

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金
(LOF)
2018 年半年度报告摘要

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：平安银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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。

原平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 1 月 19 日止，平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)报告期自 2018 年 1 月 20 日至 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（转型后）

基金名称	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	平安大华鼎泰混合
场内简称	平安鼎泰
基金主代码	167001
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	2016年7月21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	462,721,029.60份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016年10月18日

本基金转型日期为2018年1月20日，上述份额日期为2018年6月30日

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	平安大华鼎泰混合
场内简称	平安鼎泰
基金主代码	167001
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2016年7月21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	1,318,879,411.68份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016年10月18日

本基金转型日期为2018年1月20日，上述份额日期为2018年1月19日

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	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	本基金转为上市开放式基金（LOF）后，并更名为平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF），在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件，将事件性因素作为投资的主线，形成以事件驱动为核心的投资策略。
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

2.2 基金产品说明（转型前）

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。
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，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资。将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线，形成以定向增发为核心的投资策略。
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

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 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日
本期已实现收益	-59,962,550.82
本期利润	-56,713,777.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0976
本期加权平均净值利润率	-12.93%
本期基金份额净值增长率	-31.39%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月30日
期末可供分配利润	-145,247,763.22
期末可供分配基金份额利润	-0.3139
期末基金资产净值	317,473,266.38
期末基金份额净值	0.6861
3.1.3 累计期末指标	2018年6月30日
基金份额累计净值增长率	-31.39%

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上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。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年1月19日
本期已实现收益	-120,763,017.32
本期利润	-6,318,402.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0048
本期加权平均净值利润率	-0.60%
本期基金份额净值增长率	-0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2018年1月19日
期末可供分配利润	-177,837,797.89
期末可供分配基金份额利润	-0.1348
期末基金资产净值	1,046,905,498.59
期末基金份额净值	0.7938
3.1.3 累计期末指标	2018年1月19日
基金份额累计净值增长率	-20.62%

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上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 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	-6.91%	1.41%	-3.57%	0.64%	-3.34%	0.77%
过去三个月	-8.79%	1.13%	-4.07%	0.57%	-4.72%	0.56%
自基金合同生效起至今	-13.57%	1.03%	-7.52%	0.60%	-6.05%	0.43%

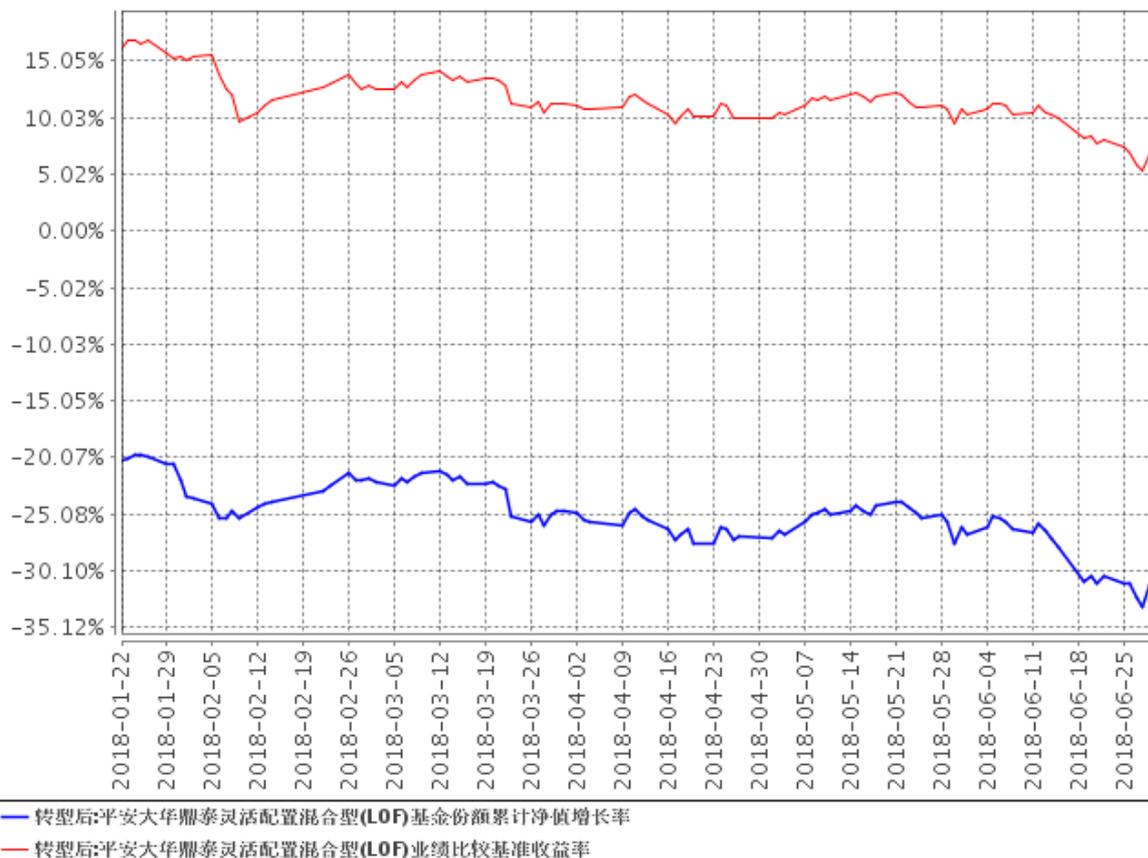
注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证综合债券指数是反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债、和企业债、该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场标准。根据本基金的投资范围约束，该基准能客观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。

