

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金
2017 年半年度报告

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：平安银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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。

基金托管人平安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 25 日起至 6 月 30 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
7.7 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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64

11.1 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.....	64
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金
基金简称	平安大华中证沪港深高股息
场内简称	-
基金主代码	003702
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	2017 年 1 月 25 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	32,127,393.08 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	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证沪港深高股息精选指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分

	<p>红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	中证沪港深高股息精选指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。</p> <p>本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>

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		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34	深圳市罗湖区深南东路 5047 号

	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	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、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

§ 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 25 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,286,432.91
本期利润	1,866,075.95
加权平均基金份额本期利润	0.0228
本期加权平均净值利润率	2.28%
本期基金份额净值增长率	3.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	648,426.54
期末可供分配基金份额利润	0.0202
期末基金资产净值	33,156,978.17
期末基金份额净值	1.0320
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.20%

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	2.86%	0.53%	2.87%	0.53%	-0.01%	0.00%
过去三个月	2.56%	0.42%	2.46%	0.54%	0.10%	-0.12%
自基金合同 生效起至今	3.20%	0.33%	8.18%	0.56%	-4.98%	-0.23%

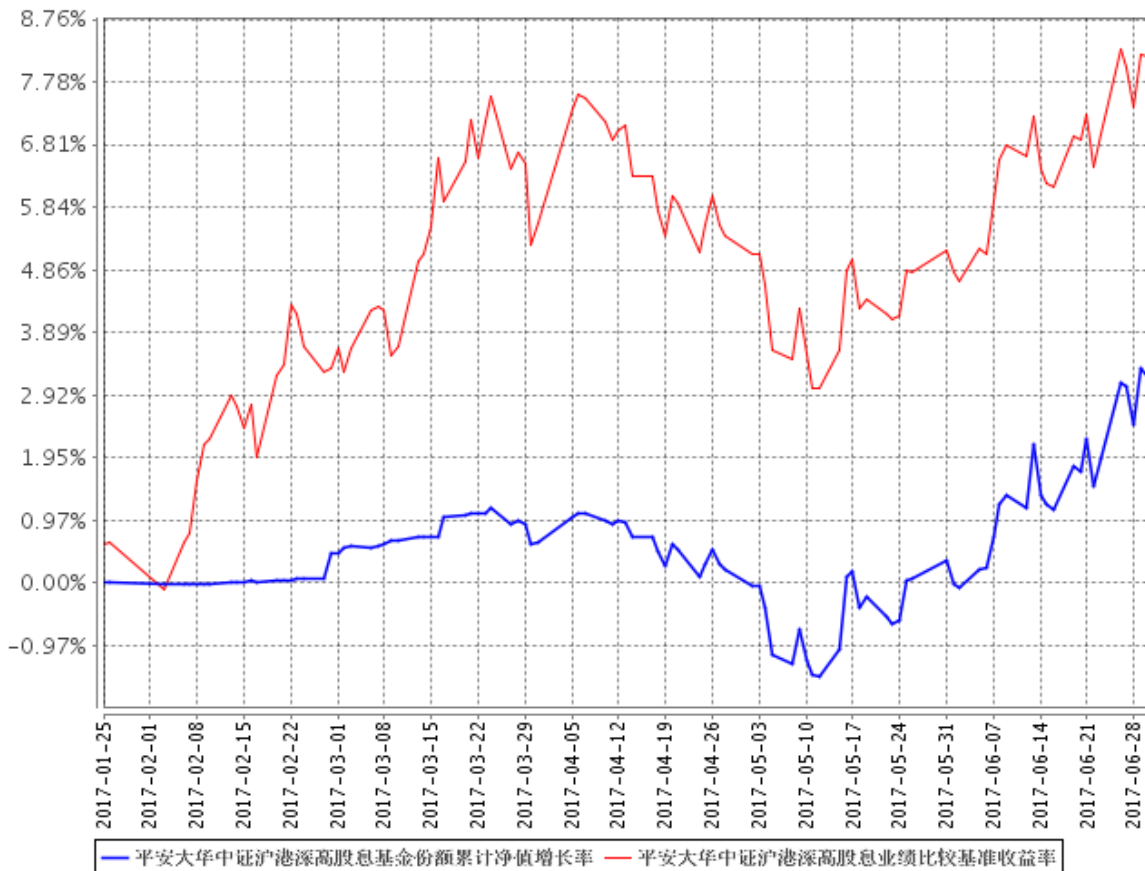
业绩比较基准： $\text{中证沪港深高股息精选指数收益率} \times 95\% + \text{银行人民币活期存款利率 (税后)} \times 5\%$ 。

