平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金
2018年第2季度报告

2018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

报告送出日期：2018年7月18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 2018 年 7 月 17 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 2018 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金的报告期自 2018 年 4 月 1 日至 6 月 19 日，平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金的报告期自 2018 年 6 月 20 日至 6 月 30 日。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	平安大华鼎越混合
场内简称	平安鼎越
交易代码	167002
基金运作方式	上市开放式基金（LOF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 20 日
报告期末基金份额总额	102,143,902.09 份
投资目标	本基金转型为上市开放式基金（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	本基金转型为上市开放式基金（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，力争实现资产的长期稳健增值。
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。
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

备注：本基金转型日期为 2018 年 6 月 20 日，该日起“平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金”转型为“平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金”，此处基金份额日期为 2018 年 6 月 30 日。

转型前：

基金简称	平安大华鼎越混合
场内简称	平安鼎越
交易代码	167002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 20 日
报告期末基金份额总额	102,143,902.09 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。
投资策略	本基金通过对宏观经济、行业分析轮动效应与定向增发项目优势的深入研究的基础上，灵活运用大类资产配置策略、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。
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。
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

本基金转型日期为 2018 年 6 月 20 日，该日起“平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金”转型为“平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金”，此处基金份额日期为 2018 年 6 月 19 日。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2018 年 6 月 20 日 － 2018 年 6 月 30 日 ）
1.本期已实现收益	-386,314.20
2.本期利润	-86,646.99
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0008

4.期末基金资产净值	88,088,980.36
5.期末基金份额净值	0.8624

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2018 年 4 月 1 日 － 2018 年 6 月 19 日 ）
1.本期已实现收益	-38,986,730.26
2.本期利润	-11,734,253.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0239
4.期末基金资产净值	88,175,627.35
5.期末基金份额净值	0.8632

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（转型后）

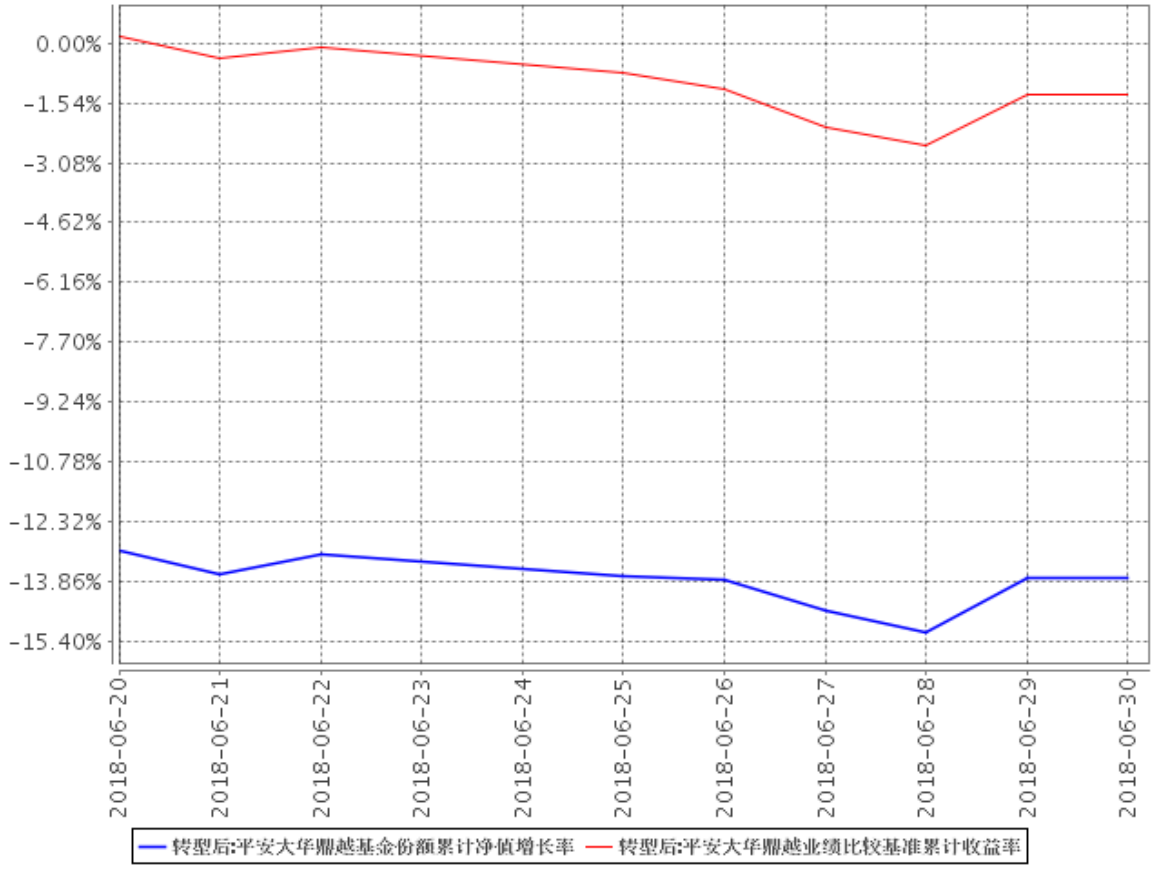
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2018 年 6 月 20 日至 2018 年 6 月 30 日	-0.09%	0.88%	-1.30%	0.70%	1.21%	0.18%

沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%

3.2.2 自基金转型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



注：本基金合同的生效日期为 2016 年 9 月 20 日，本基金转型日期为 2018 年 6 月 20 日，本基金的转型日至披露时点未满一年。

3.2 基金净值表现（转型前）

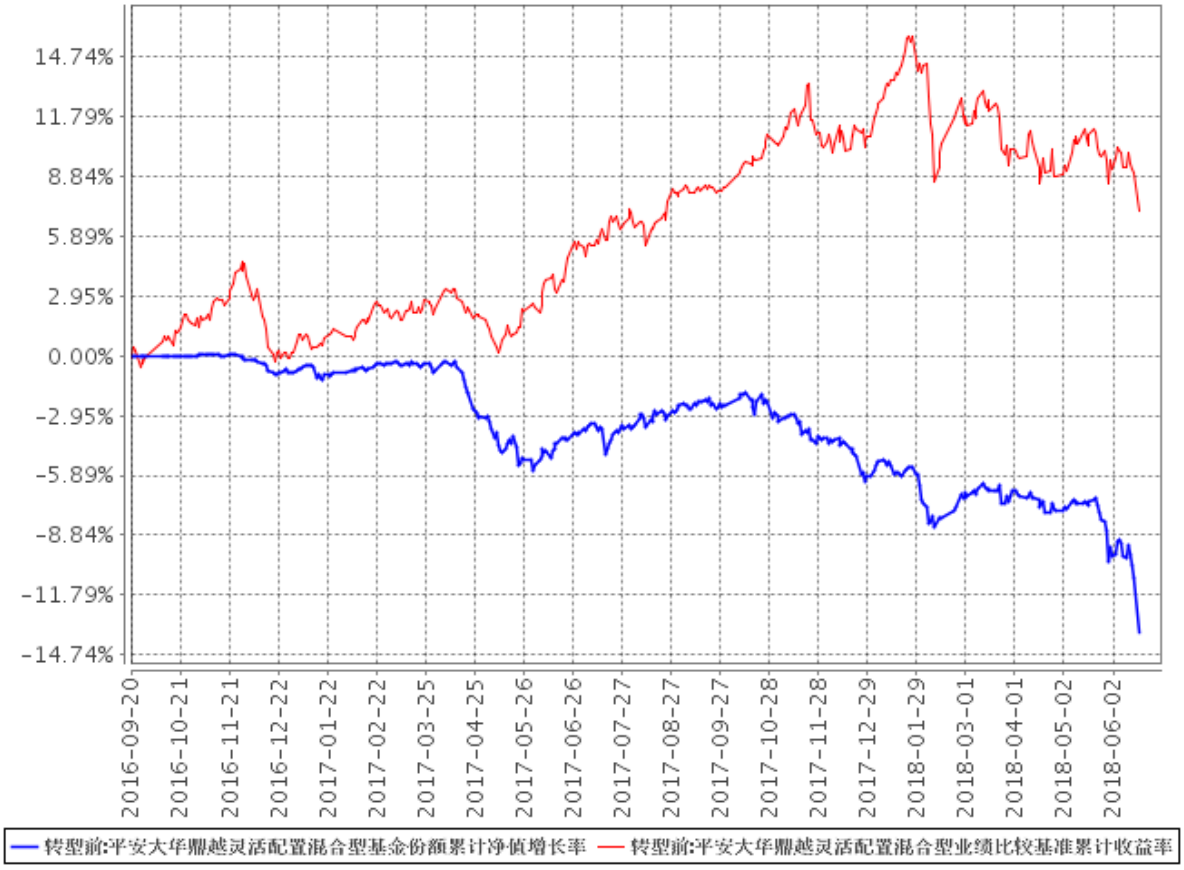
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2018 年 4 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日	-7.50%	0.57%	-2.81%	0.55%	-4.69%	0.02%

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



注：本基金合同的生效日期为 2016 年 9 月 20 日。

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 基金经理（或基金经理小组）简介 （转型前）

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		
WANG AO	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	2018 年 3 月 16 日	-	5	WANG AO 先生，CAIA、FRM，CFA，澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士，曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012 年 9 月加入平安大华基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益研究员。现任平安大华鼎信债券型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠裕债券型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金、平安大华双债添益债券型证券投资基金基金经理。
刘俊廷	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	2016 年 9 月 20 日	-	6	刘俊廷，硕士研究生，曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF)、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、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华保本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聘任日期和解聘日期。

