

平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：平安大华基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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。

普华永道中天会计师事务所为基金财务出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 3 月 29 日起至 12 月 31 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 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.....	57

8.7 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	57
8.8 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	57
8.9 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	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	58
§9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.3 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	60
§10 开放式基金份额变动	60
§11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
11.2 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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4 基金投资策略的改变	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息	错误!未定义书签。
§13 备查文件目录	67
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	67
13.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	平安大华睿享文娱灵活配置	
基金主代码	002450	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 3 月 29 日	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	58,326,789.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	平安大华睿享文娱灵活配置 A	平安大华睿享文娱灵活配置 C
下属分级基金的交易代码:	002450	002451
报告期末下属分级基金的份额总额	9,302,622.08 份	49,024,167.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金通过股票与债券等资产的合理配置,重点投资与文体娱乐主题相关的优质证券,力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	从我国宏观层面(经济转型、通货膨胀和利率的预期)出发,依据工业增加值与 CPI 的变动划分经济周期的不同阶段(复苏、扩张、滞涨、萧条),依据产业的生命周期把产业分为概念、导入、萌芽、成长、繁荣、衰退六个阶段。同时将行业非系统风险均值与其分布的 GINI 系数结合运用,全面准确地判断大类资产风险程度和收益前景,统筹考量短、中、长期资产配置比例。股票投资在投资时钟与产业生命周期策略基础上秉持自上而下与自下而上相结合的选股理念,精选有成长潜力的优质股票构建投资组合。债券投资以目标久期管理和品种选择策略为主,以收益率利差策略、债券置换策略为辅,构造能获取稳定收益的固定收益类投资品种组合。	
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,属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。	
	平安大华睿享文娱灵活配置 A	平安大华睿享文娱灵活配置 C

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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	崔瑞娟
	联系电话	0755-22626828	020-87555888

	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95575
传真		0755-23997878	020-87555129
注册地址		深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦酒店 01: 419	广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)
办公地址		深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼	广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5、7、8、18、19、38、40 至 44 楼
邮政编码		518048	510620
法定代表人		罗春风	孙树明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、上海证券报、中国证券报
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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

§ 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 3 月 29 日 (基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日		2015 年		2014 年	
	平安大华睿享文娱灵活配置 A	平安大华睿享文娱灵活配置 C	平安大华睿享文娱灵活配置 A	平安大华睿享文娱灵活配置 C	平安大华睿享文娱灵活配置 A	平安大华睿享文娱灵活配置 C
本期已实现收益	-1,044,653.47	-5,537,483.86	-	-	-	-
本期利润	-1,075,041.24	-5,687,471.30	-	-	-	-
加权平均基金份	-0.0541	-0.0607	-	-	-	-

额本期利润						
本期加权平均净值利润率	-5.50%	-6.20%	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	-6.30%	-7.20%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
期末可供分配利润	-582,542.43	-3,513,799.69	-	-	-	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0626	-0.0717	-	-	-	-
期末基金资产净值	8,720,079.65	45,510,367.53	-	-	-	-
期末基金份额净值	0.937	0.928	-	-	-	-
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
基金份额累计净值增长率	-6.30%	-7.20%	-	-	-	-

1. 本基金基金合同于 2016 年 3 月 29 日正式生效，截至报告期末未满一年；
2. 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；
3. 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）；
4. 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

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

平安大华睿享文娱灵活配置 A

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
过去三个月	-3.70%	0.45%	0.19%	0.38%	-3.89%	0.07%
过去六个月	-3.80%	0.45%	2.80%	0.39%	-6.60%	0.06%
自基金合同生效起至今	-6.30%	0.39%	2.87%	0.44%	-9.17%	-0.05%

平安大华睿享文娱灵活配置 C

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

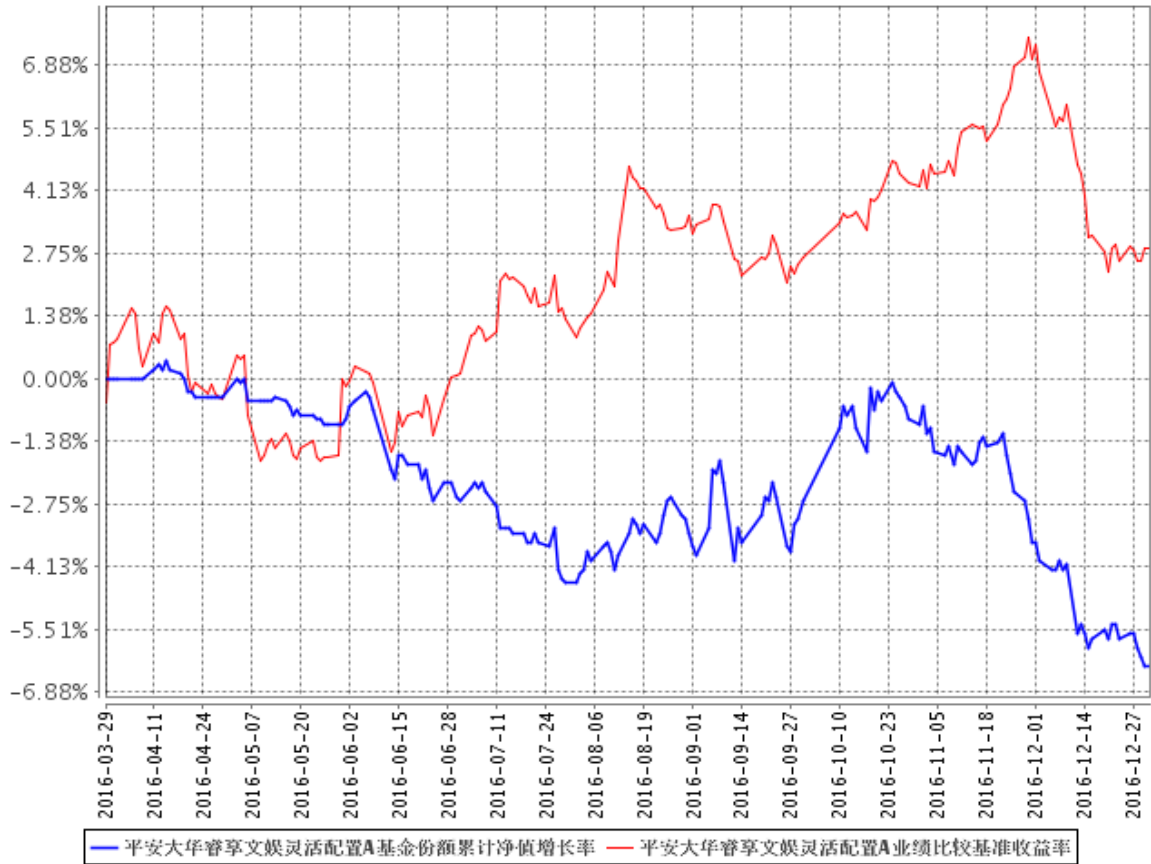
	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	-3.93%	0.46%	0.19%	0.38%	-4.12%	0.08%
过去六个月	-4.43%	0.45%	2.80%	0.39%	-7.23%	0.06%
自基金合同生效起至今	-7.20%	0.39%	2.87%	0.44%	-10.07%	-0.05%