中证沪港深高股息精选指数是寻求盈利能力高、盈利具有持续性且兼具合理成长性特征的中小公司。根据本基金的投资范围约束， $\text{中证沪港深高股息精选指数收益率} \times 95\% + \text{银行人民币活期存款利率 (税后)} \times 5\%$ 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

平安大华中证沪港深高股息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 2017 年 1 月 25 日正式生效，截至报告期末未半年；
- 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。

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

§ 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 亿元人民币。

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		
施旭	平安大华 中证沪港 深高股息 精选指数 型证券投资 基金的 基金经理	2017 年 1 月 25 日	-	7 年	施旭先生，哥伦比亚大学金融数学硕士，曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券，于 2015 年加入平安大华基金，任衍生品投资中心量化研究员，现任平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、平

					安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票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

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、《平安大华中证沪港深高股息精选指数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。

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

回顾 2017 年上半年，A 股在监管趋严，新股持续发行、利率上行、和防范金融风险的大背景之下，市场的风险偏好和定价水平显著的反映了监管政策所带来的巨大的变化。从整体来看，上半年个股和行业分化明显，市场一方面走出了一轮以食品、家电、非银和银行等几个行业为主线，消费白马、细分行业龙头表现强势的行情，另一方面，市场中估值较高、市值偏肖、盈利确定性差的股票确经历了一个不断的寻底的过程，两极分化比较严重，市场整体的风险偏好水平和波动率较往年有明显下降，偏价值的投资策略上半年比较占优，在宏观和政策层面均存在很大不确定性的市场里，市场资金对盈利确定性和增长确定性表现出了明显的偏好。回顾港股市场，一方面，基于对特朗普政策和欧洲大选等不确定性因素的担忧，海外资金回流，港股配置需求明显，另一方面，随着沪深港通和两地互联互通的不断深入，内地资金不断南下配置具有估值优势的港股，同时，我们也看到香港主要的上市公司盈利较去年有所改善。从年初以来港股市场持续上涨，恒指表现强势，香港部分行业和个股出现了估值重构的迹象。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0320 元，份额累计净值为 1.0320 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 3.20%，同期业绩基准增长率为 8.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为 A 股市场的监管环境将大概率延续总体偏严防风险的环境，货币易紧难松，货币政策是否出现重大变化，还需要密切观察下半年整体经济下行的压力，但目前白马蓝筹股行情仍在继续，趋势仍未打破，成长类的中小市值开始逐步企稳，市场有望出现价值和成长交替震荡向上的走势，价值股和高股息类个股仍将收到市场偏爱。从港股的角度看，虽然我们经历了上半年的大幅上涨，但在全球来看，港股的估值仍然明显的低于美国、欧洲和亚太地区其他

几个主要的资本市场，伴随着企业盈利的进一步改善和两地互联互通的不断深入，两地的市场估值体系将出现逐步趋同的趋势，高股息价值股大概率将继续受到市场追捧，市场向上的趋势，在出现重大的外生影响因素之前，将大概率延续。本基金将继续采用严格的指数跟踪的投资方式，复制中证沪港深高股息指数，配置两地具有高股息属性，并且在公司质量、估值、成长、和财务风险各方面具有优势的个股，在保证基金仓位及现金流流动性的前提下，严格跟踪指数，控制跟踪误差，实现投资收益。

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、程序及方法的科学性合理性，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

本基金本报告期内自 3 月 17 日至 6 月 5 日，出现连续 52 个工作日基金资产净值低于 5000 万的情形。截止本报告期末，以上情形未消除。

§ 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”）在对平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金（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：平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

