(上接 D14 版)

联系人:许曼华
联系电话:021-20315117
客服电话:95538
传真:0531-68889752
网址:www.zts.com.cn
(23) 第一创业证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼
办公地址:深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼
法定代表人:刘学民
联系人:毛诗莉
电话:0755-23838750
传真:0755-25838701
客服电话:95358
网址:www.firstcapital.com.cn
(24) 中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路 291 号
办公地址:江西省南昌市抚河北路 291 号
法定代表人:王宜四
联系人:刘小莹
联系电话:0755-83689020
传真:010-64818443
客服电话:95335
网址:www.scstock.com
(25) 中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址:北京市建国门外大街甲 6 号 SK 大厦
法定代表人:毕明建
联系人:杨涵宇
电话:010-65051166
客服电话:400-910-1166
网址:www.cicc.com.cn
(26) 华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元
法定代表人:俞洋
办公地址:上海市徐汇区宛平南路 8 号
联系人:杨莉娟
业务联系电话:021-54967552
传真电话:021-54967293
网站:www.cfsc.com.cn
客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
(27) 联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 楼
法定代表人:徐刚
联系人:彭莲
电话:0755-83331195
客服电话:95564
网址:www.lxzq.com.cn
(28) 国金证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市东城根上街 95 号
办公地址:四川省成都市东城根上街 95 号
法定代表人:冉云
联系人:刘婧漪、贾鹏
电话:028-86690057、028-86690058
客服电话:95310
公司网址:www.gjzq.com.cn
(29) 天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼
法定代表人:余磊
联系人:岑妹妹
电话:027-87617017
客服电话:95391/400-800-5000
网址:http://www.tfzq.com
(30) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室
法定代表人:王翔
联系人:蓝杰
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客户服务电话:021-65370077
网址:www.jiyufund.com.cn
(31) 海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室
法定代表人:刘惠
联系人:毛林
客服电话:400-808-1016
网址:www.fundhaiyin.com
(32) 上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服电话:4008219031
网址:www.lufunds.com
(33) 中国平安人寿保险股份有限公司(仅代销 A 类)
注册地址:深圳市福田中心区福华三路星河发展中心办公 9、10、11 层
办公地址:深圳市福田中心区福华三路星河发展中心办公 9、10、11 层
法定代表人:丁新民
联系人:张露
电话:021-38635631
传真:021-50475630
客服电话:95511 转 1
网址:http://life.pingan.com/
(34) 华瑞保险销售有限公司
注册地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层
办公地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层
法定代表人:路昊
联系人:茆勇强
电话:021-61058785
传真:021-61098515
客服电话:400-111-5818
网址:www.huaruisales.com
(35) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址:上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-64385308
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
(36)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-20613999
传真:021-68596916
客服电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com
(37)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服电话:4008219031
网址:www.lufunds.com
(38)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路 6 号
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼
法定代表人:肖雯
联系人:吴煜浩
电话:020-89629021
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn
(二)登记机构
平安大华基金管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层
法定代表人:罗春风
电话:0755-22624581
传真:0755-23990088
联系人:张平

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人:俞卫锋
联系人:陈颖华
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、陈颖华
(四)审计基金财产的会计师事务所
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
法定代表人:李丹
联系电话:(021)2323 8888
传真电话:(021)2323 8800
经办注册会计师:曹翠丽、张宁
联系人:张宁

四、基金的名称

平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

混合型发起式证券投资基金

六、基金的运作方式

契约型开放式

七、基金的投资

(一)投资目标

本基金利用数量化投资模型指导投资组合的构建,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。

(二)投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债),资产支持证券,债券回购,银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款)、同业存单、货币市场工具,权证、股指期货、国债期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

(三)投资策略

本基金采用数量化投资策略建立投资模型,采用自上而下的资产配置和自下而上的个股选择相结合的方式,切实贯彻数量化的投资策略,以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。

本基金的投资策略包括两部分:一是通过自上而下的资产配置策略确定各类标的资产的配置比例,并对组合进行动态管理,进一步优化整个组合的风险收益参数;二是通过自下而上的上市公司的基本面数据、交易所公开信息、资本/资金市场数据、分析师预期数据、以及其他对股票选取有帮助的公开数据,构建数量化的多因子模型,选取具有投资价值的上市公司股票构成最终的股票投资组合。

