

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

普华永道中天会计师事务所为基金财务出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者仔细阅读。

本报告期自 2016 年 7 月 21 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
8.6 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.....	45

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
8.8 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贵金属投资明细	45
8.9 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	45
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
8.12 投资组合报告附注	46
§9 基金份额持有人信息	47
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
9.2 期末上市基金前十名持有人	47
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	48
§10 开放式基金份额变动	48
§11 重大事件揭示	48
11.1 基金份额持有人大会决议	48
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
11.4 基金投资策略的改变	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
11.8 其他重大事件	52
§12 影响投资者决策的其他重要信息	错误!未定义书签。
§13 备查文件目录	54
13.1 备查文件目录	54
13.2 存放地点	55
13.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	平安大华鼎泰灵活配置混合型
场内简称	平安鼎泰
基金主代码	167001
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2016 年 7 月 21 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
报告期末基金份额总额	1,318,879,411.68 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016 年 10 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,在基金合同生效后 18 个月内,灵活运用定向增发股票等投资策略,充分挖掘市场投资机会,力争基金资产的长期稳健增值。本基金转为上市开放式基金（LOF）后,积极发掘可能对上市公司当前或未来价值产生重大影响的各类事件,在控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在合同生效后 18 个月 内（含第 18 个月 ），通过对宏观经济、行业分析轮动效应与定向增发项目优势的深入研究基础上,利用项目的事件性特征与折价优势,选能够改善、提升企业基本面经营状况定向增发股票进行投资。
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,属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安大华基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	方琦
	联系电话	0755-22626828	0755-22160168

	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fangqi275@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦酒店 01: 419	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		518048	518001
法定代表人		罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 7 月 21 日 (基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-1,668,104.03	-	-
本期利润	-404,420.02	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0003	-	-
本期加权平均净值利润率	-0.03%	-	-
本期基金份额净值增长率	-0.03%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-1,668,104.03	-	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0013	-	-
期末基金资产净值	1,318,474,991.66	-	-

期末基金份额净值	0.9997	-	-
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	-0.03%	-	-

1. 本基金基金合同于 2016 年 7 月 21 日正式生效，截至报告期末未满一年；
2. 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；
3. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；
4. 上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 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

