

平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金
2017 年半年度报告 摘要

2017 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：广发证券股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华睿享文娱混合	
场内简称	-	
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	41,416,318.22 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	-	
下属分级基金的基金简称:	平安大华睿享文娱混合 A	平安大华睿享文娱混合 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	002450	002451
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	6,466,982.14 份	34,949,336.08 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	本基金采用“灵活资产配置、主动投资管理”的投资策略，一方面通过大类资产配置，降低系统性风险，把握市场波动中的投资机会；另一方面利用平安大华研究平台优势，重点研究、投资与文体娱乐主题相关的证券资产，构建在中长期能够从经济转型、产业升级中受益的投资组合。	
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。	
	平安大华睿享文娱混合 A	平安大华睿享文娱混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人办公地址

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	平安大华睿享文娱混合 A	平安大华睿享文娱混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日-2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日-2017年6月30日)
本期已实现收益	356,246.30	1,651,667.65
本期利润	599,507.69	2,943,286.28
加权平均基金份额本期利润	0.0712	0.0685
本期基金份额净值增长率	8.32%	7.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0141	-0.0278
期末基金资产净值	6,565,167.37	34,988,119.02
期末基金份额净值	1.015	1.001

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

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

平安大华睿享文娱混合 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
过去一个月	6.28%	0.82%	3.01%	0.34%	3.27%	0.48%
过去三个月	3.68%	0.78%	3.16%	0.32%	0.52%	0.46%
过去六个月	8.32%	0.69%	5.36%	0.29%	2.96%	0.40%
过去一年	4.21%	0.58%	8.32%	0.35%	-4.11%	0.23%
自基金合同生效起至今	1.50%	0.53%	8.39%	0.39%	-6.89%	0.14%

平安大华睿享文娱混合 C

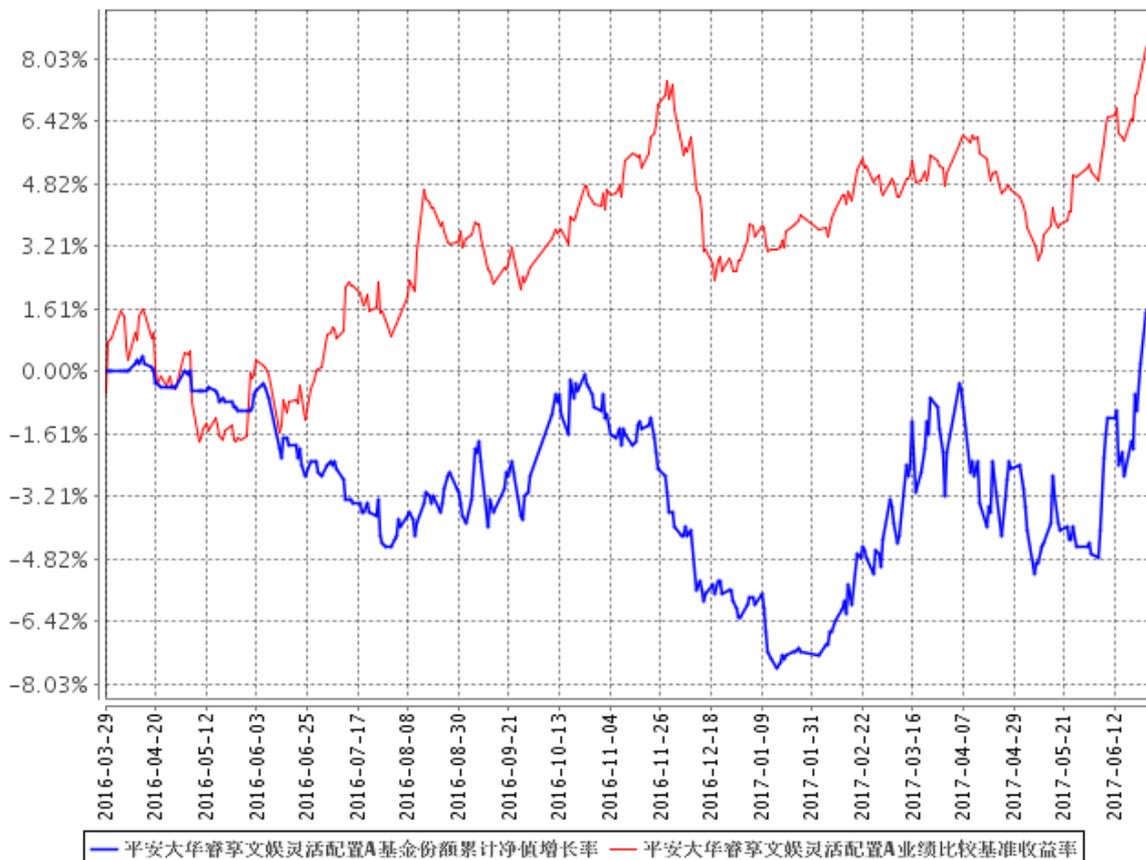
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.26%	0.84%	3.01%	0.34%	3.25%	0.50%
过去三个月	3.52%	0.79%	3.16%	0.32%	0.36%	0.47%
过去六个月	7.87%	0.70%	5.36%	0.29%	2.51%	0.41%
过去一年	3.09%	0.58%	8.32%	0.35%	-5.23%	0.23%
自基金合同生效起至今	0.10%	0.53%	8.39%	0.39%	-8.29%	0.14%

