

# 平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金

## 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

原平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资报告期自 2018 年 1 月 1 日至 1 月 18 日，平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2018 年 1 月 19 日至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
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）.....	11
3.3 其他指标.....	13
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>14</b>
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.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....	<b>37</b>
6.1 资产负债表.....	37
6.2 利润表.....	38
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	39
6.4 报表附注.....	40
<b>§7 投资组合报告（转型后）</b> .....	<b>56</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	56
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	56
7.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
7.11 投资组合报告附注 .....	58
<b>§7 投资组合报告（转型前） .....</b>	<b>59</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	59
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	59
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 .....	59
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§8 基金份额持有人信息（转型后） .....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	62
<b>§8 基金份额持有人信息（转型前） .....</b>	<b>63</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	63
<b>§9 开放式基金份额变动(转型后) .....</b>	<b>64</b>
<b>§9 开放式基金份额变动(转型前) .....</b>	<b>65</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>66</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	66
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 .....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
10.4 基金投资策略的改变 .....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
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 .....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后） .....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前） .....	69
10.9 其他重大事件（转型后） .....	72
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>74</b>
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 .....	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>75</b>

12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	平安大华鑫利混合
场内简称	-
基金主代码	003626
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 12 月 7 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	169,123.90 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

本基金转型日期为 2018 年 1 月 19 日，该日起原平安大华鑫利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鑫利灵活配置混合型证券投资基金，此处期末份额日期为 2018 年 6 月 30 日。

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	平安大华鑫利定期开放
场内简称	-
基金主代码	003626
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，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。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）或首个开放期结束之日次日至 6 个月（含 6 个月）后的对应日的前一日止。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，本基金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 12 月 7 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	137,725.12 份
基金合同存续期	不定期

基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

本基金转型日期为 2018 年 1 月 19 日，该日起原平安大华鑫利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鑫利灵活配置混合型证券投资基金，此处期末份额日期为 2018 年 1 月 18 日。

## 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	在严格控制风险的基础上，本基金通过灵活的资产配置，力求在有效分散风险的同时实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金转型为开放式基金后，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×30%+中证综合债指数收益率×70%。
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	在严格控制风险的基础上，本基金通过灵活的资产配置，力求在有效分散风险的同时实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。
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	funds@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	深圳市罗湖区深南东路

	5033 号平安金融中心 34 层	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	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2018年1月19日(基金合同生效日)至2018年6月30日
本期已实现收益	782.98
本期利润	782.98
加权平均基金份额本期利润	0.0054
本期加权平均净值利润率	0.52%
本期基金份额净值增长率	0.54%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2018年6月30日
期末可供分配利润	6,459.88
期末可供分配基金份额利润	0.0382
期末基金资产净值	175,583.82
期末基金份额净值	1.0382
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018年6月30日
基金份额累计净值增长率	0.54%

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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2018年1月1日至2018年1月18日
本期已实现收益	177.16
本期利润	177.16
加权平均基金份额本期利润	0.0013
本期加权平均净值利润率	0.13%
本期基金份额净值增长率	0.13%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2018年1月18日
期末可供分配利润	4,486.27
期末可供分配基金份额利润	0.0326
期末基金资产净值	142,211.44
期末基金份额净值	1.0326
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018年1月18日
基金份额累计净值增长率	6.31%