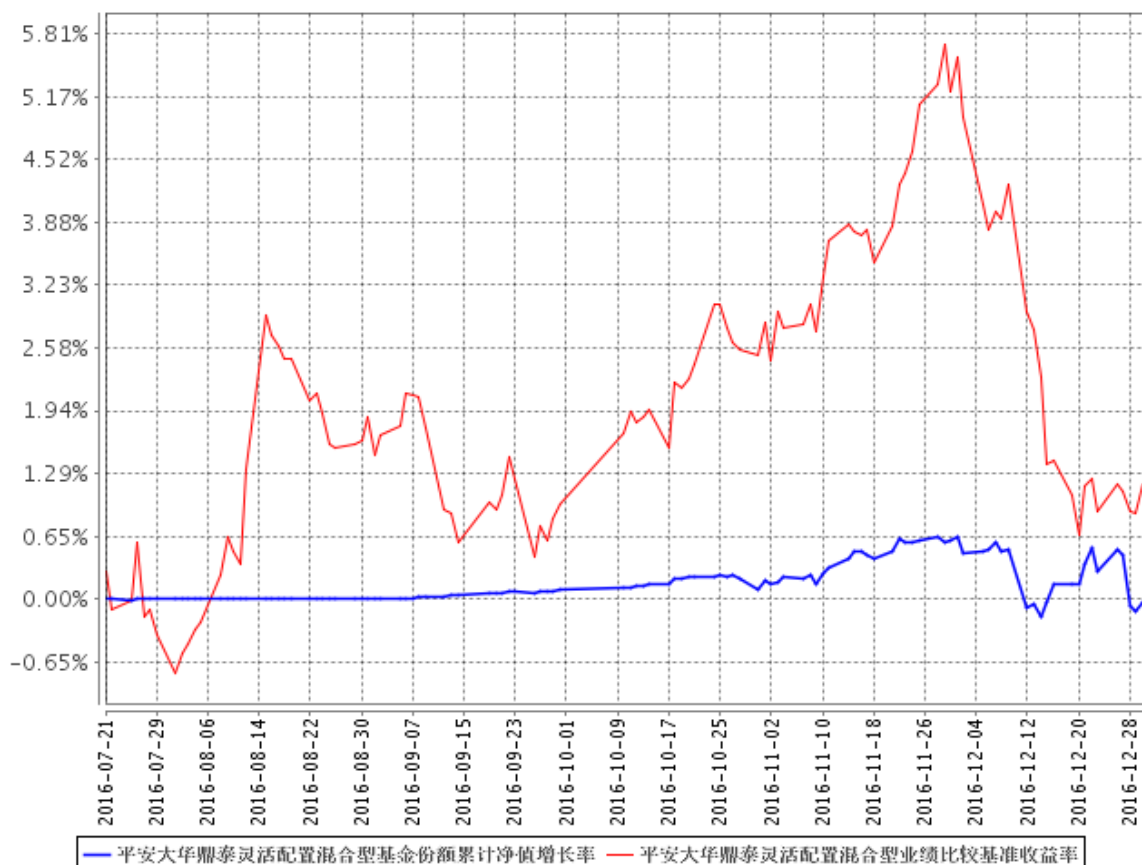
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.12%	0.13%	0.19%	0.38%	-0.31%	-0.25%
自基金合同生效起至今	-0.03%	0.10%	1.17%	0.39%	-1.20%	-0.29%

注：1、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%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证综合债券指数是反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债、和企业债、该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场标准。根据本基金的投资范围约束，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

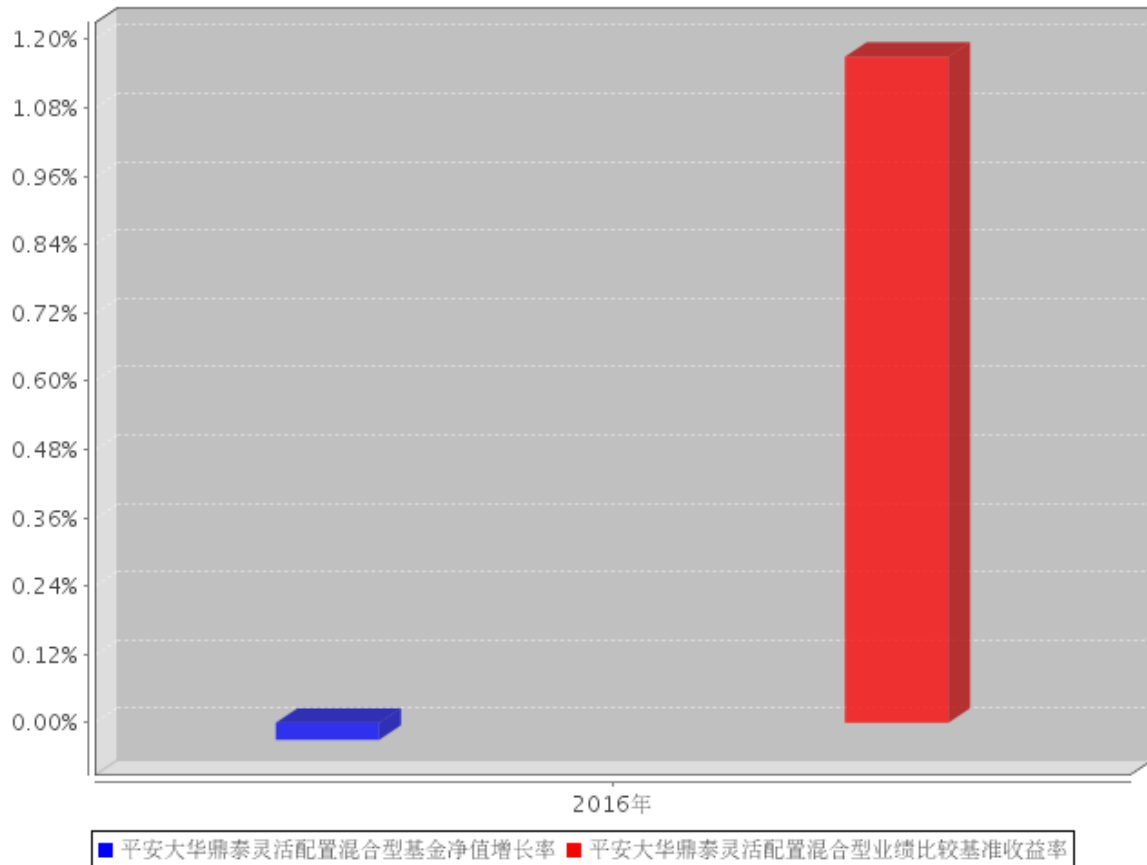
平安大华鼎泰灵活配置混合型基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2016 年 7 月 21 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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安大华鼎泰灵活配置混合型自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