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。

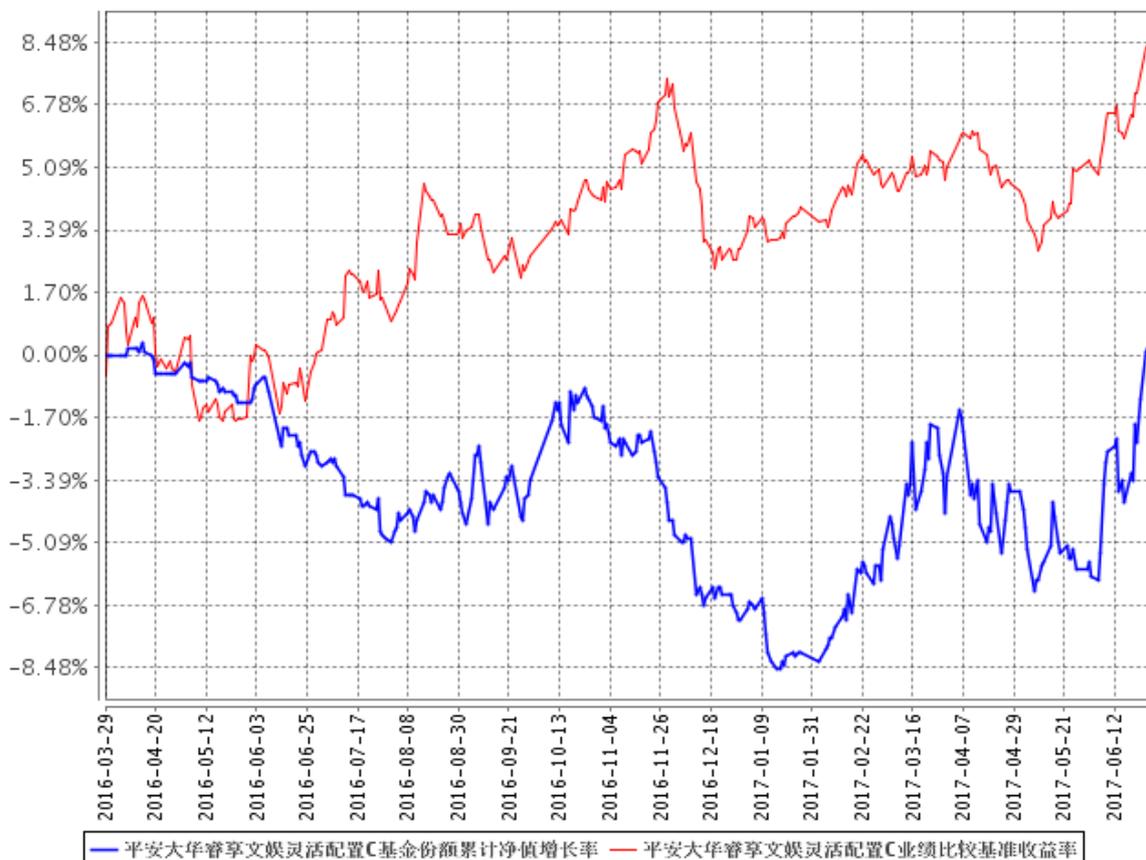
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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，截至报告期末已满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安大华”）经中国证监会证监许可【2010】1917号文批准设立。平安大华总部位于深圳，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，持有股份 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股份 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份 14.3%。

