

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金  
(LOF)  
2018 年第 3 季度报告

2018 年 9 月 30 日

基金管理人：平安大华基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	平安大华鼎泰混合
场内简称	平安鼎泰
交易代码	167001
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市开放式基金（LOF）
基金合同生效日	2016 年 7 月 21 日
报告期末基金份额总额	435,614,227.96 份
投资目标	本基金转为上市开放式基金（LOF）后，积极发掘可能对上市公司当前或未来价值产生重大影响各类事件，通过筛选、鉴别事件信息扩散对资产价格的影响模式，选择最具有竞争优势的标的，在控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金转为上市开放式基金（LOF）后，并更名为平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金（LOF），在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件，将事件性因素作为投资的主线，形成以事件驱动为核心的投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基

	金。
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

注：本基金转型日期为 2018 年 1 月 20 日，该日起原“平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金”转型为“平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018 年 7 月 1 日 — 2018 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-3,655,694.92
2. 本期利润	-7,216,119.81
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0161
4. 期末基金资产净值	292,045,843.90
5. 期末基金份额净值	0.6704

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

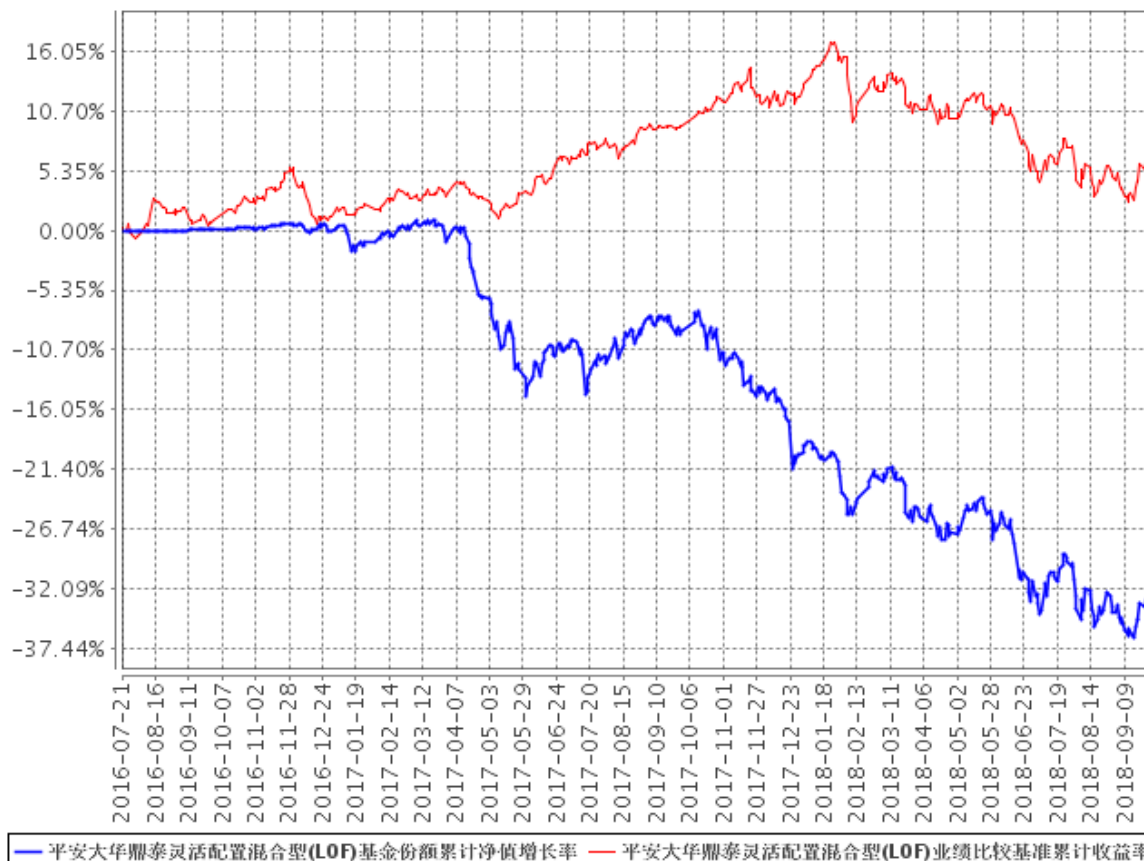
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-2.29%	1.27%	-0.23%	0.67%	-2.06%	0.60%

业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

平安大华鼎泰灵活配置混合型(LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2016 年 7 月 21 日正式生效，截至报告期末已满两年；
- 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘俊廷	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的基金经理	2016年7月21日	-	6	刘俊廷先生，中国科学院研究生院硕士。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。2014年12月加入平安大华基金管理有限公司，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基金经理。