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。

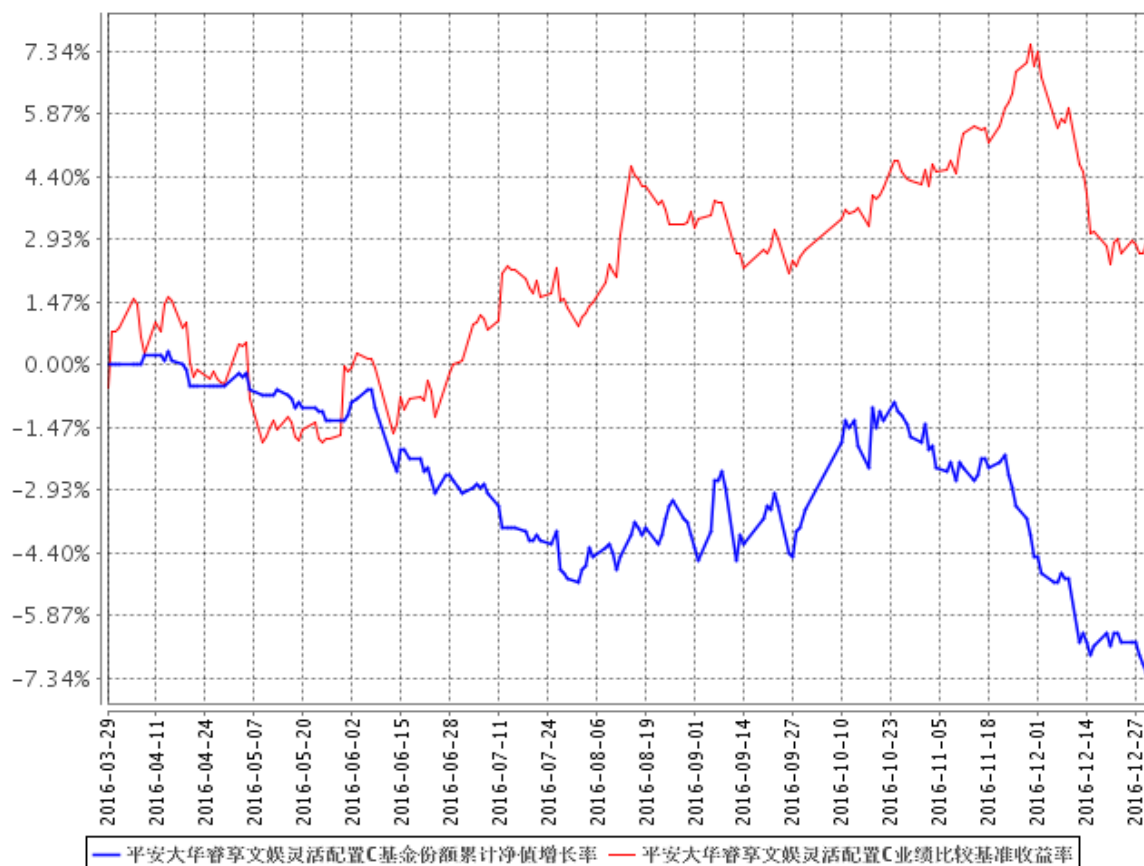
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

平安大华睿享文娱灵活配置A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



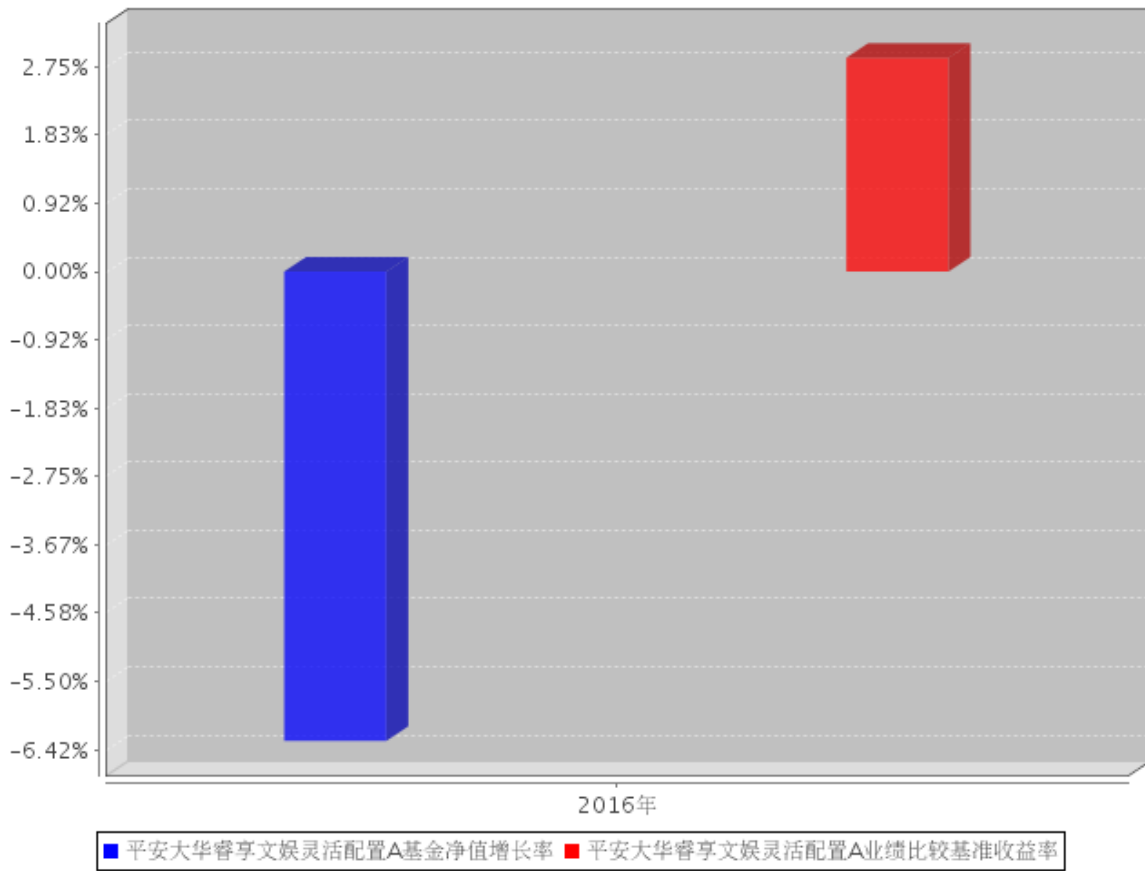
平安大华睿享文娱灵活配置C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