注：本基金在 2018 年 1 月 20 日转型，转型后过去一个月为 2018 年 6 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日、过去三个月为 2018 年 4 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日，过去六个月、过去一年无完整数据，基金合同生效以来为基金转型日至 2018 年 6 月 30 日。

3.2.2 自基金转型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

平安大华鼎泰灵活配置混合型(LOF)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、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 21 日，转型日期为 2018 年 1 月 20 日，截至报告期末，本基金转型起至披露时点未满一年。

3.2 基金净值表现（转型前）

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
过去六个月	-0.60%	0.44%	3.15%	0.21%	-3.75%	0.23%
过去一年	-11.07%	0.61%	8.33%	0.34%	-19.40%	0.27%
自基金合同生效起至今	-20.62%	0.77%	15.48%	0.34%	-36.10%	0.43%

注：1、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%。沪深 300 指数

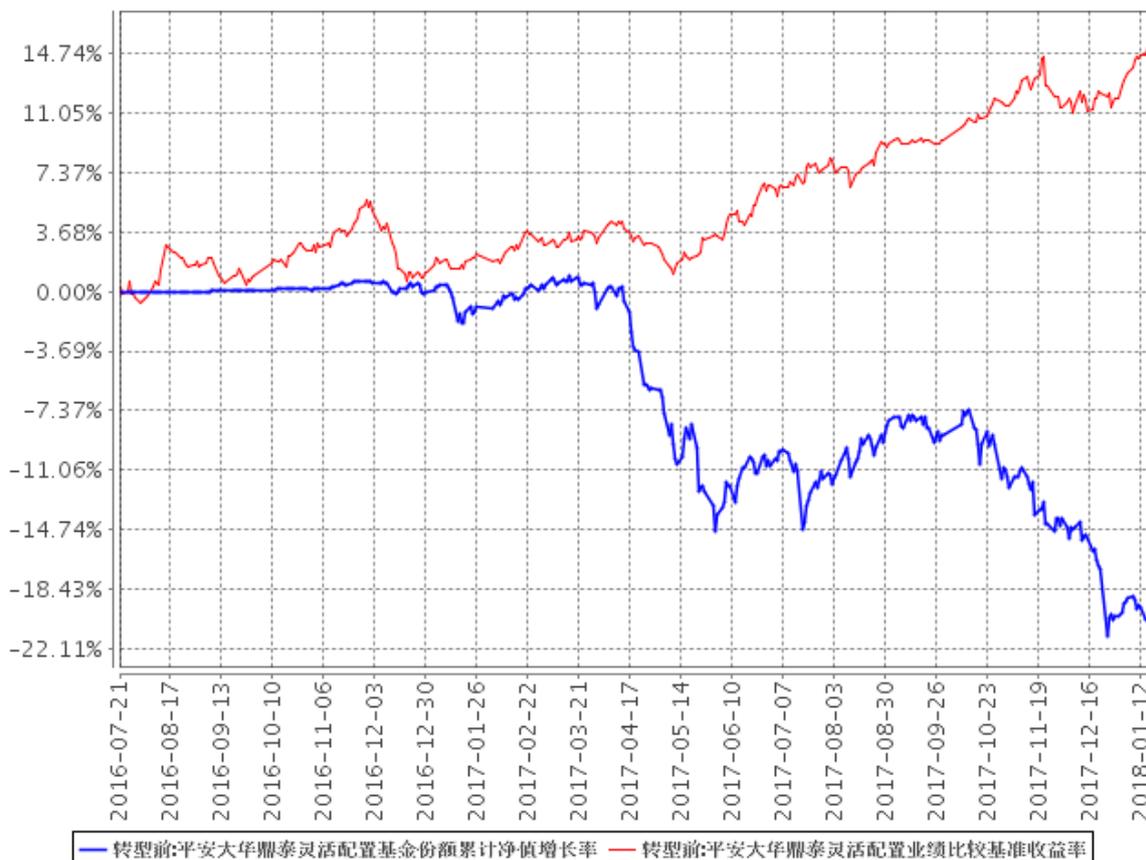
的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证综合债券指数是反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债、和企业债、该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场标准。根据本基金的投资范围约束，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

注：本基金在 2018 年 1 月 20 日转型，转型前过去一个月、过去三个月无完整数据，过去六个月为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 1 月 19 日，过去一年为 2017 年 7 月 1 日至 2018 年 1 月 19 日，基金合同生效以来为合同成立日至 2018 年 1 月 19 日。

