平安大华行业先锋混合型证券投资基金
2017 年半年度报告 摘要

2017 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§1 重要提示

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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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。

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 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华行业先锋混合
场内简称	-
基金主代码	700001
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	2011 年 9 月 20 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
报告期末基金份额总额	271,733,088.71 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	深入研究中国宏观经济、证券市场发展过程中的结构性和趋势性规律，把握不同行业在此变化趋势中可行的投资机会，以超越业绩比较基准表现为首要投资目标，并以追求基金资产的长期稳健回报为最终投资目标。
投资策略	在大类资产配置中，从全球、区域的宏观层面（经济增长、通货膨胀和利息的预期）出发，依据工业增加值与 CPI 的变动划分经济周期的不同阶段（复苏、扩张、滞涨、萧条）。同时，将行业非系统风险均值与其分布的 GINI 系数结合运用，全面准确地判断大类资产风险程度和收益前景，统筹考量短、中、长期资产配置比例。股票投资在投资时钟策略基础上秉持自下而上选股理念，精选有成长潜力的优质股票构建投资组合。债券投资以目标久期管理和品种选择策略为主，以收益率利差策略、债券置换策略为辅，构造能获取稳定收益的固定收益类投资品种组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×85% + 中证全债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	王永民
	联系电话	0755-22626828	010-66594896
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-9,478,689.66
本期利润	-1,700,688.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0060
本期基金份额净值增长率	-0.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.1281
期末基金资产净值	306,545,147.38
期末基金份额净值	1.128

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，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

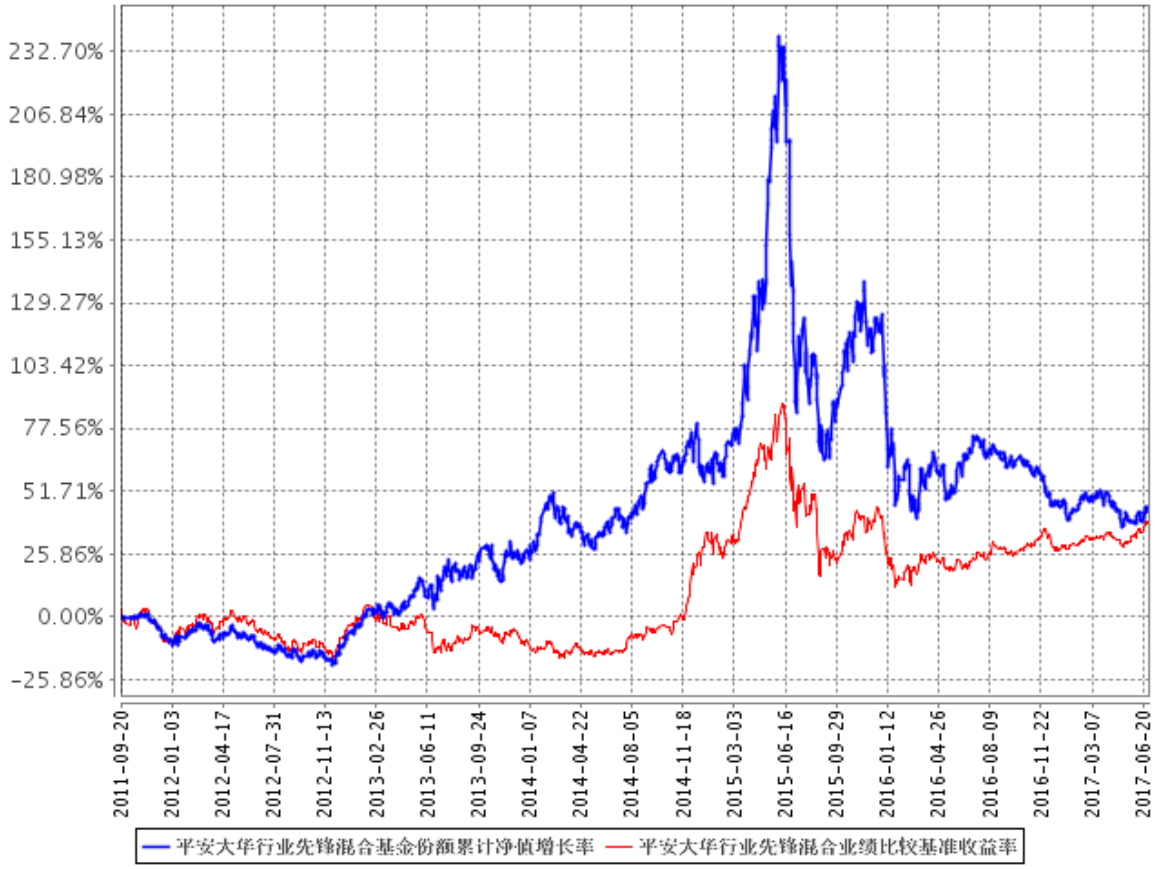
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.87%	0.92%	4.41%	0.57%	-0.54%	0.35%
过去三个月	-2.00%	0.94%	5.20%	0.53%	-7.20%	0.41%
过去六个月	-0.62%	0.88%	9.08%	0.48%	-9.70%	0.40%
过去一年	-13.83%	0.89%	13.77%	0.57%	-27.60%	0.32%
过去三年	1.99%	2.10%	62.39%	1.49%	-60.40%	0.61%
自基金合同生效起至今	44.41%	1.74%	39.18%	1.32%	5.23%	0.42%