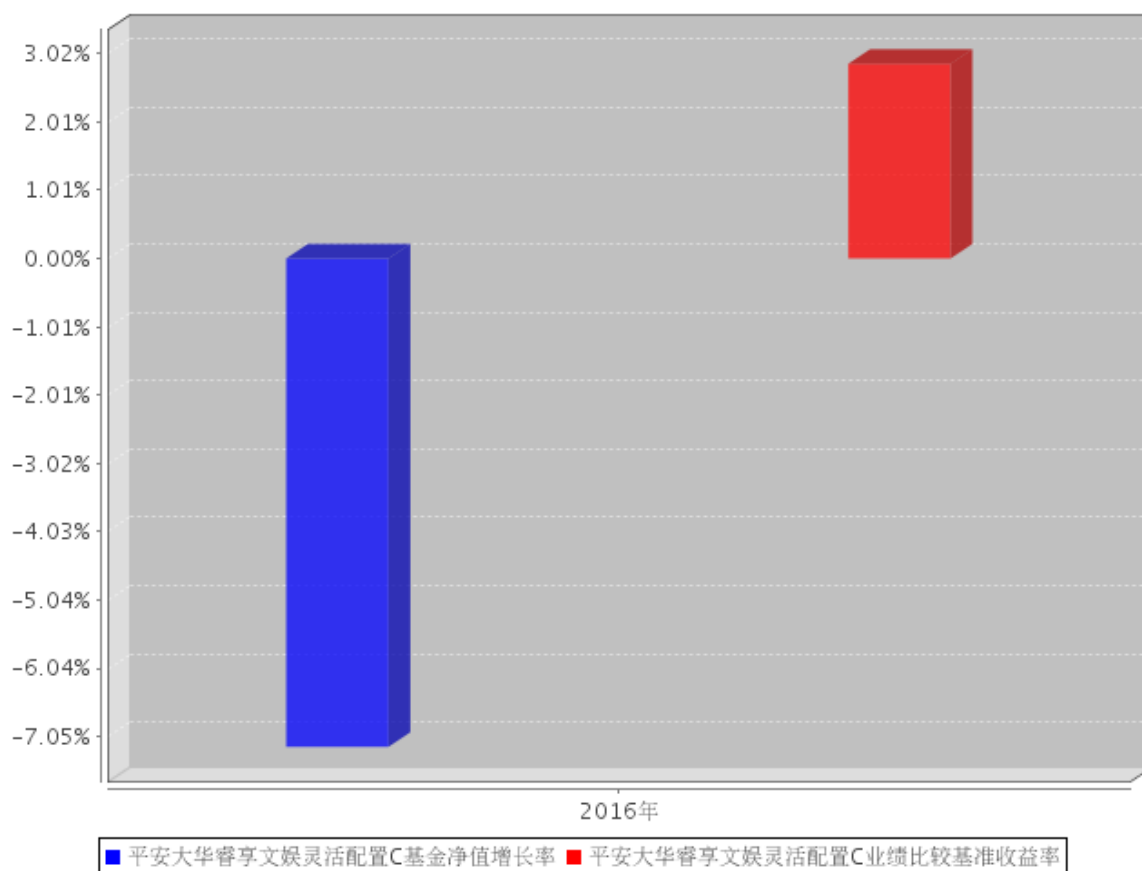
- 1、本基金基金合同于 2016 年 3 月 29 日正式生效，截至报告期末未满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安大华睿享文娱灵活配置A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



平安大华睿享文娱灵活配置C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



1. 本基金合同于 2016 年 3 月 29 日正式生效，截止报告期末未满一年。
2. 2016 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2016 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日至报告期期末，本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，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 2016 年 12 月 31 日，平安基金共管理 29 只开放式基金，资产管理总规模超 836 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

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		
黄维	本基金的基金经理	2016 年 8 月 24 日	-	6	北京大学微电子学硕士，6 年证券从业经验，曾先后任广发证券资产管理（广东）有限公司研究员、投资经理，2016 年 5 月加入平安大华基金管理公司，现任平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华睿享文娱灵活配置混合性证券投资基金基金经理。
史献涛	本基金的基金经理	2016 年 3 月 29 日	2016 年 8 月 31 日	8	史献涛先生曾任职于广发证券资产管理（广东）有限公司投资研究部，于 2015 年 2 月加入平安大华基金，曾任平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金、平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵循协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华睿享文娱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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定并下发了《平安大华基金管理有限责任公司公平交易管理制度》、《平安大华基金管理有限责任公司异常交易监控及报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 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。

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期连续四个季度期间内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程

中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

4.3.3 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

2016 年市场整体表现较差，主要源于年初在经济和汇率的双重压力下，估值处于高位的市场出现熔断下跌走势，而熔断后，市场整体维持震荡，可以说是股灾后的灾后重建。事实上，16 年的市场走势可以说是对 15 年的一个纠偏，我们回顾 15 年，可以发现其快速上涨主要是因为两点：流动性宽松以及风险偏好提升，而这又是基于监管层希望借助资本市场助力实体企业转型的大背景，然而，产业发展有其自身规律，不可一蹴而就，最后流动性的泛滥和杠杆的提升实际上推动了资本市场泡沫，而 16 年市场的下跌可以说是对泡沫消化的一个过程。在这过程中，市场结构出现了巨大分化，部分估值合理，盈利成长良好的企业创出了股价新高，而绝大部分标的则维持震荡走势，甚至不少还出现了破位下跌。

基于上述所分析的市场背景，本基金产品在 16 年的操作上实际是比较谨慎的，首先仓位上，基本控制在六成以下，在 12 月份甚至下降至两成，而结构上基本上配置在具备安全边际的个股上。但需要反思的是，由于市场分化剧烈，本基金产品在有效个股（绝对收益表现良好的标的）配置上仍需要进一步加强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 份额净值为 0.937 元，份额累计净值为 0.937 元。报告期内，本基金 A 份额净值增长率为-6.30%，同期业绩基准增长率为 2.87%。本基金 C 份额净值为 0.928 元，份额累计净值为 0.928 元。报告期内，本基金 C 份额净值增长率为-7.20%，同期业绩基准增长率为 2.87%。

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 17 年，我们认为今年市场将面临很多不确定因素：1) 外部环境上，特朗普上台，其施政思路存在较大不确定性，包括财政政策以及贸易政策等，这会对全球经济走向产生重要影响，进而对全球资本市场产生影响；2) 对内，如何深化供给侧改革、国企改革等系列推动经济转型的政策，如何在保持良好增长的基础上去杠杆、防金融风险，我们都需要持续观察。因此，在这个

充满变数的大环境下，我们需要以“不变”应“万变”，这个“不变”，就是紧抓估值合适的绩优标的，虽然说起来很简单，但确实行之有效，我们认为市场将延续 16 年的结构分化，而且将会表现的更为明显，因为今年新股发行将显著加速，过往许多中小盘个股靠稀缺性拉动高估值的局面将不复存在，只有满足估值和业绩双条件的标的，才有可能穿越市场突围而出，我们将持续深挖该类型标的，而且相信这些标的会为投资人带来持续的良好收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部门按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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工作组，由投研部、运营部及监察稽核部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理，特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.9 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，广发证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华睿享文娱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，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安的大华基金管理有限公司编制和披露的平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 22047 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“平安大华睿享文娱混合基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是平安大华睿享文娱混合基金 的基金管理人平安大华基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为,上述平安大华睿享文娱混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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,公允反映了平安大华睿享文娱混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	曹翠丽	边晓红
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	34,330,981.14	-
结算备付金		865,843.11	-
存出保证金		243,178.21	-
交易性金融资产	7.4.7.2	14,739,224.32	-
其中：股票投资		14,739,224.32	-
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,770,366.24	-
应收利息	7.4.7.5	7,052.06	-
应收股利		-	-
应收申购款		198.52	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		54,956,843.60	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		103,154.68	-
应付管理人报酬		70,729.68	-
应付托管费		11,788.28	-
应付销售服务费		31,609.71	-
应付交易费用	7.4.7.7	374,036.63	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	135,077.44	-
负债合计		726,396.42	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	58,326,789.30	-
未分配利润	7.4.7.10	-4,096,342.12	-
所有者权益合计		54,230,447.18	-
负债和所有者权益总计		54,956,843.60	-

注：

1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 58,326,789.30 份，其中下属 A 类基金份额 9,302,622.08 份，C 类基金份额 49,024,167.22 份。下属 A 类基金份额净值 0.937 元，C 类基金份额净值 0.928 元。
2. 本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 3 月 29 日(基金 合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-2,913,691.91	-
1.利息收入		521,530.78	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	501,915.44	-
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		19,615.34	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,371,065.33	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-4,474,379.37	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	103,314.04	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-180,375.21	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,116,217.85	-
减：二、费用		3,848,820.63	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,250,876.96	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	208,479.50	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	549,055.52	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,549,408.65	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	291,000.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,762,512.54	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,762,512.54	-