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

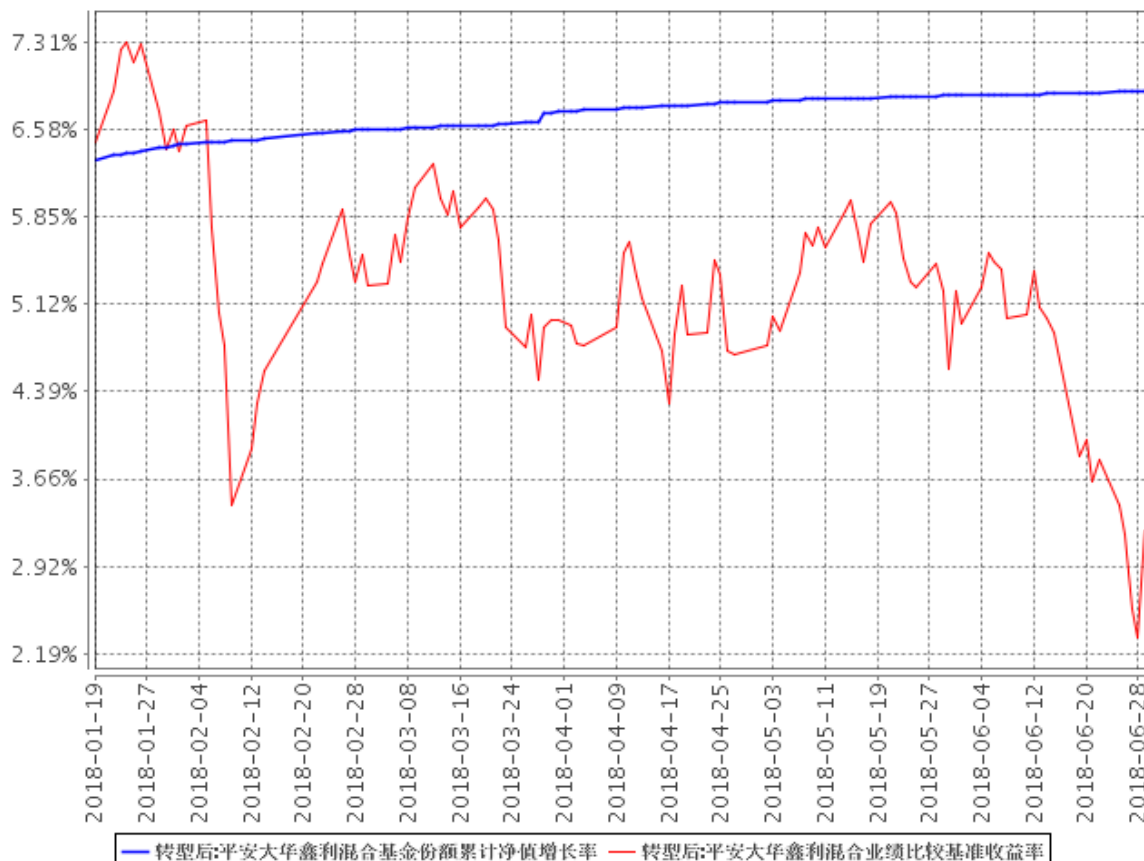
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.03%	0.00%	-1.91%	0.38%	1.94%	-0.38%
过去三个月	0.15%	0.00%	-1.68%	0.34%	1.83%	-0.34%
自基金合同生效起至今	0.54%	0.01%	-2.95%	0.36%	3.49%	-0.35%

注：1、业绩比较基准为中证综合债指数收益率\*70%+沪深 300 指数收益率\*30%。其中，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综合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、短期融资券以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基准。本基金为灵活配置型基金，通常状况下基金在运作过程中股票资产将在 0%-95%范围内调整。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准的权重分别是 30%和 70%。

注：本基金在 2018 年 1 月 19 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

平安大华鑫利混合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 12 月 07 日正式生效，转型日期为 2018 年 1 月 19 日，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	0.13%	0.01%	1.81%	0.14%	-1.68%	-0.13%
过去一年	4.53%	0.65%	4.93%	0.21%	-0.40%	0.44%
自基金合同生效起至今	6.31%	0.46%	6.36%	0.21%	-0.05%	0.25%