注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×85% + 中证全债指数收益率×15%。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。中证全债指数从沪深交易所和银行间市场挑选国债、金融债及企业债组成样本券，最大限度地涵盖了中国固定收益市场可供投资的产品，已成为广受投资者认可的投资中国固定收益市场的基准指标。本基金为混合型基金，通常状况下基金在运作过程中股票资产将在 80%-90%范围内调整，中长期可能的股票仓位平均在 85%左右。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准的权重分别是 85%和 15%。因此，该基准是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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

平安大华行业先锋混合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 2011 年 9 月 20 日正式生效，截至报告期末已满五年；

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.

§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"平安大华"）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安大华总部位于深圳，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，持有股份 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股份 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份 14.3%。

平安大华秉承“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，不断丰富的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.截至到 2017 年二季度末，公司旗下共有 39 只公募基金，公募基金管理规模突破 1200 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		
傅浩	平安大华行业先锋混合证券投资基金的基金经理	2016 年 8 月 16 日	-	8 年	中山大学金融学硕士，8 年证券从业经验，曾任国都证券有限责任公司行业研究员、广发证券资产管理（广东）有限公司投资经理，2016 年 5 月加入平安大华基金管理公司，任投资研究部投资经理，现任平安大华行业先锋混合型证券投资基金、平安大华智能生活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”和“离任日期”均指公司作出决定后正式对外公告之日。

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、《平安大华行业先锋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。

4.3.2 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 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

一季度 A 股市场迎来春季行情，市场热点和投资机会较多。一方面，围绕着经济复苏主线展开行情，投资主线以偏周期的钢铁、建筑为代表。另一方面，以白酒和家电为代表的稳定增长消费板块也稳步上涨。在一季度，产品组合主要围绕经济复苏主线布局了偏周期的建筑和钢铁建材板块，获得了一定的投资收益，但周期板块波动较大，持续性不如消费板块，总体上看，一季度的配置虽然抓住了部分热点板块，但和今年以来的主流行情板块还是有所偏差。

4 月份以来 A 股市场经历了较大的波动，我们认为存在政策和流动性两方面的原因。在 4-5 月份市场经历短期的风险偏好上升后快速回落，加上金融去杠杆对市场流动性的边际负面影响，市场经历今年以来最大的一波单边下跌。6 月初，央行为防止季末流动性紧张的局面出现，提前在月初进行了一系列公开市场操作改善市场的流动性状况，这带来了 6 月份市场的反弹。

产品组合净值在 4-5 月份回撤较大，客观上有市场整体单边下跌的因素，主观上来看，在 4 月份我们对于金融去杠杆政策的影响估计不足导致组合仓位保持在较高的水平。配置方向上看，我们虽然配置了较高比例的大消费，但是也存在例如“一带一路“这类回调较大的板块配置，并没有有效规避市场的下跌。

4.4.2 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 1.128 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.62%，业绩比较基准收益率为 9.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前的时点，我们认为市场整体的大环境没有发生大的变化：1）市场利率在金融去杠杆的大环境下易上难下。2）在监管趋严的大环境下，市场风险偏好难以出现大幅上行，市场对

业绩的确定性和低估值板块和行业的偏好短期难以改变。我们认为未来改变这种格局事件可能是：1）经济超预期下滑，货币政策重回宽松。2）十九大后改革力度加强，市场风险偏好快速回升。

基于以上判断，下半年以大消费为代表的低估值蓝筹板块和行业依然会是我们配置的主线。同时，基于对明年的布局，我们会逐步关注中长期成长逻辑确定的板块，包括：新能源汽车产业链、消费电子、5G 产业链等成长性板块。

