平安大华深证300指数增强型证券投资基金

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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月18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2018年7月17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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华深证300指数增强
场内简称	-
交易代码	700002
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	2011年12月20日
报告期末基金份额总额	42,908,040.13份
投资目标	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过指数复制的方法拟合、跟踪深证300指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理,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的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过全样本复制的方式拟合、跟踪深证300指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理,以有效降低基金运作成本并提高本基金的投资收益率。其中指数复制策略采用全样本复制的方式,即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合以拟合标的指数的业绩表现。股票增强策略在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上,辅以有限度的增强操作及一级市场股票投资,以求获取超越标的指数的收益率表现。
业绩比较基准	深证300指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,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。同时,本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
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

§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(2018年4月1日 — 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-3,763,718.54
2.本期利润	-9,413,466.97
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2284
4.期末基金资产净值	64,362,286.93
5.期末基金份额净值	1.500

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。

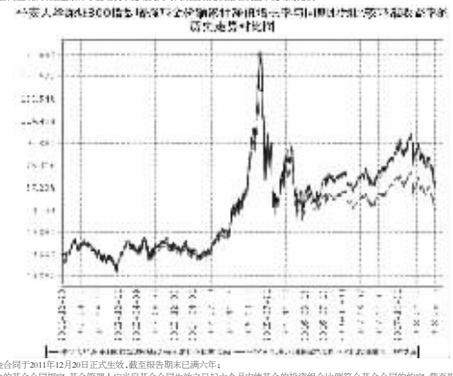
3.2 基金净值表现

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	-13.24%	1.30%	-12.74%	1.27%	-0.50%	0.03%

业绩比较基准:深证300指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%

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12月20日正式生效,截至报告期末已满六年;

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		
施旭	平安大华深证300指数增强型证券投资基金的基金经理	2016年5月19日	-	7	施旭先生,哥伦比亚大学金融数学硕士,曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券,于2015年加入平安大华基金,任衍生品投资中心量化研究员,现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金经理。
DANIEL DONGNING SUN	衍生品投资中心投资执行总经理、平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理	2017年9月5日	-	13	DANIEL DONGNING SUN,北京大学硕士,美国哥伦比亚大学博士,约翰霍普金斯大学博士后。先后担任瑞士再保险日普交易部量化分析师、花旗集团投资银行高级副总裁、瑞士银行投资银行交易量化总监、德意志银行战略科技部量化服务负责人,2014年10月加入平安大华基金管理有限公司,任衍生品投资中心投资执行总经理,现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金、平安大华沪深300指数量化增强证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票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聘任日期和解聘日期。

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、《平安大华深证300指数增强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

三季度货币政策维持稳健中性、流动性"合理充裕",央行启动了降准置换MLF,边际放松迹象可循。总体资金面宽松,仅在税期和季末MPA考核下,出现短期资金价格波动。6月份美联储加息后,央行并未跟随上调政策利率,市场做多情绪高涨,利率债收益率迅速下行。报告期内,本基金的投资操作仍以加强流动性管理为主要原则,在有效控制负偏离度的前提下,择时拉长组合剩余期限,适当调整回业存单和银行存款的配置比例,同时加强波段交易力度,提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为0.9797%,业绩比较基准收益率为0.3413%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内本出现连续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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	58,489,519.26	88.86
	其中:股票	58,489,519.26	88.86
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	7,250,404.29	11.01
8	其他资产	85,313.53	0.13
9	合计	65,825,237.08	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	707,040.48	1.10
B	采矿业	39,867.00	0.06
C	制造业	33,829,631.21	52.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	523,203.00	0.81
E	建筑业	1,357,977.00	2.11
F	批发和零售业	1,420,212.00	2.21
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	3,988,450.40	6.20
J	金融业	2,795,573.00	4.34
K	房地产业	3,119,647.00	4.85
L	租赁和商务服务业	200,970.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	897,862.00	1.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,220.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	2,440,331.56	3.79
S	综合	232,750.00	0.36
	合计	51,659,734.65	80.26

