平安大华安享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 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	273,980,239.03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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-4,419,250.74
2.本期利润	-1,753,597.97
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0060
4.期末基金资产净值	277,901,987.43
5.期末基金份额净值	1.014

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。

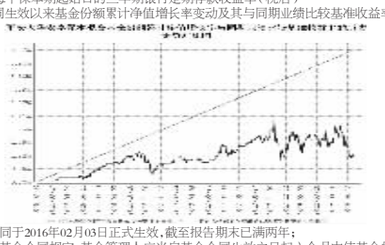
3.2 基金净值表现

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%	0.18%	0.65%	0.01%	-1.34%	0.17%

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02月03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		
张恒	平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理	2018年2月8日	-	6	张恒,西南财经大学硕士研究生,曾先后担任于华泰证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫基金、联储长城基金,2015年起在第一创业证券历任投资经理,高级投资经理,投资主办人,2017年11月加入平安大华基金管理有限公司,任固定收益投资部投资经理,现任"平安大华鑫荣混合型证券投资基金"、"平安大华鑫瑞债债券型证券投资基金"、"平安大华鑫益纯债债券型证券投资基金"、"平安大华合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金"、"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"、"平安大华鑫安纯债债券型证券投资基金"基金经理。
高勇标	平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理	2018年3月16日	-	7	高勇标先生,西南财经大学硕士研究生,曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理,深圳市选山财富管理有限公司投资管理部副总经理,胜大人寿保险有限公司固定收益投资经理,2017年4月加入平安大华基金管理有限公司,任投资研究部固定收益投资经理,现任平安大华鑫长盛混合型证券投资基金、平安大华鑫乐混合型证券投资基金、平安大华惠悦纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫瑞纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫泽纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫沣纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫享纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫益保本混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华鑫安纯债债券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 管理人对投资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

本基金交易所投资的证券品种,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。

本报告期内,本基金投资的证券品种,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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度宏观经济运行平稳,但社会融资余额增速低于预期;通胀水平维持较低水平,资金面保持相对宽松。政策方面,央行在4月份宣布降准并部分用于置换MLF,之后央行扩大MLF担保品范围,6月并未跟随美国加息,并且再次宣布定向降准;在此期间,中美贸易战持续发酵,市场避险情绪升温,利率债和高等级信用债收益率持续下行。而低等级信用债受金融强监管,债务违约等影响,信用利差反而不断扩大,基金净值表现相对平稳。

权益市场方面,二季度在金融去杠杆背景下,企业资金骤然收紧,信用风险上升,叠加中美贸易战,投资者风险偏好出现明显下降,市场也出现较大幅度下调。目前我国正处在经济转型的关键时期,只有依靠创新,提升经济的活力和效率,才能帮助我国经济实现顺利转型、保持平稳增长。因此,创新领域或将是股市在中长期内的投资主线。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.014元;本报告期基金份额净值增长率为-0.69%,业绩比较基准收益率为0.65%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	308,890,072.30	81.96
	其中:债券	288,890,072.30	76.65
	资产支持证券	20,000,000.00	5.31
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	52,321,926.69	13.88
8	其他资产	15,664,359.29	4.16
9	合计	376,876,358.28	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票 。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	35,848,800.00	12.90
	其中:政策性金融债	16,060,800.00	5.78
4	企业债券	64,234,272.30	23.11
5	企业短期融资券	70,283,000.00	25.29
6	中期票据	80,221,000.00	28.87
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	38,303,000.00	13.78
9	其他	-	-
10	合计	288,890,072.30	103.95

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	111771238	17宁波银行CD243	300,000	28,650,000.00	10.31
2	101456010	14云城投MTN001	200,000	20,318,000.00	7.31
3	1182338	11万王MTN2	200,000	20,258,000.00	7.28
4	011800410	18华安商业SCP003	200,000	20,118,000.00	7.24
5	011800037	18晋煤SCP001	200,000	20,110,000.00	7.24

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	149380	18兴06A1	200,000	20,000,000.00	7.20