4.6 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、运营部及法律合规监察部相关人员组成。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 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 万人民币的情形。

§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华行业先锋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，对本基金管理人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的复核，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。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安大华行业先锋混合型证券投资基金
报告截止日： 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		29,364,789.24	63,667,328.12
结算备付金		4,414,249.69	7,689,165.58
存出保证金		296,115.77	349,882.09
交易性金融资产		266,535,083.15	254,004,613.94
其中：股票投资		266,535,083.15	254,004,613.94
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		10,844,703.46	12,840,990.26
应收利息		6,801.00	11,280.19
应收股利		-	-
应收申购款		11,893.88	200,718.33
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		311,473,636.19	338,763,978.51
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 6 月 30 日**	**上年度末 2016 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,065,495.98
应付赎回款		458,573.43	123,303.26
应付管理人报酬		373,806.75	431,331.33
应付托管费		62,301.12	71,888.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,679,162.03	3,217,876.45
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,354,645.48	1,346,083.10
负债合计		4,928,488.81	6,255,978.67
所有者权益：			
实收基金		271,733,088.71	292,993,192.19
未分配利润		34,812,058.67	39,514,807.65
所有者权益合计		306,545,147.38	332,507,999.84
负债和所有者权益总计		311,473,636.19	338,763,978.51

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.128 元，基金份额总额 271,733,088.71 份。

6.2 利润表

会计主体：平安大华行业先锋混合型证券投资基金
本报告期： 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		10,128,146.67	-120,028,710.99
1.利息收入		210,217.80	288,037.88
其中：存款利息收入		210,217.80	264,428.65
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	23,609.23
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,129,852.73	-66,198,951.45
其中：股票投资收益		-361,467.31	-67,201,533.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,491,320.04	1,002,582.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		7,778,001.44	-54,156,685.89
4. 汇兑收益 （损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		10,074.70	38,888.47
减：二、费用		11,828,834.89	7,267,352.98

1．管理人报酬		2,380,745.47	2,982,195.68
2．托管费		396,790.93	497,032.57
3．销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4．交易费用		8,842,257.74	3,559,236.41
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用		209,040.75	228,888.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,700,688.22	-127,296,063.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,700,688.22	-127,296,063.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华行业先锋混合型证券投资基金
本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	292,993,192.19	39,514,807.65	332,507,999.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-1,700,688.22	-1,700,688.22
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）	-21,260,103.48	-3,002,060.76	-24,262,164.24
其中：1.基金申购款	11,076,955.20	1,442,714.80	12,519,670.00
2.基金赎回款	-32,337,058.68	-4,444,775.56	-36,781,834.24
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）	271,733,088.71	34,812,058.67	306,545,147.38
项目	**上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	310,965,843.57	222,618,854.41	533,584,697.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-127,296,063.97	-127,296,063.97
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）	8,209,517.60	3,263,880.58	11,473,398.18
其中：1.基金申购款	48,714,653.02	13,057,668.81	61,772,321.83
2.基金赎回款	-40,505,135.42	-9,793,788.23	-50,298,923.65
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）	319,175,361.17	98,586,671.02	417,762,032.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风	林婉文	胡明
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安大华行业先锋混合型证券投资基金(原名为平安大华行业先锋股票型证券投资基金，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[2011]第 1111 号《关于核准平安大华行业先锋股票型证券投资基金募集的批复》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《平安大华行业先锋股票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 3,197,219,239.94 元，经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2011)验字第 60937497_H01 号验资报告。经向中国证监会备案，《平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,198,155,247.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 936,007.43 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，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，平安大华行业先锋股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 5 日公告后更名为平安大华行业先锋混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华行业先锋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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规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。本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×85% + 中证全债指数收益率×15%。

6.4.2 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》、《平安大华行业先锋混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的会计差错更正。

6.4.5 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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人股东
大华资产管理有限公司	基金管理人股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人股东
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
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
平安银行股份有限公司	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安证券股份有限公司	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
上海陆金所资产管理有限公司	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
平安证券	319,661,434.42	5.10%	355,712,549.87	14.57%

6.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.7.1.4 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。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
平安证券	297,700.93	5.77%	237,782.36	8.88%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
平安证券	331,276.02	15.68%	5,452.78	0.47%

注：

1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,380,745.47	2,982,195.68
其中：支付销售机构的客户维护费	622,799.58	763,618.52

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人管理费按前一日基金资产净值 1.50%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：

日管理人管理费＝前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付	396,790.93	497,032.57

的托管费		

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算方法如下：

日托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.7.2.3 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。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 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期期末和上年度可比期末均未投资本基金。

