

平安大华安盈保本混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018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:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月18日

1.1 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约定,于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者应当仔细阅读本报告全文并自行承担投资风险。
本报告自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

1.2 基金基本情况

| | |
|------------|---|
| 基金名称 | 平安大华安盈保本混合 |
| 场内简称 | — |
| 交易代码 | 000257 |
| 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 |
| 基金合同生效日 | 2014年4月21日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,196,695,678.92 |
| 投资目标 | 本基金以保本为投资目标,通过有效的组合管理,力争实现基金资产的稳定增长和本基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略,建立由股票、债券、货币市场工具、衍生品等组成的投资组合,在有效控制投资组合风险的前提下,追求基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 每个保本周期内的三年定期存款利率加上期间存款利息之和。 |
| 风险收益特征 | 本基金的风险收益特征为低风险。 |
| 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 |
| 基金管理人 | 平安大华基金管理有限公司 |
| 基金管理人 | 平安大华基金管理有限公司 |

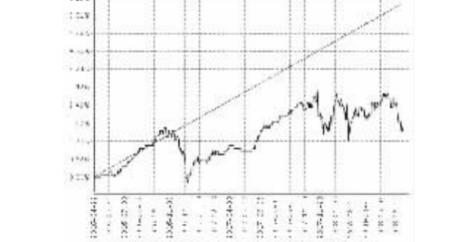
3.1 主要财务指标

| 主要财务指标 | 报告期(2018年4月1日—2018年6月30日) | 单位:人民币元 |
|----------------|---------------------------|---------|
| 1.本期净利润 | -13,692,825.48 | |
| 2.本期利润 | -4,866,420.20 | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0409 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,236,628,968.02 | |
| 报告期末基金份额净值 | 1.017 | |

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.本报告期末和上年度末均无以摊余成本计量的金融资产,且无在资产负债表日采用公允价值计量的金融资产。
3.基金净值增长率
4.2.主要财务指标和基金净值表现及其与同期银行存款利率的比较

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|----------|-----------|--------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.99% | 0.11% | 0.68% | 0.01% | -1.67% | 0.12% |

3.2 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.本基金合同于2014年4月21日正式生效,截至报告期末本基金运作正常。
2.按照本基金合同约定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起每个保本周期内的报告期末按照基金合同约定的,截至报告期末本基金已实现收益、基金净值增长率等各项数据予以披露并符合基金合同约定。
3.本基金本报告期无其他事项。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金基金经理的时间 | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------------------|-------------|--------|---|
| 高勇标 | 平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理 | 2018年11月21日 | 7 | 高勇标先生,中国政法大学法律硕士,曾任平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理,现任平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理。高勇标先生于2014年加入平安大华基金管理有限公司,历任平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理助理,平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理。高勇标先生于2014年加入平安大华基金管理有限公司,历任平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理助理,平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理。高勇标先生于2014年加入平安大华基金管理有限公司,历任平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理助理,平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理。 |
| 何晓斌 | 平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理 | 2018年5月17日 | 6 | 何晓斌先生,中国政法大学法律硕士,曾任平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理,现任平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理。何晓斌先生于2014年加入平安大华基金管理有限公司,历任平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理助理,平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理。何晓斌先生于2014年加入平安大华基金管理有限公司,历任平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理助理,平安大华安盈保本混合证券投资基金基金经理。 |

1.基金经理(或基金经理小组)简介
2.基金经理(或基金经理小组)简介
3.基金经理(或基金经理小组)简介

4.2 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.3 基金管理人职责

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|------|------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 279,720.40 | 0.02 |
| 2 | 固定收益 | — | — |
| 3 | 其他资产 | — | — |
| 4 | 负债 | — | — |
| 5 | 合计 | 279,720.40 | 0.02 |

4.4 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.5 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.6 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.7 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.8 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.9 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

平安大华保本混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018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:2018年7月18日

1.1 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约定,于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者应当仔细阅读本报告全文并自行承担投资风险。
本报告自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