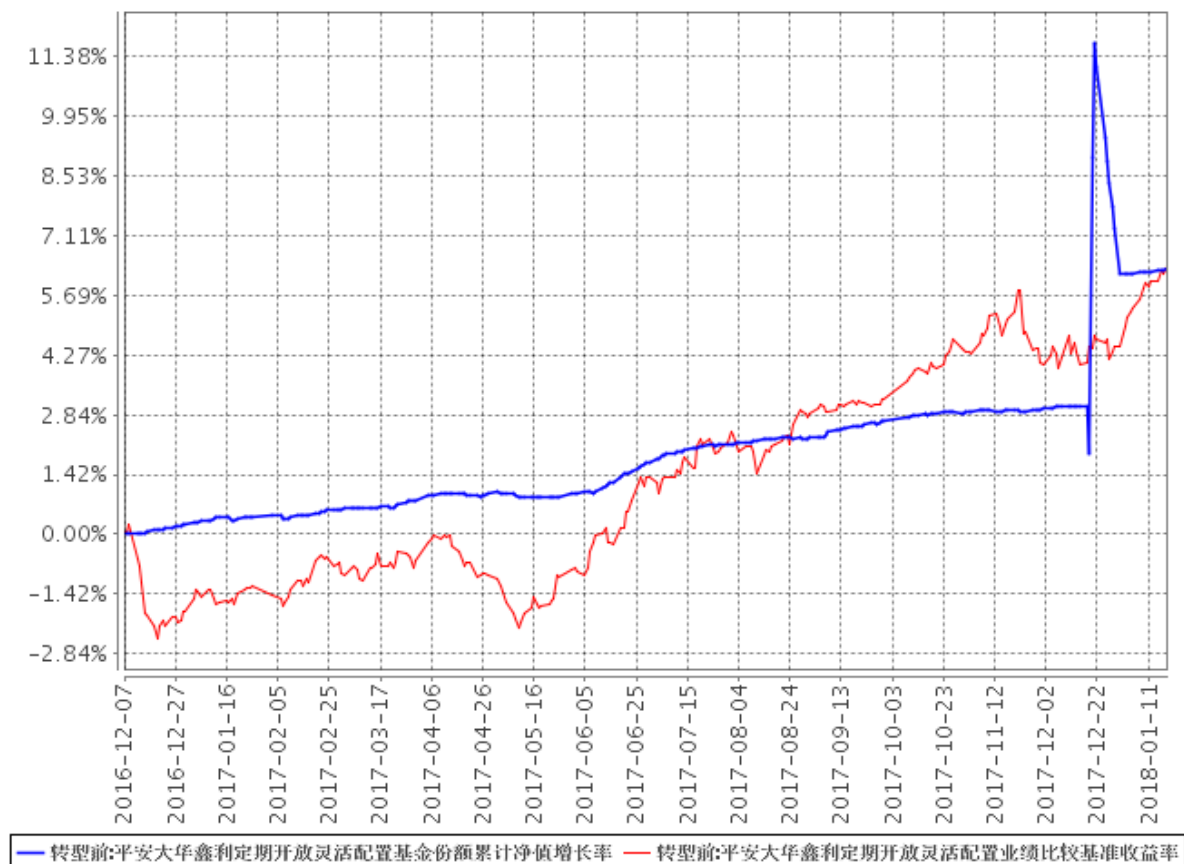
注：1、业绩比较基准为中证综合债指数收益率\*70%+沪深 300 指数收益率\*30%。其中，沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场

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综合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、短期融资券以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基准。本基金为灵活配置型基金，通常状况下基金在运作过程中股票资产将在 0%-95%范围内调整。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准的权重分别是 30%和 70%。

注：本基金在 2018 年 1 月 19 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 18 日，过去一年为 2017 年 7 月 1 日至 2018 年 1 月 18 日，基金合同生效以来为合同成立日至 2018 年 1 月 18 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

平安大华鑫利定期开放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 12 月 07 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	平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016 年 12 月 7 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。

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		
WANG AO	平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2016年12月7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、平安大华鑫利定期开放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、《平安大华鑫利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，两两组合间单日、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

今年上半年债券市场收益率在一月份见顶以后，随后出现一路下行的走势，本基金的主要策略是以现金管理为主，未进行权益投资。上半年债券市场是在货币政策边际宽松与社会融资需求走弱的主逻辑下走出了牛市行情。贸易摩擦与权益市场波动率上升引发的避险情绪也导致资金流向债券市场。

#### 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 19 日-2018 年 6 月 30 日）份额净值增长率为 0.54%，同期业绩比较基准增长率为-2.95%；

截至转型前报告期末，本报告期（2018 年 1 月 1 日-2018 年 1 月 18 日）份额净值增长率为 0.13%，同期业绩比较基准增长率为 1.81%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金认为中长期经济增速仍然面临较大的下行压力，政策将继续加码促进社会融资的增长，财政可能发力，今年表现最疲软的基建投资有望企稳。上半年牛市主逻辑可能



遭到破坏，长端利率债波动有望加大。下半年整体信用环境将有望改善，信用债有整体性的机会，特别是 AA+以上的优质品种。

#### 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

本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，截至报告期末，以上情况未消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

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低于 200 人的情形。

## § 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”）在对平安大华鑫利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

会计主体：平安大华鑫利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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	172,286.31
结算备付金		-
存出保证金		559.40
交易性金融资产	6.4.7.2	-
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	39.56
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	3,000.00
资产总计		175,885.27
<b>负债和所有者权益</b>		<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
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		205.88
应付管理人报酬		81.63
应付托管费		13.55
应付销售服务费		-

