

平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金
金
2018 年半年度报告

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

送出日期：2018 年 8 月 27 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。

基金托管人中国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。

原平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 19 日止，平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2018 年 6 月 20 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（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
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、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.2 基金净值表现（转型前）.....	12
3.3 其他指标.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	20
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	23
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	41
6.1 资产负债表.....	41
6.2 利润表.....	42
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	43
6.4 报表附注.....	44
§7 投资组合报告（转型后）	65
7.1 期末基金资产组合情况.....	65
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	65
7.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	73
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	73
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	73
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	73
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	74
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.11 投资组合报告附注	74
7 投资组合报告（转型前）	76
7.1 期末基金资产组合情况	76
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	76
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	77
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	82
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	84
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	84
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	84
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	85
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	85
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	85
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	85
7.12 投资组合报告附注	85
§8 基金份额持有人信息（转型后）	88
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	88
8.2 期末上市基金前十名持有人	88
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	88
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	88
§8 基金份额持有人信息（转型前）	89
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	89
8.2 期末上市基金前十名持有人	89
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	89
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	89
§9 开放式基金份额变动(转型后)	90
§9 开放式基金份额变动(转型前)	91
§10 重大事件揭示	92
10.1 基金份额持有人大会决议	92
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	92
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	92
10.4 基金投资策略的改变	92
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	92
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	92
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	92
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	95
10.9 其他重大事件（转型后）	97
10.9 其他重大事件（转型前）	97
§11 影响投资者决策的其他重要信息	99

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	99
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	99
§12 备查文件目录.....	100
12.1 备查文件目录.....	100
12.2 存放地点.....	100
12.3 查阅方式.....	100

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	平安大华鼎越混合
场内简称	平安鼎越
基金主代码	167002
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 20 日
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	102,143,902.09 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 12 月 19 日

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正式转型并更名为平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金。此处份额日期为 2018 年 6 月 30 日。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	平安大华鼎越混合
场内简称	平安鼎越
基金主代码	167002
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型、定期开放式。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 20 个月（含 20 个月）后的对应日的前一日止（若该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一工作日）。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起至 20 个月后的对应日前一日的期间，以此类推。本基金自封闭期结束之后的第一个工作日起（包括该日）进入开放期，每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。
基金合同生效日	2016 年 9 月 20 日
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	102,143,902.09 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 12 月 19 日

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正式转型并更名为平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金。此处份额日期为 2018 年 6 月 19 日。

2.2 基金产品说明（转型后）

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。

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，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安大华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	王永民
	联系电话	0755-22626828	010-66594896
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566

传真	0755-23997878	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内 大街 1 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	北京市西城区复兴门内 大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	罗春风	陈四清

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

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、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6月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日
本期已实现收益	-386,314.20
本期利润	-86,646.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0008
本期加权平均净值利润率	-0.10%
本期基金份额净值增长率	-13.76%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月30日
期末可供分配利润	-16,095,667.05
期末可供分配基金份额利润	-0.1576
期末基金资产净值	88,088,980.36
期末基金份额净值	0.8624
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	-13.76%

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6月19日
本期已实现收益	-42,822,220.22
本期利润	-16,980,067.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0289
本期加权平均净值利润率	-3.10%
本期基金份额净值增长率	-8.27%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月19日
期末可供分配利润	-15,709,352.85
期末可供分配基金份额利润	-0.1538
期末基金资产净值	88,175,627.35
期末基金份额净值	0.8632
3.1.3 累计期末指标	2018年6月19日
基金份额累计净值增长率	-13.68%

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
自基金合同生效起至今	-0.09%	0.88%	-1.30%	0.70%	1.21%	0.18%

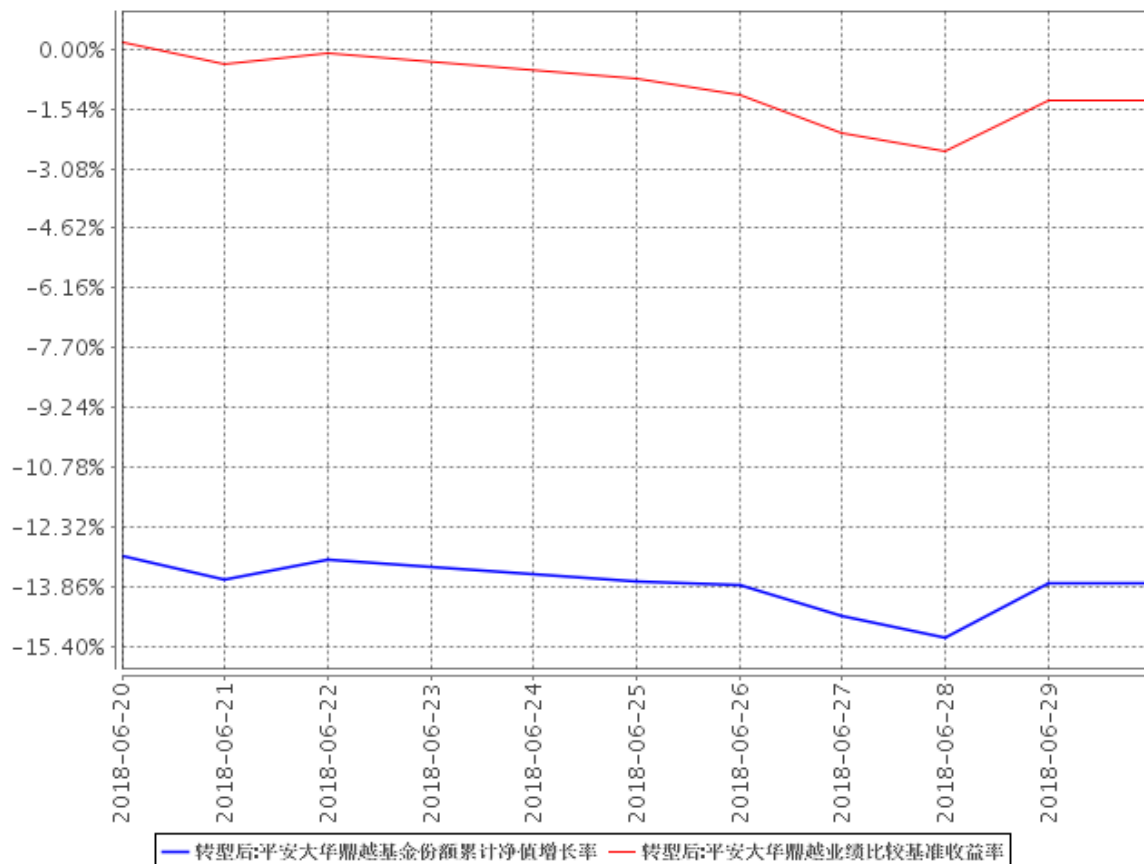
注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证综合债券指数是反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债、和企业债、该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场标准。根据本基金的投资范围约束，该基准能客观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 6 月 20 日转型，转型后过去一个月、过去三个月、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



1、本基金合同生效日为 2016 年 9 月 20 日，转型日期为 2018 年 6 月 20 日，截至报告期末，本基金转型起至披露时点未及半年。

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
过去一个月	-4.73%	0.96%	-2.30%	0.62%	-2.43%	0.34%
过去三个月	-7.50%	0.57%	-2.81%	0.55%	-4.69%	0.02%
过去六个月	-8.27%	0.45%	-3.35%	0.57%	-4.92%	-0.12%
过去一年	-10.22%	0.36%	1.49%	0.47%	-11.71%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-13.68%	0.30%	7.14%	0.41%	-20.82%	-0.11%