6.4.7.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
深圳中行存款	29,364,789.24	165,445.31	57,051,568.84	237,459.43

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.8 期末（ 2017 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600795	国电电力	2017 年 6 月	重大事项	3.60	-	-	850,400	3,001,912.00	3,061,440.00	-

		5 日								
002291	星期六	2017 年 6 月 5 日	重大事项	15.12	2017 年 7 月 5 日	13.78	86,409	1,457,071.44	1,306,504.08	-
603238	诺邦股份	2017 年 5 月 15 日	重大事项	29.38	2017 年 8 月 23 日	31.99	1,750	23,292.50	51,415.00	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.9.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.9.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.9.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 08 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 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	266,535,083.15	85.57
	其中：股票	266,535,083.15	85.57
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	33,779,038.93	10.84
7	其他各项资产	11,159,514.11	3.58
8	合计	311,473,636.19	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	4,527,426.00	1.48
C	制造业	207,164,618.24	67.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,061,440.00	1.00
E	建筑业	7,558,873.00	2.47
F	批发和零售业	19,678,305.80	6.42
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00

J	金融业	187,943.49	0.06
K	房地产业	18,239,977.00	5.95
L	租赁和商务服务业	3,086,368.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,022,492.00	0.99
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	266,535,083.15	86.95

7.2.2 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。

7.3 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

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	600104	上汽集团	722,238	22,425,489.90	7.32
2	000651	格力电器	421,998	17,373,657.66	5.67
3	000858	五 粮 液	282,352	15,715,712.32	5.13
4	002241	歌尔股份	639,743	12,334,245.04	4.02
5	000333	美的集团	286,331	12,323,686.24	4.02
6	000050	深天马A	552,252	11,359,823.64	3.71
7	603626	科森科技	158,750	10,347,325.00	3.38
8	000725	京东方A	2,220,600	9,237,696.00	3.01
9	000959	首钢股份	1,315,798	9,197,428.02	3.00
10	600048	保利地产	921,600	9,188,352.00	3.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600068	葛洲坝	61,176,608.51	18.40
2	601668	中国建筑	58,640,069.14	17.64
3	601336	新华保险	55,522,137.98	16.70
4	000049	德赛电池	52,696,723.39	15.85
5	002456	欧菲光	49,154,159.46	14.78
6	000651	格力电器	48,438,856.92	14.57
7	601117	中国化学	44,589,061.93	13.41
8	000725	京东方Ａ	44,454,300.00	13.37
9	600153	建发股份	43,695,575.60	13.14
10	600690	青岛海尔	40,895,407.78	12.30
11	000059	华锦股份	38,487,648.19	11.57
12	002616	长青集团	38,028,728.77	11.44
13	601111	中国国航	37,575,604.87	11.30
14	000333	美的集团	37,572,555.76	11.30
15	601800	中国交建	37,216,378.41	11.19
16	000709	河钢股份	36,984,967.72	11.12
17	600585	海螺水泥	36,813,945.04	11.07
18	000018	神州长城	36,361,161.47	10.94
19	002271	东方雨虹	36,057,574.36	10.84
20	601186	中国铁建	35,493,979.08	10.67
21	300136	信维通信	34,938,508.62	10.51
22	000858	五 粮 液	34,120,587.58	10.26
23	001979	招商蛇口	33,890,123.22	10.19
24	002241	歌尔股份	31,609,763.85	9.51
25	002475	立讯精密	30,210,658.29	9.09
26	603993	洛阳钼业	29,990,066.00	9.02
27	002573	清新环境	28,868,919.71	8.68
28	600240	华业资本	27,828,192.86	8.37
29	600104	上汽集团	27,495,824.20	8.27
30	000921	海信科龙	27,281,689.29	8.20