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

平安大华鼎泰灵活配置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，截至报告期末已满一年；
- 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，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“平安大华基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917号文批准设立。平安大华基金总部位于深圳，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，持有股权60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股权25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权14.3%。平安大华基金秉承“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2018年6月30日，平安大华基金共管理57只公募基金，资产管理总规模2442亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
刘俊廷	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
刘俊廷	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	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、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》、《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、《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合同单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于 2016 年 7 月 21 日成立,自 2018 年 1 月 20 日起,本基金已转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“平安大华-鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。

目前 A 股不再是典型普涨普跌牛熊市,个股区间涨幅已是南辕北辙。资本市场改革及国际化正在深刻改变 A 股原有生态,“劣币驱逐良币”的历史一去不复返,绩优股的牛市仍在进行,绩劣股熊市愈演愈烈。因此在报告期内的投资标的的选择上,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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末,本报告期(2018 年 1 月 20 日-2018 年 6 月 30 日)份额净值增长率为-13.57%,同期业绩比较基准增长率为-7.52%;

截至转型前报告期末,本报告期(2018 年 1 月 1 日-2018 年 1 月 19 日)份额净值增长率为-0.60%,同期业绩比较基准增长率为 3.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。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委员会，成员由投资管理部门、研究中心、资本市场风控监控室、基金运营部基金会计室及法律合规监察部相关人员组成。基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。

估值委员会的职责主要包括有：制订健全有效的估值政策和程序；定期对估值政策和程序进行评价等；保证基金估值的公平、合理；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；估值委员会成员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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 万元的情形。

§ 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，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（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地复核，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。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由平安大华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、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）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表（转型后）

会计主体：平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	18,979,140.39
结算备付金		2,547,129.48
存出保证金		517,799.93
交易性金融资产	6.4.7.2	295,511,201.96
其中：股票投资		295,511,201.96
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		2,146,200.40
应收利息	6.4.7.5	12,036.48
应收股利		-
应收申购款		998.50
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		319,714,507.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30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		682,969.03
应付赎回款		427,458.11
应付管理人报酬		414,412.90
应付托管费		69,068.83
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	464,520.00
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	182,811.89
负债合计		2,241,240.76
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	462,721,029.60
未分配利润	6.4.7.10	-145,247,763.22
所有者权益合计		317,473,266.38
负债和所有者权益总计		319,714,507.14

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6861 元，累计份额净值 0.6861 元，基金份额总额 462,721,029.60 份。

6.2 利润表

会计主体：平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2018 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月20日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
一、收入		-51,714,235.49
1. 利息收入		1,061,375.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	366,660.38
债券利息收入		73,631.43
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		621,083.53
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-57,890,719.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-60,709,609.41
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	2,683.03
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	2,816,207.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,248,773.29
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	1,866,335.13
减：二、费用		4,999,542.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,966,646.56

2. 托管费	6.4.10.2.2	494,441.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,366,083.45
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	172,370.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-56,713,777.53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-56,713,777.53

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月20日(基金合同生效日)至2018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)	1,318,879,411.68	-271,973,913.09	1,046,905,498.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-56,713,777.53	-56,713,777.53
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)	-856,158,382.08	183,439,927.40	-672,718,454.68
其中：1. 基金申购款	1,032,384.27	-238,237.89	794,146.38
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-857,190,766.35	183,678,165.29	-673,512,601.06
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)	462,721,029.60	-145,247,763.22	317,473,266.38

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

基金管理人负责人

林婉文

主管会计工作负责人

胡明

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于 2016 年 7 月 21 日成立,根据《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)及《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”)及相关公告的规定,根据本基金基金合同的约定,本基金的封闭期为基金合同生效之日(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)。本基金的封闭期为 2016 年 7 月 21 日至 2018 年 1 月 19 日。封闭期届满后,即自 2018 年 1 月 20 日起,本基金转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。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(以下简称“平安银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等)、债券资产(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、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)、现金资产等货币市场工具,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

自本基金转换为上市开放式基金后,股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%,投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除国债期货和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投资比例合计不低于基金净值的 5%;本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%;基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%。

本基金的业绩比较基准是:沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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》、《平安大华鼎泰灵活配置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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 20 日至 2018 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

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须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
平安大华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人，基金销售机构
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
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
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
上海陆金所基金销售有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的 联营公司、基金销售机构

注：下述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 2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
平安证券	22,743,581.70	2.12%

6.4.7.1.2 债券交易

本基金于本报告期未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

本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 2018年1月20日(基金合同生效日)至2018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	16,177.33	2.06%	16,177.33	3.48%

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 2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,966,646.56
其中：支付销售机构的客户维护费	610,454.28

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人报酬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：

日管理人报酬=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 2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费	494,441.11	

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0.25%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×0.25%/当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付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

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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

本基金的基金管理人于本期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

本基金本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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 2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期	18,979,140.39	366,660.38