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年12月31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）	399,852,632.86	-	399,852,632.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,762,512.54	-6,762,512.54
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）	-341,525,843.56	2,666,170.42	-338,859,673.14
其中：1. 基金申购款	6,620,260.58	-81,194.67	6,539,065.91
2. 基金赎回款	-348,146,104.14	2,747,365.09	-345,398,739.05
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）	58,326,789.30	-4,096,342.12	54,230,447.18
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 罗春风 林婉文 陈星
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安大华睿享文娱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]170号《关于准予平安大华睿享文娱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《平安大华睿享文娱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

399,836,477.64 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 335 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 399,852,632.86 份基金份额,其中认购资金利息折合 16,155.22 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,基金托管人为广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华睿享文娱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,包括国内依法公开发行的股票(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、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 \times 50%+中证综合债指数收益率 \times 50%。

本财务报表由本基金的基金管理人平安大华基金管理有限公司于 2017 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 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》、《平安大华睿享文娱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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时, 终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额, 计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值; 估值日无交易, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具, 如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化, 参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素, 调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场, 采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时, 尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金

指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资者选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益登记日当日收市后计算的基金份额净值为基准转为基金份额进行再投资；(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(3) 每一基金份额享有同等分配权；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组

成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	34,330,981.14	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	34,330,981.14	-

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	14,919,599.53	14,739,224.32	-180,375.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计	14,919,599.53	14,739,224.32	-180,375.21	
项目	上年度末 2015年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	-	-	-	

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	6,553.06	-
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	389.60	-
应收债券利息	-	-
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	109.40	-
合计	7,052.06	-

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	374,036.63	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	374,036.63	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	77.44	-
预提费用	135,000.00	-
合计	135,077.44	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安大华睿享文娱灵活配置 A		
项目	本期 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	56,180,305.55	56,180,305.55
本期申购	269,424.57	269,424.57
本期赎回(以“-”号填列)	-47,147,108.04	-47,147,108.04
- 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	9,302,622.08	9,302,622.08

金额单位：人民币元

平安大华睿享文娱灵活配置 C		
项目	本期 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	343,672,327.31	343,672,327.31
本期申购	6,350,836.01	6,350,836.01
本期赎回(以“-”号填列)	-300,998,996.10	-300,998,996.10
- 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	49,024,167.22	49,024,167.22

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。
2. 本基金自 2016 年 2 月 29 日至 2016 年 3 月 25 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 399,836,477.64 元，其中 A 类基金净有效认购资金为人民币 56,178,090.90 元，C 类基金净有效认购资金为人民币 343,658,386.74 元。根据《平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 16,155.22 元，在本基金成立后折算为 16,155.22 份基金份额(其中 A 类基金募集期内认购资金产生的利息收入为 2,214.65 元，折算为 2,214.65 份基金份额；C 类基金募集期内认购资金产生的利息收入为 13,940.57 元，折算为 13,940.57 份基金份额)，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安大华睿享文娱灵活配置 A			
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	-	-	-
本期利润	-1,044,653.47	-30,387.77	-1,075,041.24
本期基金份额交易产生的变动数	490,956.31	1,542.50	492,498.81
其中：基金申购款	-4,703.06	-202.46	-4,905.52
基金赎回款	495,659.37	1,744.96	497,404.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-553,697.16	-28,845.27	-582,542.43

单位：人民币元

平安大华睿享文娱灵活配置 C

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	-	-	-
本期利润	-5,537,483.86	-149,987.44	-5,687,471.30
本期基金份额交易产生的变动数	2,174,132.55	-460.94	2,173,671.61
其中：基金申购款	-77,159.13	869.98	-76,289.15
基金赎回款	2,251,291.68	-1,330.92	2,249,960.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,363,351.31	-150,448.38	-3,513,799.69

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	490,638.95	-
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	6,682.12	-
其他	4,594.37	-
合计	501,915.44	-

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	510,000,741.04	-
减：卖出股票成本总额	514,475,120.41	-
买卖股票差价收入	-4,474,379.37	-

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13.3 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收益产生的赎回差价收入。

7.4.7.13.4 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收益产生的申购差价收入。

7.4.7.13.5 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 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收益。

7.4.7.14.2 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收益。

7.4.7.14.3 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收益。

7.4.7.14.4 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收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金
	2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日	额 2015年1月1日至2015年12月31日
股指期货-投资收益	-	

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	103,314.04	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	103,314.04	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-180,375.21	-
——股票投资	-180,375.21	-
——债券投资	-	-
——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	-	-
合计	-180,375.21	-

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	1,113,745.39	-
基金转换费收入	2,472.46	-
合计	1,116,217.85	-

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对于持续持有期少于 30 天的 A 类基金份额持有人收取的赎回费，全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 天(含 30 天)但少于 3 个月的 A 类基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75%计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的 A 类基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50%计入基金财产；对持续持

有期长于 6 个月的 A 类基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。对于持续持有期少于 30 天的 C 类基金份额持有人收取的赎回费，全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 天(含 30 天) 的 C 类基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,549,408.65	-
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,549,408.65	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	-
信息披露费	225,000.00	-
银行间账户维护费	6,000.00	-
合计	291,000.00	-

7.4.7.21 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，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务

等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号), 要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号), 2017 年 7 月 1 日(含)以后, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理有限公司(“平安大华”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
广发证券股份有限公司(“广发证券”)	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(“平安证券”)	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
上海陆金所资产管理有限公司(“陆金所”)	与基金管理人受同一实际控制的公司、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	与基金管理人受同一实际控制的公司、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
广发证券	1,039,395,460.98	100.00%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月29日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
广发证券	85,200,000.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
广发证券	947,202.06	100.00%	374,036.63	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,250,876.96	-
其中：支付销售机构的客户维护费	546,035.79	-

注：支付基金管理人平安大华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 X 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	208,479.50	-

注：支付基金托管人广发证券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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华睿享文娱 灵活配置 A	平安大华睿享文娱 灵活配置 C	合计
平安大华基金管理有限公司	-	74,200.76	74,200.76
广发证券股份有限公司	-	436,435.77	436,435.77
平安证券股份有限公司	-	1.97	1.97
上海陆金所资产管理有 限公司	-	50.85	50.85
平安银行股份有限公司	-	2,413.62	2,413.62
合计	-	513,102.97	513,102.97

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华睿享文娱 灵活配置 A	平安大华睿享文娱 灵活配置 C	合计

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安大华，再由平安大华计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类基金日销售服务费 = C 类基金前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期内未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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 2016 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券	34,330,981.14	490,638.95	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人广发证券保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 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。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002635	安洁科技	2016 年 11 月 8 日	重大事项	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	18,000	644,220.00	655,200.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。本基金管理人制定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。

7.4.13.2 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中国建设银行股份有限公司，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。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。

7.4.13.3 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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公司的证券不得超过该证券的 10%。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 7.4.12 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 2016 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	34,330,981.14	-	-	-	-	-	34,330,981.14
结算备付金	865,843.11	-	-	-	-	-	865,843.11
存出保证金	243,178.21	-	-	-	-	-	243,178.21
交易性金融资产	-	-	-	-	-	14,739,224.32	14,739,224.32
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,770,366.24	4,770,366.24
应收利息	-	-	-	-	-	7,052.06	7,052.06
应收申购款	100.00	-	-	-	-	98.52	198.52
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	35,440,102.46	-	-	-	-	19,516,741.14	54,956,843.60
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	103,154.68	103,154.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,729.68	70,729.68
应付托管费	-	-	-	-	-	11,788.28	11,788.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-	31,609.71	31,609.71
应付交易费用	-	-	-	-	-	374,036.63	374,036.63
其他负债	-	-	-	-	-	135,077.44	135,077.44
负债总计	-	-	-	-	-	726,396.42	726,396.42
利率敏感度缺口	35,440,102.46	-	-	-	-	-	-

