平安大华安享保本混合型证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

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7月20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7月18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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华安享保本混合
场内简称	-
交易代码	002282
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2月3日
报告期末基金份额总额	471,167,583.98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	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4月1日 - 2017年6月30日)
1.本期已实现收益	2,967,639.15
2.本期利润	4,601,555.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0058
4.期末基金资产净值	479,612,665.36
5.期末基金份额净值	1.018

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。

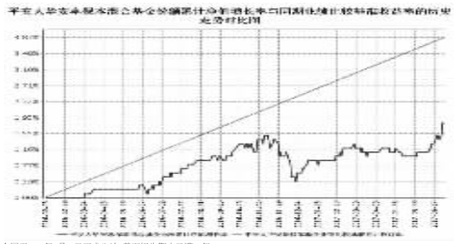
3.2 基金净值表现

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	0.69%	0.06%	0.66%	0.01%	0.03%	0.05%

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2月03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	平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理	2016年2月3日	-	16	孙健先生,基金经理,硕士,1975年生,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,银华货币市场证券投资基金、银华短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”、“平安大华惠盈混合型证券投资基金”基金经理。

1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日,“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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、《平安大华安享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

第二季度债券市场延续调整走势,本基金在市场调整中逐步增加信用债券投资,债券市场5月份收益率达到历史中高水平,短期银行存单和债券收益率具备较高投资价值,6月份央行提前续做MLF给市场宽松预期,银行行业百家报告截止时间延后3个月,都表明了缓解市场情绪的态度,前期发债收益率大幅上升至企业信贷成本以上,造成大量债券取消发行,影响实体融资,M2数据,理财数据都显著下行取得去杠杆阶段性成果,预计第三季度政策以稳定为主不会再加码,城投债券收益率回到2012年时期水平,部分中短期企业债具备配置价值,在目前短期利率仍旧不高的情况下,配置信用债券获取较高的票息收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日,本基金份额净值为1.018元,份额累计净值为1.018元,报告期内,本基金份额净值增长率为0.69%,同期业绩基准增长率为0.66%。

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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	5,574,145.00	1.14
	其中:股票	5,574,145.00	1.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	458,139,954.00	93.65
	其中:债券	447,429,954.00	91.46
	资产支持证券	10,710,000.00	2.19
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	19,888,491.42	4.07
8	其他资产	5,579,202.29	1.14
9	合计	489,181,792.71	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	4,729,150.00	0.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,260.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,688.00	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	820,608.00	0.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,439.00	0.00
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	5,574,145.00	1.16

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
合计	-	-

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	603228	景旺电子	50,000	2,412,500.00	0.50
2	601966	玲珑轮胎	70,000	1,570,100.00	0.33
3	600850	华东电脑	38,400	820,608.00	0.17
4	300476	胜宏科技	30,000	708,900.00	0.15
5	002185	华天科技	2,000	14,480.00	0.00
6	601233	桐昆股份	1,000	13,860.00	0.00
7	600856	中天能源	1,000	11,260.00	0.00
8	002400	省广股份	1,300	10,439.00	0.00
9	002418	康盛股份	1,000	9,310.00	0.00
10	600120	浙江东方	100	2,688.00	0.00

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	29,520,000.00	6.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	88,460,000.00	18.44
	其中:政策性金融债	69,028,000.00	14.39
4	企业债券	38,546,000.00	8.04
5	企业短期融资券	120,331,000.00	25.09
6	中期票据	20,006,000.00	4.17
7	可转债(可交换债)	3,462,954.00	0.72
8	同业存单	147,104,000.00	30.67
9	其他	-	-
10	合计	447,429,954.00	93.29

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	111797611	17广州农村商业银行CD082	700,000	69,188,000.00	14.43
2	170201	17国开01	500,000	48,980,000.00	10.21
3	111794765	17广州农村商业银行CD065	500,000	48,885,000.00	10.19
4	041656021	16云投CP002	300,000	30,195,000.00	6.30
5	011763006	17晋控SCP003	300,000	30,042,000.00	6.26