应付交易费用	6.4.7.7	-
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	0.39
负债合计		301.45
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	169,123.90
未分配利润	6.4.7.10	6,459.92
所有者权益合计		175,583.82
负债和所有者权益总计		175,885.27

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0382 元，累计份额净值 1.0678 元，基金份额总额 169,123.90 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 19 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19日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
<b>一、收入</b>		4,250.37
1. 利息收入		1,111.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,037.41
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		74.07
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
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	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
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	3,138.89



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安大华鑫利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 12 月 7 日成立，根据《平安大华鑫利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《平安大华鑫利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，本基金的第二次开放期自 2017 年 12 月 14 日起至 2017 年 12 月 20 日止，因在第二次开放期最后一日日终触发本基金的转型条件，根据《基金合同》及《关于平安大华鑫利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 1 月 19 日转型为“平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金”。自 2018 年 1 月 19 日起，本基金正式实施转型，运作方式由原 6 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《平安大华鑫利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（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）、同业存单、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资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%。

### 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》、《平安大华鑫利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。

### 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 19 日至 2018 年 6 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) 自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	172,286.31
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：	172,286.31

### 6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告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

本基金本报告期末未持有从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	39.29
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	-
应收债券利息	-
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	0.27
合计	39.56

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
其他应收款	3,000.00
待摊费用	-
合计	3,000.00

**6.4.7.7 应付交易费用**

本基金本报告期末无应付交易费用。

**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	0.39
合计	0.39

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月19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	137,725.12	137,725.12
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	83,895.66	83,895.66
本期赎回(以“-”号填列)	-52,496.88	-52,496.88
本期末	169,123.90	169,123.90

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

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	4,486.27	0.05	4,486.32
本期利润	782.98	-	782.98
本期基金份额交易产生的变动数	1,190.63	-0.01	1,190.62
其中：基金申购款	3,048.70	-	3,048.70
基金赎回款	-1,858.07	-0.01	-1,858.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,459.88	0.04	6,459.92

## 6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2018年1月19日(基金合同生效日)至2018年6月30日
活期存款利息收入	835.98
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	196.63
其他	4.80
合计	1,037.41

#### **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**

本基金本报告期末持有股票。

#### **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**

本基金本报告期末持有债券。

##### **6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期末持有债券。

##### **6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期末持有债券。

##### **6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末持有债券。

##### **6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期末持有资产支持证券。

#### **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**

本基金本报告期末持有贵金属投资。

##### **6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期末持有贵金属投资。

##### **6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期末持有贵金属投资。

##### **6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末持有贵金属投资。

#### **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**

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动损益。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月19日(基金合同生效日)至2018年 6月30日
基金赎回费收入	138.89
其他	3,000.00
合计	3,138.89

#### 6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月19日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
审计费用	-
信息披露费	-
银行间账户维护费	3,000.00
合计	3,000.00

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司

注：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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内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 19 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	400.69
其中：支付销售机构的客户维护费	100.55

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 0.60% 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 × 0.60% / 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 19 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	66.70

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 0.10% 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 × 0.10% / 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

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期未运用固有资金投资本基金。

### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金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19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-活期存款	172,286.31	835.98

注：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。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内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**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.17 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有股票。

**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，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

**6.4.13 金融工具风险及管理****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平安银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的债券。

##### **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**

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的债券。

##### **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 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

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 172286.31 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	172,286.31	-	-	-	-	-	172,286.31
存出保证金	559.40	-	-	-	-	-	559.40
应收利息	-	-	-	-	-	39.56	39.56
其他资产	-	-	-	-	-	3,000.00	3,000.00
资产总计	172,845.71	-	-	-	-	3,039.56	175,885.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	205.88	205.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	81.63	81.63
应付托管费	-	-	-	-	-	13.55	13.55
其他负债	-	-	-	-	-	0.39	0.39
负债总计	-	-	-	-	-	301.45	301.45
利率敏感度缺口	172,845.71	-	-	-	-	2,738.11	175,583.82

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**

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

**6.4.13.4.2 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。开放期内或按照《基金合同》的约定，本基金转型为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资产净值的 5%，前述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。