本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.8 期末（2018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	说明
000875	吉电股份	2017年1月3日	2019年1月4日	非公开发行流通受限	5.60	2.69	8,928,573	50,000,008.80	24,017,861.37	-
002344	海宁皮城	2016年12月22日	2018年12月26日	非公开发行流通受限	10.70	4.60	3,453,650	36,954,055.00	15,886,790.00	-
300370	安控科技	2016年9月7日	2018年9月13日	非公开发行流通受限	9.28	3.33	4,146,554	24,050,010.88	13,808,024.82	-
600579	天华院	2016年9月12日	2018年9月10日	非公开发行流通受限	12.50	9.42	880,000	11,000,000.00	8,289,600.00	-
002073	软控股份	2016年11月3日	2018年11月6日	非公开发行流通受限	10.30	5.40	9,171	94,461.30	49,523.40	-
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
600676	交运股份	2016年11月14日	2018年11月22日	非公开发行流通受限	8.58	4.77	600	5,148.00	2,862.00	-
002400	省广集团	2016年9月21日	2018年9月14日	非公开发行流通受限	13.58	3.10	684	8,914.17	2,120.40	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项	17.08	-	-	57,000	1,185,832.00	973,560.00	
300229	拓尔思	2018年4月17日	重大事项	15.88	2018年7月17日	14.29	57,600	828,778.00	914,688.00	
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项	7.47	2018年8月20日	7.25	119,800	898,809.10	894,906.00	
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项	13.08	-	-	28,600	566,377.33	374,088.00	
601118	海南橡胶	2018年5月24日	重大事项	6.62	-	-	37,000	214,753.20	244,940.00	

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

截至本报告期末 2018 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。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金未从事交易所市场债券正回购交易，无质押债券。

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 2018 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表（转型前）

会计主体：平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年1月19日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年1月19日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	720,697,537.93	16,653,973.47
结算备付金		2,767,845.18	3,620,255.92
存出保证金		76,395.66	15,975.65
交易性金融资产	6.4.7.2	257,544,274.09	670,134,757.58
其中：股票投资		257,544,274.09	657,612,444.98
基金投资		-	-
债券投资		-	12,522,312.60
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	50,000,275.00	364,323,593.98
应收证券清算款		17,125,493.70	-
应收利息	6.4.7.5	301,241.94	461,262.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,048,513,063.50	1,055,209,818.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年1月19日	上年度末 2017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		-	12,000.27
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		827,828.20	1,406,995.53
应付托管费		137,971.37	234,499.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	432,244.96	142,423.06
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	209,520.38	190,000.00
负债合计		1,607,564.91	1,985,918.11
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,318,879,411.68	1,318,879,411.68
未分配利润	6.4.7.10	-271,973,913.09	-265,655,511.01
所有者权益合计		1,046,905,498.59	1,053,223,900.67
负债和所有者权益总计		1,048,513,063.50	1,055,209,818.78

注：报告截止日 2018 年 1 月 19 日，基金份额净值 0.7938 元，累计份额净值 0.7938 元，基金份额总额 1,318,879,411.68 份。

6.2 利润表

会计主体：平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 1 月 19 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 1 月 19 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-4,598,292.21	-130,070,380.35
1. 利息收入		787,108.43	4,040,519.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	52,194.53	293,306.75
债券利息收入		525.94	281,109.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		734,387.96	3,466,102.72
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-119,830,015.88	4,435,083.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-120,750,212.66	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	920,196.78	73,652.19
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	-	4,361,431.21
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	114,444,615.24	-138,545,983.11
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	-	-

减：二、费用		1,720,109.87	11,178,827.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	827,828.20	9,419,267.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	137,971.37	1,569,877.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	725,489.92	0.09
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	28,820.38	189,681.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,318,402.08	-141,249,207.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,318,402.08	-141,249,207.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年1月19日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年1月19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）	1,318,879,411.68	-265,655,511.01	1,053,223,900.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,318,402.08	-6,318,402.08
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）	-	-	0.00
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	0.00	0.00
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）	-	-	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	1,318,879,411.68	-271,973,913.09	1,046,905,498.59
项目	上年度可比期间 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）	1,318,879,411.68	-404,420.02	1,318,474,991.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-141,249,207.45	-141,249,207.45
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）	1,318,879,411.68	-141,653,627.47	1,177,225,784.21

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

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(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]1208号《关于准予平安大华鼎泰灵活配置混合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《平安大华鼎泰灵活配置混合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基金,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1,318,599,857.89元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第868号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年7月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,318,879,411.68份基金份额,其中认购资金利息折合279,553.79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(以下简称“平安银行”),登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)至 18 个月(含第 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。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所(以下简称“深交所”)转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金(LOF)，并更名为平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)，投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。

经深交所深证上[2016] 696 号文审核同意，本基金 519,058,725.00 份基金份额于 2016 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鼎泰灵活配置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(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等)、债券资产(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、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)、现金资产等货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率× 50% + 中证综合债指数收益率× 50%。

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》、《平安大华鼎泰灵活配置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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2018 年 1 月 19 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 01 月 19 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

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须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。

6.4.7 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
平安大华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人，基金销售机构
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
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
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
上海陆金所基金销售有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的 联营公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 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

本基金于本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

本基金于本报告期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

本基金于本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

本基金于本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期无应支付关联方的佣金。

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 2018年1月1日至2018年1 月19日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	827,828.20	9,419,267.90
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	165,564.86	1,748,008.80