31	600362	江西铜业	26,611,782.25	8.00
32	600887	伊利股份	26,609,251.82	8.00
33	002108	沧州明珠	26,595,155.98	8.00
34	600884	杉杉股份	25,886,036.73	7.79
35	000980	众泰汽车	25,329,474.09	7.62
36	000910	大亚圣象	24,746,581.66	7.44
37	300237	美晨科技	24,286,410.27	7.30
38	000418	小天鹅Ａ	24,283,996.58	7.30
39	601233	桐昆股份	23,697,817.28	7.13
40	000789	万年青	23,539,518.68	7.08
41	600547	山东黄金	23,098,355.71	6.95
42	000065	北方国际	22,690,186.53	6.82
43	601689	拓普集团	22,499,322.75	6.77
44	002511	中顺洁柔	21,296,610.18	6.40
45	600886	国投电力	20,410,550.70	6.14
46	600660	福耀玻璃	20,317,071.67	6.11
47	000983	西山煤电	20,081,461.47	6.04
48	601009	南京银行	19,181,508.00	5.77
49	300124	汇川技术	19,128,250.90	5.75
50	002353	杰瑞股份	18,441,023.46	5.55
51	601601	中国太保	18,006,950.94	5.42
52	601989	中国重工	17,869,247.60	5.37
53	000090	天健集团	17,653,928.21	5.31
54	002831	裕同科技	17,647,564.62	5.31
55	002236	大华股份	17,639,904.97	5.31
56	600038	中直股份	17,548,002.22	5.28
57	603626	科森科技	17,483,886.11	5.26
58	600048	保利地产	17,376,964.60	5.23
59	600019	宝钢股份	16,580,280.00	4.99
60	600166	福田汽车	16,557,473.00	4.98
61	601155	新城控股	16,546,337.77	4.98
62	000899	赣能股份	16,507,987.55	4.96
63	300450	先导智能	16,487,207.70	4.96
64	601611	中国核建	16,462,862.00	4.95
65	600569	安阳钢铁	16,383,913.00	4.93
66	600015	华夏银行	15,967,294.00	4.80

67	601225	陕西煤业	15,928,483.08	4.79
68	002372	伟星新材	15,684,354.73	4.72
69	600029	南方航空	15,278,915.00	4.60
70	600518	康美药业	15,238,351.26	4.58
71	600340	华夏幸福	15,216,548.74	4.58
72	300034	钢研高纳	15,208,323.72	4.57
73	601628	中国人寿	15,135,166.43	4.55
74	600425	*ST 青松	14,924,152.00	4.49
75	600966	博汇纸业	14,859,155.36	4.47
76	600521	华海药业	14,571,025.69	4.38
77	000423	东阿阿胶	14,296,262.00	4.30
78	603898	好莱客	13,922,433.45	4.19
79	002035	华帝股份	13,839,677.92	4.16
80	000050	深天马Ａ	13,834,529.21	4.16
81	600507	方大特钢	13,751,239.00	4.14
82	600326	西藏天路	13,656,628.00	4.11
83	000151	中成股份	13,363,516.37	4.02
84	300410	正业科技	13,238,723.26	3.98
85	600867	通化东宝	13,161,768.00	3.96
86	600276	恒瑞医药	13,113,340.62	3.94
87	603186	华正新材	13,013,568.43	3.91
88	601818	光大银行	12,903,818.00	3.88
89	002045	国光电器	12,627,042.22	3.80
90	600983	惠而浦	12,371,408.17	3.72
91	002508	老板电器	12,298,173.64	3.70
92	000581	威孚高科	12,270,398.86	3.69
93	000002	万　科Ａ	12,264,897.88	3.69
94	002677	浙江美大	11,979,107.40	3.60
95	601939	建设银行	11,854,354.00	3.57
96	000786	北新建材	11,813,988.40	3.55
97	002611	东方精工	11,757,405.70	3.54
98	300424	航新科技	11,576,009.10	3.48
99	600110	诺德股份	11,284,833.30	3.39
100	000823	超声电子	11,104,741.98	3.34
101	300258	精锻科技	10,857,591.23	3.27
102	002635	安洁科技	10,659,874.20	3.21

103	601231	环旭电子	10,544,970.34	3.17
104	000860	顺鑫农业	10,387,088.20	3.12
105	600096	云天化	10,305,863.42	3.10
106	600307	酒钢宏兴	10,156,604.20	3.05
107	000703	恒逸石化	10,134,570.44	3.05
108	600036	招商银行	10,119,171.46	3.04
109	601766	中国中车	10,114,438.36	3.04
110	601211	国泰君安	10,110,024.90	3.04
111	000800	一汽轿车	10,091,168.56	3.03
112	002215	诺 普 信	10,081,257.51	3.03
113	300152	科融环境	10,069,626.65	3.03
114	000666	经纬纺机	10,046,362.07	3.02
115	300183	东软载波	10,045,658.33	3.02
116	000563	陕国投Ａ	9,982,011.00	3.00
117	300093	金刚玻璃	9,950,752.00	2.99
118	002080	中材科技	9,895,555.97	2.98
119	002185	华天科技	9,769,823.00	2.94
120	600285	羚锐制药	9,726,829.99	2.93
121	603040	新坐标	9,720,807.00	2.92
122	600885	宏发股份	9,693,058.39	2.92
123	600452	涪陵电力	9,613,561.50	2.89
124	600266	北京城建	9,265,988.00	2.79
125	000959	首钢股份	9,215,315.42	2.77
126	000568	泸州老窖	9,097,274.00	2.74
127	601288	农业银行	9,074,050.00	2.73
128	600741	华域汽车	9,055,928.40	2.72
129	000069	华侨城Ａ	9,055,417.28	2.72
130	300433	蓝思科技	9,033,234.94	2.72
131	002032	苏 泊 尔	9,014,737.18	2.71
132	601006	大秦铁路	9,001,322.00	2.71
133	002705	新宝股份	8,976,753.00	2.70
134	002303	美盈森	8,280,122.71	2.49
135	002262	恩华药业	8,229,873.87	2.48
136	600977	中国电影	8,103,329.00	2.44
137	000822	山东海化	8,097,717.00	2.44
138	600720	祁连山	8,093,872.85	2.43