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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 （转型后）

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		
WANG AO	平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2018 年 3 月 16 日	-	5	WANG AO 先生，CAIA、FRM，CFA，澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士，曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012 年 9 月加入平安大华基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益研究员。现任平安大华鼎信债券型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠裕债券型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安大华双债添益债券型证券投

					资基金基金经理。
刘俊廷	平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016 年 9 月 20 日	-	6	刘俊廷，硕士研究生，曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、平安大华鼎越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、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华保本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聘任日期和解聘日期。

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遵规守信情况的说明

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、《平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（转型前：《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

平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2016 年 9 月 20 日成立。自 2018 年 6 月 20 日起，本基金将转型为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金”。

2018 年上半年，伴随国内金融强监管、中美贸易摩擦、汇率变化等因素，市场震荡下跌，风险偏好回落。在此背景下，经济增速或将有所放缓，但更加高质量、可持续。经济总体稳中趋缓、稳中有进、 均衡发展。我国经济有韧性、外汇储备充足、汇率预期稳定，也决定了人民币汇率贬值空间有限。短期极端悲观的情绪使得市场已经处于中期的底部区域。风雨之后，彩虹可期。展望 2018 年下半年，投资风格上，追求业绩的确定性依旧是市场的主线，市场风格之争将逐步淡化，业绩为王依旧为贯穿全年的投资逻辑。

在报告期内的投资标的选择上，本基金更关注主板中绩优、低估、高分红的蓝筹龙马，或者是中小创中业绩真实、内生成长的新经济领军企业。报告期内，本基金未参与新的定向增发。本基金持有的已经解禁的定增股票，基金管理人已经开始择机进行减持。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.8624 元；本报告期(2018 年 6 月 20 日至 2018 年 6 月 30 日)，基金份额净值增长率为-0.09%，业绩比较基准收益率-1.30%。

截至 2018 年 6 月 19 日，本基金份额净值为 0.8632 元；本报告期(2018 年 4 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日)，基金份额净值增长率为-7.50%，业绩比较基准收益率为-2.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

转型前：

本基金本报告期内(2018 年 4 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日)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。

转型后：

本基金本报告期内（2018 年 6 月 20 日至 2018 年 6 月 30 日）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

转型后：

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	53,075,918.18	59.93
	其中：股票	53,075,918.18	59.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,569,027.00	20.97
	其中：债券	18,569,027.00	20.97
	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	16,309,976.85	18.42
8	其他资产	610,322.83	0.69
9	合计	88,565,244.86	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	168,932.00	0.19
B	采矿业	882,482.00	1.00
C	制造业	19,078,764.18	21.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,633,687.03	7.53
E	建筑业	1,466,183.80	1.66
F	批发和零售业	914,236.00	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	961,862.83	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,895,920.44	2.15
J	金融业	9,899,540.68	11.24
K	房地产业	2,339,381.00	2.66

L	租赁和商务服务业	7,596,765.12	8.62
M	科学研究和技术服务业	79,391.50	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	287,599.00	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	439,534.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	431,638.60	0.49
S	综合	-	-
	合计	53,075,918.18	60.25

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	002344	海宁皮城	1,580,989	7,273,901.92	8.26
2	000875	吉电股份	2,242,285	6,033,166.53	6.85
3	601166	兴业银行	163,400	2,352,960.00	2.67
4	300421	力星股份	161,690	2,162,047.15	2.45
5	600036	招商银行	60,900	1,610,196.00	1.83
6	600276	恒瑞医药	14,884	1,127,611.84	1.28
7	600030	中信证券	67,700	1,121,789.00	1.27
8	601328	交通银行	163,800	940,212.00	1.07
9	601668	中国建筑	168,980	922,630.80	1.05
10	000333	美的集团	16,000	835,520.00	0.95

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	8,495,027.00	9.64
5	企业短期融资券	10,074,000.00	11.44
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,569,027.00	21.08

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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112473	16 海普瑞	79,000	7,561,880.00	8.58
2	011764116	17 大丰海港 SCP004	50,000	5,038,000.00	5.72
3	011752076	17 三环 SCP002	50,000	5,036,000.00	5.72
4	136328	16 忠旺 01	9,690	933,147.00	1.06

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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情况。

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

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

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

本组合投资的前十名证券之一兴业银行于 2018 年 4 月 19 日被银保监公开处罚，主要违法违规事实包括:（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。中国银行保险监督管理委员会决定罚款兴业银行 5870 万元。

