.04
N	文化、体育和娱乐业	116,260.00	0.04
O	教育	12,770.00	0.00
P	合计	239,267,942.46	82.39

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组合明细

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	111719105	17上银转债	300,000	29,697,000.00	14.44
2	111719176	17南钢转债	200,000	19,524,000.00	9.61
3	111712016	17龙净转债	200,000	19,272,000.00	9.43
4	111681046	16华润转债	200,000	19,288,000.00	9.39
5	111713042	17招商转债	200,000	19,096,000.00	9.29

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

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持仓。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

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

报告期内本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中，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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,449,562.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,449,562.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	121002	12国债02	2,070,000.00	0.88

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中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

项目	平安大华鑫享混合A	平安大华鑫享混合C
报告期末基金份额总额	41,391,289.71	214,099,944.25
减：报告期基金总申购份额	270,522.00	111,662.03
减：报告期基金总赎回份额	18,349,331.19	32,628,246.28
报告期末基金份额总额	23,312,480.52	181,409,765.27

§ 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

项目	基金管理人	基金管理人
报告期末持有本基金份额	9,999,000.00	-
报告期末持有本基金份额	9,999,000.00	-
报告期末持有本基金份额	9,999,000.00	-
报告期末持有本基金份额	9,999,000.00	-

§ 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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.1 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.2 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.3 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.4 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.5 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.6 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.7 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.8 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.9 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.10 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.11 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.12 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.13 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.14 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.15 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.16 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.17 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.18 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.19 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.20 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.21 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.22 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.23 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.24 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.25 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.26 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.27 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.28 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.29 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.30 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.31 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.32 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.33 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.34 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.35 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.36 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.37 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.38 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.39 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.40 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.41 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.42 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.43 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.44 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.45 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.46 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.47 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.48 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.49 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.50 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.51 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.52 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.53 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.54 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.55 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.56 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.57 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.58 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.59 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.60 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.61 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.62 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.63 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.64 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.65 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.66 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.67 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.68 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.69 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.70 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.71 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.72 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.73 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.74 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.75 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.76 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.77 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.78 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.79 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.80 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.81 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.82 影响投资者决策的其他重要信息

8.2.83 影响投资者决策的其他重要信息

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

项目	平安大华鑫利混合A	平安大华鑫利混合C
报告期末基金份额总额	200,048,118.64	-
减：报告期基金总申购份额	-	-
减：报告期基金总赎回份额	-	-
报告期末基金份额总额	200,048,118.64	-

§ 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

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。

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.1 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.2 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.3 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.4 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.5 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.6 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.7 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.9 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.10 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.11 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.12 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.13 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.14 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.15 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.16 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.17 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.18 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.19 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.20 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.21 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.22 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.23 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.24 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.25 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.26 影响投资者决策的其他重要信息

8.1.27 影响投资者决策的其他重要信息