139	000898	鞍钢股份	7,797,514.00	2.35
140	601398	工商银行	7,557,323.00	2.27
141	000968	蓝焰控股	7,302,222.55	2.20
142	002622	融钰集团	6,728,696.82	2.02
143	600006	东风汽车	6,704,393.00	2.02
144	300106	西部牧业	6,703,736.95	2.02
145	600237	铜峰电子	6,700,623.00	2.02
146	600809	山西汾酒	6,697,586.00	2.01
147	300001	特锐德	6,684,772.95	2.01
148	300153	科泰电源	6,674,472.76	2.01
149	000852	石化机械	6,669,842.00	2.01
150	000998	隆平高科	6,668,117.00	2.01
151	600388	龙净环保	6,666,852.00	2.01
152	000597	东北制药	6,657,469.54	2.00
153	600060	海信电器	6,653,408.00	2.00
154	600557	康缘药业	6,652,519.52	2.00

买入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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600068	葛洲坝	67,901,571.18	20.42
2	000049	德赛电池	60,099,374.22	18.07
3	000018	神州长城	57,581,943.70	17.32
4	601668	中国建筑	57,414,628.25	17.27
5	601336	新华保险	54,891,357.66	16.51
6	002456	欧菲光	52,199,206.21	15.70
7	000725	京东方 A	44,829,476.52	13.48
8	601117	中国化学	44,712,011.27	13.45
9	000059	华锦股份	42,485,234.15	12.78
10	002616	长青集团	40,329,577.02	12.13
11	600690	青岛海尔	40,286,357.61	12.12
12	601800	中国交建	39,558,384.81	11.90
13	601111	中国国航	38,612,032.30	11.61
14	002475	立讯精密	37,808,801.16	11.37
15	300136	信维通信	36,610,623.45	11.01

16	600585	海螺水泥	36,596,817.15	11.01
17	000709	河钢股份	36,316,152.06	10.92
18	601233	桐昆股份	36,018,048.56	10.83
19	601186	中国铁建	35,287,586.92	10.61
20	000651	格力电器	34,522,606.21	10.38
21	001979	招商蛇口	34,419,568.40	10.35
22	002271	东方雨虹	34,139,979.12	10.27
23	000065	北方国际	33,897,141.56	10.19
24	600153	建发股份	33,491,997.71	10.07
25	603993	洛阳钼业	29,208,507.12	8.78
26	002108	沧州明珠	27,230,987.64	8.19
27	600240	华业资本	27,197,995.13	8.18
28	600362	江西铜业	27,054,416.44	8.14
29	600887	伊利股份	26,814,145.34	8.06
30	000910	大亚圣象	26,350,986.50	7.92
31	002573	清新环境	25,427,796.17	7.65
32	000333	美的集团	25,105,011.58	7.55
33	000921	海信科龙	25,087,286.40	7.54
34	000418	小天鹅Ａ	24,671,500.68	7.42
35	300237	美晨科技	24,273,065.35	7.30
36	000789	万年青	24,078,578.78	7.24
37	601989	中国重工	23,977,734.12	7.21
38	000980	众泰汽车	23,582,025.90	7.09
39	600547	山东黄金	22,588,408.70	6.79
40	000423	东阿阿胶	22,253,551.90	6.69
41	601689	拓普集团	22,113,650.56	6.65
42	002241	歌尔股份	20,671,116.16	6.22
43	600884	杉杉股份	20,613,190.79	6.20
44	600886	国投电力	20,612,637.14	6.20
45	601009	南京银行	19,773,708.00	5.95
46	002511	中顺洁柔	19,747,048.00	5.94
47	000983	西山煤电	19,444,091.55	5.85
48	000858	五 粮 液	19,172,701.62	5.77
49	600110	诺德股份	19,050,329.59	5.73
50	300124	汇川技术	18,929,457.58	5.69
51	601601	中国太保	18,832,186.54	5.66
52	002353	杰瑞股份	18,268,630.19	5.49
53	000090	天健集团	18,259,903.32	5.49