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

2017年12月22日,根据上海交易所《关于对方正科技集团股份有限公司、控股股东北大方正集团有限公司及其一致行动人和有关责任人予以纪律处分的决定》,方正集团、武汉国兴未披露一致行动人关系,该行为严重违反了《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第2号-年度报告的内容与格(2016年修订)式》第四十条、第四十六条和《上海证券交易所股票上市规则》第1.4条、第2.1条、第2.3条、第2.5条、第2.7条、第2.22条、第10.2.5条等有关规定。对方正科技集团股份有限公司、控股股东北大方正集团有限公司及其一致行动人武汉国兴科技发展有限公司、方正集团有限公司主要负责人李友、方正科技集团股份有限公司时任董事长方中华、易梅予以公开谴责;对历任董事会秘书、副总裁、董事、总裁侯郁波,时任财务总监兼董事李晓勤,时任董事兼北大方正集团有限公司财务部副总裁余文彬、干新国,时任董事长刘欲晓,时任总裁朱兆庆,时任副总经理胡永柱、贾朝心,时任副总裁黄肖锋,时任独立董事傅林生、何明珂、王善迈、董黎明,时任监事邱泽珺、蒋艳华予以通报批评。

本基金管理人认为,该事项对公司的生产经营不会造成重大不利影响,我们对该证券的投资严格执行了内部投资决策流程,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

本基金本报告期末未投资股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	63,882.71
2	应收证券清算款	10,100,589.90
3	应收股利	-
4	应收利息	5,499,886.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,664,359.29

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	313,474,419.67
报告期期间基金总申购份额	56,729.86
减:报告期期间基金总赎回份额	39,550,910.50
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	273,980,239.03

§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 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

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

平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	平安大华量化精选混合
场内简称	-
交易代码	005486
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月1日
报告期末基金份额总额	225,109,755.07份
投资目标	在严格控制风险的基础上,本基金通过量化模型进行资产配置、精选股票,力求在有效分散风险的同时实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在投资过程中主要运用量化投资策略进行投资管理,减少人为主观情绪及个人判断的失误概率,使投资过程富于纪律性和规范性,力争获取超越市场比较基准的投资收益。本基金的投资策略主要包括两部分:一是,采取数量化方法,运用行业轮动投资时钟的资产配置策略,确定资产配置的具体比例;二是,在股票投资过程中,本基金将保持通过模型选股构建股票投资组合的投资策略,强调投资纪律,降低随意性投资带来的风险,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*70%+中证综合债指数收益率*30%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及预期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	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	平安大华量化精选混合A	平安大华量化精选混合C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	005486	005487
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	117,106,722.84份	108,003,032.23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)	
	平安大华量化精选混合A	平安大华量化精选混合C
1.本期已实现收益	-2,285,235.46	-2,342,923.20
2.本期利润	-4,568,327.14	-4,388,846.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0380	-0.0396
4.期末基金资产净值	107,689,870.22	98,982,390.68
5.期末基金份额净值	0.9196	0.9165

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

平安大华量化精选混合A

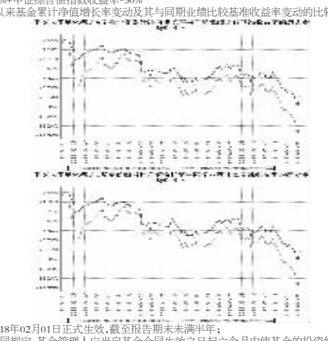
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.00%	0.60%	-6.44%	0.79%	2.44%	-0.19%

平安大华量化精选混合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	-4.20%	0.60%	-6.44%	0.79%	2.24%	-0.19%

沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%

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2018年02月01日正式生效,截至报告期末未满半年;