1. 本基金合同于 2016 年 7 月 21 日正式生效，截止报告期末未满一年。
2. 2016 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

本基金本报告期无其他指标。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2016 年 7 月 21 日正式生效，基金合同生效日至报告期末，本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号

文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 3 亿元人民币，是目前中国内地基金业注册资本金最高的基金公司之一。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股权 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。

平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2016 年 12 月 31 日，平安基金共管理 29 只开放式基金，资产管理总规模超 836 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘俊廷	本基金的基金经理	2016 年 7 月 21 日	-	5	刘俊廷先生曾在国泰君安证券股份有限公司担任分析师一职，于 2014 年 12 月加入平安大华基金，任行业研究员，现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵循行业协会《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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定并下发了《平安大华基金管理有限责任公司公平交易管理制度》、《平安大华基金管理有限责任公司异

常交易监控及报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期连续四个季度期间内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年定增市场发行规模总计规模突破 1.55 万亿元，相较于 2015 年 1.36 万亿的规模，在今年监管整体趋严的基调下，2016 年同比依旧略有增长。市场低迷时定增相对更安全，上证 3500 以下，定增市场都有不错的胜率（取得绝对正收益的比例）和收益率。我们从历史的统计情况来看，在上证 3500 以下，定增市场都有不错的胜率（取得绝对正收益的比例）和收益率。

2016 年竞价定增折价率整体处于低位，自 5 月份开始，折价率均在 10%以内，且折价率降低已经成为常态。因此我们以稳住折价率为大的前提，增组合则分散个股及建仓时点，充分吸收单票风险，控制平均折扣，应对震荡行情。在 A 股市场趋势性行情难现的背景下，定增已经成为大类资产配置的重要品种。选票上会通过自主投研能力，筛选基本面良好、有业绩支撑的标的，规避缺乏业绩与盈利预期的“讲故事”个股。

在报告期内，我们分别参与了富煌钢构、安控科技、天华院、省广股份、中电鑫龙、力星股份、美菱电器、软控股份、航天科技、旷达科技、交运股份、豫光金铅、海宁皮城、神州信息等公司的定向增发，根据合同安排，本基金定增仓位的建仓期为 2016 年 7 月 21 日至 2017 年 1 月 21 日。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.9997 元，份额累计净值为 0.9997 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-0.03%，同期业绩基准增长率为 1.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据 WIND 不完全统计，2016 年的定增市场发行规模共 1.58 万亿元，在定增市场监管趋严的基调下，相比 2015 年 1.36 万亿的定增规模，2016 年同比依旧略有增长。其中竞价类定增规模 6126 亿元，2015 年同期的为 4589 亿元，同比增长了 33.5%。