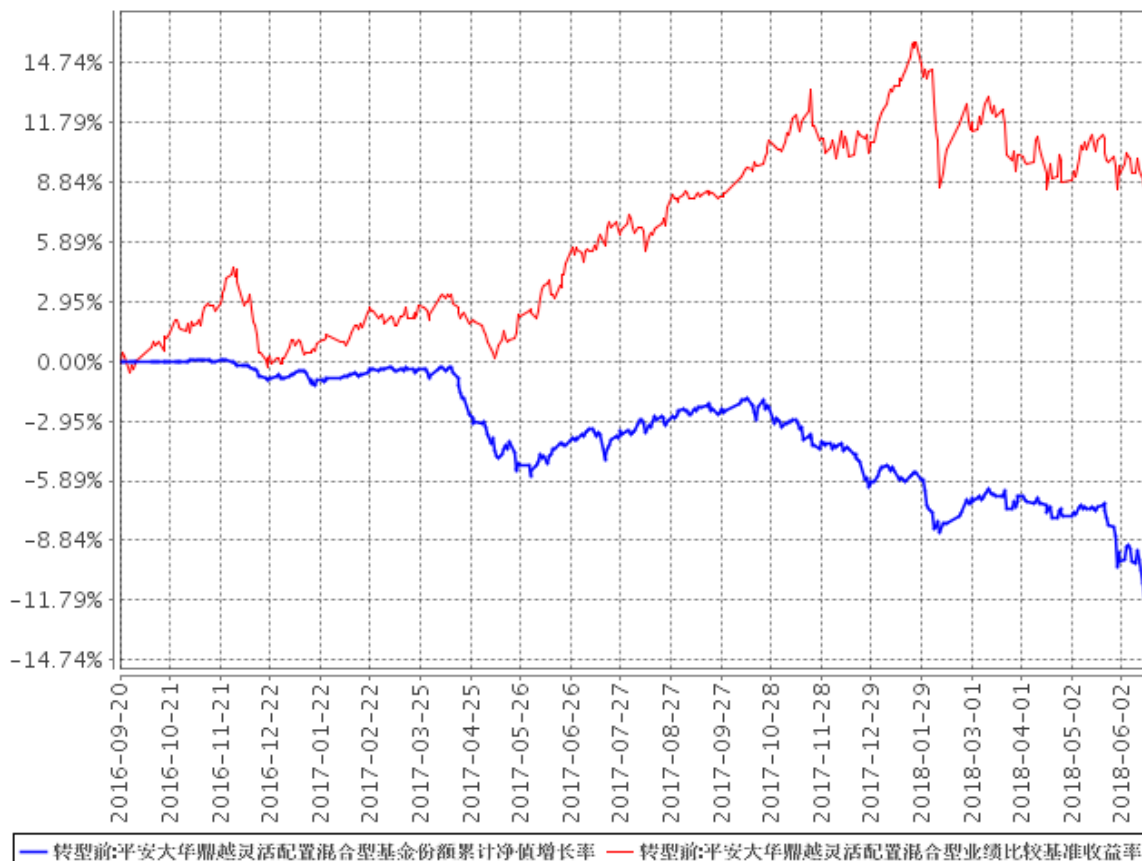
注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证综合债券指数是反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债、和企业债、该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场标准。根据本基金的投资范围约束，该基准能客观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 6 月 20 日转型，转型前过去一个月 2018 年 6 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日，过去三个月为 2018 年 4 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日，过去六个月为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日，过去一年为 2017 年 7 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日，基金合同生效以来为合同成立日至 2018 年 6 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



- 1、本基金基金合同于 2016 年 9 月 20 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。

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		
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，澳大利亚籍，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	平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2016年9月20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基金经理。
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的基金经理	2018年3月16日	-	5	WANG AO 先生，澳大利亚籍，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。
--	--	--	--	--	---

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》、《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、《平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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，本基金已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”。

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 6 月 20 日-2018 年 6 月 30 日）份额净值增长率为 -0.09%，同期业绩比较基准增长率为 -1.30%；

截至转型前报告期末，本报告期（2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 19 日）份额净值增长率为 -8.27%，同期业绩比较基准增长率为 -3.35%。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，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。

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）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金

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	6,926,164.95
结算备付金		9,383,811.90
存出保证金		35,358.62
交易性金融资产	6.4.7.2	71,644,945.18
其中：股票投资		53,075,918.18
基金投资		-
债券投资		18,569,027.00
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		128,889.51
应收利息	6.4.7.5	446,074.70
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		88,565,244.86
负债和所有者权益		
		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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		127,695.03
应付托管费		21,282.51
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	147,047.93
应交税费		2,668.89

应付利息		4,926.23
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	172,643.91
负债合计		476,264.50
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	102,143,902.09
未分配利润	6.4.7.10	-14,054,921.73
所有者权益合计		88,088,980.36
负债和所有者权益总计		88,565,244.86

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8624 元，累计份额净值 0.8624 元，基金份额总额 102,143,902.09 份。

6.2 利润表

会计主体：平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 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6月20日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
一、收入		-21,516.07
1. 利息收入		26,260.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,311.88
债券利息收入		19,948.89
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-347,444.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-422,144.91
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	74,700.86
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	299,667.21
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		65,130.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	39,836.32

2. 托管费	6.4.10.2.2	6,639.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	7,450.03
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		71.84
7. 其他费用	6.4.7.20	11,133.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-86,646.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-86,646.99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 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 6 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)	102,143,902.09	-13,968,274.74	88,175,627.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-86,646.99	-86,646.99
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(以“-”号填列)	-	-	-
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)	102,143,902.09	-14,054,921.73	88,088,980.36

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，根据《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》（以下简称“《基金合同》”）及《平安大华鼎越定期开放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，本基金的第一个封闭期为 2016 年 9 月 20 日至 2018 年 5 月 20 日，第一个开放期为 2018 年 5 月 21 日至 2018 年 6 月 15 日。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》及《关于平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金及相关业务规则的提示性公告》的规定，本基金自 2018 年 6 月 20 日转型为“平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金”。自 2018 年 6 月 20 日起，本基金正式实施转型，运作方式由原 20 个月定期开放变更为一般开放式。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鼎越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）。本基金转型为上市开放式基金（LOF）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资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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%；基金总资产不得超过基金净资产的 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》、《平安大华鼎越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 6 月 20 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

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

本基金本报告期间未发生会计差错的更正。

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 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	6,926,164.95
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	6,926,164.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	73,497,787.47	53,075,918.18	-20,421,869.29
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	8,505,932.77	8,495,027.00	-10,905.77
	银行间市场	10,000,307.39	10,074,000.00	73,692.61
	合计	18,506,240.16	18,569,027.00	62,786.84
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		92,004,027.63	71,644,945.18	-20,359,082.45

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未持有买入返售金融资产。

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	1,220.96
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	3,800.43
应收债券利息	441,039.00
应收资产支持证券利息	-
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	14.31
合计	446,074.70

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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	144,222.93
银行间市场应付交易费用	2,825.00
合计	147,047.93

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	172,643.91
合计	172,643.91

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年6月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	102,143,902.09	102,143,902.09
本期申购		
本期赎回(以“-”号填列)		
- 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	102,143,902.09	102,143,902.09

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：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	-15,709,352.85	1,741,078.11	-13,968,274.74
本期利润	-386,314.20	299,667.21	-86,646.99
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,095,667.05	2,040,745.32	-14,054,921.73

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期	
	2018年6月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
活期存款利息收入		1,649.35
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		4,644.78
其他		17.75
合计		6,311.88

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	
	2018年6月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
卖出股票成交总额		3,060,925.96
减：卖出股票成本总额		3,483,070.87
买卖股票差价收入		-422,144.91

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

本基金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

本基金本报告期内未发生由于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

本基金本报告期内未发生由于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

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

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**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	74,700.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	74,700.86

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年6月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	299,667.21
——股票投资	294,259.91
——债券投资	5,407.30
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	299,667.21

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月20日(基金合同生效日)至2018年 6月30日
交易所市场交易费用	7,450.03
银行间市场交易费用	-
合计	7,450.03

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月20日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
审计费用	2,410.98
信息披露费	5,726.05
上市费	1,808.18
其他	-
银行间账户维护费	1,088.00
银行费用	100.13
合计	11,133.34

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，无须作披露的分部报告。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

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，本基金并无须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、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、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。

6.4.10 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

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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
	2018年6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	39,836.32
其中：支付销售机构的客户维护费	17,162.36

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6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托管费	6,639.39

注：支付基金托管人中国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。

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.5 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 2018年6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
中国银行	6,926,164.95	1,649.35