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未完成建仓。

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		
施旭	平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金的基金经理	2018年2月1日	-	7	施旭先生,哥伦比亚大学金融数学硕士,曾任职于西斯证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc.,国信证券,于2015年加入平安大华基金,任红利总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、平安大华鑫宁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指数型证券投资基金、平安大华恒益精选沪港深投资型证券投资基金、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 管理人对投资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、《平安大华量化精选混合型发起式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《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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾二季度,受国内去杠杆和对美贸易战不断发酵的影响,市场风险偏好下降,对下半年国内经济形势也持谨慎态度,各指数均出现较大幅震荡和下跌,估值回落,一定程度超出市场预期。二季度,出于对各风险的担忧,为应对市场波动加大以及市场对上市公司业绩的考验,本基金在控制总体仓位的前提下,收紧组合行业和风格暴露,继续以量化多因子选股模型为框架,精选精选防御性个股为主要配置策略,争取超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安大华量化精选A基金份额净值为0.9196元,本报告期基金份额净值增长率为-4.00%;截至本报告期末平安大华量化精选C基金份额净值为0.9165元,本报告期基金份额净值增长率为-4.20%;同期业绩比较基准收益率为-6.44%。

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	102,760,819.24	48.41
	其中:股票	102,760,819.24	48.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,570,300.00	8.75
	其中:债券	18,570,300.00	8.75
	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	68,000,000.00	32.03
	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	22,733,551.52	10.71
8	其他资产	206,836.32	0.10
9	合计	212,271,507.08	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	-	-
B	采矿业	4,643,586.00	2.25
C	制造业	48,037,135.94	23.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,015,173.85	1.46
E	建筑业	2,697,760.00	1.31
F	批发和零售业	4,687,279.00	2.27
G	交通运输、仓储和邮政业	3,515,889.60	1.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,518,972.00	0.73
J	金融业	26,249,468.00	12.70
K	房地产业	4,199,835.00	2.03
L	租赁和商务服务业	591,426.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,192,967.71	1.06
R	文化、体育和娱乐业	1,330,100.00	0.64
S	综合	-	-
	合计	102,760,819.24	49.72

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	600519	贵州茅台	5,910	4,322,928.60	2.09
2	000651	格力电器	77,900	3,672,985.00	1.78
3	000338	潍柴动力	345,000	3,018,750.00	1.46
4	600018	上港集团	452,760	2,698,449.60	1.31
5	000333	美的集团	51,000	2,663,220.00	1.29
6	000776	广发证券	189,800	2,518,646.00	1.22
7	600837	海通证券	245,400	2,323,938.00	1.12
8	601288	农业银行	649,600	2,234,624.00	1.08
9	600030	中信证券	134,400	2,227,008.00	1.08
10	600036	招商银行	82,900	2,191,876.00	1.06

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	18,570,300.00	8.99
	其中:政策性金融债	18,570,300.00	8.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,570,300.00	8.99

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	018005	国开1701	185,000	18,570,300.00	8.99

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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持仓。

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持有国债期货投资。

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

本组合投资的前十名证券之一招商银行于2018年2月12日被中国银监会公开处罚,主要违法违规事实包括:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良资款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款,中国银监会决定罚款招商银行6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析,认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。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	51,897.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	154,939.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	206,836.32

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的情况。

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	122,241,266.21	116,802,353.20
报告期期间基金总申购份额	33,368.35	26,024.50
减:报告期期间基金总赎回份额	5,167,911.72	8,825,345.47
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	117,106,722.84	108,003,032.23

§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

项目	平安大华量化精选A	平安大华量化精选C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,005,417.21	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,005,417.21	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.44	-

备注:比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,005,417.21	4.44	10,005,417.21	4.44	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,005,417.21	4.44	10,005,417.21	4.44	3年

§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量化精选混合型发起式证券投资基金设立的文件

(2)平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同

(3)平安大华量化精选混合型发起式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)报告期内平安大华量化精选混合型发起式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

平安大华中证500交易型开放式指数证券投资基金

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 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	平安大华中证500ETF
场内简称	平安500
交易代码	510590
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018年3月23日
报告期末基金份额总额	347,986,121.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数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,或因其他特殊情况导致流动性不足时,