于 2018 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### **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：平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 1 月 18 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 1 月 18 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	17,756.38	377,365.64
结算备付金		290,476.19	-
存出保证金		521.17	-
交易性金融资产	6.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	297.00	71.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	99.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		309,050.74	377,536.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 1 月 18 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		41.04	1,176.82
应付管理人报酬		41.15	63,131.59
应付托管费		6.83	10,521.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,750.28	4,750.28
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	162,000.00	162,000.00
负债合计		166,839.30	241,580.62
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	137,725.12	131,824.76
未分配利润	6.4.7.10	4,486.32	4,131.33
所有者权益合计		142,211.44	135,956.09
负债和所有者权益总计		309,050.74	377,536.71

注：报告截止日 2018 年 1 月 18 日，基金份额净值 1.0326 元，累计份额净值 1.0622 元，基金份额总额 137,725.12 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安大华鑫利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 1 月 18 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 18 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		225.14	3,824,052.35
1. 利息收入		225.14	4,446,680.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	225.14	27,597.63
债券利息收入		-	4,189,916.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	229,166.12
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-	73,606.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	73,606.00
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	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-696,234.15
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		47.98	853,508.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	41.15	599,779.28

2. 托管费	6.4.10.2.2	6.83	99,963.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	-	3,910.00
5. 利息支出		-	13,607.80
其中：卖出回购金融资产支出		-	13,607.80
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	-	136,247.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		177.16	2,970,544.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		177.16	2,970,544.04

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华鑫利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 1 月 18 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 1 月 18 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）	131,824.76	4,131.33	135,956.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	177.16	177.16
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）	5,900.36	177.83	6,078.19
其中：1. 基金申购款	12,633.82	401.85	13,035.67
2. 基金赎回款	-6,733.46	-224.02	-6,957.48
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）	137,725.12	4,486.32	142,211.44
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）	200,058,990.97	457,716.43	200,516,707.40

净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,970,544.04	2,970,544.04
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)	-10,872.33	-111.68	-10,984.01
其中: 1. 基金申购款	196.45	1.96	198.41
2. 基金赎回款	-11,068.78	-113.64	-11,182.42
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)	200,048,118.64	3,428,148.79	203,476,267.43

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

平安大华鑫利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]2136号《关于准予平安大华鑫利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《平安大华鑫利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,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 200,058,989.91 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 1569 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,058,990.97 份基金份额,其中认购资金利息折合 1.06 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”)。

根据《平安大华鑫利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,本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)至 6 个月(含 6 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 6 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。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。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鑫利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(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)、同业存单、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×30%+中证综合债指数收益率×70%。

#### 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》、《平安大华鑫利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。

#### 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 18 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 1 月 18 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) 自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 1 月 18 日
活期存款	17,756.38
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：	17,756.38

### 6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告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

本基金本报告期末未持有从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 1 月 18 日
应收活期存款利息	100.65
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	196.05
应收债券利息	-
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	0.30
合计	297.00

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 1 月 18 日
交易所市场应付交易费用	4,750.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,750.28

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 1 月 18 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	156,000.00
其它	6,000.00
合计	162,000.00

#### 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 1 月 18 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	131,824.76	131,824.76
本期申购	12,633.82	12,633.82
本期赎回（以“-”号填列）	-6,733.46	-6,733.46
- 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	137,725.12	137,725.12

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,131.28	0.05	4,131.33
本期利润	177.16	-	177.16
本期基金份额交易产生的变动数	177.83	-	177.83
其中：基金申购款	401.85	-	401.85
基金赎回款	-224.02	-	-224.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,486.27	0.05	4,486.32

#### 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1月18日
活期存款利息收入	28.79
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	196.05
其他	0.30
合计	225.14

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末未持有债券。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未持有债券。

#### **6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末持有债券。

#### **6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期末持有资产支持证券。

#### **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**

本基金本报告期末持有贵金属投资。

##### **6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期末持有贵金属投资。

##### **6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期末持有贵金属投资。

##### **6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期末持有贵金属投资。

#### **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/损失。

##### **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**

本基金本报告期内无股利收益。

#### **6.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期内无公允价值变动损益。

#### **6.4.7.18 其他收入**

本基金本报告期内无其他收入。

#### **6.4.7.19 交易费用**

本基金本报告期内无交易费用。

### 6.4.7.20 其他费用

本基金本报告期内无其他费用。

### 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、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司

注：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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内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1 月18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	41.15	599,779.28
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	7.28	71.14

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 0.60% 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 X 0.60% / 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1 月18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	6.83	99,963.26

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 0.10% 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 X 0.10% / 当年天数。