1、资产配置策略

本基金采用"自上而下"的资产配置方法,确定本基金资产在股票、债券及其他金融工具等类别资产间的分配比例。在具体的资产配置过程中,通过把握宏观经济增长的长期趋势,短期的经济周期波动以及政策导向,判断各类资产的风险程度和收益特征,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,合理调整股票资产、债券资产和其他金融工具的比例,以达到控制风险、增加收益的目的。

2、量化多因子股票投资策略

本基金主要通过数量化投资模型,选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金利用长期积累并实时扩展的数据库,科学地考虑了大量的各类信息,并运用基金管理人自行开发的量化多因子模型框架,综合基本面因子、量价技术面因子以及分析师预期因子优选股票,基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断,结合收益与风险的波动性,适时调整组合的持股组成以及个股的资金权重。模型主要包含但不限于以下因子:

(1)基本面因子:主要包括公司的基本面信息,主要包括净利润长期和短期增长情况,主营业务收入长期和短期增长情况,公司业绩预告超越市场预期的幅度,公司最近重要新闻事件的发生,例如:新产品上市、新收购、新管理层上任等,个股流动性供应,包括:流通市值、解禁计划;

(2)量价技术面因子:通过研究分析个股二级市场价格和交易量数据,挖掘股价的增长与反转模式,作为选股的依据;

(3)分析师预期因子:包括分析师投资评级及其变化、上市公司年度净利润一致预期及其变化、分析师关注度及其变化等反映上市公司动态成长性指标。

3、量化价值成长策略

本策略综合考虑股票的长期稳定增长性和和单期增长性,对处于成长阶段的上市公司收入增长、利润增长的稳定性和持续性进行评估,同时也对毛利率,净利润率等盈利质量指标进行跟踪,并考察分析师对该股的盈利预测。

4、事件驱动策略

该策略通过对某些公司事件和市场事件的研究,分析事件对股价造成波动的方向,以赚取超额收益。此外,该策略还利用市场上存在的金融产品定价非有效性,实现套利收益。

5、债券投资策略

本基金将根据需要,适度进行债券投资。本基金在严格控制整体资产风险的基础上,根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架,通过对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测,进行以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标的债券投资。

本基金对中小企业私募债券的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面,根据宏观经济运行状况的分析和预判,灵活调整组合的久期。信用风险控制方面,对个券信用资质进行详尽的分析,对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量,尽可能地缩小信用风险暴露。流动性控制方面,要根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模,在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

6、权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

7、股指期货等投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8、资产支持证券投资策略

本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素,预判资产池未来现金流变动;研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响,同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响,在严格控制信用风险暴露程度的前提下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

9、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断,并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置,谨慎进行投资,以调整债券组合的久期,降低投资组合的整体风险。具体而言,本基金的国债期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上,将审慎地获取相应的超额收益,通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的增加,以及国债期货与债券的多空比例调整,获取组合的稳定收益。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

(四)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%;

(2)本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;

(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;

(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;

(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(11)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(12)本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(13)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(14)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

(15)本基金投资股指期货或国债期货,在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;在任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定,即占基金资产的比例为 60%-95%;

(16)在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

(17)本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的 10%;

(18)本基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

(19)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

(20)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(21)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(12)、(20)、(21)项所规定的情形外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是法律法规或中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合中国证监会的规定,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

五、业绩比较基准

中证 500 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

选择该业绩比较基准,是基于以下因素:

1、中证 500 指数和中证综合债指数合理、透明;

2、中证综合债指数具有较高的知名度和市场影响力;

3、基于本基金的投资范围和投资比例限制,选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时,基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数,而无需召开基金份额持有人大会。

六、风险收益特征

本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金,属于风险水平较高的基金。

七、基金管理人代表基金行使所投资证券项下权利的原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使所投资证券项下得权利,保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使所投资证券项下权利时应遵守以下原则:

1、不参与所投资公司的经营管理,不谋求对上市公司的控股;

2、有利于基金财产的安全与增值,有利于保护基金份额持有人的合法权益。

八、投资组合报告

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,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。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 3 月 31 日,本财务数据未经审计。