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人报酬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：

日管理人报酬=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 2018年1月1日至2018年1 月19日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	137,971.37	1,569,877.91

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 0.25%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×0.25%/当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

本基金于本期及上年度可比期间均无应支付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

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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

本基金的基金管理人于本期末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

本基金本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年1月19日		2017年1月1日至2017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	720,697,537.93	52,194.53	9,375,944.27	229,290.58

本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2018年1月19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	说明
002073	软控股份	2016年11月3日	2018年11月6日	非公开发行流通受限	10.30	7.35	4,499,171	46,341,461.30	33,068,906.85	-
002344	海宁皮城	2016年12月22日	2018年12月26日	非公开发行流通受限	10.70	7.16	4,502,250	48,174,075.00	32,236,110.00	-
000875	吉电股份	2017年1月3日	2019年1月4日	非公开发行流通受限	5.60	3.53	8,928,573	50,000,008.80	31,517,862.69	-
000521	美菱电器	2016年10月13日	2018年10月	非公开发行流	5.59	4.85	6,261,181	35,000,001.79	30,366,727.85	-

		日	月 15 日	通受限							
600522	中天 科技	2017年2 月10日	2018 年2月 8日	非公开 发行流 通受限	9.62	12.45	1,819,127	17,500,001.74	22,648,131.15		-
600522	中天 科技	2017年2 月10日	2019 年2月 8日	非公开 发行流 通受限	9.62	11.74	1,819,127	17,500,001.74	21,356,550.98		-
300370	安控 科技	2016年9 月7日	2018 年9月 13日	非公开 发行流 通受限	9.28	3.50	4,146,554	24,050,010.88	14,512,939.00		-
600676	交运 股份	2016年 11月14 日	2018 年11 月12 日	非公开 发行流 通受限	8.58	6.09	1,675,600	14,376,648.00	10,204,404.00		-
600579	天华 院	2016年9 月12日	2018 年9月 10日	非公开 发行流 通受限	12.50	10.61	880,000	11,000,000.00	9,336,800.00		-
300421	力星 股份	2016年 10月13 日	2018 年10 月22 日	非公开 发行流 通受限	30.72	16.97	537,817	16,521,738.24	9,126,754.49		-
002114	罗平 锌电	2017年2 月17日	2018 年2月 20日	非公开 发行流 通受限	16.71	17.07	159,200	2,660,232.00	2,717,544.00		-
002114	罗平 锌电	2017年2 月17日	2019 年2月 20日	非公开 发行流 通受限	16.71	16.11	159,201	2,660,248.71	2,564,728.11		-
601838	成都 银行	2018年1 月19日	2018 年1月 31日	新股流 通受限	6.99	6.99	12,799	89,465.01	89,465.01		-
300737	科顺 股份	2018年1 月18日	2018 年1月 25日	新股流 通受限	9.95	9.95	6,133	61,023.35	61,023.35		-
603356	华菱 精工	2018年1 月15日	2018 年1月 24日	新股流 通受限	10.21	10.21	1,239	12,650.19	12,650.19		-
002400	省广 股份	2016年9 月21日	2018 年9月 24日	非公开 发行流 通受限	13.58	4.86	684	8,914.17	3,324.24		-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持

股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有因认购新发/暂时停牌的股票。

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

截至本报告期末 2018 年 1 月 19 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。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 1 月 19 日止，本基金未从事交易所市场债券正回购交易，无质押债券。

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 2018 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告（转型后）

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	295,511,201.96	92.43
	其中：股票	295,511,201.96	92.43
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	21,526,269.87	6.73
7	其他各项资产	2,677,035.31	0.84
8	合计	319,714,507.14	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	702,956.00	0.22
B	采矿业	6,449,225.00	2.03
C	制造业	132,554,347.41	41.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,631,071.66	8.70
E	建筑业	7,052,329.40	2.22
F	批发和零售业	5,299,792.82	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	4,929,456.38	1.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,664,440.86	3.36
J	金融业	57,199,260.14	18.02
K	房地产业	11,455,066.25	3.61
L	租赁和商务服务业	23,824,016.54	7.50
M	科学研究和技术服务业	529,549.45	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	572,046.14	0.18

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,675,128.71	1.16
R	文化、体育和娱乐业	2,972,515.20	0.94
S	综合	-	-
	合计	295,511,201.96	93.08

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。

7.2.3 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

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	000875	吉电股份	8,929,293	24,019,898.97	7.57
2	002344	海宁皮城	4,704,699	21,966,888.14	6.92
3	300370	安控科技	4,147,057	13,809,790.35	4.35
4	601288	农业银行	2,482,700	8,540,488.00	2.69
5	600436	片仔癀	74,200	8,305,206.00	2.62
6	600579	天华院	880,500	8,294,670.00	2.61
7	600036	招商银行	310,300	8,204,332.00	2.58
8	000333	美的集团	113,886	5,947,126.92	1.87
9	601939	建设银行	888,100	5,817,055.00	1.83
10	600030	中信证券	344,100	5,701,737.00	1.80