展望 2017 年我们认为非公开发行作为上市公司再融资的渠道地位依然被呵护。再融资市场也已受到监管层的密切关注，在监管趋严继续的情况下，我们预计 2017 年定增市场发行规模同比将有小幅减少，平均折价率依然保持在 10%左右。

监管严格更意味着项目质量的提升。通过立足于基础性制度建设，提高信息披露质量，严厉打击违法违规行为，投资者特别是中小投资者的权益将得到更充分的保障。在此趋势下，定增市场将得到进一步的规范，专业的机构投资者在定增市场的优势将愈加明显，同时也为定增市场的健康长久发展打下坚实基础。

从中长期来看，并购重组市场生态将进一步优化，有助于发挥资本市场的融资功能，体现资本市场服务实体经济的根本宗旨，中小投资者的权益将得到更充分的保障。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，

确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部门按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部、运营部及监察稽核部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理，特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金基金合同的规定，本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法

律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由平安大华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字（2017）第 22039 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“平安大华鼎泰混合基金”）的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是平安大华鼎泰混合基金的基金管理人平安大华基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、实施和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报

注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述平安大华鼎泰混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了平安大华鼎泰混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	曹翠丽 边晓红
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,199,968.22	-
结算备付金		29,281,818.17	-
存出保证金		15.60	-
交易性金融资产	7.4.7.2	811,940,032.11	-
其中：股票投资		791,946,032.11	-
基金投资		-	-

债券投资		19,994,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	275,640,745.21	-
应收证券清算款		202,116,576.07	-
应收利息	7.4.7.5	356,899.77	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,320,536,055.15	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,680,511.97	-
应付托管费		280,085.35	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,466.17	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	95,000.00	-
负债合计		2,061,063.49	-
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,318,879,411.68	-
未分配利润	7.4.7.10	-404,420.02	-
所有者权益合计		1,318,474,991.66	-
负债和所有者权益总计		1,320,536,055.15	-

注:(1)报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.9997 元,基金份额总额 1,318,879,411.68 份。

(2)本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效,实际报告期间为 2016 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日,因此无需披露比较数据。

7.2 利润表

会计主体：平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 7 月 21 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		10,108,461.80	-
1. 利息收入		8,804,369.56	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,659,143.84	-
债券利息收入		17,978.96	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,127,246.76	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		40,408.23	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	40,408.23	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,263,684.01	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		10,512,881.82	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,824,948.51	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,470,824.70	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	208.61	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	216,900.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-404,420.02	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-404,420.02	-

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,318,879,411.68	-	1,318,879,411.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-404,420.02	-404,420.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,318,879,411.68	-404,420.02	1,318,474,991.66
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-	-

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>陈星</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第 1208 号《关于准予平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由平安大华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,318,599,857.89 元,经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具普华永道中天验字(2016)第 868 号验资报告。经向中国证监会备案,《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,318,879,411.68 份基金份额,其中认购资金利息折合 279,553.79 份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”),登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)至 18 个月(含第 18 个月)后的对应日止,若该日为非工作日或无该对应日,则为该日之前的最后一个工作日。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所(以下简称“深交所”)转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF),并更名为平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF),投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。

经深交所深证上[2016]696 号文审核同意,本基金 519,058,725.00 份基金份额于 2016 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基

金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、衍生工具（权证、股指期货、国债期货等）、债券资产（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金资产等货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。报告截止日 2016 年 12 月 31 日,本基金尚处于封闭期,实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1)在符合有关基金分红条件的前提下，封闭期内，本基金的收益分配，每年不得少于一次，且每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的90%；(2)本基金收益分配方式为现金分红；(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4)每一基金份额享有同等分配权；(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收

政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	1,199,968.22	-
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,199,968.22	-