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	6.4.7.1	2,317,760.79	-
结算备付金		69,252.21	-
存出保证金		9,743.68	-
交易性金融资产	6.4.7.2	31,207,511.46	-
其中：股票投资		31,207,511.46	-
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	542.57	-
应收股利		95,261.93	-
应收申购款		199.76	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		33,700,272.40	-
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2.90	-
应付赎回款		314,790.85	-
应付管理人报酬		31,266.28	-
应付托管费		6,253.26	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	34,360.84	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	156,620.10	-
负债合计		543,294.23	-
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	32,127,393.08	-
未分配利润	6.4.7.10	1,029,585.09	-
所有者权益合计		33,156,978.17	-
负债和所有者权益总计		33,700,272.40	-

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0320 元，基金份额总额 32,127,393.08 份。

2、本基金于 2017 年 1 月 25 号成立，本报告的实际编制区间为 2017 年 1 月 25 日（基金成立日）至 2017 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月25日(基金合同生效日)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		2,577,273.36	-
1.利息收入		569,390.19	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	155,148.99	-
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		414,241.20	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		440,939.46	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	78,082.90	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	362,856.56	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	579,643.04	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	987,300.67	-

减：二、费用		711,197.41	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	368,049.21	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	73,609.84	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	74,921.84	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	194,616.52	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,866,075.95	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,866,075.95	-

注：本基金于 2017 年 1 月 25 号成立，本报告的实际编制区间为 2017 年 1 月 25 日（基金成立日）至 2017 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 25 日（基金合同生效日）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）	249,314,243.26	-	249,314,243.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	1,866,075.95	1,866,075.95

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)	-217,186,850.18	-836,490.86	-218,023,341.04
其中：1.基金申购款	24,509,963.16	14,397.84	24,524,361.00
2.基金赎回款	-241,696,813.34	-850,888.70	-242,547,702.04
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)	32,127,393.08	1,029,585.09	33,156,978.17
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)	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金于 2017 年 1 月 25 号成立，本报告的实际编制区间为 2017 年 1 月 25 日（基金成立日）至 2017 年 6 月 30 日。

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：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>胡明</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金（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]1978 号《关于准予平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金注册的批复》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《平安大华中证沪港深高股息精选指数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，首次募集期间为 2016 年 11 月 21 日至 2017 年 1 月 20 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 249,245,009.43 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司(2017)验字第 032 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 249,314,243.26 份基金份额，其中认购资金利息折合 69,233.83 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政

府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、中小企业私募债券、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)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需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 90%以上的基金资产投资于股票。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%,每个交易日日终在扣除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的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准:中证沪港深高股息精选指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%

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》、《平安大华中证沪港深高股息精选指数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于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2017 年 1 月 25 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2017 年 1 月 25 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次；基金合同生效满 6 个月后，若基金在每 6 个月最后一个交易日收盘后每 10 份基金份额的可供分配利润高于 0.05 元(含)，则基金须在 15 个工作日之内进行收益分配，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 80%；若基金合同生效不满 6 个月可不进行收益分配；(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资(红利再投资不受封闭期限制)；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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) 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	2,317,760.79
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	2,317,760.79
-----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,627,868.42	31,207,511.46	579,643.04
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	30,627,868.42	31,207,511.46	579,643.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	509.81
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	28.08
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.68
合计	542.57

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	34,360.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	34,360.84

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	726.74
预提费用	105,893.36
指数使用费	50,000.00
合计	156,620.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	249,314,243.26	249,314,243.26
本期申购	24,509,963.16	24,509,963.16
本期赎回(以“-”号填列)	-241,696,813.34	-241,696,813.34
- 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	32,127,393.08	32,127,393.08

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	1,286,432.91	579,643.04	1,866,075.95
本期基金份额交易产生的变动数	-638,006.37	-198,484.49	-836,490.86
其中：基金申购款	275,578.65	-261,180.81	14,397.84
基金赎回款	-913,585.02	62,696.32	-850,888.70

本期已分配利润	-	-	-
本期末	648,426.54	381,158.55	1,029,585.09

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
活期存款利息收入	140,342.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,313.14
其他	1,492.99
合计	155,148.99

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017年6月30日
卖出股票成交总额	12,562,091.32
减：卖出股票成本总额	12,484,008.42
买卖股票差价收入	78,082.90

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末无债券买卖差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期未发生贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6
----	--

	月 30 日
股票投资产生的股利收益	362,856.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	362,856.56

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017 年6月30日
1. 交易性金融资产	579,643.04
——股票投资	579,643.04
——债券投资	-
——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	579,643.04