7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

7.3.1 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	600028	中国石化	16,904,779.00	5.32
2	601288	农业银行	12,883,809.10	4.06
3	600048	保利地产	11,563,513.20	3.64
4	600030	中信证券	10,935,453.00	3.44
5	000651	格力电器	10,887,001.00	3.43
6	601328	交通银行	9,991,604.00	3.15

7	600036	招商银行	9,295,098.30	2.93
8	601398	工商银行	9,212,489.91	2.90
9	000333	美的集团	9,208,570.69	2.90
10	002202	金风科技	9,171,064.72	2.89
11	600104	上汽集团	9,046,027.95	2.85
12	601166	兴业银行	8,809,998.00	2.78
13	601857	中国石油	8,002,259.76	2.52
14	600016	民生银行	7,728,286.72	2.43
15	600690	青岛海尔	7,493,033.00	2.36
16	600436	片仔癀	7,084,822.71	2.23
17	601939	建设银行	6,725,947.67	2.12
18	600741	华域汽车	6,267,285.12	1.97
19	600519	贵州茅台	6,241,222.00	1.97
20	601225	陕西煤业	6,222,751.00	1.96

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。

7.3.2 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	600522	中天科技	40,740,336.13	12.83
2	002073	软控股份	34,760,333.13	10.95
3	002344	海宁皮城	27,714,848.42	8.73
4	000521	长虹美菱	24,954,178.21	7.86
5	600028	中国石化	17,161,313.94	5.41
6	600676	交运股份	9,033,786.47	2.85
7	600048	保利地产	8,957,758.96	2.82
8	002202	金风科技	8,272,718.69	2.61
9	300421	力星股份	8,180,575.08	2.58
10	000651	格力电器	7,813,382.98	2.46
11	600104	上汽集团	7,471,159.42	2.35
12	601857	中国石油	7,408,921.32	2.33
13	601398	工商银行	7,245,451.28	2.28
14	600741	华域汽车	5,910,879.89	1.86
15	600690	青岛海尔	5,331,587.63	1.68
16	002114	罗平锌电	4,702,628.80	1.48
17	601225	陕西煤业	4,565,583.93	1.44

18	601328	交通银行	4,547,938.29	1.43
19	600030	中信证券	4,400,383.96	1.39
20	002044	美年健康	4,312,328.97	1.36

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。

7.3.3 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	584,098,660.32
卖出股票收入（成交）总额	488,670,896.33

7.4 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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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情况。

7.9.2 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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情况。

7.10.2 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。

7.10.3 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情况。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

本基金管理人认为，该事项对公司的生产经营不会造成重大不利影响，我们对该证券的投资严格执行了内部投资决策流程，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九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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	517,799.93
2	应收证券清算款	2,146,200.40
3	应收股利	-
4	应收利息	12,036.48
5	应收申购款	998.50

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,677,035.31

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十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	000875	吉电股份	24,017,861.37	7.57	非公开发行
2	002344	海宁皮城	15,886,790.00	5.00	非公开发行
3	300370	安控科技	13,808,024.82	4.35	非公开发行
4	600579	天华院	8,289,600.00	2.61	非公开发行

7.11.6 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。

§ 7 投资组合报告（转型前）

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	257,544,274.09	24.56
	其中：股票	257,544,274.09	24.56
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	50,000,275.00	4.77
	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	723,465,383.11	69.00
7	其他资产	17,503,131.30	1.67
8	合计	1,048,513,063.50	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	-	-
C	制造业	146,793,869.36	14.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,200,333.89	3.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	834,850.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	10,242,878.88	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	405,094.07	0.04
J	金融业	543,905.01	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	66,059,742.88	6.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	463,600.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	257,544,274.09	24.60

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	002344	海宁皮城	9,004,499	65,822,887.54	6.29
2	600522	中天科技	3,638,254	44,004,682.13	4.20
3	002073	软控股份	4,499,784	33,073,700.51	3.16
4	000875	吉电股份	8,929,293	31,520,533.89	3.01
5	000521	美菱电器	6,262,266	30,372,250.50	2.90
6	300370	安控科技	4,147,057	14,514,790.04	1.39
7	600676	交运股份	1,675,600	10,204,404.00	0.97
8	600579	天华院	880,500	9,342,320.00	0.89
9	300421	力星股份	538,334	9,136,148.38	0.87
10	002114	罗平锌电	318,401	5,282,272.11	0.50

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	300409	道氏技术	1,148,849.00	0.11
2	600452	涪陵电力	1,001,635.00	0.10
3	000400	许继电气	641,909.00	0.06
4	000792	盐湖股份	481,824.00	0.05
5	600298	安琪酵母	478,200.00	0.05
6	002466	天齐锂业	402,816.41	0.04