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	790,741,476.60	791,946,032.11	1,204,555.51	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	19,934,871.50	19,994,000.00	59,128.50
	合计	19,934,871.50	19,994,000.00	59,128.50
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	810,676,348.10	811,940,032.11	1,263,684.01	
项目	上年度末 2015年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	合计	-	-	
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	-	-	-	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	150,140,745.21	-
买入返售证券	125,500,000.00	-
合计	275,640,745.21	-

项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	31,702.79	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	13,176.80	-
应收债券利息	228,703.56	-
应收买入返售证券利息	83,316.62	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	356,899.77	-

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	5,466.17	-
合计	5,466.17	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

预提费用	95,000.00	-
合计	95,000.00	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年7月21日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,318,879,411.68	1,318,879,411.68
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,318,879,411.68	1,318,879,411.68

注：1. 本基金自2016年06月20日至2016年07月15日止期间公开发售，共募集有效净认购资金1,318,599,857.89元。根据《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入279,553.79元，在本基金成立后，折算为279,553.79份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的封闭期为自2016年7月21日(基金合同生效日)至2018年1月19日(含)止期间，封闭期内本基金不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深交所转让基金份额。

3. 截至2016年12月31日，本基金深交所上市的基金份额为519,058,725.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为799,820,686.68份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通，未上市的基金份额登记在注册登记系统。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,668,104.03	1,263,684.01	-404,420.02
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,668,104.03	1,263,684.01	-404,420.02

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月21日(基金合同生效 日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
活期存款利息收入	1,098,049.15	-
定期存款利息收入	2,467,777.77	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	82,665.13	-
其他	10,651.79	-
合计	3,659,143.84	-

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月21日(基金 合同生效日)至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债 转股及债券到期兑付）差价收入	40,408.23	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	40,408.23	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月21日(基金 合同生效日)至2016年12月	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
----	--	--------------------------------------

	31日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	215,449.66	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	174,992.33	-
减：应收利息总额	49.10	-
买卖债券差价收入	40,408.23	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度末均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度末均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比均无贵金属投资。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2016年7月21日(基金合同生效)	2015年1月1日至2015年12月31

	日)至 2016 年 12 月 31 日	日
股指期货-投资收益	-	

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 7 月 21 日(基金 合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,263,684.01	-
——股票投资	1,204,555.51	-
——债券投资	59,128.50	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	1,263,684.01	-

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 21 日(基金合同生 效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	8.61	-
银行间市场交易费用	200.00	-
合计	208.61	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2016 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	95,000.00	-
信息披露费	75,000.00	-
银行间账户维护费	1,500.00	-
上市费	45,000.00	-
其他	400.00	-
合计	216,900.00	-

注：“其他”为证券账户开户费。

7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人，基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东

深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券有限责任公司	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
上海陆金所资产管理有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无关联方债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末无应支付给关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年7月21日(基金合同生效日)至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,824,948.51	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,661,949.23	-

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,470,824.70	-

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无支付给关联方的销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期	1,199,968.22	1,098,049.15	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600676	交运股份	2016年11月14日	2017年11月10日	非公开发行流通受限	8.58	8.64	11,655,013	100,000,011.54	100,699,312.32	-
002344	海宁皮城	2016年12月22日	2017年12月26日	非公开发行流通受限	10.70	10.72	9,004,499	96,348,139.30	96,528,229.28	-
002073	软控股份	2016年11月3日	2017年11月6日	非公开发行流通受限	10.30	10.48	8,998,342	92,682,922.60	94,302,624.16	-
000901	航天科技	2016年11月17日	2017年11月20日	非公开发行流通受限	30.72	31.00	2,597,735	79,802,419.20	80,529,785.00	-
000521	美菱电器	2016年10月13日	2017年10月16日	非公开发行流通受限	5.59	5.90	12,522,361	69,999,997.99	73,881,929.90	-
600531	豫光金铅	2016年12月20日	2017年12月18日	非公开发行流通受限	7.50	7.54	9,329,760	69,973,200.00	70,346,390.40	-
002400	省广股份	2016年9月21日	2017年9月22日	非公开发行流通受限	13.58	13.64	4,626,252	62,824,502.16	63,102,077.28	-
300370	安控科技	2016年9月7日	2017年9月13日	非公开发行流通受限	9.28	9.24	5,183,192	48,100,021.76	47,892,694.08	-
002298	中电鑫龙	2016年10月11日	2017年10月11日	非公开发行流	14.78	13.81	3,044,649	44,999,912.22	42,046,602.69	-