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
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	1,575,787	16,860,920.90	7,248,620.20	-
000875	吉电	2017年1	2019	非公开	5.60	2.69	2,232,143	12,500,000.80	6,004,464.67	-

	股份	月 3 日	年 1 月 4 日	发行流 通受限						
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	13.37	161,345	4,956,518.40	2,157,182.65	-
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	4.77	3,252	27,902.16	15,512.04	-
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	8.12	151	1,452.62	1,226.12	-

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。

6.4.12.17 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	-	-	13,100	272,309.01	223,748.00	-
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	13,300	98,420.00	99,351.00	-
002310	东方园 林	2018 年 5 月 25 日	重大事项	13.08	-	-	7,200	136,232.91	94,176.00	-
601118	海南橡 胶	2018 年 5 月 24 日	重大事项	6.62	-	-	9,400	49,350.00	62,228.00	-

6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.18.1 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。

6.4.12.18.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

6.4.13.2 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中国银行，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-

未评级	10,074,000.00
合计	10,074,000.00

注：以上按短期信用评级的债券投资未评级的债券投资为超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日
AAA	-
AAA 以下	8,495,027.00
未评级	-
合计	8,495,027.00

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金所持大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 6.4.12 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。

于 2018 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.54%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 6926164.95 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018 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	6,926,164.95	-	-	-	-	-	6,926,164.95
结算备付金	9,383,811.90	-	-	-	-	-	9,383,811.90
存出保证金	35,358.62	-	-	-	-	-	35,358.62
交易性金融资产	10,074,000.00	-	933,147.00	7,561,880.00	-	53,075,918.18	71,644,945.18
应收证券清算款	-	-	-	-	-	128,889.51	128,889.51
应收利息	-	-	-	-	-	446,074.70	446,074.70
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	26,419,335.47	-	933,147.00	7,561,880.00	-	53,650,882.39	88,565,244.86

负债							
应付管理人报酬						127,695.03	127,695.03
应付托管费						21,282.51	21,282.51
应付交易费用						147,047.93	147,047.93
应付利息						4,926.23	4,926.23
应交税费						2,668.89	2,668.89
其他负债						172,643.91	172,643.91
负债总计						476,264.50	476,264.50
利率敏感度缺口	26,419,335.47		-933,147.00	7,561,880.00		-53,174,617.89	88,088,980.36

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2018年6月30日）
	市场利率下降 25 个基点	5,715.49
	市场利率上升 25 个基点	-5,700.98

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金在开放期内或按照《基金合同》的

约定，本基金转型为上市开放式基金（LOF）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资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	53,075,918.18	60.25
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	53,075,918.18	60.25

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 06 月 30 日，本基金转型未满一年，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 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

会计主体：平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 19 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 19 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,736,629.96	1,074,533.13
结算备付金		9,383,811.90	1,368,166.83
存出保证金		35,358.62	7,116.70
交易性金融资产	6.4.7.2	72,673,884.88	728,022,858.04
其中：股票投资		54,110,265.18	138,310,240.94
基金投资		-	-
债券投资		18,563,619.70	589,712,617.10
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	516,396.12	11,700,202.77
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		95,346,081.48	742,172,877.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 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		-	107,529,438.70
应付证券清算款		2,000,186.45	-
应付赎回款		4,756,105.05	-
应付管理人报酬		87,858.71	817,433.47
应付托管费		14,643.12	136,238.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	143,125.44	14,774.43
应交税费		1,998.43	-

应付利息		4,926.23	95,707.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	161,610.70	170,000.00
负债合计		7,170,454.13	108,763,593.38
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	102,143,902.09	673,107,849.99
未分配利润	6.4.7.10	-13,968,274.74	-39,698,565.90
所有者权益合计		88,175,627.35	633,409,284.09
负债和所有者权益总计		95,346,081.48	742,172,877.47

注：报告截止日 2018 年 6 月 19 日，基金份额净值 0.8632 元，累计份额净值 0.8632 元，基金份额总额 102,143,902.09 份。

6.2 利润表

会计主体：平安大华鼎越定期开放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 6 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 6 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		-11,562,530.55	-12,147,922.62
1. 利息收入		11,193,049.95	10,820,492.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	104,862.68	25,960.30
债券利息收入		10,515,993.64	10,794,531.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		572,193.63	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-48,604,705.80	-1,745,275.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-48,150,517.58	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,101,142.45	-2,558,037.27
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	646,954.23	812,761.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	25,842,152.62	-21,223,139.38
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	6,972.68	-

减：二、费用		5,417,537.05	8,302,844.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,828,932.58	4,907,496.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	638,155.45	817,916.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	317,595.91	2,689.04
5. 利息支出		405,805.51	2,401,816.28
其中：卖出回购金融资产支出		405,805.51	2,401,816.28
6. 税金及附加		37,796.08	-
7. 其他费用	6.4.7.20	189,251.52	172,925.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,980,067.60	-20,450,766.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,980,067.60	-20,450,766.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华鼎越定期开放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 6 月 19 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 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）	673,107,849.99	-39,698,565.90	633,409,284.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,980,067.60	-16,980,067.60
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）	-570,963,947.90	42,710,358.76	-528,253,589.14
其中：1. 基金申购款	6,656.76	-632.31	6,024.45
2. 基金赎回款	-570,970,604.66	42,710,991.07	-528,259,613.59
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）	102,143,902.09	-13,968,274.74	88,175,627.35
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）	673,107,849.99	-5,482,023.89	667,625,826.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,450,766.64	-20,450,766.64
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）	673,107,849.99	-25,932,790.53	647,175,059.46

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”)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]1749号《关于准予平安大华鼎越定期开放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《平安大华鼎越定期开放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672,853,122.63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1153号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于2016年9月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为673,107,849.99份基金份额,其中认购资金利息折合254,727.36份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银

行”)，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《平安大华鼎越定期开放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 20 个月(含 20 个月)后的对应日的前一日止，若该对应日为非工作日或无改对应日，则顺延至下一工作日。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起至 20 个月后的对应日前一日的期间，以此类推。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。基金合同生效后，在任一开放期的最后一日日终，如发生基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 2 亿元情形之一的，本基金将转型为上市开放式基(LOF)，基金名称相应变更为“平安大华鼎越灵活配置混合型证券投资基金”，本基金转型为上市开放式基金(LOF)之日起不超过 30 天开始办理申购、赎回业务。

经深交所深证上[2016] 909 号文审核同意，本基金 22,393,734.00 份基金份额于 2016 年 12 月 19 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《平安大华鼎越定期开放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% + 中证综合债券指数收益率× 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》、《平安大华鼎越定期开放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 19 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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) 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 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 2018 年 6 月 19 日
活期存款	12,736,629.96
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	12,736,629.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 19 日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	74,826,394.38	54,110,265.18	-20,716,129.20	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	8,505,932.77	8,498,119.70	-7,813.07
	银行间市场	10,000,307.39	10,065,500.00	65,192.61
	合计	18,506,240.16	18,563,619.70	57,379.54
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	93,332,634.54	72,673,884.88	-20,658,749.66	

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未持有买入返售金融资产。

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 2018年6月19日
应收活期存款利息	79,132.26
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	16,674.68
应收债券利息	420,491.49
应收资产支持证券利息	-
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	97.69
合计	516,396.12

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 2018年6月19日
交易所市场应付交易费用	140,300.44
银行间市场应付交易费用	2,825.00
合计	143,125.44

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月19日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	161,610.70
合计	161,610.70

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月19日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	673,107,849.99	673,107,849.99
本期申购	6,656.76	6,656.76
本期赎回（以“-”号填列）	-570,970,604.66	-570,970,604.66
- 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	102,143,902.09	102,143,902.09

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
上年度末	6,802,336.38	-46,500,902.28	-39,698,565.90
本期利润	-42,822,220.22	25,842,152.62	-16,980,067.60
本期基金份额交易产生的变动数	20,310,530.99	22,399,827.77	42,710,358.76
其中：基金申购款	-711.63	79.32	-632.31
基金赎回款	20,311,242.62	22,399,748.45	42,710,991.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,709,352.85	1,741,078.11	-13,968,274.74