上年度末 2015 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							
负债							

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金股票资产的投资比例为基金资产的 0-95%，其中投资于文体娱乐主题相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的 80%，其中权证占基金资产净值的 0-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	14,739,224.32	27.18	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	14,739,224.32	27.18	-	-

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 14,084,024.32 元，属于第二层次的余额为 655,200.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期

间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	14,739,224.32	26.82
	其中：股票	14,739,224.32	26.82
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	35,196,824.25	64.04
7	其他各项资产	5,020,795.03	9.14
8	合计	54,956,843.60	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	278,698.00	0.51
B	采矿业	288,420.00	0.53
C	制造业	11,807,432.32	21.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	792,870.00	1.46
F	批发和零售业	541,886.00	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	273,346.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	247,608.00	0.46
J	金融业	271,492.00	0.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	237,472.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,739,224.32	27.18

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末无沪港通股票投资。

8.3 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	000049	德赛电池	33,300	1,400,265.00	2.58
2	300200	高盟新材	75,000	1,342,500.00	2.48
3	600141	兴发集团	69,300	1,054,053.00	1.94
4	300232	洲明科技	55,694	830,954.48	1.53

5	002690	美亚光电	38,100	806,196.00	1.49
6	000018	神州长城	74,100	792,870.00	1.46
7	000661	长春高新	7,078	791,674.30	1.46
8	002635	安洁科技	18,000	655,200.00	1.21
9	600285	羚锐制药	44,100	562,716.00	1.04
10	300410	正业科技	10,192	550,164.16	1.01
11	002008	大族激光	24,000	542,400.00	1.00
12	600110	诺德股份	50,100	534,066.00	0.98
13	600096	云天化	32,000	303,680.00	0.56
14	601233	桐昆股份	20,100	288,636.00	0.53
15	600766	园城黄金	16,500	288,420.00	0.53
16	002311	海大集团	18,900	284,445.00	0.52
17	002200	云投生态	11,900	278,698.00	0.51
18	600987	航民股份	22,457	277,119.38	0.51
19	601607	上海医药	14,100	275,796.00	0.51
20	600596	新安股份	26,700	273,408.00	0.50
21	600004	白云机场	19,400	273,346.00	0.50
22	600016	民生银行	29,900	271,492.00	0.50
23	300003	乐普医疗	15,000	268,950.00	0.50
24	000066	长城电脑	21,600	268,704.00	0.50
25	002589	瑞康医药	8,200	266,090.00	0.49
26	000100	TCL 集团	80,200	264,660.00	0.49
27	600166	福田汽车	83,300	257,397.00	0.47
28	002456	欧菲光	7,300	250,244.00	0.46
29	300033	同花顺	3,600	247,608.00	0.46
30	603729	龙韵股份	3,200	237,472.00	0.44

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002450	康得新	21,339,191.04	39.35
2	300383	光环新网	11,482,170.31	21.17
3	300088	长信科技	8,792,202.00	16.21
4	300133	华策影视	8,479,497.43	15.64
5	002245	澳洋顺昌	8,369,703.00	15.43

6	600570	恒生电子	8,094,591.00	14.93
7	300037	新宙邦	7,638,728.08	14.09
8	002343	慈文传媒	7,559,686.75	13.94
9	002292	奥飞娱乐	7,060,345.69	13.02
10	002618	丹邦科技	6,650,980.91	12.26
11	002456	欧菲光	6,569,343.72	12.11
12	300324	旋极信息	6,563,802.54	12.10
13	300014	亿纬锂能	6,425,270.16	11.85
14	300232	洲明科技	6,327,832.96	11.67
15	000049	德赛电池	5,440,104.25	10.03
16	000661	长春高新	5,396,011.22	9.95
17	002635	安洁科技	4,986,694.52	9.20
18	002675	东诚药业	4,937,038.89	9.10
19	600183	生益科技	4,919,042.98	9.07
20	000892	欢瑞世纪	4,868,507.37	8.98
21	002475	立讯精密	4,706,030.49	8.68
22	300408	三环集团	4,449,842.83	8.21
23	600498	烽火通信	4,395,378.85	8.11
24	000059	华锦股份	4,359,842.00	8.04
25	002589	瑞康医药	4,332,448.86	7.99
26	600110	诺德股份	4,100,207.17	7.56
27	601689	拓普集团	4,032,849.56	7.44
28	600519	贵州茅台	4,017,001.00	7.41
29	600028	中国石化	3,923,364.00	7.23
30	300100	双林股份	3,852,340.30	7.10
31	000423	东阿阿胶	3,848,199.00	7.10
32	002636	金安国纪	3,818,516.00	7.04
33	002686	亿利达	3,777,309.00	6.97
34	002089	新海宜	3,738,820.04	6.89
35	002048	宁波华翔	3,573,413.04	6.59
36	000823	超声电子	3,565,198.00	6.57
37	600885	宏发股份	3,543,406.11	6.53
38	300221	银禧科技	3,540,325.88	6.53
39	600898	三联商社	3,528,130.39	6.51
40	002519	银河电子	3,494,958.00	6.44
41	002091	江苏国泰	3,451,729.80	6.36

42	002008	大族激光	3,394,777.82	6.26
43	002655	共达电声	3,336,415.00	6.15
44	300073	当升科技	3,245,486.00	5.98
45	300027	华谊兄弟	3,196,431.04	5.89
46	300130	新国都	3,082,626.00	5.68
47	300160	秀强股份	2,938,856.19	5.42
48	600867	通化东宝	2,855,983.43	5.27
49	002366	台海核电	2,850,387.58	5.26
50	600809	山西汾酒	2,841,074.00	5.24
51	600104	上汽集团	2,815,817.00	5.19
52	600285	羚锐制药	2,802,724.35	5.17
53	002712	思美传媒	2,787,634.50	5.14
54	600328	兰太实业	2,768,982.00	5.11
55	300207	欣旺达	2,740,806.74	5.05
56	002108	沧州明珠	2,730,790.00	5.04
57	600096	云天化	2,694,735.00	4.97
58	300115	长盈精密	2,657,918.00	4.90
59	300011	鼎汉技术	2,631,626.00	4.85
60	601677	明泰铝业	2,617,452.33	4.83
61	002410	广联达	2,588,812.00	4.77
62	300059	东方财富	2,576,125.38	4.75
63	002179	中航光电	2,516,871.00	4.64
64	000018	神州长城	2,512,921.00	4.63
65	002281	光迅科技	2,510,571.68	4.63
66	300377	赢时胜	2,446,433.03	4.51
67	600338	西藏珠峰	2,440,384.00	4.50
68	000008	神州高铁	2,439,296.00	4.50
69	002664	信质电机	2,414,751.00	4.45
70	000070	特发信息	2,394,277.00	4.42
71	600006	东风汽车	2,378,898.57	4.39
72	300121	阳谷华泰	2,304,834.00	4.25
73	300351	永贵电器	2,288,114.87	4.22
74	000673	当代东方	2,265,508.00	4.18
75	600373	中文传媒	2,251,525.00	4.15
76	300235	方直科技	2,249,378.00	4.15
77	600850	华东电脑	2,248,421.00	4.15

