

平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金 2018年第2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

重要提示 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本基金招募说明书中已对本基金的风险进行了充分揭示,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。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资风险,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。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

基金产品概况表,包含基金简称、场内简称、交易代码、基金运作方式、基金合同生效日、报告期末基金份额总额、投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金管理人、基金托管人、下属分级基金名称、下属分级基金场内简称、下属分级基金的交易代码、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、下属分级基金的风险收益特征。

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

主要财务指标表,包含报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)的主要财务指标,如本期已实现收益、本期利润、加权平均基金份额本期利润、期末基金份额净值、期末基金净值增长率等。

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。

3.2.1 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

平安大华转型创新混合A 业绩比较表,包含阶段、净值增长率、业绩比较基准收益率、跟踪误差等数据。

平安大华转型创新混合C 业绩比较表,包含阶段、净值增长率、业绩比较基准收益率、跟踪误差等数据。

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的比较

注:1.本基金基金合同于2017年4月14日正式生效,截至本报告期末已满一年; 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,截至本报告期末本基金已完成建仓,建仓期结束的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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

基金经理简介表,包含姓名、职务、任职日期、离任日期、证券从业年限、说明。

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”为根据基金合同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”分别指根据基金合同决定确认的聘任日期和解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理,其“任职日期”和“离任日期”指中国证监会核准公告的日期。

3.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

4.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

5.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

6.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

7.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

8.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

9.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

10.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

11.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

12.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

13.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

14.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

15.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

16.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

17.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

18.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

19.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

20.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

21.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

22.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

23.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

24.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

25.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

26.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

27.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

28.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

29.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金 2018年第2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

重要提示 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本基金招募说明书中已对本基金的风险进行了充分揭示,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。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资风险,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。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

基金产品概况表,包含基金简称、场内简称、交易代码、基金运作方式、基金合同生效日、报告期末基金份额总额、投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金管理人、基金托管人、下属分级基金名称、下属分级基金场内简称、下属分级基金的交易代码、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、下属分级基金的风险收益特征。

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

主要财务指标表,包含报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)的主要财务指标,如本期已实现收益、本期利润、加权平均基金份额本期利润、期末基金份额净值、期末基金净值增长率等。

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。

3.2.1 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

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金 业绩比较表,包含阶段、净值增长率、业绩比较基准收益率、跟踪误差等数据。

注:1.本基金基金合同于2017年1月25日正式生效,截至本报告期末已满一年; 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,截至本报告期末本基金已完成建仓,建仓期结束的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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

基金经理简介表,包含姓名、职务、任职日期、离任日期、证券从业年限、说明。

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”为根据基金合同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”分别指根据基金合同决定确认的聘任日期和解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理,其“任职日期”和“离任日期”指中国证监会核准公告的日期。

3.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

4.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

5.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

6.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

7.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

8.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

9.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

10.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

11.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

12.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

13.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

14.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

15.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

16.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

17.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

18.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

19.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

20.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

21.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

22.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

23.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

24.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

25.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

26.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

27.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

28.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

29.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

30.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

31.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

32.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

33.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

34.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

35.基金经理的离任日期,指其不再担任该基金基金经理职务的日期。

基金投资组合表,包含代码、行业类别、公允价值(元)、占基金资产净值比例(%)。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合表,包含行业类别、公允价值(人民币)、占基金资产净值比例(%)。

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

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表,包含序号、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(%)。

5.3.2 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

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表,包含序号、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(%)。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.13 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.14 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.15 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.16 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.17 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.18 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.19 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.20 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.21 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.22 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.23 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.24 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.25 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.26 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.27 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.28 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.29 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.30 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.31 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.32 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.33 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.34 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.35 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.36 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.37 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.38 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.39 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合表,包含代码、行业类别、公允价值(元)、占基金资产净值比例(%)。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合表,包含行业类别、公允价值(人民币)、占基金资产净值比例(%)。

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

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表,包含序号、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(%)。

5.3.2 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

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表,包含序号、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(%)。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.13 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.14 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.15 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.16 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.17 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.18 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.19 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.20 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.21 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.22 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.23 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.24 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.25 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.26 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.27 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.28 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.29 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.30 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.31 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.32 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.33 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.34 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.35 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.36 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.37 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.38 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.39 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.40 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.41 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.42 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.43 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.44 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.45 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.46 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.47 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.48 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.49 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.50 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.51 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.52 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.53 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.54 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.55 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.56 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.57 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.58 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.59 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.60 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.61 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.62 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.63 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.64 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.65 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.66 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.67 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.68 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.69 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.70 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.71 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.72 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.73 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.74 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.75 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.76 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.77 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.78 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.79 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.80 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.81 报告期末本基金投资的国债期货评价

5.82 报告期末本基金投资的国债期货评价

</