5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	4,902,560.61	7.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	651,270.00	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	438,666.00	0.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	658,892.00	1.02
K	房地产业	-	-
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	32,980.00	0.05
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	145,416.00	0.23
	合计	6,829,784.61	10.61

5.2.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	000651	格力电器	66,800	3,149,620.00	4.89
2	000333	美的集团	49,200	2,569,224.00	3.99
3	002415	海康威视	59,900	2,224,087.00	3.46
4	000725	京东方A	507,900	1,797,966.00	2.79
5	000002	万 科A	70,500	1,734,300.00	2.69
6	000568	泸州老窖	19,400	1,180,684.00	1.83
7	000776	广发证券	88,400	1,173,068.00	1.82
8	300003	乐普医疗	31,900	1,170,092.00	1.82
9	000963	华东医药	23,800	1,148,350.00	1.78
10	002142	宁波银行	66,700	1,086,543.00	1.69

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002518	科士达	72,600	723,822.00	1.12
2	601100	恒立液压	32,620	681,105.60	1.06
3	601633	长城汽车	69,000	677,580.00	1.05
4	600828	茂业商业	127,700	651,270.00	1.01
5	300618	寒锐钴业	4,500	577,530.00	0.90

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

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	4,987.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,128.00
5	应收申购款	79,198.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,313.53

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

单位:份

报告期期初基金份额总额	40,865,304.53
报告期期间基金申购份额	4,708,342.13
减:报告期期间基金总赎回份额	2,665,606.53
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	42,908,040.13

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	23.30

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,基金管理人不存在中购、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	20180401-20180630	9,999,000.00	-	-	9,999,000.00	23.30%
产品持有风险							
本报告期内,本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况。当该基金份额持有人连环大比例赎回时,可能引发巨额赎回,若发生巨额赎回而本基金没有变现能力时,存在一定的流动性风险;为应对巨额赎回而进行投资权的变现时,可能存在价位调整困难,甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理,但当基金出现巨额赎回并被全部确认时,申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险,未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。						
在极端情况下,当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致在其赎回巨额基金资产规模连续六个工作日低于5000万元,基金处可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

为维护基金持有人利益,提高产品的市场竞争力,根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,基金管理人平安大华基金管理有限公司经与本基金的基金托管人协商一致,决定自2018 年06月06 日至2018 年06月29 日以通讯方式召开本基金的份额持有人大会审议《关于平安大华深证300指数增强型证券投资基金转型相关事项的议案》,本次基金份额持有人大会由于出具有效表决票见的基金份额持有人及代理人所代表的基金份额未达到权益登记日本基金总份额的 50%以上,因此未达到《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金合同》关于"以通讯方式召开基金份额持有人大会"的有效开会条件。

§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深证300指数增强型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金合同

(3)平安大华深证300指数增强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)报告期内平安大华深证300指数增强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
2018年7月18日

平安大华睿享文娱灵活配置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:广发证券股份有限公司
报告送出日期:2018年7月18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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华睿享文娱混合	
场内简称	-	
交易代码	002450	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年3月29日	
报告期末基金份额总额	37,696,891.14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,重点投资与文体娱乐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、投资与文体娱乐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×50%+中证综合债指数收益率×50%	
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。	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安大华睿享文娱混合A	平安大华睿享文娱混合C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	002450	002451
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	10,202,044.29份	27,494,846.85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(2018年4月1日 — 2018年6月30日)	
	平安大华睿享文娱混合A	平安大华睿享文娱混合C
1. 本期已实现收益	72,912.25	98,778.06
2. 本期利润	-97,060.30	-447,822.90
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0092	-0.0163
4. 期末基金资产净值	11,830,046.19	31,283,028.84
5. 期末基金份额净值	1.160	1.138

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

平安大华睿享文娱混合A

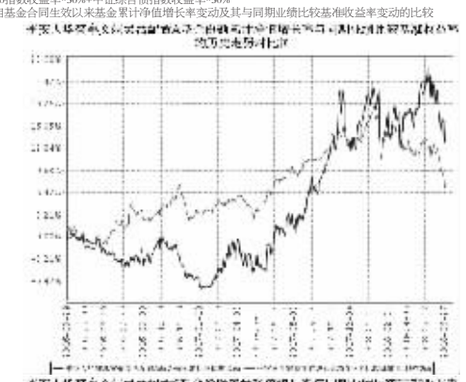
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.11%	0.99%	-4.07%	0.57%	2.96%	0.42%