54	600569	安阳钢铁	18,095,514.23	5.44
55	600166	福田汽车	18,087,898.00	5.44
56	300450	先导智能	17,552,014.97	5.28
57	002831	裕同科技	17,521,679.78	5.27
58	600038	中直股份	17,432,816.54	5.24
59	002236	大华股份	17,299,258.14	5.20
60	601155	新城控股	16,721,189.23	5.03
61	000899	赣能股份	16,692,012.51	5.02
62	601611	中国核建	16,636,452.03	5.00
63	000703	恒逸石化	16,479,198.86	4.96
64	600019	宝钢股份	16,403,546.00	4.93
65	600518	康美药业	16,384,417.86	4.93
66	600015	华夏银行	16,220,079.11	4.88
67	600966	博汇纸业	16,207,460.47	4.87
68	300034	钢研高纳	15,949,823.57	4.80
69	601225	陕西煤业	15,903,185.03	4.78
70	000538	云南白药	15,326,445.18	4.61
71	600565	迪马股份	15,275,508.60	4.59
72	601628	中国人寿	15,154,127.05	4.56
73	600340	华夏幸福	15,006,039.00	4.51
74	600029	南方航空	14,712,160.52	4.42
75	600660	福耀玻璃	14,623,622.74	4.40
76	002372	伟星新材	14,549,470.17	4.38
77	600425	*ST 青松	13,865,130.00	4.17
78	601818	光大银行	13,465,656.00	4.05
79	002045	国光电器	13,129,387.75	3.95
80	002035	华帝股份	13,119,324.42	3.95
81	600326	西藏天路	13,116,438.23	3.94
82	600867	通化东宝	13,053,404.31	3.93
83	600507	方大特钢	13,046,389.04	3.92
84	600787	中储股份	12,956,354.62	3.90
85	603898	好莱客	12,836,502.43	3.86
86	603186	华正新材	12,706,450.89	3.82
87	600983	惠而浦	12,397,450.14	3.73
88	300410	正业科技	12,255,053.09	3.69
89	000151	中成股份	12,245,640.68	3.68
90	300424	航新科技	12,226,674.40	3.68
91	002611	东方精工	12,167,243.49	3.66

92	601939	建设银行	12,150,985.00	3.65
93	000581	威孚高科	12,110,203.59	3.64
94	002677	浙江美大	12,076,131.74	3.63
95	002508	老板电器	12,001,224.83	3.61
96	000786	北新建材	11,836,163.23	3.56
97	600096	云天化	11,538,816.00	3.47
98	600521	华海药业	11,452,322.38	3.44
99	002291	星期六	11,386,617.19	3.42
100	000666	经纬纺机	11,032,545.38	3.32
101	000823	超声电子	10,835,156.88	3.26
102	002384	东山精密	10,781,138.00	3.24
103	601231	环旭电子	10,780,274.61	3.24
104	600036	招商银行	10,279,855.08	3.09
105	300152	科融环境	10,236,255.21	3.08
106	000860	顺鑫农业	10,048,994.57	3.02
107	600276	恒瑞医药	10,023,410.84	3.01
108	601211	国泰君安	9,984,604.00	3.00
109	300093	金刚玻璃	9,963,906.05	3.00
110	601766	中国中车	9,960,824.16	3.00
111	002080	中材科技	9,936,225.24	2.99
112	002215	诺 普 信	9,915,963.63	2.98
113	000563	陕国投A	9,911,492.00	2.98
114	002185	华天科技	9,865,977.57	2.97
115	300258	精锻科技	9,791,161.34	2.94
116	000800	一汽轿车	9,760,341.94	2.94
117	600720	祁连山	9,723,897.45	2.92
118	300332	天壕环境	9,543,944.38	2.87
119	600885	宏发股份	9,532,425.21	2.87
120	600452	涪陵电力	9,492,125.65	2.85
121	300183	东软载波	9,490,205.61	2.85
122	300433	蓝思科技	9,472,419.16	2.85
123	000568	泸州老窖	9,297,509.00	2.80
124	601288	农业银行	9,186,437.00	2.76
125	600307	酒钢宏兴	9,152,173.54	2.75
126	601006	大秦铁路	8,977,965.00	2.70
127	600141	兴发集团	8,878,003.78	2.67
128	000069	华侨城A	8,800,127.80	2.65
129	603040	新坐标	8,797,347.00	2.65