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月19日
活期存款利息收入	86,436.10
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	18,274.45
其他	152.13
合计	104,862.68

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 2018年1月1日至2018年6月19日
卖出股票成交总额	135,739,784.07
减：卖出股票成本总额	183,890,301.65
买卖股票差价收入	-48,150,517.58

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**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月19日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,101,142.45
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,101,142.45

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月19日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额	722,609,517.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	703,416,908.44

本总额	
减：应收利息总额	20,293,751.04
买卖债券差价收入	-1,101,142.45

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内未发生由于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

本基金本报告期内未发生由于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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月19日
股票投资产生的股利收益	646,954.23

基金投资产生的股利收益	-
合计	646,954.23

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月19日
1. 交易性金融资产	25,842,152.62
——股票投资	24,054,311.39
——债券投资	1,787,841.23
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	25,842,152.62

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月19日
基金赎回费收入	6,972.68
合计	6,972.68

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月19日
交易所市场交易费用	313,233.41
银行间市场交易费用	4,362.50
合计	317,595.91

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日
审计费用	37,260.60
信息披露费	88,493.50
上市费	27,944.60
其他	625.00
银行间账户维护费	25,912.00
银行费用	9,015.82
合计	189,251.52

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，无须作披露的分部报告。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

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，本基金并无须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、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、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。

6.4.10 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

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月19日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	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 成交总额的 比例
平安证券	42,346,918.84	30.93%	47,734,584.35	36.79%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月19日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
平安证券	125,000,000.00	3.88%	55,600,000.00	3.47%

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2018年1月1日至2018年6 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	3,828,932.58	4,907,496.93
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	1,091,818.13	1,398,320.00

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 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	638,155.45	817,916.16

注：支付基金托管人中国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。

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年6月19日		上年度可比期间 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
中国银行	12,736,629.96	86,436.10	3,411,648.13	15,196.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018年6月19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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
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	4.43	1,575,787	16,860,920.90	6,980,736.41	-
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	2.60	2,232,143	12,500,000.80	5,803,571.80	-
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	12.92	161,345	4,956,518.40	2,084,577.40	-
600676	交运股份	2016年11月14日	2018年11月	非公开发行流	8.58	4.48	3,252	27,902.16	14,568.96	-

		日	月 12	通受限						
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	7.92	151	1,452.62	1,195.92	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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
002466	天齐锂业	2018年5月31日	重大事项	54.99	2018年6月20日	49.49	4,700	248,771.00	258,453.00	-
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项	17.08	-	-	13,100	272,309.01	223,748.00	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项	15.03	-	-	7,200	136,232.91	108,216.00	-
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项	7.47	-	-	13,300	98,420.00	99,351.00	-
002470	金正大	2018年6月15日	重大事项	7.39	2018年6月25日	7.08	9,600	85,778.38	70,944.00	-
601118	海南橡胶	2018年5月25日	重大事项	6.62	-	-	9,400	49,350.00	62,228.00	-

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 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

6.4.13.2 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中国银行，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月19日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	149,986,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	10,065,500.00	250,196,000.00
合计	10,065,500.00	400,182,000.00

注：以上按短期信用评级的债券投资未评级的债券投资为超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 19 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	9,876,000.00
AAA 以下	8,498,119.70	171,053,266.70
未评级	-	8,601,350.40
合计	8,498,119.70	189,530,617.10

注：以上按长期信用评级的债券投资未评级债券为政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金所持大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 6.4.12 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。

于 2018 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 6 月 19 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 17.73%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 6 月 19 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 69773868.35 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018年6 月19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	12,736,629.96	-	-	-	-	-	12,736,629.96
结算备付金	9,383,811.90	-	-	-	-	-	9,383,811.90
存出保证金	35,358.62	-	-	-	-	-	35,358.62
交易性金融资产	10,065,500.00	-	931,499.70	7,566,620.00	-	54,110,265.18	72,673,884.88
应收利息	-	-	-	-	-	516,396.12	516,396.12
资产总计	32,221,300.48	-	931,499.70	7,566,620.00	-	54,626,661.30	95,346,081.48
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,000,186.45	2,000,186.45
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,756,105.05	4,756,105.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	87,858.71	87,858.71
应付托管费	-	-	-	-	-	14,643.12	14,643.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	143,125.44	143,125.44
应付利息	-	-	-	-	-	4,926.23	4,926.23
应交税费	-	-	-	-	-	1,998.43	1,998.43
其他负债	-	-	-	-	-	161,610.70	161,610.70

负债总计	-	-	-	-	-	7,170,454.13	7,170,454.13
利率敏感度缺口	32,221,300.48	-	931,499.70	7,566,620.00	-	47,456,207.17	88,175,627.35
上年度末 2017年12月31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	1,074,533.13	-	-	-	-	-	1,074,533.13
结算备付金	1,368,166.83	-	-	-	-	-	1,368,166.83
存出保证金	7,116.70	-	-	-	-	-	7,116.70
交易性金融资产	20,179,000.00	126,817,363.50	361,487,903.20	81,228,350.40	-	138,310,240.94	728,022,858.04
应收利息	-	-	-	-	-	11,700,202.77	11,700,202.77
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,628,816.66	126,817,363.50	361,487,903.20	81,228,350.40	-	150,010,443.71	742,172,877.47
负债							
卖出回购金融资产款	107,529,438.70	-	-	-	-	-	107,529,438.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	817,433.47	817,433.47
应付托管费	-	-	-	-	-	136,238.91	136,238.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,774.43	14,774.43
应付利息	-	-	-	-	-	95,707.87	95,707.87
其他负债	-	-	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	107,529,438.70	-	-	-	-	1,234,154.68	108,763,593.38
利率敏感度缺口	-84,900,622.04	126,817,363.50	361,487,903.20	81,228,350.40	-	148,776,289.03	633,409,284.09

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月19日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	5,971.42	642,076.38

市场利率上升 25 个基点	-5,956.29	-638,681.65
---------------	-----------	-------------

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金在封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%；非公开发行股票资产占非现金基金资产的比例为 0%-100%；债券资产占基金资产的比例范围为 0%-100%，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 19 日		上年度末 2017 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	54,110,265.18	61.37	138,310,240.94	21.84
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	54,110,265.18	61.37	138,310,240.94	21.84

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月19日）	上年度末（2017年12月31日）
	业绩比较基准增加5%	2,590,599.93	6,042,724.57
	业绩比较基准减少5%	-2,590,599.93	-6,042,724.57

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	53,075,918.18	59.93
	其中：股票	53,075,918.18	59.93
2	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	-	-
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	16,309,976.85	18.42
7	其他各项资产	610,322.83	0.69
8	合计	88,565,244.86	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	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

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	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
11	601939	建设银行	124,900	818,095.00	0.93
12	002415	海康威视	20,700	768,591.00	0.87
13	001979	招商蛇口	37,500	714,375.00	0.81
14	300750	宁德时代	9,619	692,183.24	0.79
15	603345	安井食品	17,100	598,500.00	0.68
16	601009	南京银行	60,300	466,119.00	0.53
17	600028	中国石化	70,100	454,949.00	0.52
18	603589	口子窖	7,400	454,730.00	0.52
19	600519	贵州茅台	600	438,876.00	0.50
20	603288	海天味业	5,900	434,476.00	0.49
21	601601	中国太保	13,100	417,235.00	0.47
22	600048	保利地产	33,800	412,360.00	0.47
23	002594	比亚迪	8,600	410,048.00	0.47
24	000402	金融街	47,600	383,180.00	0.43
25	300059	东方财富	28,820	379,847.60	0.43