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1689136	16企置1A	500,000	10,710,000.00	2.23

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。

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

宁波银行股份有限公司(以下简称“公司”)于近日收到“甬银监罚决字[2017]1号、4号”行政处罚决定书显示,宁波银行因存在关联交易管理不到位,票据同业业务未能持续实现同业专营制管理等违法行为,被宁波银监局责令改正,并处罚款350万元。

本基金管理人对该公司进行了深入的研究和分析,认为该处罚不对宁波银行的信用及还本付息能力造成影响;管理人投资宁波银行CD已经审慎评估过该行还本付息能力,银行CD属于央行备案发行的银行债务工具,目前处于较安全投资领域。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	57,133.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,522,068.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,579,202.29

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	128010	顺昌转债	3,462,954.00	0.72

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	002418	康盛股份	9,310.00	0.00	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

报告期初基金份额总额	861,419,248.76
报告期间基金总申购份额	98,623.61
减:报告期间基金总赎回份额	390,350,288.39
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	471,167,583.98

§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运用固有资金投资本基金。

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	20170401-20170626	300,006,000.00	0.00	300,006,000.00	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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

1.经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第四十一次会议通过,同意推荐李兆良先生、李娟娟女士、刘雪山先生、潘汉腾先生为公司第三届董事会独立非执行董事候选人;推荐姚波先生、陈敬达先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生为公司第三届董事会非执行董事;推荐罗春凤先生、肖宇鹏先生为公司第三届监事会执行监事,并同意提交股东会审议。

2.经平安大华基金管理有限公司第二届监事会第九次会议通过,同意推荐巢傲文先生、冯方女士为公司第三届监事会股东监事候选人,并同意提交股东会审议。

3.经平安大华基金管理有限公司2017年第三次股东会议通过,选举姚波先生、罗春凤先生、陈敬达先生、肖宇鹏先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生、李兆良先生、李娟娟女士、刘雪山先生、潘汉腾先生为第三届董事会董事。

4.经平安大华基金管理有限公司2017年第三次股东会议通过,选举巢傲文先生、冯方女士为第三届监事会监事。

§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享保本混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华安享保本混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华安享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享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、基金托管人住处

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7月20日

平安大华安心保本混合型证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

基金管理人:平安大华基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年7月20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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7月19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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华安心保本混合
场内简称	-
交易代码	002304
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1月15日
报告期末基金份额总额	944,927,701.48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	中国银行股份有限公司
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4月1日 - 2017年6月30日)
1.本期已实现收益	4,433,288.14
2.本期利润	6,917,049.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0066
4.期末基金资产净值	965,112,367.69
5.期末基金份额净值	1.021

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。

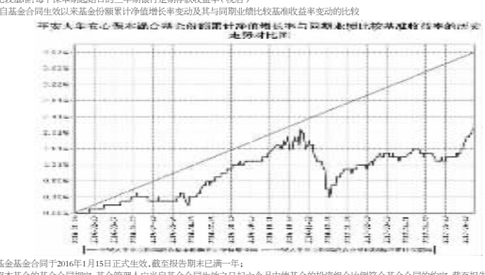
3.2 基金净值表现

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	0.69%	0.05%	0.66%	0.01%	0.03%	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1月15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经完成建仓。

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	平安大华安心保本混合型证券投资基金基金经理	2016年1月15日	-	16	孙健先生,基金经理,硕士,1975年生,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,银华货币市场证券投资基金、银华短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”、“平安大华惠盈混合型证券投资基金”基金经理。

1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日,“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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、《平安大华安心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