		日	月 13 日	通受限						
300421	力星股份	2016 年 10 月 13 日	2017 年 10 月 20 日	非公开 发行流 通受限	30.72	31.80	1,075,634	33,043,476.48	34,205,161.20	-
000555	神州信息	2016 年 12 月 28 日	2017 年 12 月 29 日	非公开 发行流 通受限	25.57	21.23	1,471,517	37,626,689.69	31,240,305.91	-
002516	旷达科技	2016 年 11 月 9 日	2017 年 11 月 10 日	非公开 发行流 通受限	6.52	6.53	3,579,783	23,340,185.16	23,375,982.99	-
600579	天华院	2016 年 9 月 12 日	2017 年 9 月 11 日	非公开 发行流 通受限	12.50	13.06	1,760,000	22,000,000.00	22,985,600.00	-
002743	富煌钢构	2016 年 8 月 18 日	2017 年 8 月 21 日	非公开 发行流 通受限	12.85	13.89	778,210	9,999,998.50	10,809,336.90	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金通过认购上市公司非公开发行股票的方式获取的省广股份（002400）于 2016 年 11 月 28 日起停牌。截止本报告期末，上述股票尚未复牌。上述股票的相关信息详见 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有除超短期融资券以外的债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
--------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

资产							
银行存款	1,199,968.22	-	-	-	-	-	1,199,968.22
结算备付金	29,281,818.17	-	-	-	-	-	29,281,818.17
存出保证金	15.60	-	-	-	-	-	15.60
交易性金融资产	-	-19,994,000.00	-	-	-791,946,032.11	-	811,940,032.11
买入返售金融资产	275,640,745.21	-	-	-	-	-	275,640,745.21
应收证券清算款	-	-	-	-	-202,116,576.07	-	202,116,576.07
应收利息	-	-	-	-	-	356,899.77	356,899.77
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	306,122,547.20	-19,994,000.00	-	-	-994,419,507.95	-	1,320,536,055.15
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,680,511.97	1,680,511.97
应付托管费	-	-	-	-	-	280,085.35	280,085.35
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,466.17	5,466.17
其他负债	-	-	-	-	-	95,000.00	95,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,061,063.49	2,061,063.49
利率敏感度缺口	306,122,547.20	-19,994,000.00	-	-	-	-	-
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
负债							

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券投资仅占基金净值 1.52%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金在封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例为 0%-100%；公开发行股票资产占非现金基金资产的比例为 0%-20%；债券资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；转换为上市开放式基金 (LOF) 后股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。在封闭期内，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金 (LOF) 后，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，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	791,946,032.11	60.07	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	791,946,032.11	60.07	-	-

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 811,940,032.11 元，无属于第一层次以及第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	791,946,032.11	59.97
	其中：股票	791,946,032.11	59.97
2	固定收益投资	19,994,000.00	1.51
	其中：债券	19,994,000.00	1.51
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	275,640,745.21	20.87
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	30,481,786.39	2.31
7	其他各项资产	202,473,491.44	15.33
8	合计	1,320,536,055.15	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	458,329,504.63	34.76
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	100,699,312.32	7.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,286,908.60	5.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	159,630,306.56	12.11
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	791,946,032.11	60.07