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月25日(基金合同生效日)至2017 年6月30日
基金赎回费收入	986,906.50
转换费收入	394.17

合计	987,300.67
----	------------

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对份额持有期限小于 30 个自然日的，赎回费用全部归基金财产，对份额持有期限小于 3 个自然月的，赎回费用的 75% 归基金财产，对份额持有期限小于 6 个自然月的，赎回费用的 50% 归基金财产，对份额持有期限大于等于 6 个自然月的，赎回费用的 25% 归基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	74,921.84
银行间市场交易费用	-
合计	74,921.84

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	27,624.15
信息披露费	78,269.21
证券组合费_港股通	156.49
银行间账户维护费	1,500.00
指数使用费	86,666.67
其他	400.00
合计	194,616.52

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
平安大华基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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
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、基金代销机构
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期无通过关联方进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期无通过关联方进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	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	368,049.21	-
其中：支付销售机构的客户维护费	101,215.02	-

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 1.0%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	73,609.84	-

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 0.2%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×0.2%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本报告期内无支付给关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金于本期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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	
	2017年1月25日(基金合同生效日)至 2017年6月30日		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
平安银行-活期	2,317,760.79	140,342.86	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 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
600050	中国联通	2017年4月6日	重大事项	7.47	2017年8月21日	8.22	100	681.00	747.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

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。本基金管理人制订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。

6.4.13.1 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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.1.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有债券投资。

6.4.13.1.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有债券投资。

6.4.13.2 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。本基金所持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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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。

于 2017 年 06 月 30 日，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 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	2,317,760.79	-	-	-	-	-	2,317,760.79
结算备付金	69,252.21	-	-	-	-	-	69,252.21
存出保证金	9,743.68	-	-	-	-	-	9,743.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-31,207,511.46	31,207,511.46
应收利息	-	-	-	-	-	542.57	542.57
应收股利	-	-	-	-	-	95,261.93	95,261.93
应收申购款	-	-	-	-	-	199.76	199.76
资产总计	2,396,756.68	-	-	-	-	-31,303,515.72	33,700,272.40
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2.90	2.90
应付赎回款	-	-	-	-	-	314,790.85	314,790.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	31,266.28	31,266.28
应付托管费	-	-	-	-	-	6,253.26	6,253.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	34,360.84	34,360.84

其他负债	-	-	-	-	-	156,620.10	156,620.10
负债总计	-	-	-	-	-	543,294.23	543,294.23
利率敏感度缺口	2,396,756.68	-	-	-	-	-30,760,221.49	33,156,978.17

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。

6.4.13.3.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.3.2 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。

6.4.13.3.3 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。本基金投资组合中股票等权益类资产投资占基金资产的比例范围为 0-90%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，其中每个交易日日终在扣除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。

6.4.13.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	31,207,511.46	94.12	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	31,207,511.46	94.12	-	-

6.4.13.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2017 年 06 月 30 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**6.4.14.1 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。

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 8 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	31,207,511.46	92.60
	其中：股票	31,207,511.46	92.60
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	2,387,013.00	7.08
7	其他各项资产	105,747.94	0.31
8	合计	33,700,272.40	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的香港股票金额为 13,160,589.46 元，占基金总资产比例 39.05%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	321,360.00	0.97
C	制造业	13,558,563.40	40.89
D	电力、热力、燃气及水生产和	765,495.00	2.31

	供应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	135,036.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	1,476,812.00	4.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	366,481.00	1.11
J	金融业	771,971.00	2.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	64,096.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	99,951.60	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	171,173.00	0.52
R	文化、体育和娱乐业	315,236.00	0.95
S	综合	-	-
	合计	18,046,175.00	54.43

7.2.2 期末积极投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术 服务业	747.00	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	747.00	0.00

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
房地产	432,336.99	1.30
非日常生活消费品	5,410,319.92	16.32
工业	783,054.78	2.36
公用事业	2,325,860.69	7.01
金融	1,056,640.52	3.19
信息技术	2,177,984.48	6.57
医疗保健	491,329.51	1.48