平安大华秉承“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。截至到 2017 年二季度末，公司旗下共有 39 只公募基金，公募基金管理规模突破 1200 亿元人民币。

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	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	2016 年 8 月 24 日	-	6 年	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有限公司，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、平安大华鼎弘混合型证券投资基金基金经理。

1、此处的“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。

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

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。

4.3.2 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

本产品上半年的配置主线主要聚焦在成长性好以及盈利确定的主线，如消费类电子、汽车零部件、家电白酒和金融等板块，产品净值相对收益较为显著。展望后市，我们认为聚焦价值和盈利确定的格局不会改变，市场主线依然会是这些方向，我们将在此基础上，精选个股，聚焦行业龙头，在盈利驱动的市场结构中，成长确定的个股将一定能带来良好的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安大华睿享文娱灵活配置 A 基金份额净值为 1.015 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.32%；截至本报告期末平安大华睿享文娱灵活配置 C 基金份额净值为 1.001 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.87%；同期业绩比较基准收益率为 5.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，市场走出了先涨后跌的走势，波动较大。前半段上涨主要由企业盈利推动，因为经过去年供给侧改革后，企业盈利整体维持良好的状态，而下半段市场下跌，主要原因是：1) 监管层推进金融去杠杆，流动性显著收紧，使到股债商品都走熊；2) 国内经济在二季度开始去库存，全年经济前高后低的预期逐步明确，使到市场担忧企业盈利下滑。而 6 月份监管层释放了一定流动性对冲年中资金紧张，使到流动性紧张局面有所缓和，同时 A 股加入 MSCI，提升了市场风险偏好，因此市场在 6 月份开始了一波反弹行情。但我们也可以看到，虽然市场调整较深，但价值蓝筹股和业绩白马股在这波调整中回撤较少，具备较为显著的相对收益，我们认为这会是今年的主线，原因是：1) IPO 数量增加使到壳价值不再如往前般稀缺，同时也打击了外延并购增厚业绩的确定性；2) 流动性下降，压制市场估值中枢，市场更加追求确定性。也就是说，随着制度的逐步完善，市场将更为理性，价值投资将更加有效。

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、运营部及法律合规监察部相关人员组成。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万人民币的情形。

§ 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，本基金托管人在对《平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金》的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金的管理人—平安大华基金管理有限公司在平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等的问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		3,948,927.31	34,330,981.14
结算备付金		1,083,379.57	865,843.11
存出保证金		284,329.92	243,178.21
交易性金融资产		37,275,059.67	14,739,224.32
其中：股票投资		37,275,059.67	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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		1,001,856.92	4,770,366.24
应收利息		1,182.07	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		-	-
资产总计		43,594,735.46	54,956,843.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		804,275.88	-
应付赎回款		429,288.67	103,154.68
应付管理人报酬		52,494.49	70,729.68
应付托管费		8,749.09	11,788.28
应付销售服务费		23,513.64	31,609.71
应付交易费用		574,079.46	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		149,047.84	135,077.44
负债合计		2,041,449.07	726,396.42
所有者权益：			
实收基金		41,416,318.22	58,326,789.30
未分配利润		136,968.17	-4,096,342.12
所有者权益合计		41,553,286.39	54,230,447.18
负债和所有者权益总计		43,594,735.46	54,956,843.60

注：

1. 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 41,416,318.22 份，其中下属 A 类基金份额 6,466,982.14 份，C 类基金份额 34,949,336.08 份。下属 A 类基金份额净值 1.015 元，C 类基金份额净值 1.001 元。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 3 月 29 日(基金 合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		5,974,464.44	-2,262,265.87
1.利息收入		85,830.78	359,296.72
其中：存款利息收入		77,607.11	339,681.38
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		8,223.67	19,615.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,348,729.06	-3,591,669.61
其中：股票投资收益		4,025,970.38	-3,597,245.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		322,758.68	5,576.20
3.公允价值变动收益（损失以		1,534,880.02	-96,179.22

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		5,024.58	1,066,286.24
减:二、费用		2,431,670.47	1,708,949.97
1. 管理人报酬		364,371.08	705,761.48
2. 托管费		60,728.54	117,626.91
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	162,127.70	308,707.54
4. 交易费用		1,686,675.63	482,875.95
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		157,767.52	93,978.09
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		3,542,793.97	-3,971,215.84
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		3,542,793.97	-3,971,215.84