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600676	交运股份	11,655,013	100,699,312.32	7.64
2	002344	海宁皮城	9,004,499	96,528,229.28	7.32
3	002073	软控股份	8,998,342	94,302,624.16	7.15
4	000901	航天科技	2,597,735	80,529,785.00	6.11
5	000521	美菱电器	12,522,361	73,881,929.90	5.60
6	600531	豫光金铅	9,329,760	70,346,390.40	5.34
7	002400	省广股份	4,626,252	63,102,077.28	4.79
8	300370	安控科技	5,183,192	47,892,694.08	3.63
9	002298	中电鑫龙	3,044,649	42,046,602.69	3.19
10	300421	力星股份	1,075,634	34,205,161.20	2.59
11	000555	神州信息	1,471,517	31,240,305.91	2.37
12	002516	旷达科技	3,579,783	23,375,982.99	1.77
13	600579	天华院	1,760,000	22,985,600.00	1.74
14	002743	富煌钢构	778,210	10,809,336.90	0.82

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600676	交运股份	100,000,011.54	7.58
2	002344	海宁皮城	96,348,139.30	7.31
3	002073	软控股份	92,682,922.60	7.03
4	000901	航天科技	79,802,419.20	6.05
5	000521	美菱电器	69,999,997.99	5.31
6	600531	豫光金铅	69,973,200.00	5.31
7	002400	省广股份	62,824,502.16	4.76
8	300370	安控科技	48,100,021.76	3.65
9	002298	中电鑫龙	44,999,912.22	3.41
10	000555	神州信息	37,626,689.69	2.85
11	300421	力星股份	33,043,476.48	2.51
12	002516	旷达科技	23,340,185.16	1.77
13	600579	天华院	22,000,000.00	1.67
14	002743	富煌钢构	9,999,998.50	0.76

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	790,741,476.60
卖出股票收入（成交）总额	-

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	19,994,000.00	1.52
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,994,000.00	1.52

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	011698181	16 首钢 SCP002	200,000	19,994,000.00	1.52

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末无贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货，

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未持仓投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15.60
2	应收证券清算款	202,116,576.07
3	应收股利	-
4	应收利息	356,899.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	202,473,491.44

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转债。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600676	交运股份	100,699,312.32	7.64	非公开发行
2	002344	海宁皮城	96,528,229.28	7.32	非公开发行
3	002073	软控股份	94,302,624.16	7.15	非公开发行
4	000901	航天科技	80,529,785.00	6.11	非公开发行
5	000521	美菱电器	73,881,929.90	5.60	非公开发行
6	600531	豫光金铅	70,346,390.40	5.34	非公开发行
7	002400	省广股份	63,102,077.28	4.79	非公开发行
8	300370	安控科技	47,892,694.08	3.63	非公开发行
9	002298	中电鑫龙	42,046,602.69	3.19	非公开发行
10	300421	力星股份	34,205,161.20	2.59	非公开发行

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
12,168	108,389.17	301,511,901.35	22.86%	1,017,367,510.33	77.14%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	易方达资产穗鑫 2 号专项资产管理计划	180,007,100.00	13.65%
2	张敏喆	30,007,100.00	2.28%
3	中国通用技术（集团）控股 有限责任公司	28,000,000.00	2.12%
4	都邦财产保险股份有限公司	15,002,166.00	1.14%
5	申万宏源证券有限公司	10,000,194.00	0.76%
6	戴璐	9,999,450.00	0.76%
7	临汾市昊天元商贸有限公司	9,999,450.00	0.76%
8	融通资本—广州农村商业银行—广州农村商业银行股份 有限公司	8,642,129.00	0.66%
9	平安大华基金—平安银行— 平安大华固定收益增强七号 特定客户资	6,375,000.00	0.48%
10	平安大华基金—平安银行— 平安大华固定收益增强六号 特定客户资	6,340,000.00	0.48%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	28,724.92	0.0022%
------------------	-----------	---------