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年前三季度中国经济韧性较强，但经济平缓下行压力仍然存在，随着年内经济持续承压，以及 PPI 进入下行周期，工业企业利润增速或将延续放缓。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，短期极端悲观的情绪使得市场的估值水平已经处于历史的较低水平。

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

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.6704 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.29%，业绩比较基准收益率为-0.23%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	258,911,381.24	88.17
	其中：股票	258,911,381.24	88.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,976,000.00	6.80
	其中：债券	19,976,000.00	6.80
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,314,353.51	4.87
8	其他资产	443,414.71	0.15
9	合计	293,645,149.46	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	651,290.00	0.22
B	采矿业	5,762,889.00	1.97
C	制造业	107,724,264.16	36.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,095,874.58	9.96
E	建筑业	6,158,721.60	2.11
F	批发和零售业	4,013,174.21	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	4,012,242.13	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,597,776.88	2.94
J	金融业	54,062,324.53	18.51
K	房地产业	9,475,921.00	3.24
L	租赁和商务服务业	24,395,555.10	8.35
M	科学研究和技术服务业	419,191.41	0.14

N	水利、环境和公共设施管理业	469,189.29	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,901,708.95	0.65
R	文化、体育和娱乐业	2,171,258.40	0.74
S	综合	-	-
	合计	258,911,381.24	88.65

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000875	吉电股份	8,929,293	25,537,828.38	8.74
2	002344	海宁皮城	4,704,699	22,638,587.10	7.75
3	300370	安控科技	4,147,057	12,441,171.00	4.26
4	600036	招商银行	270,500	8,301,645.00	2.84
5	601288	农业银行	2,125,700	8,268,973.00	2.83
6	600579	天华院	880,500	7,827,645.00	2.68
7	600436	片仔癀	63,400	6,419,884.00	2.20
8	601939	建设银行	785,100	5,684,124.00	1.95
9	600030	中信证券	311,600	5,200,604.00	1.78
10	601328	交通银行	721,200	4,211,808.00	1.44

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,976,000.00	6.84
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,976,000.00	6.84



**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101801027	18 星河实业 MTN002	200,000	19,976,000.00	6.84

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末无资产支持证券投资情况。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金报告期末无贵金属投资。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末无权证投资。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无股指期货投资。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末无股指期货投资。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末无国债期货投资。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本组合投资的前十名证券之一招商银行于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。

青岛天华院化学工程股份有限公司（以下简称“公司”）于2017年10月25日收到上海证券交易所《关于对青岛天华院化学工程股份有限公司及关联方和有关责任人予以通报批评的决定》的公开批评处分决定通知书（〔2017〕54号）。于2017年11月11日收到中国证券监督管理委员会青岛监管局下发的《关于对青岛天华院化学工程股份有限公司采取出具警示函措施的决定》的行政监管措施决定书（〔2017〕12号）。公司受到上海证券交易所公开批评，及中国证券监督管理委员会青岛监管局出具警示函处分的原因是：

1. 2016年11月16日公司从募集资金专户向关联方中国化工装备有限公司分四笔合计转出4000万元，中国化工装备有限公司于2016年11月17日将上述4000万元转回至公司募集资金专户。公司2016年12月22日从募集资金专户向关联方化学工业设备质量监督检验中心转出1000万元，2016年12月30日化学工业设备质量监督检验中心将上述1000万元转回至公司募集资金专户。上述关联交易未经审议，也未及时进行信息披露。

2. 公司2016年共收到政府拨付的与收益相关的政府补助金额合计2424.04万元，达到临时信息披露标准而未进行临时信息披露。

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不会造成重大不利影响。事后公司也已经进行了相关的整改，并表示将严格按照《上市公司信息披露管理办法》、《上市公司证券发行管理办法》、《上市公司监管指引第2号——上市公司募集资金管理和使

用的监管要求》和《关于规范上市公司与关联方资金往来及上市公司对外担保若干问题的通知》要求，加强相关法律、法规的学习，吸取经验教训，强化募集资金的管理与使用，规范与关联方的资金往来，确保真实、准确、完整、及时地履行信息披露义务。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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

### 5.11.2

基金投资的前十名股票没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	231,342.65
2	应收证券清算款	110,680.36
3	应收股利	-
4	应收利息	100,993.63
5	应收申购款	398.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	443,414.71

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000875	吉电股份	25,535,718.78	8.74	非公开发行, 流通受限
2	002344	海宁皮城	16,508,447.00	5.65	非公开发行, 流通受限

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	462,721,029.60
报告期期间基金总申购份额	159,417.59
减：报告期期间基金总赎回份额	27,266,219.23
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	435,614,227.96

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)设立的文件
- (2) 平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同
- (3) 平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 报告期内平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)在指定报刊上各项公告的原

稿

## 8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

## 8.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安大华基金管理有限公司

2018 年 10 月 25 日