原材料	483,062.57	1.46
合计	13,160,589.46	39.69

注：以上分类采用全球行业分类标准。

7.3 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

7.3.1 期末指数投资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	600660	福耀玻璃	52,000	1,354,080.00	4.08
2	H00303	VTECH HOLDINGS	10,900	1,170,242.57	3.53
3	000895	双汇发展	48,400	1,149,500.00	3.47
4	H00868	信义玻璃	164,000	1,100,279.54	3.32
5	H02380	中国电力	435,000	1,045,800.20	3.15
6	H01999	敏华控股	147,200	895,582.35	2.70
7	H00002	中电控股	10,300	738,408.98	2.23
8	H02333	长城汽车	81,000	677,706.65	2.04
9	002242	九阳股份	33,200	653,044.00	1.97
10	H00165	中国光大控股	44,000	649,204.16	1.96
11	H00425	敏实集团	22,000	632,019.34	1.91
12	600023	浙能电力	113,400	619,164.00	1.87
13	601877	正泰电器	29,100	584,619.00	1.76
14	H02020	安踏体育	25,000	559,808.40	1.69
15	H02018	瑞声科技	6,500	550,608.45	1.66
16	H00270	粤海投资	58,000	541,651.51	1.63
17	600018	上港集团	81,900	519,246.00	1.57
18	600563	法拉电子	10,400	513,864.00	1.55
19	H00914	安徽海螺水泥股	20,500	483,062.57	1.46

		份			
20	H00001	长和	5,500	467,808.88	1.41
21	600012	皖通高速	34,300	463,393.00	1.40
22	H00308	香港中旅	236,000	460,865.52	1.39
23	H00696	中国民航信息网 络	22,900	457,133.46	1.38
24	H00688	中国海外发展	21,800	432,336.99	1.30
25	600987	航民股份	32,000	414,720.00	1.25
26	H02328	中国财险	36,000	407,436.36	1.23
27	600009	上海机场	10,900	406,679.00	1.23
28	601678	滨化股份	56,900	395,455.00	1.19
29	002294	信立泰	10,900	388,694.00	1.17
30	000876	新希望	46,100	378,942.00	1.14
31	002050	三花智控	22,300	363,936.00	1.10
32	H02313	申洲国际	8,000	356,194.37	1.07
33	002662	京威股份	48,700	350,640.00	1.06
34	600703	三安光电	17,100	336,870.00	1.02
35	600816	安信信托	24,100	327,519.00	0.99
36	300146	汤臣倍健	23,400	321,516.00	0.97
37	600583	海油工程	51,500	321,360.00	0.97
38	H00586	海螺创业	25,400	315,245.90	0.95
39	H00867	康哲药业	26,600	311,670.07	0.94
40	002508	老板电器	7,040	306,099.20	0.92
41	300124	汇川技术	11,800	301,372.00	0.91
42	002311	海大集团	16,200	295,974.00	0.89
43	H01316	耐世特	27,000	286,830.20	0.87
44	600271	航天信息	13,300	274,512.00	0.83
45	H00669	创科实业	8,500	264,845.79	0.80

46	002008	大族激光	7,600	263,264.00	0.79
47	601098	中南传媒	13,600	253,504.00	0.76
48	002701	奥瑞金	39,500	252,405.00	0.76
49	600750	江中药业	7,100	246,725.00	0.74
50	002553	南方轴承	19,700	230,096.00	0.69
51	002007	华兰生物	6,100	222,650.00	0.67
52	000637	茂化实华	32,800	217,792.00	0.66
53	002287	奇正藏药	5,200	213,772.00	0.64
54	002454	松芝股份	16,700	210,420.00	0.63
55	603766	隆鑫通用	27,300	198,744.00	0.60
56	600369	西南证券	34,600	194,106.00	0.59
57	601788	光大证券	13,000	194,090.00	0.59
58	300039	上海凯宝	24,900	181,023.00	0.55
59	H01177	中国生物制药	30,000	179,659.44	0.54
60	002152	广电运通	21,450	178,249.50	0.54
61	H01169	海尔电器	10,000	176,187.76	0.53
62	002643	万润股份	11,850	174,906.00	0.53
63	600201	生物股份	4,800	170,736.00	0.51
64	600114	东睦股份	9,500	166,250.00	0.50
65	600422	昆药集团	14,000	158,760.00	0.48
66	000596	古井贡酒	3,000	152,850.00	0.46
67	601311	骆驼股份	10,700	151,512.00	0.46
68	601199	江南水务	21,300	146,331.00	0.44
69	002117	东港股份	5,400	139,752.00	0.42
70	002191	劲嘉股份	14,800	138,528.00	0.42
71	600993	马应龙	6,200	135,036.00	0.41
72	002550	千红制药	22,100	131,274.00	0.40
73	002020	京新药业	10,700	126,795.00	0.38