26	601155	新城控股	12,200	377,834.00	0.43
27	600600	青岛啤酒	8,600	376,938.00	0.43
28	600521	华海药业	13,600	362,984.00	0.41
29	002507	涪陵榨菜	14,000	359,520.00	0.41
30	600436	片仔癀	3,100	346,983.00	0.39
31	600809	山西汾酒	5,500	345,895.00	0.39
32	600298	安琪酵母	9,400	335,392.00	0.38
33	000596	古井贡酒	3,400	301,852.00	0.34
34	601398	工商银行	53,000	281,960.00	0.32
35	600114	东睦股份	28,784	281,219.68	0.32
36	600690	青岛海尔	14,400	277,344.00	0.31
37	600498	烽火通信	10,700	265,895.00	0.30
38	600585	海螺水泥	7,900	264,492.00	0.30
39	002304	洋河股份	2,000	263,200.00	0.30
40	002024	苏宁易购	18,600	261,888.00	0.30
41	002396	星网锐捷	12,700	259,969.00	0.30
42	600763	通策医疗	5,300	257,951.00	0.29
43	000069	华侨城A	35,000	253,050.00	0.29
44	601818	光大银行	68,900	252,174.00	0.29
45	002202	金风科技	19,400	245,216.00	0.28
46	000166	申万宏源	56,000	244,720.00	0.28
47	600845	宝信软件	9,100	239,785.00	0.27
48	600050	中国联通	48,700	239,604.00	0.27
49	600019	宝钢股份	29,500	229,805.00	0.26
50	600588	用友网络	9,300	227,943.00	0.26
51	603568	伟明环保	9,000	227,700.00	0.26
52	300017	网宿科技	21,000	224,910.00	0.26
53	002419	天虹股份	15,350	224,110.00	0.25
54	002450	康得新	13,100	223,748.00	0.25
55	002376	新北洋	13,500	223,290.00	0.25
56	300124	汇川技术	6,763	221,961.66	0.25
57	601006	大秦铁路	27,000	221,670.00	0.25
58	600452	涪陵电力	7,600	207,556.00	0.24
59	600703	三安光电	10,700	205,654.00	0.23
60	000661	长春高新	900	204,930.00	0.23
61	002008	大族激光	3,700	196,803.00	0.22
62	603799	华友钴业	2,000	194,940.00	0.22
63	600104	上汽集团	5,500	192,445.00	0.22
64	600392	盛和资源	11,400	185,022.00	0.21

65	300661	圣邦股份	1,500	184,725.00	0.21
66	601788	光大证券	16,800	184,464.00	0.21
67	002142	宁波银行	11,100	180,819.00	0.21
68	601288	农业银行	51,500	177,160.00	0.20
69	603788	宁波高发	7,000	172,480.00	0.20
70	601628	中国人寿	7,600	171,152.00	0.19
71	600900	长江电力	10,600	171,084.00	0.19
72	300178	腾邦国际	12,100	170,126.00	0.19
73	601877	正泰电器	7,600	169,632.00	0.19
74	601799	星宇股份	2,800	167,692.00	0.19
75	600660	福耀玻璃	6,400	164,544.00	0.19
76	600297	广汇汽车	26,500	155,290.00	0.18
77	600438	通威股份	22,500	155,250.00	0.18
78	002027	分众传媒	15,960	152,737.20	0.17
79	600282	南钢股份	32,700	144,534.00	0.16
80	300144	宋城演艺	6,100	143,350.00	0.16
81	603027	千禾味业	6,300	142,758.00	0.16
82	601336	新华保险	3,300	141,504.00	0.16
83	600887	伊利股份	5,000	139,500.00	0.16
84	000002	万科A	5,600	137,760.00	0.16
85	002128	露天煤业	14,900	134,994.00	0.15
86	600066	宇通客车	7,000	134,330.00	0.15
87	601186	中国铁建	15,500	133,610.00	0.15
88	601872	招商轮船	36,600	132,126.00	0.15
89	000768	中航飞机	8,400	131,376.00	0.15
90	603179	新泉股份	5,900	129,505.00	0.15
91	002371	北方华创	2,600	129,142.00	0.15
92	600016	民生银行	18,000	126,000.00	0.14
93	000968	蓝焰控股	11,700	121,563.00	0.14
94	002044	美年健康	5,320	120,232.00	0.14
95	000425	徐工机械	28,300	119,992.00	0.14
96	600740	山西焦化	11,600	119,248.00	0.14
97	600115	东方航空	17,900	118,498.00	0.13
98	600867	通化东宝	4,740	113,617.80	0.13
99	601998	中信银行	17,800	110,538.00	0.13
100	002138	顺络电子	6,900	110,469.00	0.13
101	000709	河钢股份	37,000	109,150.00	0.12
102	000703	恒逸石化	7,300	108,624.00	0.12
103	300745	欣锐科技	1,304	107,032.32	0.12

104	002714	牧原股份	2,400	106,704.00	0.12
105	000963	华东医药	2,200	106,150.00	0.12
106	601390	中国中铁	13,300	99,351.00	0.11
107	002500	山西证券	14,700	99,078.00	0.11
108	600547	山东黄金	4,100	98,072.00	0.11
109	002475	立讯精密	4,300	96,922.00	0.11
110	002440	闰土股份	8,100	94,689.00	0.11
111	002310	东方园林	7,200	94,176.00	0.11
112	000157	中联重科	22,700	93,297.00	0.11
113	002311	海大集团	4,400	92,840.00	0.11
114	300024	机器人	5,300	92,220.00	0.10
115	000792	盐湖股份	8,500	91,970.00	0.10
116	600886	国投电力	12,500	90,875.00	0.10
117	000887	中鼎股份	6,300	90,783.00	0.10
118	000060	中金岭南	18,650	90,639.00	0.10
119	000681	视觉中国	3,100	88,970.00	0.10
120	600009	上海机场	1,600	88,768.00	0.10
121	002624	完美世界	2,800	86,828.00	0.10
122	600760	中航沈飞	2,400	86,496.00	0.10
123	300476	胜宏科技	5,600	86,240.00	0.10
124	002174	游族网络	4,100	81,590.00	0.09
125	601229	上海银行	5,100	80,376.00	0.09
126	601618	中国中冶	24,000	79,920.00	0.09
127	000100	TCL 集团	27,400	79,460.00	0.09
128	300746	汉嘉设计	2,318	79,391.50	0.09
129	002555	三七互娱	6,500	78,975.00	0.09
130	601111	中国国航	8,788	78,125.32	0.09
131	600637	东方明珠	5,100	76,806.00	0.09
132	002315	焦点科技	5,300	76,638.00	0.09
133	300170	汉得信息	4,700	76,328.00	0.09
134	600999	招商证券	5,501	75,253.68	0.09
135	600596	新安股份	4,600	74,382.00	0.08
136	002120	韵达股份	1,400	74,270.00	0.08
137	601933	永辉超市	9,100	69,524.00	0.08
138	002472	双环传动	7,900	67,703.00	0.08
139	601333	广深铁路	15,900	67,575.00	0.08
140	002470	金正大	9,600	66,048.00	0.07
141	600136	当代明诚	5,400	65,340.00	0.07
142	300136	信维通信	2,100	64,533.00	0.07

143	300377	赢时胜	4,600	62,514.00	0.07
144	601118	海南橡胶	9,400	62,228.00	0.07
145	601566	九牧王	4,200	61,950.00	0.07
146	600170	上海建工	20,200	61,408.00	0.07
147	300015	爱尔眼科	1,900	61,351.00	0.07
148	600027	华电国际	15,600	61,152.00	0.07
149	600606	绿地控股	9,300	60,822.00	0.07
150	600820	隧道股份	10,200	60,282.00	0.07
151	300070	碧水源	4,300	59,899.00	0.07
152	600153	建发股份	6,600	59,334.00	0.07
153	601021	春秋航空	1,600	56,048.00	0.06
154	601012	隆基股份	3,300	55,077.00	0.06
155	600676	交运股份	10,403	51,052.51	0.06
156	603833	欧派家居	400	51,012.00	0.06
157	300258	精锻科技	3,700	50,875.00	0.06
158	300251	光线传媒	4,900	49,882.00	0.06
159	603612	索通发展	1,700	48,620.00	0.06
160	000627	天茂集团	6,800	47,736.00	0.05
161	300373	扬杰科技	1,600	45,760.00	0.05
162	300122	智飞生物	1,000	45,740.00	0.05
163	002341	新纶科技	3,400	45,186.00	0.05
164	002352	顺丰控股	1,000	45,000.00	0.05
165	002343	慈文传媒	2,380	44,672.60	0.05
166	002076	雪莱特	8,800	41,272.00	0.05
167	601139	深圳燃气	7,410	41,125.50	0.05
168	300315	掌趣科技	9,600	40,128.00	0.05
169	601088	中国神华	2,000	39,880.00	0.05
170	000528	柳工	3,700	39,627.00	0.04
171	300027	华谊兄弟	6,400	39,424.00	0.04
172	300413	快乐购	1,000	37,940.00	0.04
173	002025	航天电器	1,600	36,960.00	0.04
174	000959	首钢股份	8,600	35,346.00	0.04
175	600967	内蒙一机	2,700	34,398.00	0.04
176	002129	中环股份	3,900	30,537.00	0.03
177	002531	天顺风能	6,700	29,145.00	0.03
178	600029	南方航空	3,400	28,730.00	0.03
179	300335	迪森股份	2,700	28,728.00	0.03
180	601225	陕西煤业	2,700	22,194.00	0.03
181	603260	合盛硅业	300	21,171.00	0.02