1.2 基金基本情况

| | |
|------------|---|
| 基金名称 | 平安大华保本混合 |
| 场内简称 | — |
| 交易代码 | 300004 |
| 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 |
| 基金合同生效日 | 2012年9月11日 |
| 报告期末基金份额总额 | 235,042,268.53 |
| 投资目标 | 本基金以保本为投资目标,通过有效的组合管理,力争实现基金资产的稳定增长和本基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略,建立由股票、债券、货币市场工具、衍生品等组成的投资组合,在有效控制投资组合风险的前提下,追求基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 每个保本周期内的三年定期存款利率加上期间存款利息之和。 |
| 风险收益特征 | 本基金的风险收益特征为低风险。 |
| 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 |
| 基金管理人 | 平安大华基金管理有限公司 |
| 基金管理人 | 平安大华基金管理有限公司 |

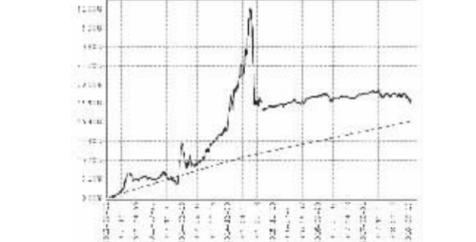
3.1 主要财务指标

| 主要财务指标 | 报告期(2018年4月1日—2018年6月30日) | 单位:人民币元 |
|----------------|---------------------------|---------|
| 1.本期净利润 | -4,138,407.66 | |
| 2.本期利润 | -60,900.00 | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0003 | |
| 报告期末基金份额总额 | 237,014,804.64 | |
| 报告期末基金份额净值 | 1.009 | |

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.本报告期末和上年度末均无以摊余成本计量的金融资产,且无在资产负债表日采用公允价值计量的金融资产。
3.基金净值增长率
4.2.主要财务指标和基金净值表现

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|----------|-----------|--------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.37% | 0.17% | 0.62% | 0.01% | -1.99% | 0.16% |

3.2 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.本基金合同于2012年9月11日正式生效,截至报告期末本基金运作正常。
2.按照本基金合同约定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起每个保本周期内的报告期末按照基金合同约定的,截至报告期末本基金已实现收益、基金净值增长率等各项数据予以披露并符合基金合同约定。
3.本基金本报告期无其他事项。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金基金经理的时间 | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--------------------|-------------|--------|---|
| 何晓斌 | 平安大华保本混合证券投资基金基金经理 | 2018年5月17日 | 6 | 何晓斌先生,中国政法大学法律硕士,曾任平安大华保本混合证券投资基金基金经理,现任平安大华保本混合证券投资基金基金经理。何晓斌先生于2014年加入平安大华基金管理有限公司,历任平安大华保本混合证券投资基金基金经理助理,平安大华保本混合证券投资基金基金经理。何晓斌先生于2014年加入平安大华基金管理有限公司,历任平安大华保本混合证券投资基金基金经理助理,平安大华保本混合证券投资基金基金经理。 |
| 何晓斌 | 平安大华保本混合证券投资基金基金经理 | 2018年2月8日 | 6 | 何晓斌先生,中国政法大学法律硕士,曾任平安大华保本混合证券投资基金基金经理,现任平安大华保本混合证券投资基金基金经理。何晓斌先生于2014年加入平安大华基金管理有限公司,历任平安大华保本混合证券投资基金基金经理助理,平安大华保本混合证券投资基金基金经理。何晓斌先生于2014年加入平安大华基金管理有限公司,历任平安大华保本混合证券投资基金基金经理助理,平安大华保本混合证券投资基金基金经理。 |

4.2 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.3 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.4 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.5 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.6 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.7 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.8 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

4.9 基金管理人职责

1.基金管理人职责
2.基金管理人职责
3.基金管理人职责

平安大华财富宝货币市场基金

2018 第二季度 报告

2018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:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月18日

1.1 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约定,于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者应当仔细阅读本报告全文并自行承担投资风险。
本报告自2014年4月1日起至2018年6月30日止。

1.2 基金基本情况

| | |
|------------|---|
| 基金名称 | 平安大华财富宝货币 |
| 场内简称 | — |
| 交易代码 | 000759 |
| 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 |
| 基金合同生效日 | 2014年4月21日 |
| 报告期末基金份额总额 | 43,966,521,178.47 |
| 投资目标 | 本基金以保本为投资目标,通过有效的组合管理,力争实现基金资产的稳定增长和本基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略,建立由股票、债券、货币市场工具、衍生品等组成的投资组合,在有效控制投资组合风险的前提下,追求基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 每个保本周期内的三年定期存款利率加上期间存款利息之和。 |
| 风险收益特征 | 本基金的风险收益特征为低风险。 |
| 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 |
| 基金管理人 | 平安大华基金管理有限公司 |
| 基金管理人 | 平安大华基金管理有限公司 |