78	300429	强力新材	2,242,123.00	4.13
79	600068	葛洲坝	2,237,165.00	4.13
80	300162	雷曼股份	2,224,222.00	4.10
81	002438	江苏神通	2,218,407.00	4.09
82	300294	博雅生物	2,184,000.00	4.03
83	300336	新文化	2,181,866.00	4.02
84	002466	天齐锂业	2,139,474.00	3.95
85	600525	长园集团	2,133,950.80	3.93
86	002020	京新药业	2,105,778.16	3.88
87	300017	网宿科技	2,105,053.00	3.88
88	002594	比亚迪	2,103,954.40	3.88
89	300496	中科创达	2,102,400.00	3.88
90	002409	雅克科技	2,099,764.00	3.87
91	000858	五粮液	2,058,240.00	3.80
92	601233	桐昆股份	2,018,760.00	3.72
93	601800	中国交建	1,972,427.01	3.64
94	002384	东山精密	1,967,128.72	3.63
95	600009	上海机场	1,934,360.00	3.57
96	002425	凯撒文化	1,931,699.94	3.56
97	600667	太极实业	1,898,468.00	3.50
98	002138	顺络电子	1,897,479.00	3.50
99	002371	北方华创	1,893,418.00	3.49
100	300322	硕贝德	1,891,449.00	3.49
101	300409	道氏技术	1,888,292.05	3.48
102	002502	骅威文化	1,824,609.00	3.36
103	300476	胜宏科技	1,820,237.00	3.36
104	300258	精锻科技	1,818,562.00	3.35
105	002056	横店东磁	1,816,231.00	3.35
106	300340	科恒股份	1,803,705.00	3.33
107	002234	民和股份	1,803,133.00	3.32
108	300157	恒泰艾普	1,792,370.25	3.31
109	603818	曲美家居	1,770,836.00	3.27
110	600141	兴发集团	1,678,872.00	3.10
111	603799	华友钴业	1,665,355.00	3.07
112	002097	山河智能	1,648,523.00	3.04
113	600261	阳光照明	1,633,486.18	3.01

114	300465	高伟达	1,571,898.13	2.90
115	600111	北方稀土	1,566,671.00	2.89
116	601118	海南橡胶	1,554,678.00	2.87
117	000758	中色股份	1,549,794.00	2.86
118	002200	云投生态	1,547,384.92	2.85
119	600766	园城黄金	1,546,956.00	2.85
120	600969	郴电国际	1,537,406.00	2.83
121	600004	白云机场	1,523,298.00	2.81
122	600639	浦东金桥	1,511,490.84	2.79
123	600409	三友化工	1,506,748.00	2.78
124	600634	中技控股	1,505,932.00	2.78
125	000402	金融街	1,488,931.00	2.75
126	600201	生物股份	1,463,341.00	2.70
127	002701	奥瑞金	1,448,943.00	2.67
128	300145	中金环境	1,442,794.00	2.66
129	000910	大亚圣象	1,431,345.00	2.64
130	002460	赣锋锂业	1,426,370.00	2.63
131	600584	长电科技	1,410,275.00	2.60
132	300459	金科娱乐	1,383,333.00	2.55
133	000889	茂业通信	1,364,612.00	2.52
134	300200	高盟新材	1,360,918.00	2.51
135	600884	杉杉股份	1,354,900.00	2.50
136	600158	中体产业	1,331,172.00	2.45
137	600232	金鹰股份	1,326,393.00	2.45
138	600499	科达洁能	1,309,505.97	2.41
139	603788	宁波高发	1,305,156.00	2.41
140	000065	北方国际	1,274,593.00	2.35
141	601898	中煤能源	1,267,081.30	2.34
142	002738	中矿资源	1,262,659.00	2.33
143	300282	汇冠股份	1,251,801.00	2.31
144	600392	盛和资源	1,250,689.00	2.31
145	002563	森马服饰	1,250,114.00	2.31
146	002643	万润股份	1,242,063.00	2.29
147	000498	山东路桥	1,236,071.00	2.28
148	600595	中孚实业	1,209,030.00	2.23
149	300348	长亮科技	1,204,450.00	2.22

150	600476	湘邮科技	1,204,158.00	2.22
151	000725	京东方 A	1,189,665.00	2.19
152	300236	上海新阳	1,187,610.00	2.19
153	601901	方正证券	1,166,832.00	2.15
154	600362	江西铜业	1,165,830.00	2.15
155	002537	海立美达	1,164,918.00	2.15
156	601211	国泰君安	1,160,464.74	2.14
157	600999	招商证券	1,159,256.00	2.14
158	002007	华兰生物	1,158,695.60	2.14
159	601633	长城汽车	1,152,635.00	2.13
160	300083	劲胜精密	1,142,559.00	2.11
161	002195	二三四五	1,125,090.00	2.07
162	601186	中国铁建	1,123,262.00	2.07
163	002250	联化科技	1,110,692.99	2.05
164	601009	南京银行	1,108,880.00	2.04
165	002022	科华生物	1,105,362.00	2.04
166	002258	利尔化学	1,105,272.00	2.04
167	002570	贝因美	1,104,837.00	2.04
168	600518	康美药业	1,102,529.00	2.03
169	600820	隧道股份	1,096,612.26	2.02
170	300102	乾照光电	1,090,414.00	2.01
171	600195	中牧股份	1,087,886.00	2.01

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。

8.4.2 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	002450	康得新	20,756,319.08	38.27
2	300383	光环新网	11,318,183.01	20.87
3	300088	长信科技	8,671,602.20	15.99
4	600570	恒生电子	8,512,186.37	15.70
5	300133	华策影视	8,326,209.00	15.35
6	300037	新宙邦	8,095,950.80	14.93
7	002245	澳洋顺昌	7,930,137.00	14.62
8	002343	慈文传媒	7,658,159.08	14.12
9	002292	奥飞娱乐	7,010,006.46	12.93

10	002456	欧菲光	6,567,297.53	12.11
11	300324	旋极信息	6,445,282.04	11.88
12	300014	亿纬锂能	6,417,400.65	11.83
13	002618	丹邦科技	6,009,465.20	11.08
14	300232	洲明科技	5,436,047.07	10.02
15	600183	生益科技	5,114,823.05	9.43
16	002675	东诚药业	5,049,271.33	9.31
17	002475	立讯精密	4,681,012.32	8.63
18	000892	欢瑞世纪	4,650,187.86	8.57
19	000661	长春高新	4,598,224.64	8.48
20	600498	烽火通信	4,489,171.10	8.28
21	000059	华锦股份	4,441,903.05	8.19
22	300408	三环集团	4,311,802.67	7.95
23	000049	德赛电池	4,307,488.84	7.94
24	002635	安洁科技	4,156,148.00	7.66
25	600519	贵州茅台	4,094,974.37	7.55
26	002636	金安国纪	4,074,145.62	7.51
27	601689	拓普集团	4,049,435.32	7.47
28	002589	瑞康医药	3,995,532.30	7.37
29	600028	中国石化	3,980,659.42	7.34
30	000423	东阿阿胶	3,838,606.00	7.08
31	300100	双林股份	3,773,453.10	6.96
32	600885	宏发股份	3,766,497.36	6.95
33	002686	亿利达	3,713,520.29	6.85
34	002089	新海宜	3,649,948.71	6.73
35	002519	银河电子	3,508,289.91	6.47
36	600898	三联商社	3,482,740.28	6.42
37	300221	银禧科技	3,482,077.60	6.42
38	000823	超声电子	3,465,117.18	6.39
39	002048	宁波华翔	3,392,961.00	6.26
40	600110	诺德股份	3,366,049.82	6.21
41	300073	当升科技	3,275,515.41	6.04
42	002091	江苏国泰	3,251,377.80	6.00
43	300027	华谊兄弟	3,119,845.01	5.75
44	002655	共达电声	3,113,502.30	5.74
45	300130	新国都	2,963,505.87	5.46
46	300115	长盈精密	2,961,740.50	5.46
47	002712	思美传媒	2,864,724.38	5.28

