平安大华智慧中国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	平安大华智慧中国混合
场内简称	–
交易代码	001297
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	2015年6月9日
报告期末基金份额总额	1,096,829,077.26份
投资目标	本基金致力于发掘中国经济转型和产业升级中新技术或新模式带来的投资机会。通过重点投资与高端装备制造、工业4.0、互联网主题相关的优质证券,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	从我国宏观层面(经济转型、区域经济增长、通货膨胀和利率的周期)出发,依照工业增加值与CPI的变动划分经济周期的不同阶段(复苏、扩张、滞涨、萧条),依照产业的生命周期把产业分为概念、导入、萌芽、成长、繁荣、衰退六个阶段。同时将行业非系统风险均值与其分布的ATR系数结合运用,全面准确地判断大类资产风险程度和收益前景。统筹考量短、中、长期资产配置比例。股票投资在投资时钟与产业生命周期策略基础上秉持自上而下与自下而上相结合的选股理念。精选有成长潜力的优质股票构建投资组合。债券投资以目标久期管理和品种选择策略为主,以收益率利差策略、债券置换策略为辅,构造能获取稳定收益的固定收益类投资品种组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型,属于中高风险收益水平的基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、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

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	26,298,741.64
2.本期利润	18,427,223.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0162
4.期末基金资产净值	619,786,405.83
5.期末基金份额净值	0.565

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。

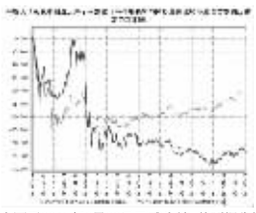
3.2 基金净值表现

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	2.91%	1.12%	3.84%	0.47%	-0.93%	0.65%

业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

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2015年6月09日正式生效,截至报告期末已满两年;

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		
神爱前	平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016年8月2日	–	8	厦门大学财政学硕士,8年证券从业经验,曾任第一创业证券研究所行业研究员、民生证券研究所高级研究员、第一创业证券资产管理部高级研究员,2014年12月加入平安大华基金管理公司,任投资研究部高级研究员,现任平安大华策略先锋混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智能生活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、《平安大华智慧中国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

三季度A股温和上涨,煤炭、钢铁等周期性行业表现活跃,涨幅较大,而以创业板为代表的中小盘公司在三季度先抑后扬,有所反弹,但由于市场环境发生深刻变化,中小盘公司整体估值依然偏高,难有整体性、系统性行情。本基金在三季度减仓了部分涨幅较高的消费白马股,加仓了锂电池、造纸、钢铁、资源等板块,取得了一定收益,但在周期性行业兑现收益不及时,影响了收益水平,三季度未能取得明显的超额收益。

展望后市,本基金认为经济温和波动,为市场提供稳定的经济环境,而流动性紧中趋缓,对市场影响减弱。中小创公司自2015年中以来持续下跌,市场整体估值压力得到缓解,而四季度临近2018年,估值切换至2018年,估值压力将进一步释放。因此我们认为,四季度可能仍将维持温和震荡上涨的格局,龙头白马股为代表的大盘价值股估值仍有修复空间,而中小创内部分化,部分估值已经合理、内生增长好的成长公司预计将会率先走出上升趋势。四季度本基金将重点布局大消费板块、低估值金融板块、农业板块、环保生态板块等投资机会,同时关注新能源产业链、苹果电子产业链、通信板块等成长性行业逢低建仓的机会。

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0.565元,份额累计净值为0.565元。报告期内,本基金份额净值增长率为2.91%,同期业绩基准增长率为3.84%。

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	568,175,090.73	89.93
	其中:股票	568,175,090.73	89.93
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	–	–
	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	47,308,054.19	7.49
8	其他资产	16,288,739.74	2.58
9	合计	631,771,884.66	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	29,415,542.00	4.75
B	采矿业	40,715.60	0.01
C	制造业	412,558,854.75	66.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	28,522.05	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	18,607,449.91	3.00
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,296,157.29	6.02
J	金融业	57,593,380.20	9.29
K	房地产业	12,444,075.00	2.01
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	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	–	–
	合计	568,175,090.73	91.67

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	600388	龙净环保	1,818,000	30,760,560.00	4.96
2	601939	建设银行	4,282,800	29,851,116.00	4.82
3	002341	新纶科技	1,246,156	29,795,589.96	4.81
4	000998	隆平高科	1,131,367	29,415,542.00	4.75
5	300317	珈伟股份	1,505,324	28,872,114.32	4.66
6	600176	中国巨石	2,507,868	28,740,167.28	4.64
7	000725	京东方A	6,455,700	28,405,080.00	4.58
8	002202	金风科技	2,150,218	28,081,847.08	4.53
9	000488	晨鸣纸业	1,419,957	27,845,356.77	4.49
10	601601	中国太保	751,200	27,741,816.00	4.48

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资情况。

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

本基金本报告期末无债券投资情况。

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情况。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末无权证投资情况。

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情况。

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情况。

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	2,404,641.81
2	应收证券清算款	13,845,737.97
3	应收股利	–
4	应收利息	13,905.00
5	应收申购款	24,454.96
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	16,288,739.74

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	002341	新纶科技	29,795,589.96	4.81	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

报告期期初基金份额总额	1,179,171,747.71
报告期期间基金总申购份额	3,699,116.76
减:报告期期间基金总赎回份额	86,041,787.21
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	1,096,829,077.26

§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智慧中国灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华智慧中国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)报告期内平安大华智慧中国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

