

平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 4 月 24 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 2017 年 4 月 21 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 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安大华鼎越灵活配置混合型
场内简称	平安鼎越
交易代码	167002
前端交易代码	—
后端交易代码	—
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 20 日
报告期末基金份额总额	673,107,849.99 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，灵活运用大类资产配置、定向增发股票、债券投资策略等多种投资策略，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。按《基金合同》约定，本基金转型为上市开放式基（LOF）后，将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，充分挖掘市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值
投资策略	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。
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（ 2017 年 1 月 1 日 — 2017 年 3 月 31 日 ）
1. 本期已实现收益	1,109,485.25
2. 本期利润	218,838.49
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0003
4. 期末基金资产净值	667,844,664.59
5. 期末基金份额净值	0.9922

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

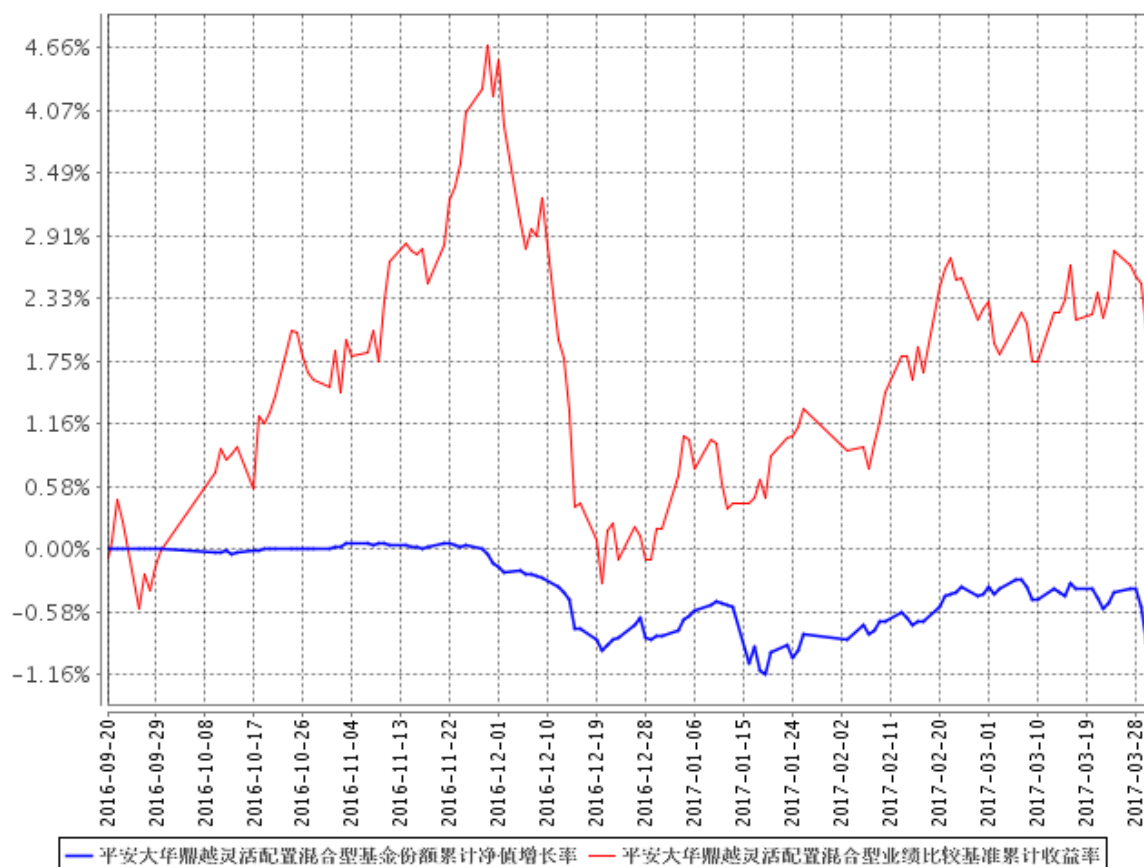
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.03%	0.12%	2.13%	0.26%	-2.10%	-0.14%

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%

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

平安大华鼎越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 9 月 20 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尚未完成建仓。