1.1 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	10,094,859.76	36.54
	其中:股票	10,094,859.76	36.54
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	5,000,000.00	18.10
	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	12,473,136.20	45.15
8	其他资产	57,787.55	0.21
9	合计	27,625,783.51	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 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	199,857.00	1.00
C	制造业	4,593,382.76	22.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,110.00	0.44
E	建筑业	273,820.00	1.37
F	批发和零售业	111,106.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	244,140.00	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,963,643.00	9.81
J	金融业	1,573,858.00	7.86
K	房地产业	209,776.00	1.05
L	租赁和商务服务业	79,365.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	67,152.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	328,614.00	1.64
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	362,036.00	1.81
S	综合	-	-
	合计	10,094,859.76	50.43

1.2.2 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。

1.3 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	300059	东方财富	20,900	353,837.00	1.77
2	300124	汇川技术	8,200	289,952.00	1.45
3	300136	信维通信	7,300	272,363.00	1.36
4	300072	三聚环保	7,800	252,720.00	1.26
5	600837	海通证券	20,100	230,949.00	1.15
6	000703	恒逸石化	8,300	215,883.00	1.08
7	300408	三环集团	8,900	214,757.00	1.07
8	300070	碧水源	11,800	213,816.00	1.07
9	600519	贵州茅台	300	205,086.00	1.02
10	300024	机器人	9,300	194,277.00	0.97

1.4 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。

1.5 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

本基金报告期末未持有债券投资。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 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。

1.9.2 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。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 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。

1.10.2 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。

1.10.3 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。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

海通证券股份有限公司(以下简称"公司")于 2017 年 5 月 25 日公告,公司近日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2017]59 号)。因公司违反了《证券公司融资融券业务管理办法》(证监会公告【2011】31 号)第十一条的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(七)项"未按照规定与客户签订业务合同,或者未在与客户的业务合同中载入规定的必要条款"所述行为,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第(七)项的规定,中国证监会拟决定:一、责令海通证券改正,给予警告,没收违法所得 509,653.15 元,并处罚款 2,548,265.75 元;二、对左秀海、徐晓啸、朱元灏给予警告,并分别处以 10 万元罚款。

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。

1.11.2

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。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,514.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,499.97
5	应收申购款	35,773.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,787.55

1.11.4 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。

1.11.5 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	000703	恒逸石化	215,883.00	1.08	重大事项

1.11.6 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。

八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、自基金合同生效以来(2017 年 11 月 1 日)至 2018 年 3 月 31 日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:

平安大华量化先锋 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2017.11.1-2017.12.31	0.40%	0.66%	-3.79%	0.83%	4.19%	-0.17%
2018.1.1-2018.3.31	-1.40%	1.11%	-1.24%	1.20%	-0.16%	-0.09%
自合同成立以来	-1.01%	0.94%	-4.98%	1.06%	3.97%	-0.12%

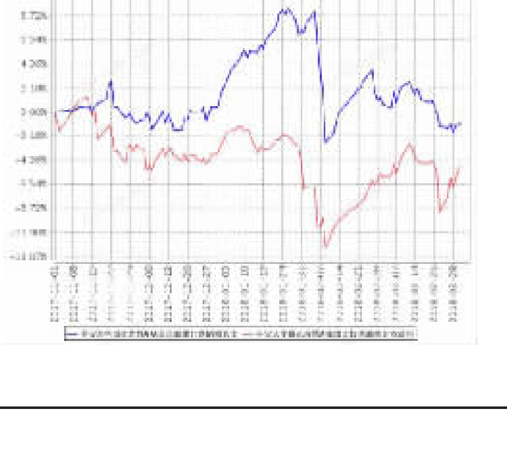
业绩比较基准:中证 500 指数收益率 ★80%+中证综合债指数收益率 ★20%