7	601877	正泰电器	347,812.00	0.03
8	600406	国电南瑞	337,520.00	0.03
9	000581	威孚高科	243,837.00	0.02
10	002202	金风科技	221,310.00	0.02
11	300129	泰胜风能	183,571.00	0.02
12	601828	美凯龙	134,064.15	0.01
13	600297	广汇汽车	115,273.00	0.01
14	601838	成都银行	89,465.01	0.01
15	002925	盈趣科技	68,670.00	0.01
16	300737	科顺股份	61,023.35	0.01
17	600066	宇通客车	30,048.00	0.00
18	300733	西菱动力	21,839.70	0.00
19	603056	德邦股份	20,066.64	0.00
20	603356	华菱精工	12,650.19	0.00

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	002157	正邦科技	95,237,469.65	9.04
2	600531	豫光金铅	58,512,529.88	5.56
3	000901	航天科技	47,622,652.39	4.52
4	600676	交运股份	40,349,514.41	3.83
5	000875	吉电股份	34,111,126.46	3.24
6	002073	软控股份	24,453,344.84	2.32
7	000521	长虹美菱	22,962,015.95	2.18
8	000555	神州信息	16,311,376.42	1.55
9	002400	省广集团	14,361,813.74	1.36
10	600579	天华院	10,761,493.29	1.02
11	300370	安控科技	10,651,684.43	1.01
12	300421	力星股份	5,055,796.62	0.48
13	002743	富煌钢构	3,631,812.35	0.34
14	002298	中电兴发	2,188,323.64	0.21
15	300409	道氏技术	2,060,395.45	0.20
16	600038	中直股份	2,028,486.29	0.19
17	600297	广汇汽车	829,217.22	0.08
18	000400	许继电气	627,915.71	0.06

19	600763	通策医疗	569,653.19	0.05
20	600521	华海药业	567,348.64	0.05

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	6,042,383.45
卖出股票收入（成交）总额	521,079,745.15

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

本基金本报告期末无股指期货投资情况。

7.10.2 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。

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情况。

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	76,395.66
2	应收证券清算款	16,721,735.24
3	应收股利	-
4	应收利息	301,241.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,503,131.30

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

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	002344	海宁皮城	65,822,887.54	6.29	非公开发行
2	600522	中天科技	44,004,682.13	4.20	非公开发行
3	002073	软控股份	33,068,906.85	3.16	非公开发行
4	000875	吉电股份	31,517,862.69	3.01	非公开发行
5	000521	美菱电器	30,366,727.85	2.90	非公开发行
6	300370	安控科技	14,512,939.00	1.39	非公开发行
7	600676	交运股份	10,204,404.00	0.97	非公开发行
8	600579	天华院	9,336,800.00	0.89	非公开发行
9	300421	力星股份	9,126,754.49	0.87	非公开发行
10	002114	罗平锌电	5,282,272.11	0.50	非公开发行

7.12.5 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（转型后）

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
5,948	77,794.39	9,948,953.44	2.15%	452,772,076.20	97.85%

本基金转型日期为2018年1月20日，上述数据为2018年6月30日的数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	平安大华基金-平安银行-国海证券 股份有限公司	5,543,043.00	2.83%
2	杨锡妹	2,964,230.00	1.51%
3	何茹	2,300,000.00	1.17%
4	刘宏	1,972,664.00	1.01%
5	林小娜	1,942,439.00	0.99%
6	任家英	1,514,075.00	0.77%
7	钱俊俊	1,339,039.00	0.68%
8	伍乃芳	1,307,159.00	0.67%
9	马艳芳	1,300,025.00	0.66%
10	高致(上海)投资管理有限公司-高致 龙程1号私募基金	1,220,729.00	0.62%

本基金转型日期为2018年1月20日，上述数据为2018年6月30日的数据。

8.3 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	296.57	0.0001%

本基金转型日期为2018年1月20日，上述数据为2018年6月30日的数据。

8.4 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
-----------------	---

本基金转型日期为 2018 年 1 月 20 日，上述数据为 2018 年 6 月 30 日的的数据。

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

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
10,088	130,737.45	356,932,927.35	27.06%	961,946,484.33	72.94%

本基金转型日期为2018年1月20日，上述数据为2018年1月19日的数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	易方达资产穗鑫2号专项资产管理计划	180,007,100.00	13.65%
2	上海斯诺波投资管理有限公司一私募工场自由之路母基金证券投资	74,000,000.00	5.61%
3	张敏喆	30,007,100.00	2.28%
4	都邦财产保险股份有限公司	15,002,166.00	1.14%
5	中国通用技术（集团）控股有限责任公司	12,000,000.00	0.91%
6	申万宏源证券有限公司	10,000,194.00	0.76%
7	戴璐	9,999,450.00	0.76%
8	南京盛泉恒元投资有限公司一盛泉恒元定增套利多策略6号私募基金	8,343,940.00	0.63%
9	临汾新丰兴商贸有限公司	7,242,418.00	0.55%
10	张志赟	6,933,381.00	0.53%

本基金转型日期为2018年1月20日，上述前十大持有人为2018年1月19日的数据。

8.3 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	10,178.44	0.0008%

本基金转型日期为2018年1月20日，上述数据为2018年1月19日的数据。

8.4 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

本基金转型日期为 2018 年 1 月 20 日，上述数据为 2018 年 1 月 19 日的的数据。

§ 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	1,318,879,411.68
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	1,032,384.27
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	857,190,766.35
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	462,721,029.60