本组合投资的前十名证券之一招商银行于 2018 年 2 月 12 日被中国银监会公开处罚，主要违法违规事实包括:（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。中国银监会决定罚款招商银行 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	35,358.62
2	应收证券清算款	128,889.51
3	应收股利	-
4	应收利息	446,074.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	610,322.83

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	7,248,620.20	8.23	非公开发行,流通受限
2	000875	吉电股份	6,004,464.67	6.82	非公开发行,流通受限
3	300421	力星股份	2,157,182.65	2.45	非公开发行,流通受限

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。

转型前：

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	54,110,265.18	56.75
	其中：股票	54,110,265.18	56.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,563,619.70	19.47
	其中：债券	18,563,619.70	19.47
	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	22,120,441.86	23.20
8	其他资产	551,754.74	0.58
9	合计	95,346,081.48	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	174,884.00	0.20
B	采矿业	977,924.00	1.11
C	制造业	18,620,834.27	21.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,752,839.46	7.66
E	建筑业	2,061,848.00	2.34
F	批发和零售业	722,472.50	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	1,287,062.43	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,030,467.23	2.30
J	金融业	10,730,573.52	12.17
K	房地产业	2,495,733.00	2.83
L	租赁和商务服务业	7,318,182.77	8.30
M	科学研究和技术服务业	83,911.60	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	197,197.00	0.22

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	328,652.40	0.37
R	文化、体育和娱乐业	327,683.00	0.37
S	综合	-	-
	合计	54,110,265.18	61.37

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	002344	海宁皮城	1,580,989	7,005,081.77	7.94
2	000875	吉电股份	2,242,285	5,831,259.46	6.61
3	601166	兴业银行	163,400	2,527,798.00	2.87
4	300421	力星股份	161,690	2,089,276.30	2.37
5	600036	招商银行	60,900	1,765,491.00	2.00
6	600030	中信证券	67,700	1,167,825.00	1.32
7	600276	恒瑞医药	14,884	1,116,151.16	1.27
8	601668	中国建筑	120,700	1,007,845.00	1.14
9	601328	交通银行	163,800	987,714.00	1.12
10	601939	建设银行	124,900	903,027.00	1.02

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	8,498,119.70	9.64
5	企业短期融资券	10,065,500.00	11.42
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,563,619.70	21.05

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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112473	16 海普瑞	79,000	7,566,620.00	8.58
2	011764116	17 大丰海港 SCP004	50,000	5,033,000.00	5.71
3	011752076	17 三环 SCP002	50,000	5,032,500.00	5.71
4	136328	16 忠旺 01	9,690	931,499.70	1.06

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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情况。

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

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

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

本组合投资的前十名证券之一兴业银行于 2018 年 4 月 19 日被银保监公开处罚，主要违法违规事实包括:（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。中国银行保险监督管理委员会决定罚款兴业银行 5870 万元。

本组合投资的前十名证券之一招商银行于 2018 年 2 月 12 日被中国银监会公开处罚，主要违法违规事实包括:（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。中国银监会决定罚款招商银行 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	35,358.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	516,396.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	551,754.74

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	6,980,736.41	7.92	非公开发行,流通受限
2	000875	吉电股份	5,803,571.80	6.58	非公开发行,流通受限
3	300421	力星股份	2,084,577.40	2.36	非公开发行,流通受限

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（转型后）

单位：份

基金转型起始日（ 2018 年 6 月 20 日 ）基金份额总额	102,143,902.09
基金转型起始日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金转型起始日至报告期期末基金总赎回份额	-
基金转型起始日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	102,143,902.09

本基金转型日期为 2018 年 6 月 20 日，此处期末基金份额日期为 2018 年 6 月 30 日。

§6 开放式基金份额变动（转型前）

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	6,656.76
减:报告期期间基金总赎回份额	570,970,604.66
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	102,143,902.09

本基金转型日期为 2018 年 6 月 20 日，此处期末基金份额日期为 2018 年 6 月 19 日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

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（转型后）

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

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（转型前）

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 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	20180401-20180522	200,017,000.00	0.00	200,017,000.00	0.00	0.00%
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2016 年 9 月 20 日成立。本基金的第一次开放期 2018 年 5 月 21 日至 2018 年 6 月 15 日止，在第一个开放

期的最后一日日终，本基金资产净值低于 2 亿元，触发本基金的转型条件。根据《基金合同》的相关约定，本基金将转型日定为 2018 年 6 月 20 日，即自 2018 年 6 月 20 日起，本基金将转型为上市开放式基金（LOF）。本基金转型后，基金名称变更为“平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金”。投资人欲了解详情，可阅读最新的《平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型为上市开放式基金（LOF 及名称变更的公告》。

§9 备查文件目录

10.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

（2）平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金合同

（3）平安大华鼎越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

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

10.3 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
2018 年 7 月 18 日