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年7月21日）基金份额总额	1,318,879,411.68
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	0.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	0.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
本报告期期末基金份额总额	1,318,879,411.68

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十三次会议审议通过，由陈特正先生接替肖宇鹏先生任职公司督察长职务，任职日期为2016年1月21日，该事项已于2016年1月22日公告。

2、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十六次会议审议通过，由肖宇鹏先生接替罗春风先生任职公司总经理职务，任职日期为2016年1月22日，该事项已于2016年1月23日公告。

日公告。

3、经平安大华基金管理有限公司 2016 年第三次股东大会审议通过《关于更换第二届董事会会议的议案》，同意由叶杨诗明女士代替王世荣先生出任董事。

4、2016 年 12 月，谢永林先生担任平安银行股份有限公司董事、董事长。上述人事变动已按规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，初次聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内应支付给该事务所的报酬为 95,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
万联证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

申万宏源	2	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
东北证券	5	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

3、本基金报告期合同生效，上述租用交易单元均为本期新增所用。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
万联证券	-	-	2,240,000,000.00	14.20%	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	1,940,000,000.00	12.30%	-	-
国信证券	-	-	1,070,000,000.00	6.78%	-	-
开源证券	-	-	1,480,000,000.00	9.38%	-	-
银河证券	215,449.66	100.00%	1,035,000,000.00	6.56%	-	-
东方证券	-	-	520,000,000.00	3.30%	-	-
华泰证券	-	-	2,750,000,000.00	17.43%	-	-
申万宏源	-	-	300,000,000.00	1.90%	-	-
安信证券	-	-	200,000,000.00	1.27%	-	-
方正证券	-	-	260,000,000.00	1.65%	-	-
光大证券	-	-	407,500,000.00	2.58%	-	-
华创证券	-	-	1,300,000,000.00	8.24%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	2,271,000,000.00	14.40%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安大华基金管理有限公司 2016 年 12 月 31 日基金净值公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 12 月 31 日
2	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“神州信息”非公开发行股票的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 12 月 30 日
3	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“海宁皮城”非公开发行股票的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 12 月 24 日
4	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“豫光金铅”非公开发行股票的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 12 月 22 日
5	平安大华基金管理有限公司开通快付通支付-快付通基金网上交易业务的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 12 月 14 日
6	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“航天科技”非公开发行股票的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 11 月 19 日
7	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“交运股份”非公开发行股票的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 11 月 16 日
8	关于旗下部分基金新增云湾投资为销售机构的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 11 月 11 日
9	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“旷达科技”非公开发行股票的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 11 月 11 日

10	关于开展通联支付费率优惠基金理财平台交易公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 11 月 8 日
11	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“软控股份”非公开发行的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 11 月 5 日
12	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 10 月 25 日
13	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金上市交易提示性公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 10 月 18 日
14	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“美菱电器”非公开发行的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 10 月 15 日
15	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“力星股份”非公开发行的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 10 月 15 日
16	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“中电鑫龙”非公开发行的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 10 月 14 日
17	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“省广股份”非公开发行的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 9 月 23 日
18	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“天华院”非公开发行的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016 年 9 月 14 日
19	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“安控科技”非公	中国证券报、证券日报及基金管理人官	2016 年 9 月 9 日

	开发行股票的公告	网	
20	关于旗下部分基金新增渤海证券为销售机构及开通转换业务的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016年8月29日
21	关于旗下部分基金新增德邦证券为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016年8月26日
22	关于增加大通证券为平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016年8月26日
23	关于旗下部分基金新增大同证券为销售机构及开通转换和定投业务的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016年8月24日
24	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金投资“富煌钢构”非公开发行股票的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016年8月20日
25	关于旗下部分基金新增首创证券为销售机构及开通定投与转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016年8月8日
26	关于平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券日报及基金管理人官网	2016年7月22日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华鼎泰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) 报告期内平安大华鼎泰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

(6) 平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>

平安大华基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日