### 6.4.10.2.3 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。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期末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1月18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
平安银行-活期存款	17,756.38	28.79	576,581.27	15,735.14

注：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。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内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1月18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

无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有股票。

### 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，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 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平安银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的债券。

##### 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

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的债券。

### 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约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 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

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 17756.38 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1月18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	17,756.38	-	-	-	-	-	17,756.38
结算备付金	290,476.19	-	-	-	-	-	290,476.19
存出保证金	521.17	-	-	-	-	-	521.17
应收利息	-	-	-	-	-	297.00	297.00
资产总计	308,753.74	-	-	-	-	297.00	309,050.74
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	41.04	41.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41.15	41.15
应付托管费	-	-	-	-	-	6.83	6.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,750.28	4,750.28
其他负债	-	-	-	-	-	162,000.00	162,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	166,839.30	166,839.30
利率敏感度缺口	308,753.74	-	-	-	-	-166,542.30	142,211.44
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	377,365.64	-	-	-	-	-	377,365.64
应收利息	-	-	-	-	-	71.86	71.86
应收申购款	-	-	-	-	-	99.21	99.21
资产总计	377,365.64	-	-	-	-	171.07	377,536.71
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,176.82	1,176.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	63,131.59	63,131.59
应付托管费	-	-	-	-	-	10,521.93	10,521.93

应付交易费用	-	-	-	-	4,750.28	4,750.28
其他负债	-	-	-	-	162,000.00	162,000.00
负债总计	-	-	-	-	241,580.62	241,580.62
利率敏感度缺口	377,365.64	-	-	-	-241,409.55	135,956.09

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

于 2018 年 1 月 18 日，本基金未持有交易性债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

#### 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。封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 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，前述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。

于 2018 年 01 月 18 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

#### **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	-	-
	其中：股票	-	-
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	172,286.31	97.95
7	其他各项资产	3,598.96	2.05
8	合计	175,885.27	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。



### **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**

本基金本报告期末持有股票。

### **7.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本基金本报告期末持有股票。

### **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。

#### **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。

### 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

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。

### 7.11.2

本基金本报告期末持有股票。

### 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	559.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	39.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	3,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,598.96

### 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债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有股票。

### 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	-	-
	其中：股票	-	-
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	308,232.57	99.74
7	其他资产	818.17	0.26
8	合计	309,050.74	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

### 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。

#### 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。

### 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

本基金本报告期末持有股票。

### 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	521.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	297.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	818.17

### 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债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有股票。

### 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
274	617.24	0.00	0.00%	169,123.90	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	37,496.49	22.1710%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部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
355	387.96	0.00	0.00%	137,725.12	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	37,496.49	27.2256%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 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	137,725.12
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	83,895.66
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	52,496.88
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	169,123.90

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 19 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	200,058,990.97
本报告期期初基金份额总额	131,824.76
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,633.82
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	6,733.46
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	137,725.12

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 19 日，此处期末份额日期为 2018 年 1 月 18 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	
西南证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-

广州证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	4	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
光大证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	新增
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	新增
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	7	-	-	-	-	新增 2 个

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
西南证券	-	-	57,000.00	100.00%	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

### 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	5	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-

华福证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	4	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	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
东北证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

本基金租用的证券公司交易单元本期无其他证券投资。

### 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	平安大华鑫利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
2	关于平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回和转换业务的公告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 1 月 19 日
3	关于平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型为平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金的公告	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 1 月 19 日
4	平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2017 年第 2 期）以及摘要	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 1 月 20 日
5	关于平安大华鑫利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	平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2017	公司网站、证券日报、中国证券报	2018 年 3 月 29 日



	年年度报告以及摘要		
8	平安大华鑫利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
9	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
个人	1	2018/01/01--2018/03/28	37,766.26	0.00	37,766.26	0.00	0.00%
	2	2018/01/01--2018/06/30	37,496.49	0.00	0.00	37,496.49	22.17%
	3	2018/02/23--2018/06/30	3,832.82	80,465.99	0.00	84,298.81	49.84%

#### 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

本基金的第二次开放期自 2017 年 12 月 14 日起至 2017 年 12 月 20 日止，因在第二次开放期最后一日日终触发本基金的转型条件，根据《基金合同》及《关于平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型为平安大华鑫利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 1 月 19 日起正式转型为“平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金”。

## § 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鑫利灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、平安大华鑫利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、报告期内平安大华鑫利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