平安大华智能生活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: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	平安大华智能生活混合
场内简称	–
交易代码	002598
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月8日
报告期末基金份额总额	54,067,415.34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,重点投资与智能生活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、投资与智能生活主题相关的证券资产,构建在中长期能够从经济转型、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×60%+中证综合债指数收益率×40%
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	中国建设银行股份有限公司
基金保证金	–
下属分级基金的基金简称	平安大华智能生活混合A / 平安大华智能生活混合C
下属分级基金的场内简称	– / –
下属分级基金的交易代码	002598 / 002599
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	42,036,498.37份 / 12,030,916.97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)	
	平安大华智能生活混合A	平安大华智能生活混合C
1. 本期已实现收益	1,317,629.46	249,257.51
2. 本期利润	757,862.90	316,965.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0166	0.0282
4. 期末基金资产净值	38,436,238.81	10,887,863.28
5. 期末基金份额净值	0.914	0.905

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

平安大华智能生活混合A

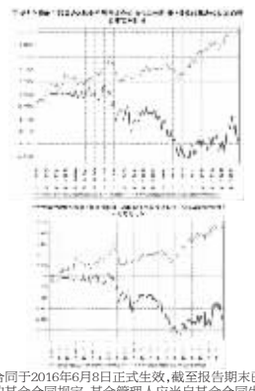
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.67%	1.09%	3.04%	0.35%	-1.37%	0.74%

平安大华智能生活混合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	2.03%	1.09%	3.04%	0.35%	-1.01%	0.74%

业绩比较基准:沪深300指数收益率*60%+中证综合债指数收益率*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2016年6月8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	平安大华智能生活灵活配置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6月8日	2017年7月4日	16	孙健先生,基金经理,硕士,1976年生。曾任摩根士丹利证券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,银华货币市场证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金基金经理。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。
神爱前	平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016年7月25日	–	8	厦门大学财政学硕士,8年证券从业经验,曾任第一创业证券研究所行业研究员、民生证券研究所高级研究员、第一创业证券资产管理部高级研究员,2014年12月加入平安大华基金管理公司,任投资研究部高级研究员,现任平安大华策略先锋混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
傅浩	平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017年3月29日	–	8	中山大学金融学硕士,8年证券从业经验,曾任国都证券有限责任公司行业研究员、广发证券资产管理(广东)有限公司投资经理,2016年5月加入平安大华基金管理公司,任投资研究部投资经理,现任平安大华行业先锋混合型证券投资基金、平安大华智能生活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、《平安大华智能生活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

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,上涨和调整幅度都比较大,操作难度加大。7月份组合配置底仓还是以白马消费股为主,也较早参与了部分周期品种的行情,但整体上看调仓速度太慢,不够坚决,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,导致净值出现回撤,同时新能源汽车、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 报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金A份额净值为0.914元,份额累计净值为0.914元。报告期内,本基金份额净值增长率为1.67%,同期业绩基准增长率为3.04%。本基金C份额净值为0.905元,份额累计净值为0.905元。报告期内,本基金份额净值增长率为2.03%,同期业绩基准增长率为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	44,976,837.23	86.02
	其中:股票	44,976,837.23	86.02
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	–	–
	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	4,503,205.96	8.61
8	其他资产	2,805,978.49	5.37
9	合计	52,286,021.68	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	7,565.00	0.02
B	采矿业	1,757,665.64	3.56
C	制造业	35,678,482.59	72.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	105,706.00	0.21
E	建筑业	156,247.00	0.32
F	批发和零售业	93,833.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	119,604.00	0.24
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	663,874.00	1.35
J	金融业	3,625,678.00	7.35
K	房地产业	2,631,089.00	5.33
L	租赁和商务服务业	41,317.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	36,311.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	10,206.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	36,137.00	0.07
S	综合	13,122.00	0.03
	合计	44,976,837.23	91.19

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	600309	万华化学	51,100	2,153,865.00	4.37
2	600581	八一钢铁	144,900	2,114,091.00	4.29
3	002009	天奇股份	127,500	2,020,875.00	4.10
4	000423	东阿阿胶	30,300	1,967,379.00	3.99
5	600963	岳阳林纸	211,400	1,879,346.00	3.81
6	000858	五粮液	28,400	1,626,752.00	3.30
7	600745	闻泰科技	59,900	1,620,894.00	3.29
8	000651	格力电器	41,900	1,588,010.00	3.22
9	601601	中国太保	41,100	1,517,823.00	3.08
10	600622	嘉宝集团	76,000	1,503,280.00	3.05

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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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情况。

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情况。

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	98,907.53
2	应收证券清算款	2,705,779.40
3	应收股利	–
4	应收利息	1,193.04
5	应收申购款	98.52
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,805,978.49

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	600581	八一钢铁	2,114,091.00	4.29	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	平安大华智能生活混合A	平安大华智能生活混合C
报告期期初基金份额总额	48,695,040.70	520,450.61
报告期期间基金总申购份额	393,989.25	23,010,159.24
减:报告期期间基金总赎回份额	7,052,519.58	11,499,692.88
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	42,036,498.37	12,030,916.97

§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智能生活混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华智能生活混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华智能生活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)报告期内平安大华智能生活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

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

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	平安大华中证沪港深高股息
场内简称	–
交易代码	003702
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	2017年1月25日
报告期末基金份额总额	24,268,298.25份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证沪港深高股息精选指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的市场市值权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理原则内进行适当的处理和调整,力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证沪港深高股息精选指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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	75,410.80
2.本期利润	552,593.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.0214
4.期末