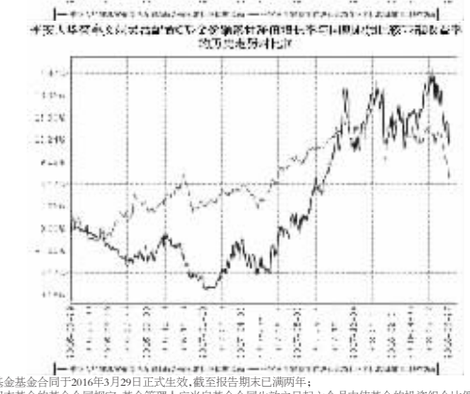
平安大华睿享文娱混合C

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	-1.22%	0.98%	-4.07%	0.57%	2.85%	0.41%

沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%

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3月29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		
黄维	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016年8月24日	-	7	黄维先生,北京大学微电子学硕士,7年证券从业经验,曾先后任广发证券股份有限公司研究员、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有限公司,现任平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎弘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聘任日期和解聘日期。

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、《平安大华睿享文娱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

本产品今年以来配置主线聚焦在成长性好以及盈利确定的板块,如信息文娱消费、医药、汽车和食品饮料等板块,标的以业绩白马为主,产品净值相对收益显著。展望后市,我们认为聚焦价值和盈利确定的格局不会改变,市场主线依然会是这些代表消费升级和制造升级的产业,我们将在此基础上,精选个股,聚焦行业龙头,在盈利驱动的市场结构中,成长确定的个股将大概率能带来良好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安大华睿享文娱灵活配置A基金份额净值为1.160元,本报告期基金份额净值增长率为-1.11%;截至本报告期末平安大华睿享文娱灵活配置C基金份额净值为1.138元,本报告期基金份额净值增长率为-1.22%;同期业绩比较基准收益率为-4.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万的情形。根据2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定,予以披露,且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

本基金本报告期内未出现连续20个工作日基金持有人数低于200人的情形。

§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	26,668,617.60	59.88
	其中:股票	26,668,617.60	59.88
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	15,611,459.14	35.05
8	其他资产	2,254,989.93	5.06
9	合计	44,535,066.67	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	22,220,487.60	51.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,238,291.00	5.19
G	交通运输、仓储和邮政业	410,552.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	1,799,287.00	4.17
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	26,668,617.60	61.86

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内无港股通投资股票。

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	600741	华域汽车	85,900	2,037,548.00	4.73
2	601799	星宇股份	31,500	1,886,535.00	4.38
3	002727	一心堂	49,500	1,606,275.00	3.73
4	603228	景旺电子	31,900	1,577,136.00	3.66
5	002236	海 利 得	290,000	1,447,100.00	3.36
6	600763	通策医疗	28,100	1,367,627.00	3.17
7	600660	福耀玻璃	53,000	1,362,630.00	3.16
8	300628	亿联网络	19,700	1,298,427.00	3.01
9	002304	洋河股份	9,400	1,237,040.00	2.87
10	600104	上汽集团	34,000	1,189,660.00	2.76

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。

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。

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

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	233,393.83
2	应收证券清算款	1,903,395.61
3	应收股利	-
4	应收利息	2,760.05
5	应收申购款	115,440.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,254,989.93

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

单位:份

项目	平安大华睿享文娱混合A	平安大华睿享文娱混合C
报告期期初基金份额总额	11,160,268.22	28,417,512.04
报告期期间基金总申购份额	788,333.17	12,680,098.15
减:报告期期间基金总赎回份额	1,746,557.10	13,602,763.34
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	10,202,044.29	27,494,846.85

§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,基金管理人不存在中购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华睿享文娱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)报告期内平安大华睿享文娱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

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

8.3 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
2018年7月18日

平安大华日增利货币市场基金

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 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2018年7月17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