第二季度债券市场延续调整走势,本基金在市场调整中逐步增加信用债券投资,债券市场5月份收益率达到历史中高水平,短期银行存单和债券收益率具备较高投资价值,6月份央行提前续做MLF给市场宽松预期,银行行业百家报告截止时间延后3个月,都表明了缓解市场情绪的态度,前期发债收益率大幅上升至企业信贷成本以上,造成大量债券取消发行,影响实体融资,M2数据,理财数据都显著下行取得去杠杆阶段性成果,预计第三季度政策以稳定为主不会再加码,城投债券收益率回到2012年时期水平,部分中短期企业债具备配置价值,在目前短期利率仍旧不高的情况下,配置信用债券获取较高的票息收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日,本基金份额净值为1.021元,份额累计净值为1.021元,报告期内,本基金份额净值增长率为0.69%,同期业绩基准增长率为0.66%。

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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	4,371,978.00	0.37
	其中:股票	4,371,978.00	0.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,147,178,513.00	97.94
	其中:债券	1,136,468,513.00	97.03
	资产支持证券	10,710,000.00	0.91
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	1,224,185.83	0.10
8	其他资产	18,504,238.92	1.58
9	合计	1,171,278,915.75	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	26,260.00	0.00
C	制造业	3,267,790.00	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,260.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,688.00	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	1,053,541.00	0.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,439.00	0.00
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	4,371,978.00	0.45

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
合计	-	-

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	601966	玲珑轮胎	70,000	1,570,100.00	0.16
2	600850	华东电脑	49,300	1,053,541.00	0.11
3	603228	景旺电子	20,000	965,000.00	0.10
4	300476	胜宏科技	30,000	708,900.00	0.07
5	601069	西部黄金	1,000	26,260.00	0.00
6	002185	华天科技	2,000	14,480.00	0.00
7	600856	中天能源	1,000	11,260.00	0.00
8	002400	省广股份	1,300	10,439.00	0.00
9	002418	康盛股份	1,000	9,310.00	0.00
10	600120	浙江东方	100	2,688.00	0.00

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	49,350,000.00	5.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	58,906,000.00	6.10
	其中:政策性金融债	39,474,000.00	4.09
4	企业债券	188,158,060.00	19.50
5	企业短期融资券	260,206,000.00	26.96
6	中期票据	134,946,400.00	13.98
7	可转债(可交换债)	4,618,053.00	0.48
8	同业存单	440,284,000.00	45.62
9	其他	-	-
10	合计	1,136,468,513.00	117.76

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	111715193	17民生银行CD193	1,000,000	97,830,000.00	10.14
2	111716085	17上海银行CD085	800,000	79,152,000.00	8.20
3	111710302	17兴业银行CD302	800,000	78,264,000.00	8.11
4	111791650	17宁波银行CD028	700,000	67,739,000.00	7.02
5	101662008	16皖高MTN001	560,000	55,574,400.00	5.76

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1689136	16企置1A	500,000	10,710,000.00	1.11

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	90,735.63
2	应收证券清算款	6,475,608.83
3	应收股利	-
4	应收利息	11,937,894.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,504,238.92

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	128010	顺昌转债	4,618,053.00	0.48

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	601069	西部黄金	26,260.00	0.00	重大事项
2	002418	康盛股份	9,310.00	0.00	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

报告期初基金份额总额	1,127,369,527.34
报告期间基金总申购份额	63,798.87
减:报告期间基金总赎回份额	182,505,624.73
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	944,927,701.48

§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运用固有资金投资本基金。

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	20170401-20170630	581,000,000.00	0.00	0.00	581,000,000.00	39.69%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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

1.经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第四十一次会议通过,同意推荐李兆良先生、李娟娟女士、刘雪山先生、潘汉腾先生为公司第三届董事会独立非执行董事候选人;推荐姚波先生、陈敬达先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生为公司第三届董事会非执行董事;推荐罗春凤先生、肖宇鹏先生为公司第三届董事会执行董事,并同意提交股东会审议。

2.经平安大华基金管理有限公司第二届监事会第九次会议通过,同意推荐巢傲文先生、冯方女士为公司第三届监事会股东监事候选人,并同意提交股东会审议。

3.经平安大华基金管理有限公司2017年第三次股东会议通过,选举姚波先生、罗春凤先生、陈敬达先生、肖宇鹏先生、杨玉萍女士、叶杨诗明女士、张文杰先生、李兆良先生、李娟