48	002366	台海核电	2,861,405.68	5.28
49	600867	通化东宝	2,856,053.20	5.27
50	600104	上汽集团	2,839,650.86	5.24
51	002281	光迅科技	2,834,785.00	5.23
52	600809	山西汾酒	2,833,308.00	5.22
53	300160	秀强股份	2,827,241.03	5.21
54	002008	大族激光	2,822,960.19	5.21
55	300011	鼎汉技术	2,803,366.00	5.17
56	300207	欣旺达	2,752,972.20	5.08
57	002108	沧州明珠	2,695,990.00	4.97
58	600328	兰太实业	2,676,712.34	4.94
59	601677	明泰铝业	2,636,169.48	4.86
60	600338	西藏珠峰	2,569,552.84	4.74
61	002410	广联达	2,521,096.08	4.65
62	000070	特发信息	2,517,969.05	4.64
63	300059	东方财富	2,495,314.20	4.60
64	600285	羚锐制药	2,472,394.72	4.56
65	002179	中航光电	2,427,311.21	4.48
66	300351	永贵电器	2,367,834.80	4.37
67	300121	阳谷华泰	2,354,642.54	4.34
68	600096	云天化	2,335,685.00	4.31
69	300377	赢时胜	2,330,760.00	4.30
70	300235	方直科技	2,315,439.00	4.27
71	002664	信质电机	2,308,224.00	4.26
72	000673	当代东方	2,290,829.00	4.22
73	300162	雷曼股份	2,267,197.20	4.18
74	300496	中科创达	2,239,130.00	4.13
75	002466	天齐锂业	2,228,072.85	4.11
76	600373	中文传媒	2,212,727.00	4.08
77	600006	东风汽车	2,205,714.00	4.07
78	600850	华东电脑	2,178,520.45	4.02
79	300336	新文化	2,175,524.00	4.01
80	300429	强力新材	2,153,037.50	3.97
81	002438	江苏神通	2,142,989.50	3.95
82	600068	葛洲坝	2,114,921.00	3.90
83	000858	五粮液	2,105,602.00	3.88
84	300017	网宿科技	2,071,047.29	3.82
85	002594	比亚迪	2,059,909.51	3.80

86	002020	京新药业	2,058,581.50	3.80
87	000008	神州高铁	2,050,247.28	3.78
88	002409	雅克科技	2,027,924.50	3.74
89	601800	中国交建	2,023,046.00	3.73
90	300294	博雅生物	1,990,335.00	3.67
91	300322	硕贝德	1,956,249.00	3.61
92	600667	太极实业	1,921,070.35	3.54
93	600009	上海机场	1,916,148.60	3.53
94	603818	曲美家居	1,901,491.00	3.51
95	002056	横店东磁	1,897,264.05	3.50
96	600525	长园集团	1,888,040.52	3.48
97	300258	精锻科技	1,865,920.50	3.44
98	002138	顺络电子	1,835,391.00	3.38
99	300340	科恒股份	1,813,439.51	3.34
100	601233	桐昆股份	1,806,993.10	3.33
101	002425	凯撒文化	1,802,978.00	3.32
102	002384	东山精密	1,794,331.62	3.31
103	300157	恒泰艾普	1,769,704.00	3.26
104	002371	北方华创	1,749,227.00	3.23
105	002502	骅威文化	1,712,812.00	3.16
106	000018	神州长城	1,710,256.00	3.15
107	600261	阳光照明	1,662,448.96	3.07
108	300476	胜宏科技	1,656,929.00	3.06
109	601118	海南橡胶	1,607,778.67	2.96
110	600639	浦东金桥	1,584,894.45	2.92
111	002097	山河智能	1,580,234.00	2.91
112	300409	道氏技术	1,550,845.79	2.86
113	600111	北方稀土	1,543,401.00	2.85
114	603799	华友钴业	1,542,282.00	2.84
115	002234	民和股份	1,528,973.00	2.82
116	000402	金融街	1,512,005.20	2.79
117	600969	郴电国际	1,511,404.63	2.79
118	000758	中色股份	1,495,290.51	2.76
119	600201	生物股份	1,494,560.00	2.76
120	600158	中体产业	1,474,918.00	2.72
121	600409	三友化工	1,469,698.00	2.71
122	600634	中技控股	1,456,439.00	2.69
123	000910	大亚圣象	1,454,496.00	2.68

124	002460	赣锋锂业	1,442,566.00	2.66
125	002701	奥瑞金	1,431,579.00	2.64
126	300145	中金环境	1,416,860.25	2.61
127	600584	长电科技	1,382,963.00	2.55
128	603788	宁波高发	1,377,215.25	2.54
129	600232	金鹰股份	1,360,516.01	2.51
130	600499	科达洁能	1,354,200.00	2.50
131	000889	茂业通信	1,341,343.67	2.47
132	600766	园城黄金	1,327,539.00	2.45
133	300465	高伟达	1,303,962.00	2.40
134	600884	杉杉股份	1,288,223.00	2.38
135	002643	万润股份	1,278,706.00	2.36
136	300459	金科娱乐	1,278,009.80	2.36
137	601898	中煤能源	1,273,262.00	2.35
138	300282	汇冠股份	1,270,539.00	2.34
139	600004	白云机场	1,262,723.00	2.33
140	002738	中矿资源	1,255,458.26	2.32
141	000498	山东路桥	1,254,362.00	2.31
142	000065	北方国际	1,250,816.56	2.31
143	600392	盛和资源	1,245,798.00	2.30
144	002563	森马服饰	1,243,995.00	2.29
145	002200	云投生态	1,223,648.00	2.26
146	000725	京东方 A	1,211,696.00	2.23
147	002258	利尔化学	1,207,717.14	2.23
148	600595	中孚实业	1,202,296.00	2.22
149	600476	湘邮科技	1,186,349.00	2.19
150	002007	华兰生物	1,185,033.60	2.19
151	601211	国泰君安	1,159,598.00	2.14
152	002530	丰东股份	1,158,514.00	2.14
153	600195	中牧股份	1,151,571.00	2.12
154	600999	招商证券	1,144,090.00	2.11
155	601901	方正证券	1,140,721.00	2.10
156	300348	长亮科技	1,127,787.00	2.08
157	002195	二三四五	1,125,409.00	2.08
158	600820	隧道股份	1,120,201.69	2.07
159	002537	海立美达	1,116,930.77	2.06
160	002022	科华生物	1,113,693.00	2.05
161	300236	上海新阳	1,103,649.00	2.04

162	002570	贝因美	1,103,069.00	2.03
163	002250	联化科技	1,094,089.00	2.02
164	300083	劲胜精密	1,093,151.00	2.02

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。

8.4.3 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	529,394,719.94
卖出股票收入（成交）总额	510,000,741.04

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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投资。