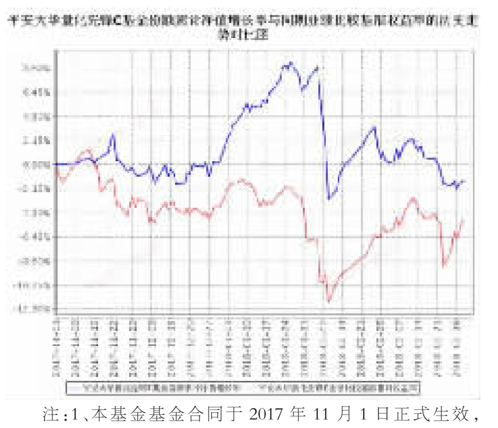
平安大华量化先锋 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2017.11.1-2017.12.31	0.26%	0.66%	-3.79%	0.83%	4.05%	-0.17%
2018.1.1-2018.3.31	-1.69%	1.11%	-1.24%	1.20%	-0.45%	-0.09%
自合同成立以来	-1.43%	0.94%	-4.98%	1.06%	3.55%	-0.12%

业绩比较基准:中证 500 指数收益率 ★80%+中证综合债指数收益率 ★20%

二、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





注:1、本基金基金合同于 2017 年 11 月 1 日正式生效,截至报告期末未满一年;

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,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

九、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券/期货交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金相关账户的开户及维护费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人按与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人按与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.80%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.80%÷当年天数

H 为本基金 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为本基金 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,基金托管人复核无误后于次月前 5 个工作日内从基金财产中划出,由登记机构代收,登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述"(一)基金费用的种类"中第 4-10 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、基金合同生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十、其他应披露事项

(一)本基金管理人、基金托管人目前无重大诉讼事项。

(二)最近半年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。

(三)2017 年 11 月 1 日至 2018 年 4 月 30 日发布的公告:

1、2017 年 11 月 2 日,关于平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告;

2、2017 年 12 月 18 日,关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构及开通基金转换业务、参与其费率优惠活动的公告;

3、2017 年 12 月 19 日,关于平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务和定期定额投资的公告;

4、2017 年 12 月 25 日,平安大华基金管理有限公司关于调整旗下基金持有流通受限股票估值方法的公告;

5、2017 年 12 月 30 日,平安大华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金缴纳增值税的公告;

6、2018 年 1 月 12 日,关于旗下部分基金新增南京证券为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告;

7、2018 年 1 月 24 日,平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告;

8、2018 年 2 月 6 日,关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为销售机构的公告;

9、2018 年 3 月 1 日,关于旗下部分基金新增中国平安人寿保险股份有限公司为销售机构的公告;

10、2018 年 3 月 24 日,关于平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金修改基金合同的公告

11、2018 年 3 月 26 日,平安大华基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金赎回费的公告;

12、2018 年 4 月 16 日,关于旗下部分基金新增海银基金为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告;

13、2018 年 4 月 20 日,平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金 2018 年 1 季度报告;

(四)《招募说明书》与本次更新的招募说明书内容若有不一致之处,以本次更新的招募说明书为准。

十一、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》等其他有关法律法规的要求及基金合同的规定,对 2017 年 8 月 25 日公布的《平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

1、根据最新资料,更新了"重要提示"部分。

2、根据最新资料,更新了"第一部分、绪言"。

3、根据最新资料,更新了"第二部分、释义"。

4、根据最新资料,更新了"第三部分、基金管理人"。

5、根据最新资料,更新了"第四部分、基金托管人"。

6、根据最新资料,更新了"第五部分、相关服务机构"。

7、根据最新资料,更新了"第六部分、基金的募集"。

8、根据最新资料,更新了"第七部分、基金合同的生效"。

9、根据最新资料,更新了"第八部分、基金份额的申购与赎回"。

10、根据最新资料,更新了"第九部分、基金的投资"。

11、根据最新资料,更新了"第十部分、基金的业绩"。

12、根据最新资料,更新了"第十二部分、基金资产的估值"。

13、根据最新资料,更新了"第十六部分、基金的信息披露"。

14、根据最新资料,更新了"第十七部分、风险揭示"。

15、根据最新资料,更新了"第二十部分、基金托管协议的内容摘要"。

16、根据最新资料,更新了"第二十二部分、其他应披露的事项"。

17、根据最新情况,更新了"第二十三部分、对招募说明书更新部分的说明"。

平安大华基金管理有限公司
2018 年 5 月 29 日