130	002705	新宝股份	8,713,256.09	2.62
131	600266	北京城建	8,457,471.28	2.54
132	603626	科森科技	8,296,641.82	2.50
133	002262	恩华药业	8,119,885.75	2.44
134	000822	山东海化	7,861,890.00	2.36
135	002303	美盈森	7,851,335.09	2.36
136	600048	保利地产	7,822,121.00	2.35
137	000898	鞍钢股份	7,807,448.99	2.35
138	600977	中国电影	7,744,031.30	2.33
139	601398	工商银行	7,585,463.80	2.28
140	000100	TCL 集团	7,227,856.00	2.17
141	600150	中国船舶	6,987,270.00	2.10
142	300153	科泰电源	6,874,482.52	2.07
143	300001	特锐德	6,868,882.39	2.07
144	000852	石化机械	6,721,128.07	2.02
145	000597	东北制药	6,718,232.82	2.02
146	600809	山西汾酒	6,701,751.00	2.02
147	600006	东风汽车	6,701,577.00	2.02

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。

7.4.3 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	3,135,869,986.16
卖出股票收入（成交）总额	3,130,756,051.08

“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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

本基金本报告期内未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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情况。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 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情况。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	296,115.77
2	应收证券清算款	10,844,703.46
3	应收股利	-
4	应收利息	6,801.00
5	应收申购款	11,893.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,159,514.11

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
12,489	21,757.79	8,195,727.00	3.02%	263,537,361.71	96.98%

8.2 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	125,356.84	0.0461%

8.3 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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2011 年 9 月 20 日 ）基金份额总额	3,198,155,247.37
本报告期期初基金份额总额	292,993,192.19
本报告期基金总申购份额	11,076,955.20
减:本报告期基金总赎回份额	32,337,058.68
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	271,733,088.71

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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三十八次会议审议通过，由付强先生任职公司副总经理，任职日期为 2017 年 1 月 20 日。

2、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由李兆良先生、李娟娟女士、刘雪生先生、潘汉腾先生接替曹勇先生、刘茂山先生、郑学定先生、黄士林先生任职公司第三届董事会董事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

3、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由巢傲文先生、李峥女士接替张云平、毛晴峰先生为第三届监事会监事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用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。

10.6 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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
兴业证券	2	609,247,396.86	9.73%	435,910.04	8.45%	-
民生证券	2	596,912,584.91	9.53%	436,522.46	8.47%	-
银河证券	2	461,869,113.27	7.38%	430,139.29	8.34%	-
广发证券	1	411,379,083.92	6.57%	383,118.09	7.43%	-
国金证券	1	398,361,327.98	6.36%	370,991.70	7.20%	-
国信证券	2	396,677,024.17	6.33%	290,089.28	5.63%	-
华泰证券	1	337,166,023.99	5.38%	239,826.27	4.65%	-
中金公司	2	332,924,150.02	5.32%	310,052.21	6.01%	-
招商证券	2	329,717,523.50	5.26%	307,067.20	5.96%	-
东方证券	2	327,093,713.91	5.22%	239,204.61	4.64%	-
平安证券	2	319,661,434.42	5.10%	297,700.93	5.77%	-
安信证券	2	248,243,401.52	3.96%	181,539.93	3.52%	-
西南证券	1	241,934,124.26	3.86%	172,087.97	3.34%	-
中信证券	2	231,327,984.72	3.69%	215,436.34	4.18%	-
中信建投	1	224,069,597.78	3.58%	163,862.51	3.18%	-

长江证券	1	214,990,564.20	3.43%	200,220.26	3.88%	-
方正证券	2	166,328,863.23	2.66%	154,902.00	3.00%	-
国泰君安	3	147,908,518.01	2.36%	105,207.26	2.04%	-
申万证券	2	146,965,199.68	2.35%	136,868.11	2.65%	-
长城证券	2	77,325,525.80	1.23%	55,001.78	1.07%	-
中银证券	1	42,463,866.40	0.68%	30,204.85	0.59%	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、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

3、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。

10.7.2 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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

平安证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
西南证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
申万证券	–	–	–	–	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
中银证券	–	–	–	–	–	–
国海证券	–	–	–	–	–	–
中航证券	–	–	–	–	–	–
湘财证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–

平安大华基金管理有限公司
2017 年 8 月 28 日