74	603328	依顿电子	8,800	124,520.00	0.38
75	300183	东软载波	6,000	122,880.00	0.37
76	300127	银河磁体	7,200	117,576.00	0.35
77	002465	海格通信	10,800	115,992.00	0.35
78	300009	安科生物	6,550	107,485.50	0.32
79	300015	爱尔眼科	4,550	105,833.00	0.32
80	002324	普利特	3,800	102,144.00	0.31
81	002033	丽江旅游	9,780	99,951.60	0.30
82	002250	联化科技	6,900	98,670.00	0.30
83	002245	澳洋顺昌	9,700	87,494.00	0.26
84	002518	科士达	5,960	87,135.20	0.26
85	002649	博彦科技	7,800	86,034.00	0.26
86	002224	三力士	7,600	84,360.00	0.25
87	002424	贵州百灵	4,100	77,326.00	0.23
88	002104	恒宝股份	8,200	76,998.00	0.23
89	002437	誉衡药业	9,900	72,072.00	0.22
90	300347	泰格医药	2,700	65,340.00	0.20
91	300269	联建光电	3,200	64,096.00	0.19
92	600557	康缘药业	3,800	63,118.00	0.19
93	300066	三川智慧	11,300	62,602.00	0.19
94	300033	同花顺	1,000	62,210.00	0.19
95	000793	华闻传媒	6,100	61,732.00	0.19
96	000810	创维数字	4,800	58,224.00	0.18
97	603000	人民网	4,300	56,631.00	0.17
98	600109	国金证券	4,800	56,256.00	0.17
99	300377	赢时胜	3,400	38,726.00	0.12

7.3.2 期末积极投资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	600050	中国联通	100	747.00	0.00

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	600660	福耀玻璃	1,771,643.00	5.34
2	H00303	VTECH HOLDINGS	1,571,323.06	4.74
3	000895	双汇发展	1,554,401.00	4.69
4	H02380	中国电力	1,506,726.97	4.54
5	H00868	信义玻璃	1,395,566.57	4.21
6	H00002	中电控股	1,085,228.13	3.27
7	H00165	中国光大控股	988,805.99	2.98
8	002242	九阳股份	922,476.37	2.78
9	600023	浙能电力	921,077.00	2.78
10	H02020	安踏体育	897,818.37	2.71
11	H02333	长城汽车	879,200.51	2.65
12	H00425	敏实集团	873,389.62	2.63
13	H01999	敏华控股	851,299.72	2.57
14	601877	正泰电器	819,777.30	2.47
15	H00270	粤海投资	789,775.69	2.38
16	H02018	瑞声科技	743,789.96	2.24
17	600012	皖通高速	686,448.27	2.07

18	H00308	香港中旅	678,510.99	2.05
19	600563	法拉电子	670,396.00	2.02
20	H00914	海螺水泥	665,299.58	2.01

注：“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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600660	福耀玻璃	605,553.55	1.83
2	000895	双汇发展	491,629.00	1.48
3	600023	浙能电力	287,811.00	0.87
4	002242	九阳股份	284,894.70	0.86
5	601877	正泰电器	249,260.18	0.75
6	600563	法拉电子	241,146.00	0.73
7	002311	海大集团	216,937.00	0.65
8	600012	皖通高速	190,650.00	0.57
9	600009	上海机场	188,383.00	0.57
10	600987	航民股份	175,574.95	0.53
11	002294	信立泰	162,864.00	0.49
12	000876	新希望	159,522.00	0.48
13	002662	京威股份	157,096.00	0.47
14	600583	海油工程	148,188.00	0.45
15	002508	老板电器	144,432.00	0.44
16	002701	奥瑞金	118,834.00	0.36
17	300146	汤臣倍健	117,884.76	0.36
18	600816	安信信托	117,386.00	0.35
19	300124	汇川技术	113,213.00	0.34