182	000581	威孚高科	800	17,688.00	0.02
183	002078	太阳纸业	1,700	16,473.00	0.02
184	601117	中国化学	2,200	14,806.00	0.02
185	000902	新洋丰	1,200	11,040.00	0.01
186	601899	紫金矿业	3,000	10,830.00	0.01
187	300470	日机密封	200	9,394.00	0.01
188	600362	江西铜业	500	7,925.00	0.01
189	000338	潍柴动力	900	7,875.00	0.01
190	600522	中天科技	901	7,833.62	0.01
191	002258	利尔化学	400	7,744.00	0.01
192	002157	正邦科技	1,016	4,135.12	0.00
193	000555	神州信息	303	4,023.84	0.00
194	600531	豫光金铅	540	2,667.60	0.00
195	000901	航天科技	264	2,645.28	0.00
196	002073	软控股份	85	488.75	0.00
197	002516	旷达科技	77	274.12	0.00

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	002594	比亚迪	402,280.00	0.46
2	000166	申万宏源	243,600.00	0.28
3	600519	贵州茅台	212,650.00	0.24
4	002376	新北洋	209,078.00	0.24
5	002419	天虹股份	175,520.00	0.20
6	603345	安井食品	115,236.00	0.13
7	000703	恒逸石化	111,325.00	0.13
8	002202	金风科技	93,611.00	0.11
9	600886	国投电力	90,250.00	0.10
10	300144	宋城演艺	84,231.00	0.10
11	600763	通策医疗	81,237.00	0.09
12	000100	TCL 集团	78,638.00	0.09
13	603568	伟明环保	74,842.00	0.08
14	600606	绿地控股	65,937.00	0.07
15	300136	信维通信	62,391.00	0.07

16	601012	隆基股份	28,351.00	0.03
17	601899	紫金矿业	11,490.00	0.01
18	300470	日机密封	9,294.00	0.01
19	000338	潍柴动力	7,839.00	0.01

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。

7.3.2 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	000961	中南建设	403,130.00	0.46
2	601211	国泰君安	242,629.00	0.28
3	002466	天齐锂业	229,455.00	0.26
4	603019	中科曙光	221,542.00	0.25
5	600570	恒生电子	211,638.00	0.24
6	600681	百川能源	208,012.00	0.24
7	600483	福能股份	181,392.00	0.21
8	601901	方正证券	179,121.00	0.20
9	002572	索菲亚	176,034.00	0.20
10	000960	锡业股份	148,748.00	0.17
11	300389	艾比森	113,689.00	0.13
12	600028	中国石化	111,125.00	0.13
13	300136	信维通信	98,671.00	0.11
14	300571	平治信息	85,366.00	0.10
15	600332	白云山	81,082.00	0.09
16	600004	白云机场	79,910.00	0.09
17	601111	中国国航	77,964.00	0.09
18	600482	中国动力	65,397.00	0.07
19	002456	欧菲科技	61,828.00	0.07
20	000002	万科 A	34,370.00	0.04

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	2,157,800.00
卖出股票收入（成交）总额	3,060,925.96

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	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

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

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。

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	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

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	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

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	54,110,265.18	56.75
	其中：股票	54,110,265.18	56.75
2	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	-	-
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	22,120,441.86	23.20
7	其他资产	551,754.74	0.58
8	合计	95,346,081.48	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	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

0	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

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	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
11	000333	美的集团	16,000	873,920.00	0.99
12	001979	招商蛇口	37,500	805,125.00	0.91
13	002415	海康威视	20,700	775,836.00	0.88
14	600028	中国石化	87,600	565,020.00	0.64
15	300750	宁德时代	9,619	560,787.70	0.64
16	000961	中南建设	67,200	497,280.00	0.56
17	601601	中国太保	13,100	476,054.00	0.54
18	601009	南京银行	60,300	473,355.00	0.54
19	600048	保利地产	33,800	455,962.00	0.52
20	603288	海天味业	5,900	449,934.00	0.51
21	603589	口子窖	7,400	443,852.00	0.50
22	603345	安井食品	13,800	431,250.00	0.49
23	000402	金融街	47,600	397,936.00	0.45
24	600600	青岛啤酒	8,600	380,980.00	0.43

25	601155	新城控股	12,200	375,760.00	0.43
26	600521	华海药业	13,600	360,128.00	0.41
27	300059	东方财富	28,820	357,079.80	0.40
28	600298	安琪酵母	9,400	335,486.00	0.38
29	600436	片仔癀	3,100	330,894.00	0.38
30	002507	涪陵榨菜	14,000	329,000.00	0.37
31	600809	山西汾酒	5,500	328,515.00	0.37
32	601398	工商银行	53,000	304,220.00	0.35
33	600690	青岛海尔	14,400	288,288.00	0.33
34	000596	古井贡酒	3,400	283,560.00	0.32
35	600585	海螺水泥	7,900	282,267.00	0.32
36	002304	洋河股份	2,000	276,400.00	0.31
37	600114	东睦股份	28,784	275,462.88	0.31
38	000069	华侨城 A	35,000	271,250.00	0.31
39	601818	光大银行	68,900	268,710.00	0.30
40	002466	天齐锂业	4,700	258,453.00	0.29
41	600019	宝钢股份	29,500	253,110.00	0.29
42	601211	国泰君安	16,400	250,264.00	0.28
43	600498	烽火通信	10,700	249,310.00	0.28
44	002024	苏宁易购	18,600	247,194.00	0.28
45	600050	中国联通	48,700	242,526.00	0.28
46	601006	大秦铁路	27,000	241,650.00	0.27
47	002396	星网锐捷	12,700	241,554.00	0.27
48	002450	康得新	13,100	223,748.00	0.25
49	603019	中科曙光	5,300	222,441.00	0.25
50	600519	贵州茅台	300	221,400.00	0.25
51	300124	汇川技术	6,763	215,266.29	0.24
52	601111	中国国航	17,688	208,895.28	0.24
53	600681	百川能源	16,100	208,495.00	0.24
54	600452	涪陵电力	7,600	208,012.00	0.24
55	600703	三安光电	10,700	207,473.00	0.24
56	600570	恒生电子	4,200	205,800.00	0.23
57	300017	网宿科技	21,000	202,650.00	0.23
58	600588	用友网络	9,300	202,554.00	0.23
59	600104	上汽集团	5,500	202,400.00	0.23
60	002008	大族激光	3,700	196,433.00	0.22
61	600845	宝信软件	9,100	195,468.00	0.22
62	002572	索菲亚	5,500	192,500.00	0.22
63	002142	宁波银行	11,100	191,142.00	0.22