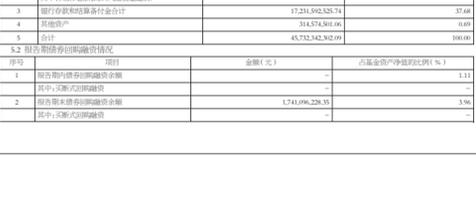
3.1 主要财务指标

| 主要财务指标 | 报告期(2018年4月1日—2018年6月30日) | 单位:人民币元 |
|----------------|---------------------------|---------|
| 1.本期净利润 | 426,251,191.91 | |
| 2.本期利润 | 426,251,191.91 | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0097 | |
| 报告期末基金份额总额 | 43,966,521,178.47 | |
| 报告期末基金份额净值 | 1.017 | |

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.本报告期末和上年度末均无以摊余成本计量的金融资产,且无在资产负债表日采用公允价值计量的金融资产。
3.基金净值增长率
4.2.主要财务指标和基金净值表现

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|-------|---------|----------|-----------|--------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.0017% | 0.0001% | 0.0133% | 0.0001% | 0.0014% | 0.0016% |

3.2 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.本基金合同于2014年4月21日正式生效,截至报告期末本基金运作正常。
2.按照本基金合同约定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起每个保本周期内的报告期末按照基金合同约定的,截至报告期末本基金已实现收益、基金净值增长率等各项数据予以披露并符合基金合同约定。
3.本基金本报告期无其他事项。

平安大华保本混合型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018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:2018年7月18日

1.1 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约定,于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者应当仔细阅读本报告全文并自行承担投资风险。
本报告自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

1.2 基金基本情况

| | |
|------------|---|
| 基金名称 | 平安大华保本混合 |
| 场内简称 | — |
| 交易代码 | 300004 |
| 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 |
| 基金合同生效日 | 2012年9月11日 |
| 报告期末基金份额总额 | 235,042,268.53 |
| 投资目标 | 本基金以保本为投资目标,通过有效的组合管理,力争实现基金资产的稳定增长和本基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下资产配置和自下而上精选个股相结合的投资策略,建立由股票、债券、货币市场工具、衍生品等组成的投资组合,在有效控制投资组合风险的前提下,追求基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 每个保本周期内的三年定期存款利率加上期间存款利息之和。 |
| 风险收益特征 | 本基金的风险收益特征为低风险。 |
| 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 |
| 基金管理人 | 平安大华基金管理有限公司 |
| 基金管理人 | 平安大华基金管理有限公司 |

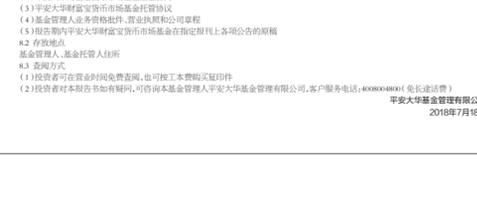
3.1 主要财务指标

| 主要财务指标 | 报告期(2018年4月1日—2018年6月30日) | 单位:人民币元 |
|----------------|---------------------------|---------|
| 1.本期净利润 | -4,138,407.66 | |
| 2.本期利润 | -60,900.00 | |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0003 | |
| 报告期末基金份额总额 | 237,014,804.64 | |
| 报告期末基金份额净值 | 1.009 | |

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.本报告期末和上年度末均无以摊余成本计量的金融资产,且无在资产负债表日采用公允价值计量的金融资产。
3.基金净值增长率
4.2.主要财务指标和基金净值表现

| 期间 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|----------|-----------|--------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.37% | 0.17% | 0.62% | 0.01% | -1.99% | 0.16% |

3.2 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.本基金合同于2012年9月11日正式生效,截至报告期末本基金运作正常。
2.按照本基金合同约定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起每个保本周期内的报告期末按照基金合同约定的,截至报告期末本基金已实现收益、基金净值增长率等各项数据予以披露并符合基金合同约定。
3.本基金本报告期无其他事项。