注: 本基金于 2016 年 3 月 29 日成立, 故上年可比期间从 2016 年 3 月 29 日至 2016 年 6 月 30 日。

6.3 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: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 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)	58,326,789.30	-4,096,342.12	54,230,447.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	3,542,793.97	3,542,793.97
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)	-16,910,471.08	690,516.32	-16,219,954.76
其中: 1.基金申购款	390,548.84	-18,484.40	372,064.44
2. 基金赎回款	-17,301,019.92	709,000.72	-16,592,019.20
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）	41,416,318.22	136,968.17	41,553,286.39
项目	上年度可比期间 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016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）	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（本期净利润）	-	-3,971,215.84	-3,971,215.84
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）	-279,875,665.08	563,449.20	-279,312,215.88
其中：1.基金申购款	4,940,024.46	-22,146.93	4,917,877.53
2.基金赎回款	-284,815,689.54	585,596.13	-284,230,093.41
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）	119,976,967.78	-3,407,766.64	116,569,201.14

本基金于 2016 年 3 月 29 日成立，故上年可比期间从 2016 年 3 月 29 日至 2016 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

基金管理人负责人

林婉文

主管会计工作负责人

胡明

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安大华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]第 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，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经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)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率× 50% + 中证综合债券指数收益率× 50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安大华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 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

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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 2017 年 6 月 30 日日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

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

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

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人股东
大华资产管理有限公司	基金管理人股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人股东
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
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
平安银行股份有限公司	基金销售机构
平安证券股份有限公司	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
上海陆金所资产管理有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金销售机构、基金托管行

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月29日(基金合同生效日)至 2016年6月30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	1,130,101,564.93	100.00%	332,165,581.87	100.00%

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月29日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例

本基金本报告期及上年度可比期间均内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月29日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
广发证券	25,100,000.00	100.00%	85,200,000.00	100.00%

6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	1,029,861.52	100.00%	574,079.46	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	302,703.22	100.00%	302,703.22	100.00%

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。权证交易不计佣金。

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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	364,371.08	705,761.48
其中：支付销售机构的客户维护费	182,749.47	250,205.61

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人管理费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：

日管理人管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,728.54	117,626.91

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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.7.2.3 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 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华睿享文娱混合 A	平安大华睿享文娱混合 C	合计
平安大华基金管理有限公司	-	2,515.71	2,515.71
广发证券股份有限公司	-	154,583.11	154,583.11
平安银行股份有限公司	-	1,572.54	1,572.54
上海陆金所资产管理有	-	3.62	3.62

限公司			
合计	-	158,674.98	158,674.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年3月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华睿享文娱混合 A	平安大华睿享文娱混合 C	合计
平安大华基金管理有限公司	-	66,912.48	66,912.48
广发证券股份有限公司	-	211,028.75	211,028.75
平安证券股份有限公司	-	1.97	1.97
平安银行股份有限公司	-	841.65	841.65
上海陆金所资产管理有 限公司	-	7.60	7.60
合计	-	278,792.45	278,792.45

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 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基金管理有限公司，再由平安大华基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

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

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年3月29日(基金合同生效日)至 2016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

广发证券	3,948,927.31	68,254.26	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。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600795	国电电力	2017年6月5日	重大事项	3.60	-	-	364,500	1,286,625.00	1,312,200.00	-
601727	上海电气	2017年6月22日	重大事项	7.57	2017年7月3日	7.54	85,100	631,130.00	644,207.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.9.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.9.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.9.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 8 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

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	37,275,059.67	85.50
	其中：股票	37,275,059.67	85.50
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	5,032,306.88	11.54
7	其他各项资产	1,287,368.91	2.95
8	合计	43,594,735.46	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,464,798.00	3.53
C	制造业	28,257,964.20	68.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,312,200.00	3.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	418,969.20	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	854,218.04	2.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	2,187,935.31	5.27
K	房地产业	1,281,303.00	3.08
L	租赁和商务服务业	1,077,985.92	2.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	419,686.00	1.01
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	37,275,059.67	89.70