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。本基金转型日期为 2018 年 1 月 20 日，上述数据为 2018 年 1 月 20 日至 2018 年 6 月 30 日的的数据。

§ 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	1,318,879,411.68
本报告期期初基金份额总额	1,318,879,411.68
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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	1,318,879,411.68

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。本基金转型日期为 2018 年 1 月 20 日，上述期末数据为 2018 年 1 月 19 日的的数据。

§ 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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（转型后）

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	
东北证券	7	162,820,811.62	15.21%	118,155.78	15.06%	新增 2 个
东吴证券	2	143,566,361.30	13.41%	102,117.93	13.02%	-
恒泰证券	4	141,282,986.26	13.19%	103,319.58	13.17%	-

华创证券	2	111,269,266.23	10.39%	79,146.70	10.09%	-
广发证券	2	87,635,512.51	8.18%	79,862.57	10.18%	-
安信证券	3	63,109,525.81	5.89%	44,890.16	5.72%	新增1个
兴业证券	1	63,071,846.65	5.89%	44,862.90	5.72%	-
银河证券	2	57,337,922.06	5.35%	40,783.68	5.20%	-
华泰证券	2	44,854,548.71	4.19%	31,904.30	4.07%	-
光大证券	2	42,582,564.42	3.98%	30,288.23	3.86%	-
西南证券	1	26,216,984.87	2.45%	18,648.12	2.38%	-
东兴证券	2	23,870,088.34	2.23%	16,978.92	2.16%	-
平安证券	4	22,743,581.70	2.12%	16,177.33	2.06%	-
长江证券	1	22,521,029.89	2.10%	16,019.19	2.04%	-
中泰证券	1	16,793,531.39	1.57%	11,945.14	1.52%	-
财富证券	1	9,562,365.00	0.89%	6,801.91	0.87%	-
国信证券	2	6,102,244.65	0.57%	4,340.16	0.55%	-
方正证券	2	5,353,434.38	0.50%	3,807.80	0.49%	-
华福证券	2	5,302,423.80	0.50%	3,771.68	0.48%	-
天风证券	2	3,871,295.00	0.36%	2,753.44	0.35%	-
中银国际	1	3,656,313.70	0.34%	2,600.72	0.33%	-
中信证券	2	2,455,777.68	0.23%	1,746.76	0.22%	新增
海通证券	2	1,789,508.00	0.17%	1,272.85	0.16%	-
民生证券	1	1,625,348.50	0.15%	1,156.09	0.15%	-
国联证券	2	1,346,684.00	0.13%	957.97	0.12%	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	新增
中信建投	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-

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
东北证券	-	-	6,000,000.00	0.24%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	524,500,000.00	21.07%	-	-
华创证券	-	-	265,000,000.00	10.64%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	278,000,000.00	11.17%	-	-
兴业证券	24,997,316.97	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	111,100,000.00	4.46%	-	-
华泰证券	-	-	76,000,000.00	3.05%	-	-
光大证券	-	-	385,200,000.00	15.47%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	158,800,000.00	6.38%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	112,000,000.00	4.50%	-	-
天风证券	-	-	160,000,000.00	6.43%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	56,000,000.00	2.25%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	127,000,000.00	5.10%	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	230,000,000.00	9.24%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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	
东北证券	7	166,726,667.62	41.07%	120,434.01	41.31%	-
西南证券	1	77,423,604.40	19.07%	55,071.74	18.89%	-
银河证券	2	46,387,724.83	11.43%	32,995.50	11.32%	-
方正证券	2	24,644,139.08	6.07%	17,529.60	6.01%	-
恒泰证券	4	18,493,626.40	4.56%	13,524.45	4.64%	-
万联证券	2	17,316,550.87	4.27%	12,317.29	4.22%	-
民生证券	1	17,097,195.60	4.21%	12,513.61	4.29%	-
东方证券	1	15,563,157.75	3.83%	11,069.71	3.80%	-
国信证券	2	15,028,000.00	3.70%	10,908.98	3.74%	-
中信建投	2	6,704,155.35	1.65%	4,768.82	1.64%	-
天风证券	2	478,200.00	0.12%	340.15	0.12%	-
财富证券	1	101,115.00	0.02%	71.92	0.02%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	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
东北证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	365,000,000.00	17.63%	-	-
恒泰证券	-	-	1,005,700,000.00	48.57%	-	-
万联证券	-	-	600,000,000.00	28.98%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	12,933,712.00	100.00%	100,000,000.00	4.83%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2016 年 7 月 21 日成立。根据本基金合同的约定，本基金的封闭期为基金合同生效之日（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）。本基金的封闭期为 2016 年 7 月 21 日至 2018 年 1 月 19 日。封闭期届满后，即自 2018 年 1 月 20 日起，本基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。投资人欲了解详情，可阅读最新的《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF）及名称变更的提示性公告》、《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF）及名称变更的公告》、《平安大华基金管理有限公司关于平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回、转换业务和定期定额投资的公告》。

平安大华基金管理有限公司

2018 年 8 月 27 日