20	601098	中南传媒	112,875.00	0.34
----	--------	------	------------	------

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。

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	43,111,876.84
卖出股票收入（成交）总额	12,562,091.32

注：“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

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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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。

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。

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	9,743.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	95,261.93
4	应收利息	542.57
5	应收申购款	199.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,747.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五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	600050	中国联通	747.00	0.00	重大事项

7.12.6 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。

§ 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
627	51,239.86	349,461.86	1.09%	31,777,931.22	98.91%

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	23,826.01	0.0742%

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 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（2017 年 1 月 25 日）基金份额总额	249,314,243.26
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	24,509,963.16
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	241,696,813.34
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）	-
本报告期期末基金份额总额	32,127,393.08

§ 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、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
海通证券	2	23,165,251.00	41.61%	13,899.21	36.48%	-
光大证券	2	7,686,014.34	13.81%	5,466.74	14.35%	-
广发证券	2	4,973,924.80	8.93%	4,532.75	11.90%	-
天风证券	2	4,476,397.86	8.04%	3,184.10	8.36%	-
恒泰证券	2	4,045,134.24	7.27%	2,958.38	7.77%	-
西南证券	1	3,763,400.08	6.76%	2,676.93	7.03%	-
财富证券	1	2,000,040.03	3.59%	1,422.65	3.73%	新增 1 个
方正证券	2	1,962,001.00	3.52%	1,395.57	3.66%	-
中信建投	2	1,697,777.94	3.05%	1,207.63	3.17%	-
英大证券	1	1,595,801.50	2.87%	1,135.07	2.98%	-
东兴证券	2	275,282.37	0.49%	195.85	0.51%	-
川财证券	1	32,262.00	0.06%	22.96	0.06%	新增 1 个
国信证券	2	681.00	0.00%	0.49	0.00%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
银河证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	5	-	-	-	-	新增 1 个
国联证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	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。

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

海通证券	-	-236,600,000.00	15.14%	-	-
光大证券	-	9,900,000.00	0.63%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-
天风证券	-	22,900,000.00	1.46%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-
方正证券	-	-143,500,000.00	9.18%	-	-
中信建投	-	-395,600,000.00	25.31%	-	-
英大证券	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-
国信证券	-	-236,500,000.00	15.13%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-
安信证券	-	22,000,000.00	1.41%	-	-

华泰证券	-	-204,600,000.00	13.09%	-	-
华林证券	-	-16,500,000.00	1.06%	-	-
东北证券	-	-12,000,000.00	0.77%	-	-
国联证券	-	-253,300,000.00	16.20%	-	-
华创证券	-	-9,800,000.00	0.63%	-	-

10.8 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	关于平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金延长募集期的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017年1月13日
2	关于新增平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金销售机构的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017年1月16日
3	平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金生效的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017年1月26日
4	关于平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017年2月23日
5	关于平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2017年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换、定投业务的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017年3月14日
6	关于旗下部分基金新增扬州国信嘉利投资理财有限公司为销售机构同时开通定投和转换业务并参	中国证券报、证券日报、公司网站	2017年3月31日

	与其费率优惠的公告		
7	关于旗下部分基金参加关于旗下部分基金参加中国工商银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017 年 4 月 1 日
8	关于旗下部分基金新增深圳盈信基金销售有限公司为销售机构同时开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017 年 4 月 17 日
9	关于旗下部分基金新增苏州财路基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017 年 4 月 18 日
10	关于新增中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金销售机构并开通基金转换、定投业务的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017 年 5 月 22 日
11	关于新增万联证券为中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金的销售机构并开通基金定投业务、参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017 年 5 月 24 日
12	关于旗下部分基金参与银河证券费率调整的公告	中国证券报、证券日报、公司网站	2017 年 5 月 25 日
13	关于旗下部分基金新增基煜基金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	中国证券报、证券日报、公司网站	2017 年 6 月 10 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20170317-20170630	10,011,200.00	0.00	0.00	10,011,200.00	31.16
	2	20170124-20170316	0.00	55,026,200.00	55,026,200.00	0.00	0.00
	3	20170608-20170612	0.00	10,006,004.20	10,006,004.20	0.00	0.00
产品特有风险							
流动性风险							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金的文件；
- 2、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同；
- 3、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金托管协议；
- 4、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安大华基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

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 8 月 28 日