

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。

本基金持有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。

基金持有人平安银行股份有限公司承诺以诚实信用、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。

本基金持有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。

基金管理人对本报告的财务数据、净值表现和投资组合报告无异议。

本报告期财务数据未经审计。

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	平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金
场内简称	-
交易代码	000626
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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
报告期末基金份额总额	200,040,116.0份
投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过资产配置，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将根据宏观经济形势、资金面情况、股票市场的估值水平、行业景气度、个股的基本面情况、债券市场的收益率水平、资金面情况、利率走势、信用利差等多方面分析，从宏观到微观，综合考虑，精选出具有投资价值的股票和债券品种，进行资产配置。本基金将通过资产配置，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金，低于股票型基金。
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

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	1,947,324.03	
2.本期利润	1,501,299.61	
3.加权平均基金份额本期利润	0.00097	
4.期末基金份额净值	200,407,472.04	
5.期末基金份额净值	1.0000	

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。

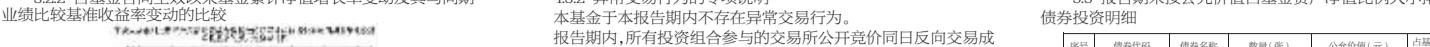
3.基金净值表现

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(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)
过去一个月	0.05%	0.02%	1.8%	0.17%

*业绩比较基准:中证综合债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%

3.2.2 本基金自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



3.2.2 本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

3.3 其他指标

本基金报告期无其他指标。

§ 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年限	证券从业年限	说明
WANG AO	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经理	2016年12月7日	-	

1.对本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 管理人对报告期内基金运作遵守法律法规情况的说明

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。本基金报告期内,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

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引》和公司制定的公平交易相关制度。

4.4 报告期内基金的投资组合报告

本基金报告期未完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

4.5 报告期内按行业分类的境内股票投资组合

本基金报告期未持有股票。

4.6 报告期内按行业分类的港股通股票投资组合

本基金报告期未持有港股通股票。

4.7 报告期内按行业分类的其他证券投资组合

本基金报告期未持有其他证券投资。

4.8 报告期末按行业分类的境内债券投资组合

本基金报告期未持有债券。

4.9 报告期末按品种分类的债券投资组合

本基金报告期未持有债券。

4.10 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

本基金报告期未持有贵金属。

4.11 报告期末按行业分类的衍生品投资组合

本基金报告期未持有衍生品。

4.12 报告期末按融资质押等用途的股票投资组合

本基金报告期未持有融资质押等用途的股票。

4.13 报告期末按债券品种的债券投资组合

本基金报告期未持有债券。

4.14 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债券投资

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资。

4.15 报告期末按资产支持证券投资品种的资产支持证券投资组合

本基金报告期未持有资产支持证券投资。

4.16 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

本基金报告期未持有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。

4.17 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贵金属投资

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资。

4.18 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保险及理财计划投资

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及理财计划投资。

4.19 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买入返售金融资产

本基金报告期未持有买入返售金融资产。

4.20 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应收款项

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名应收款项。

4.21 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卖出回购金融资产

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名卖出回购金融资产。

4.22 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其他资产

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他资产。

4.23 公平交易专项说明

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引》和公司制定的公平交易相关制度。

4.24 管理人对报告期内基金运作遵守法律法规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行了《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。本基金报告期内,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。

4.25 管理人对基金的投资组合报告的说明

本基金报告期未完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

4.26 报告期内基金的投资组合报告

本基金报告期未完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

4.27 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金报告期未持有股票。

4.28 报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

本基金报告期未持有港股通股票。

4.29 报告期末按行业分类的其他证券投资组合

本基金报告期未持有其他证券投资。

4.30 报告期末按品种分类的债券投资组合

本基金报告期未持有债券。

4.31 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

本基金报告期未持有贵金属。

4.32 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债券投资

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资。

4.33 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

本基金报告期未持有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。

4.34 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买入返售金融资产

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名买入返售金融资产。

4.35 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应收款项

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名应收款项。

4.36 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卖出回购金融资产

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名卖出回购金融资产。

4.37 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其他资产

本基金报告期未持有公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他资产。

4.38 公平交易专项说明

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引》和公司制定的公平交易相关制度。

4.39 管理人对报告期内基金运作遵守法律法规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行了《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。本基金报告期内,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。

4.40 管理人对基金的投资组合报告的说明

本基金报告期未完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

4.41 公平交易专项说明

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引》和公司制定的公平交易相关制度。

4.42 管理人对报告期内基金运作遵守法律法规情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格执行了