

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金

2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 月 30 日

基金管理人：平安大华基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 25 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安大华鼎泰混合
场内简称	平安鼎泰
交易代码	167001
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型基金。本基金合同生效后，在封闭期内不开放申购、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转让基金份额。本基金的封闭期为基金合同生效日（包括基金合同生效之日）至 18 个月（含 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）。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金，并更名为平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。
基金合同生效日	2016 年 7 月 21 日
报告期末基金份额总额	1,318,879,411.68 份
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各类事件，通过筛选、鉴别事件信息扩散对资产价格的影响模式，选择最具有竞争优势的标的，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。
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

§ 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 7 月 1 日 — 2017 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-1,075,164.10
2. 本期利润	23,788,834.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0180
4. 期末基金资产净值	1,201,014,618.83
5. 期末基金份额净值	0.9106

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

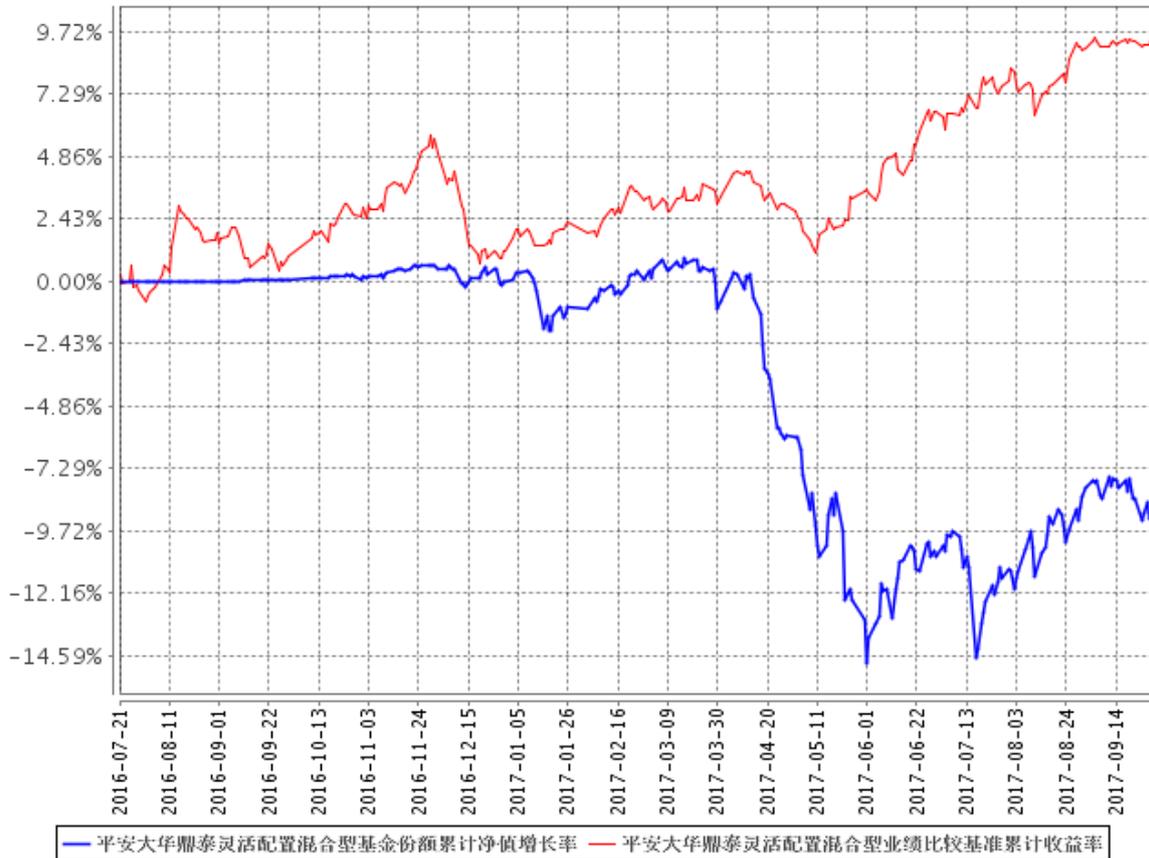
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
----	------------	---------------	----------------	-----------------------	-----	-----

过去三个月	2.02%	0.74%	2.64%	0.29%	-0.62%	0.45%
-------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

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，截至报告期已满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 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	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016 年 7 月 21 日	-	6	刘俊廷先生，中国科学院研究生院硕士。曾在国泰君安证券股份有限公司担任分析师。2014 年 12 月加入平安大华基金管理有限公司，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、平安大华鼎弘混合型证券投资基金、平安大华鼎沣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的解聘日期。
- 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、《平安大华鼎泰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 年监管无疑成为定增市场的主旋律，自再融资新规发布以来，定增市场不断降温。但 2017 年三季度以来，这一现象在逐步发生改变，定增市场开始回暖，在引导资金脱虚入实、鼓励产业整合与升级的逻辑下，定增市场将由阵痛期进入适应期，并进一步回归理性，重视公司基本面的价值投资将进一步强化。

4.5 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 0.9106 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.02%，业绩比较基准收益率为 2.64%。

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	914,099,182.80	75.98
	其中：股票	914,099,182.80	75.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,368,171.60	1.11
	其中：债券	13,368,171.60	1.11
	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	271,000,000.00	22.53
	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	4,304,381.69	0.36
8	其他资产	247,089.92	0.02
9	合计	1,203,018,826.01	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	100,550.00	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	562,958,991.34	46.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,392,872.70	7.36
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	458,404.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	87,878,798.02	7.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,353,190.33	4.86
J	金融业	204,400.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	115,751,976.41	9.64
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	914,099,182.80	76.11

5.2.2 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。

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	000875	吉电股份	17,857,146	88,392,872.70	7.36
2	600676	交运股份	11,655,013	87,878,798.02	7.32
3	002157	正邦科技	16,393,444	87,213,122.08	7.26
4	002073	软控股份	8,998,342	84,584,414.80	7.04
5	600531	豫光金铅	9,329,760	75,291,163.20	6.27
6	000901	航天科技	2,597,735	74,632,926.55	6.21
7	002344	海宁皮城	9,004,499	73,746,846.81	6.14
8	000521	美菱电器	12,522,361	73,005,364.63	6.08
9	600522	中天科技	3,638,254	45,805,617.86	3.81
10	002400	省广股份	6,014,128	41,798,189.60	3.48

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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	13,368,171.60	1.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,368,171.60	1.11

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	113011	光大转债	119,980	13,368,171.60	1.11

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情况。

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情况。

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	3,154.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	243,935.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	247,089.92

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	13,368,171.60	1.11

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	000875	吉电股份	88,392,872.70	7.36	非公开发行
2	600676	交运股份	87,878,798.02	7.32	非公开发行
3	002157	正邦科技	87,213,122.08	7.26	非公开发行
4	002073	软控股份	84,584,414.80	7.04	非公开发行
5	600531	豫光金铅	75,291,163.20	6.27	非公开发行

6	000901	航天科技	74,632,926.55	6.21	非公开发行
7	002344	海宁皮城	73,746,846.81	6.14	非公开发行
8	000521	美菱电器	73,005,364.63	6.08	非公开发行
9	600522	中天科技	45,805,617.86	3.81	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	1,318,879,411.68
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	1,318,879,411.68

§ 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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

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，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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三届董事会第二次会议通过，同意选举罗春风先生为第三届董事会董事长；同意聘任肖宇鹏先生为总经理；同意聘任付强先生、林婉文女士、汪涛先生为副总经理；同意聘任陈特正先生为督察长兼董事会秘书。

§ 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

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 10 月 25 日