64	000002	万 科A	7,000	189,700.00	0.22
65	601628	中国人寿	7,600	189,544.00	0.21
66	600900	长江电力	10,600	187,514.00	0.21
67	601288	农业银行	51,500	186,945.00	0.21
68	600483	福能股份	24,100	186,534.00	0.21
69	000661	长春高新	900	184,500.00	0.21
70	002202	金风科技	12,800	179,200.00	0.20
71	600392	盛和资源	11,400	178,980.00	0.20
72	601788	光大证券	16,800	177,576.00	0.20
73	603799	华友钴业	2,000	176,620.00	0.20
74	300661	圣邦股份	1,500	167,640.00	0.19
75	601877	正泰电器	7,600	167,580.00	0.19
76	603788	宁波高发	7,000	165,620.00	0.19
77	600660	福耀玻璃	6,400	165,184.00	0.19
78	601901	方正证券	27,300	162,162.00	0.18
79	601799	星宇股份	2,800	160,580.00	0.18
80	002027	分众传媒	13,300	159,068.00	0.18
81	600297	广汇汽车	26,500	158,470.00	0.18
82	600763	通策医疗	3,600	157,356.00	0.18
83	601336	新华保险	3,300	155,793.00	0.18
84	300178	腾邦国际	12,100	154,033.00	0.17
85	603027	千禾味业	6,300	152,082.00	0.17
86	000960	锡业股份	12,600	150,570.00	0.17
87	600066	宇通客车	7,000	147,210.00	0.17
88	600282	南钢股份	32,700	147,150.00	0.17
89	600115	东方航空	17,900	146,422.00	0.17
90	600438	通威股份	22,500	143,100.00	0.16
91	600887	伊利股份	5,000	141,050.00	0.16
92	603568	伟明环保	6,000	137,040.00	0.16
93	002128	露天煤业	14,900	134,845.00	0.15
94	603179	新泉股份	5,900	133,104.00	0.15
95	601186	中国铁建	15,500	132,680.00	0.15
96	600016	民生银行	18,000	130,500.00	0.15
97	601872	招商轮船	36,600	125,538.00	0.14
98	002371	北方华创	2,600	123,136.00	0.14
99	600740	山西焦化	11,600	121,800.00	0.14
100	000768	中航飞机	8,400	117,180.00	0.13
101	000425	徐工机械	28,300	115,181.00	0.13
102	002044	美年健康	5,320	114,752.40	0.13

103	601998	中信银行	17,800	112,852.00	0.13
104	002714	牧原股份	2,400	112,656.00	0.13
105	600867	通化东宝	4,740	111,437.40	0.13
106	300389	艾比森	6,900	110,952.00	0.13
107	000709	河钢股份	37,000	108,780.00	0.12
108	002310	东方园林	7,200	108,216.00	0.12
109	000968	蓝焰控股	11,700	108,108.00	0.12
110	002138	顺络电子	6,900	106,053.00	0.12
111	300136	信维通信	3,500	104,895.00	0.12
112	600547	山东黄金	4,100	103,074.00	0.12
113	002475	立讯精密	4,300	103,028.00	0.12
114	000963	华东医药	2,200	102,828.00	0.12
115	600004	白云机场	6,100	101,443.00	0.12
116	601390	中国中铁	13,300	99,351.00	0.11
117	002311	海大集团	4,400	98,560.00	0.11
118	002440	闰土股份	8,100	97,443.00	0.11
119	002500	山西证券	14,700	97,167.00	0.11
120	600009	上海机场	1,600	93,264.00	0.11
121	000060	中金岭南	18,650	92,504.00	0.10
122	000792	盐湖股份	8,500	91,970.00	0.10
123	000157	中联重科	22,700	91,254.00	0.10
124	000887	中鼎股份	6,300	90,342.00	0.10
125	300024	机器人	5,300	87,609.00	0.10
126	600332	白云山	2,200	87,274.00	0.10
127	002624	完美世界	2,800	86,996.00	0.10
128	300746	汉嘉设计	2,318	83,911.60	0.10
129	601229	上海银行	5,100	81,141.00	0.09
130	002174	游族网络	4,100	80,770.00	0.09
131	600760	中航沈飞	2,400	80,448.00	0.09
132	601618	中国中冶	24,000	79,920.00	0.09
133	300571	平治信息	1,400	78,400.00	0.09
134	000681	视觉中国	3,100	77,159.00	0.09
135	300745	欣锐科技	1,304	76,675.20	0.09
136	600596	新安股份	4,600	76,590.00	0.09
137	300476	胜宏科技	5,600	75,936.00	0.09
138	600029	南方航空	6,900	75,279.00	0.09
139	002315	焦点科技	5,300	74,518.00	0.08
140	002120	韵达股份	1,400	74,508.00	0.08
141	600999	招商证券	5,501	74,373.52	0.08

142	601933	永辉超市	9,100	73,164.00	0.08
143	600637	东方明珠	5,100	72,165.00	0.08
144	002456	欧菲科技	4,100	71,791.00	0.08
145	002555	三七互娱	6,500	71,630.00	0.08
146	002470	金正大	9,600	70,944.00	0.08
147	600482	中国动力	3,900	69,537.00	0.08
148	600136	当代明诚	5,400	67,986.00	0.08
149	601333	广深铁路	15,900	66,144.00	0.08
150	300170	汉得信息	4,700	63,826.00	0.07
151	600153	建发股份	6,600	63,624.00	0.07
152	002472	双环传动	7,900	63,200.00	0.07
153	601118	海南橡胶	9,400	62,228.00	0.07
154	601021	春秋航空	1,600	60,832.00	0.07
155	600170	上海建工	20,200	60,802.00	0.07
156	601566	九牧王	4,200	60,648.00	0.07
157	600027	华电国际	15,600	60,528.00	0.07
158	300070	碧水源	4,300	60,157.00	0.07
159	600820	隧道股份	10,200	59,364.00	0.07
160	300015	爱尔眼科	1,900	56,544.00	0.06
161	300377	赢时胜	4,600	55,384.00	0.06
162	603833	欧派家居	400	55,256.00	0.06
163	300144	宋城演艺	2,400	53,520.00	0.06
164	603612	索通发展	1,700	51,306.00	0.06
165	300258	精锻科技	3,700	48,470.00	0.05
166	600676	交运股份	10,403	48,107.15	0.05
167	000627	天茂集团	6,800	46,920.00	0.05
168	300251	光线传媒	4,900	45,080.00	0.05
169	002352	顺丰控股	1,000	44,980.00	0.05
170	002343	慈文传媒	1,700	44,642.00	0.05
171	002341	新纶科技	3,400	43,928.00	0.05
172	300122	智飞生物	1,000	43,180.00	0.05
173	601088	中国神华	2,000	42,820.00	0.05
174	300373	扬杰科技	1,600	41,520.00	0.05
175	601139	深圳燃气	5,700	40,527.00	0.05
176	002076	雪莱特	8,800	39,688.00	0.05
177	300027	华谊兄弟	6,400	39,296.00	0.04
178	002419	天虹股份	2,750	38,692.50	0.04
179	300413	快乐购	1,000	38,500.00	0.04
180	300315	掌趣科技	9,600	37,728.00	0.04

181	000528	柳 工	3,700	34,373.00	0.04
182	000959	首钢股份	8,600	34,056.00	0.04
183	002025	航天电器	1,600	33,120.00	0.04
184	300335	迪森股份	2,700	29,970.00	0.03
185	600967	内蒙一机	2,700	29,673.00	0.03
186	002531	天顺风能	6,700	28,877.00	0.03
187	002129	中环股份	3,900	27,690.00	0.03
188	601012	隆基股份	1,600	24,352.00	0.03
189	601225	陕西煤业	2,700	24,057.00	0.03
190	603260	合盛硅业	300	19,701.00	0.02
191	600362	江西铜业	1,100	18,700.00	0.02
192	000581	威孚高科	800	17,848.00	0.02
193	002078	太阳纸业	1,700	16,694.00	0.02
194	601117	中国化学	2,200	16,390.00	0.02
195	600741	华域汽车	600	15,534.00	0.02
196	000902	新洋丰	1,200	10,224.00	0.01
197	600522	中天科技	901	7,653.42	0.01
198	002258	利尔化学	400	7,400.00	0.01
199	002157	正邦科技	1,016	4,216.40	0.00
200	000555	神州信息	303	2,972.43	0.00
201	600531	豫光金铅	540	2,662.20	0.00
202	000901	航天科技	264	2,531.76	0.00
203	002073	软控股份	85	487.05	0.00
204	002516	旷达科技	77	279.51	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	600036	招商银行	3,107,509.00	0.49
2	601166	兴业银行	2,790,487.00	0.44
3	600030	中信证券	2,245,139.00	0.35
4	601398	工商银行	2,165,984.00	0.34
5	601328	交通银行	1,744,856.00	0.28
6	600276	恒瑞医药	1,551,515.93	0.24
7	601668	中国建筑	1,502,672.00	0.24