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前十名股票投资明细

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	600104	上汽集团	69,505	2,158,130.25	5.19
2	603626	科森科技	25,530	1,664,045.40	4.00
3	002241	歌尔股份	79,904	1,540,549.12	3.71
4	000968	蓝焰控股	101,300	1,464,798.00	3.53
5	002456	欧菲光	78,410	1,424,709.70	3.43
6	600741	华域汽车	57,992	1,405,726.08	3.38
7	600795	国电电力	364,500	1,312,200.00	3.16
8	002475	立讯精密	44,400	1,298,256.00	3.12
9	601398	工商银行	243,500	1,278,375.00	3.08
10	600519	贵州茅台	2,700	1,273,995.00	3.07

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600183	生益科技	10,935,076.02	20.16
2	002456	欧菲光	10,622,409.77	19.59
3	600104	上汽集团	10,339,205.03	19.07
4	002475	立讯精密	9,888,468.31	18.23
5	002635	安洁科技	9,370,758.80	17.28
6	601668	中国建筑	9,080,860.00	16.74
7	600068	葛洲坝	9,026,882.01	16.65
8	000049	德赛电池	8,846,511.60	16.31
9	002236	大华股份	8,224,005.90	15.16
10	601009	南京银行	7,410,984.00	13.67
11	600056	中国医药	7,276,826.35	13.42
12	002185	华天科技	6,961,802.50	12.84
13	600519	贵州茅台	6,882,381.04	12.69
14	300258	精锻科技	6,824,261.28	12.58
15	002449	国星光电	6,743,482.10	12.43
16	603626	科森科技	6,610,611.68	12.19
17	600660	福耀玻璃	6,535,423.02	12.05
18	002206	海利得	6,255,149.50	11.53
19	002241	歌尔股份	6,117,098.47	11.28
20	603186	华正新材	6,066,049.52	11.19
21	600703	三安光电	5,740,283.60	10.58
22	601699	潞安环能	5,494,266.92	10.13
23	600741	华域汽车	5,400,499.91	9.96
24	601398	工商银行	5,394,558.00	9.95
25	002466	天齐锂业	5,302,968.12	9.78
26	603989	艾华集团	5,094,671.71	9.39
27	600569	安阳钢铁	4,698,271.00	8.66
28	601233	桐昆股份	4,680,817.44	8.63
29	000709	河钢股份	4,667,467.00	8.61

30	000596	古井贡酒	4,565,903.00	8.42
31	300628	亿联网络	4,545,481.00	8.38
32	002008	大族激光	4,252,857.04	7.84
33	000059	华锦股份	4,172,095.00	7.69
34	002045	国光电器	4,145,833.00	7.64
35	002027	分众传媒	4,099,436.13	7.56
36	600110	诺德股份	4,064,826.00	7.50
37	000568	泸州老窖	3,950,292.74	7.28
38	300332	天壕环境	3,895,420.00	7.18
39	600004	白云机场	3,866,666.40	7.13
40	002384	东山精密	3,787,997.82	6.99
41	601006	大秦铁路	3,711,462.00	6.84
42	000651	格力电器	3,700,002.00	6.82
43	300136	信维通信	3,695,889.59	6.82
44	000983	西山煤电	3,667,667.00	6.76
45	600399	抚顺特钢	3,660,665.00	6.75
46	601633	长城汽车	3,596,495.00	6.63
47	600584	长电科技	3,590,712.94	6.62
48	601799	星宇股份	3,571,315.25	6.59
49	600887	伊利股份	3,547,427.00	6.54
50	300219	鸿利智汇	3,546,656.00	6.54
51	300232	洲明科技	3,420,468.30	6.31
52	002032	苏泊尔	3,369,726.00	6.21
53	603986	兆易创新	3,350,989.52	6.18
54	600028	中国石化	3,151,657.20	5.81
55	300323	华灿光电	3,147,472.32	5.80
56	002636	金安国纪	3,117,313.90	5.75
57	603228	景旺电子	3,065,624.00	5.65
58	601336	新华保险	3,064,636.00	5.65
59	600066	宇通客车	3,058,169.00	5.64
60	300476	胜宏科技	3,049,229.00	5.62
61	601225	陕西煤业	3,034,574.00	5.60
62	300183	东软载波	3,024,249.75	5.58
63	600029	南方航空	2,911,135.00	5.37
64	600036	招商银行	2,901,363.16	5.35
65	603368	柳州医药	2,893,882.80	5.34