3.3 其他指标

本基金本报告期无需披露的其他指标。

§ 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		
刘俊廷	基金经理	2016 年 9 月 20 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。
--	--	--	--	--	---

1、此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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合规守信情况的说明

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、《平安大华鼎越定期开放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

2017 年 2 月 17 日，证监会对《上市公司非公开发行股票实施细则》部分条文进行了修订，发布了《发行监管问答—关于引导规范上市公司融资行为的监管要求》。再融资新规发布后，定增项目过审、获批节奏小幅度下降。截止 2017 年 3 月 31 日，本基金目前共累积投资定增项目约 1.9 亿元，定增基本建仓完毕。债券部分考虑到今年货币市场波动较大，暂时维持债券部分现有的杠杆情况。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 3 月 31 日，本基金份额净值为 0.9922 元，份额累计净值为 0.9922 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 2.13%。

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	181,087,820.37	22.24
	其中：股票	181,087,820.37	22.24
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	620,695,972.46	76.25
	其中：债券	620,695,972.46	76.25
	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	3,299,731.62	0.41
8	其他资产	8,997,221.92	1.11
9	合计	814,080,746.37	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	87,756,419.11	13.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,357,138.80	3.80
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	30,069,925.80	4.50
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,821,313.34	0.87
J	金融业	—	—

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	32,083,023.32	4.80
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	181,087,820.37	27.12

5.2.2 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。

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	002344	海宁皮城	3,151,574	32,083,023.32	4.80
2	600676	交运股份	3,496,503	30,069,925.80	4.50
3	000875	吉电股份	4,464,285	25,357,138.80	3.80
4	002073	软控股份	2,367,985	24,437,605.20	3.66
5	002157	正邦科技	2,459,016	14,877,046.80	2.23
6	000901	航天科技	348,476	11,078,052.04	1.66
7	600522	中天科技	1,039,501	10,322,244.93	1.55
8	600531	豫光金铅	1,328,040	10,119,664.80	1.52
9	300421	力星股份	322,690	9,951,759.60	1.49
10	002516	旷达科技	1,052,877	6,970,045.74	1.04

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	191,722,972.46	28.71
5	企业短期融资券	428,973,000.00	64.23
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	620,695,972.46	92.94

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	011698651	16 金圆投资 SCP001	400,000	39,908,000.00	5.98
2	112272	15 金科 01	320,000	32,246,400.00	4.83
3	011698782	16 海沧投资 SCP003	300,000	30,024,000.00	4.50
4	011698747	16 滇世博 SCP002	300,000	29,940,000.00	4.48
5	011698677	16 天富能源 SCP002	300,000	29,931,000.00	4.48
6	011698765	16 建发 SCP006	300,000	29,931,000.00	4.48

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。

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	4,216.03
2	应收证券清算款	800,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	8,193,005.89
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	8,997,221.92

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

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	002344	海宁皮城	32,083,023.32	4.80	非公开发行
2	600676	交运股份	30,069,925.80	4.50	非公开发行
3	000875	吉电股份	25,357,138.80	3.80	非公开发行
4	002073	软控股份	24,437,605.20	3.66	非公开发行
5	002157	正邦科技	14,877,046.80	2.23	非公开发行
6	000901	航天科技	11,078,052.04	1.66	非公开发行
7	600522	中天科技	10,322,244.93	1.55	非公开发行
8	600531	豫光金铅	10,119,664.80	1.52	非公开发行
9	300421	力星股份	9,951,759.60	1.49	非公开发行
10	002516	旷达科技	6,970,045.74	1.04	非公开发行

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	673,107,849.99
报告期期间基金总申购份额	—
减：报告期期间基金总赎回份额	—
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	673,107,849.99

§ 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

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未运用固有资金投资本基金。

§ 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	20170103--20170331	200,017,000.00	0	0	200,017,000.00	29.72%
	..						
个人							
产品特有风险							
流动性风险							

注：

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第三十八次会议审议通过，付强先生新任公司副总经理职务，任职日期为 2017 年 1 月 20 日，该事项已于 2017 年 1 月 23 日公告。

§ 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鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 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合同
- (3) 平安大华鼎越定期开放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越定期开放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

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
2017 年 4 月 24 日