8	002415	海康威视	1,417,755.00	0.22
9	600000	浦发银行	1,357,394.00	0.21
10	002044	美年健康	1,343,331.00	0.21
11	600048	保利地产	1,106,494.00	0.17
12	000333	美的集团	1,084,671.00	0.17
13	001979	招商蛇口	1,064,691.79	0.17
14	601939	建设银行	1,063,553.58	0.17
15	600028	中国石化	1,036,904.10	0.16
16	601211	国泰君安	997,674.52	0.16
17	601155	新城控股	992,378.00	0.16
18	000671	阳光城	843,724.00	0.13
19	000961	中南建设	825,747.00	0.13
20	600521	华海药业	802,962.00	0.13

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	600676	交运股份	18,207,462.25	2.87
2	002073	软控股份	15,951,590.05	2.52
3	002157	正邦科技	12,383,966.27	1.96
4	600522	中天科技	11,284,993.00	1.78
5	002344	海宁皮城	8,999,253.53	1.42
6	600531	豫光金铅	8,179,920.25	1.29
7	000901	航天科技	7,169,300.30	1.13
8	000875	吉电股份	7,014,164.23	1.11
9	002516	旷达科技	4,949,597.15	0.78
10	000555	神州信息	3,517,875.66	0.56
11	300421	力星股份	2,747,712.44	0.43
12	601398	工商银行	1,828,814.81	0.29
13	600036	招商银行	1,332,554.46	0.21
14	600000	浦发银行	1,326,916.19	0.21
15	002044	美年健康	1,187,651.56	0.19
16	600030	中信证券	954,881.21	0.15
17	000671	阳光城	843,359.83	0.13
18	601328	交通银行	730,875.41	0.12
19	600085	同仁堂	718,535.87	0.11

20	601211	国泰君安	684,090.45	0.11
----	--------	------	------------	------

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	75,636,014.50
卖出股票收入（成交）总额	135,739,784.07

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	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

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

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

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。

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	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

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	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

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
681	149,991.05	210,572.00	0.21%	101,933,330.09	99.79%

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	方辰	286,726.00	28.28%
2	张明	190,700.00	18.81%
3	江西省出版集团公司企业年金计划- 中信银行股份有限公司	189,171.00	18.66%
4	王仙爱	165,200.00	16.30%
5	黄志强	24,300.00	2.40%
6	新疆唯通股权投资管理合伙企业(有 限合伙)	21,401.00	2.11%
7	王艳华	20,000.00	1.97%
8	余湘川	18,107.00	1.79%
9	何世运	9,000.00	0.89%
10	雷邱	6,200.00	0.61%

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	0.00	0.0000%

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

§ 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
682	149,771.12	210,572.00	0.21%	101,933,330.09	99.79%

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	江西省出版集团公司企业年金计划- 中信银行股份有限公司	189,171.00	26.02%
2	王仙爱	165,200.00	22.72%
3	周红菊	119,000.00	16.37%
4	刘春桃	37,900.00	5.21%
5	余湘川	29,507.00	4.06%
6	黄志强	24,300.00	3.34%
7	新疆唯通股权投资管理合伙企业(有 限合伙)	21,401.00	2.94%
8	王艳华	20,000.00	2.75%
9	冯志芳	12,400.00	1.71%
10	林思特	9,300.00	1.28%

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	0.00	0.0000%

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

§ 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	102,143,902.09
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	-
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	102,143,902.09

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 6 月 20 日，此处期末份额日期为 2018 年 6 月 30 日。

§ 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	673,107,849.99
本报告期期初基金份额总额	673,107,849.99
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,656.76
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	570,970,604.66
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	102,143,902.09

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 6 月 20 日，此处期末份额日期为 2018 年 6 月 19 日。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（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	
中泰证券	1	2,207,146.00	42.27%	1,570.01	40.03%	-
西藏东方财富	2	1,124,371.00	21.53%	799.78	20.39%	-

招商证券	2	479,790.00	9.19%	446.81	11.39%	-
长江证券	1	433,180.00	8.30%	403.44	10.29%	-
浙商证券	2	374,533.00	7.17%	266.41	6.79%	-
东方证券	2	355,623.00	6.81%	260.03	6.63%	-
西南证券	1	247,419.00	4.74%	176.01	4.49%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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	
国泰君安	2	47,394,449.69	22.45%	33,711.31	21.20%	-
兴业证券	2	39,978,295.25	18.94%	29,423.39	18.50%	-
西藏东方财富	2	25,906,079.94	12.27%	18,427.24	11.59%	-
南京证券	1	25,338,153.00	12.00%	18,023.32	11.33%	-
华泰证券	1	23,623,539.72	11.19%	16,803.45	10.57%	-
中信证券	2	15,968,646.00	7.56%	15,104.90	9.50%	-
浙商证券	2	10,783,216.76	5.11%	7,670.02	4.82%	-
长江证券	1	10,536,515.00	4.99%	9,812.93	6.17%	-
招商证券	2	8,109,780.00	3.84%	7,552.65	4.75%	-
西南证券	1	2,074,370.79	0.98%	1,475.50	0.93%	-
东方证券	2	1,392,712.00	0.66%	1,018.45	0.64%	-
申万证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	2	-	-	-	-	-

民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

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
国泰君安	8,629,314.79	6.30%	182,000,000.00	5.64%	-	-
兴业证券	989,448.79	0.72%	-	-	-	-
西藏东方财富	9,087,575.64	6.64%	992,000,000.00	30.75%	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	5,887,918.18	4.30%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	162,500,000.00	5.04%	-	-
长江证券	20,471,107.34	14.95%	711,000,000.00	22.04%	-	-
招商证券	10,004,431.86	7.31%	799,000,000.00	24.77%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	65,000,000.00	2.02%	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	7,430,724.05	5.43%	-	-	-	-
方正证券	5,667,877.86	4.14%	-	-	-	-
银河证券	8,198,497.60	5.99%	-	-	-	-
华信证券	10,467,351.34	7.65%	12,000,000.00	0.37%	-	-
民生证券	-	-	125,000,000.00	3.88%	-	-
平安证券	42,346,918.84	30.93%	125,000,000.00	3.88%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	7,718,488.25	5.64%	52,000,000.00	1.61%	-	-

10.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	公司网站、证券日报、中国证券报	2018年6月20日
2	关于旗下基金所持东方园林（代码 002310）、上海电气（代码 601727）估值调整的公告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018年6月26日

10.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金新增南京证券为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018年1月12日
2	平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018年1月19日
3	关于旗下基金所持东山精密（代码：002384）、软控股份（代	公司网站、证券日报、中国证券报	2018年2月7日

	码:002073) 估值调整的公告		
4	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变更公告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 3 月 17 日
5	关于平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的公告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 3 月 24 日
6	平安大华基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金赎回费的公告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 3 月 26 日
7	平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告以及摘要	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 3 月 29 日
8	关于旗下部分基金新增中民财富基金销售(上海)有限公司为销售机构公告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 3 月 30 日
9	平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 1 季度报告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 4 月 20 日
10	平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2018 年第 1 期)以及摘要	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 5 月 3 日
11	关于平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金第一个开放期开放申购、赎回业务的公告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 5 月 14 日
12	关于旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为销售机构公告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 5 月 29 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	1	20180126-20180228	180,007,100.00	-	180,007,100.00	-	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。

11.2 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》。

§ 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鼎越灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 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、平安大华鼎越灵活配置混合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、报告期内平安大华鼎越灵活配置混合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

2018 年 8 月 27 日