8.6 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投资。

8.7 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。

8.8 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投资。

8.9 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投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.12.2

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	243,178.21
2	应收证券清算款	4,770,366.24
3	应收股利	-
4	应收利息	7,052.06
5	应收申购款	198.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,020,795.03

8.12.4 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。

8.12.5 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	002635	安洁科技	655,200.00	1.21	重大事项

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
平安大华睿享文娱灵活配置 A	310	30,008.46	0.00	0.00%	9,302,622.08	100.00%
平安大华睿享文娱灵活配置 C	1,620	30,261.83	4,500.63	0.01%	49,019,666.59	99.99%
合计	1,907	30,585.63	4,500.63	0.01%	58,322,288.67	99.99%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	平安大华睿享文娱灵活配置 A	723,904.37	7.7817%
	平安大华睿享文娱灵活配置 C	494,020.33	1.0077%
	合计	1,217,924.70	2.0880%

9.3 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	份额级别	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	平安大华睿享文娱灵活配置 A	10~50
	平安大华睿享文娱灵活配置 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	平安大华睿享文娱灵活配置 A	0
	平安大华睿享文娱灵活配置 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安大华睿享文娱灵活配置 A	平安大华睿享文娱灵活配置 C
基金合同生效日（2016 年 3 月 29 日）基金份额总额	56,180,305.55	343,672,327.31
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	269,424.57	6,350,836.01
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	47,147,108.04	300,998,996.10
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	9,302,622.08	49,024,167.22

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

1、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十三次会议审议通过，由陈特正先生接

替肖宇鹏先生任职公司督察长职务，任职日期为 2016 年 1 月 21 日，该事项已于 2016 年 1 月 22 日公告。

2、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十六次会议审议通过，由肖宇鹏先生接替罗春风先生任职公司总经理职务，任职日期为 2016 年 1 月 22 日，该事项已于 2016 年 1 月 23 日公告。

3、经平安大华基金管理有限公司 2016 年第三次股东大会审议通过《关于更换第二届董事会会议的议案》，同意由叶杨诗明女士代替王世荣先生出任董事。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金合同生效，初次聘请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。报告期内应支付给该事务所的报酬为 60,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或罚。
2、2016 年 11 月，托管人广发证券股份有限公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（〔2016〕128 号）。中国证监会因公司未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为对公司责令改正，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。

广发证券对上述问题积极进行整改。在监管部门加大对两融业务检查与处罚力度后，广发证券自 2015 年 2 月起已暂停代销伞型信托产品，并于 5 月 26 日起组织了全公司针对伞型信托以及场外配资的自查。按照中国证监会、中国证券业协会关于规范外部系统接入、严查场外配资行为并加强账户实名制管理的统一部署和要求，广发证券自 2015 年 6 月中旬开始，在监管部门的指导下先后开展了多次外部信息系统接入自查。首次全面自查于 2015 年 6 月 17 开始，6 月下旬提交了自查报告并将核查数据上报证监会机构部监管系统。首次自查结束后，公司继续加大排查力度，7 月下旬根据监管部门以及杭州恒生网络技术服务有限责任公司（以下简称恒生）和上海铭创软件技术有限公司（以下简称铭创）等公司提供的疑似外接系统客户数据开展了第二次自查，

按要求提交了报告和核查数据。被立案调查后，公司再次针对第三方信息系统接入等问题组织进行全面的自查反思和整改，制定了违规账户认定指引，认真做好剩余账户的识别和清理工作，对于经过清理确认违规的账户，公司采取了限制买入、限制资金转入的“双限”措施，并切断外部接入。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
广发证券		21,039,395,460.98	100.00%	947,202.06	100.00%	-

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

3、本基金报告期合同生效，上述租用交易单元均为本期新增所用。

11.7.2 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
广发证券	-	-	85,200,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安大华基金管理有限公司	证券时报、中国证券	2016年3月30日

	关于平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资 基金基金合同生效公告	报、上海证券报及本 基金管理人官网	
2	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大证券为销售机构的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 3 月 31 日
3	关于平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 4 月 5 日
4	关于旗下部分基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 6 月 6 日
5	关于旗下部分基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 6 月 15 日
6	关于旗下部分基金新增东北证券为销售机构及开通定投与转换业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 6 月 17 日
7	关于旗下部分基金新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 6 月 22 日
8	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 6 月 24 日
9	平安大华基金管理有限公司 2016 年 6 月 30 日基金净值公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 6 月 30 日
10	关于旗下部分基金新增深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 7 月 6 日
11	关于旗下部分基金新增泰诚财富基金销售（大连）有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 7 月 12 日
12	平安大华基金管理有限公司	证券时报、中国证券	2016 年 7 月 12 日

	关于旗下部分基金新增万联证券为销售机构及开通定投业务的公告	报、上海证券报及本 基金管理人官网	
13	关于旗下部分基金新增乾道金融信息服务（北京）有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 7 月 15 日
14	关于旗下部分基金新增西南证券为销售机构及开通定投与转换业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 7 月 20 日
15	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 第 2 季度报告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 7 月 20 日
16	关于旗下部分基金新增京西票号为销售机构及开通定投与转换业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 8 月 1 日
17	关于旗下部分基金新增首创证券为销售机构及开通定投与转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 8 月 8 日
18	关于旗下部分基金新增大同证券为销售机构及开通转换和定投业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 8 月 24 日
19	关于旗下部分基金新增德邦证券为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 8 月 26 日
20	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 8 月 26 日
21	关于旗下部分基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 8 月 29 日
22	关于旗下部分基金新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 8 月 29 日
23	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 半年度报告及半年度报告摘	证券时报、中国证券报、上海证券报及本 基金管理人官网	2016 年 8 月 29 日

	要		
24	关于旗下部分基金新增华泰证券为销售机构及开通转换和定投业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 8 月 29 日
25	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 9 月 2 日
26	关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 9 月 5 日
27	关于旗下部分基金新增北京格上富信投资顾问有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 9 月 7 日
28	关于旗下部分基金新增武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构及开通转换业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 9 月 9 日
29	关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构及开通转换业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 9 月 21 日
30	关于旗下部分基金新增珠海盈米财富管理有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 9 月 22 日
31	关于旗下部分基金新增北京汇成基金销售有限公司为销售机构及开通转换业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 9 月 27 日
32	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第三季度报告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 10 月 25 日
33	关于旗下部分基金增加中国民生银行直销银行为销售机构并参与费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 11 月 7 日
34	关于开展通联支付费率优惠基金理财平台交易公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 11 月 8 日

35	关于旗下部分基金新增云湾投资为销售机构的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 11 月 11 日
36	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2016 年第 1 期）	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 11 月 11 日
37	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要 2016 年第 1 期	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 11 月 11 日
38	关于旗下部分基金新增华信证券为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 11 月 30 日
39	关于旗下部分基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司有限公司开通定投业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 12 月 1 日
40	关于旗下部分基金新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为销售机构及开通定投业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 12 月 6 日
41	关于旗下部分基金新增国美基金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	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 12 月 13 日
42	平安大华基金管理有限公司开通快付通支付-快付通基金网上交易业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 12 月 14 日
43	关于旗下部分基金新增北京懒猫金融信息服务有限公司为销售机构的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 12 月 26 日
44	关于旗下部分基金新增鑫鼎盛控股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	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 12 月 26 日
45	平安大华基金管理有限公司 2016 年 12 月 31 日基金净值公告	证券时报、中国证券报、上海证券报及本基金管理人官网	2016 年 12 月 31 日

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

深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

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
2017 年 3 月 30 日