66	300408	三环集团	2,889,333.33	5.33
67	600585	海螺水泥	2,869,922.23	5.29
68	600015	华夏银行	2,868,928.00	5.29
69	002838	道恩股份	2,845,361.00	5.25
70	601186	中国铁建	2,724,595.00	5.02
71	601155	新城控股	2,706,625.00	4.99
72	601607	上海医药	2,654,075.00	4.89
73	600563	法拉电子	2,619,012.49	4.83
74	600325	华发股份	2,611,872.00	4.82
75	000725	京东方 A	2,598,538.00	4.79
76	600048	保利地产	2,576,944.00	4.75
77	603239	浙江仙通	2,558,785.00	4.72
78	600297	广汇汽车	2,503,616.00	4.62
79	000333	美的集团	2,447,396.00	4.51
80	600566	济川药业	2,406,670.00	4.44
81	300145	中金环境	2,373,514.50	4.38
82	002415	海康威视	2,372,721.50	4.38
83	000858	五粮液	2,367,389.00	4.37
84	002053	云南能投	2,251,169.19	4.15
85	002583	海能达	2,250,133.01	4.15
86	601288	农业银行	2,211,287.00	4.08
87	000089	深圳机场	2,195,589.00	4.05
88	601939	建设银行	2,174,813.00	4.01
89	002142	宁波银行	2,166,119.99	3.99
90	000937	冀中能源	2,129,268.00	3.93
91	601601	中国太保	2,114,032.97	3.90
92	002681	奋达科技	2,111,921.00	3.89
93	000666	经纬纺机	2,092,838.00	3.86
94	600076	康欣新材	2,079,668.00	3.83
95	600688	上海石化	2,078,649.00	3.83
96	002677	浙江美大	2,071,698.27	3.82
97	600977	中国电影	2,065,997.00	3.81
98	300097	智云股份	2,057,173.00	3.79
99	002126	银轮股份	2,031,763.00	3.75
100	603355	莱克电气	2,024,901.00	3.73
101	603328	依顿电子	2,008,625.00	3.70

102	600884	杉杉股份	2,001,228.42	3.69
103	300308	中际装备	1,998,550.00	3.69
104	000826	启迪桑德	1,968,862.00	3.63
105	601169	北京银行	1,950,744.00	3.60
106	002572	索菲亚	1,856,842.00	3.42
107	300100	双林股份	1,824,320.00	3.36
108	002714	牧原股份	1,815,085.64	3.35
109	000018	神州长城	1,813,735.00	3.34
110	000899	赣能股份	1,808,951.80	3.34
111	002501	利源精制	1,800,930.00	3.32
112	300433	蓝思科技	1,751,840.00	3.23
113	600030	中信证券	1,730,868.00	3.19
114	000661	长春高新	1,721,010.00	3.17
115	000910	大亚圣象	1,693,909.00	3.12
116	000968	蓝焰控股	1,663,269.00	3.07
117	600039	四川路桥	1,658,970.00	3.06
118	600477	杭萧钢构	1,632,723.00	3.01
119	002472	双环传动	1,601,707.72	2.95
120	002831	裕同科技	1,600,648.00	2.95
121	002064	华峰氨纶	1,570,268.00	2.90
122	603609	禾丰牧业	1,562,271.25	2.88
123	603589	口子窖	1,559,787.00	2.88
124	002611	东方精工	1,553,775.00	2.87
125	601818	光大银行	1,546,749.00	2.85
126	000925	众合科技	1,544,929.00	2.85
127	002826	易明医药	1,539,784.00	2.84
128	603040	新坐标	1,511,215.00	2.79
129	000069	华侨城 A	1,498,007.00	2.76
130	600548	深高速	1,496,278.00	2.76
131	300070	碧水源	1,469,283.00	2.71
132	601328	交通银行	1,439,945.00	2.66
133	000823	超声电子	1,401,756.92	2.58
134	000999	华润三九	1,351,928.00	2.49
135	000065	北方国际	1,341,670.80	2.47
136	002050	三花智控	1,333,778.00	2.46
137	603179	新泉股份	1,331,653.00	2.46

138	600889	南京化纤	1,320,859.16	2.44
139	601111	中国国航	1,311,320.00	2.42
140	600565	迪马股份	1,309,826.00	2.42
141	600326	西藏天路	1,303,399.00	2.40
142	300537	广信材料	1,302,436.00	2.40
143	603078	江化微	1,297,639.00	2.39
144	600596	新安股份	1,295,929.83	2.39
145	300200	高盟新材	1,293,983.86	2.39
146	600795	国电电力	1,286,625.00	2.37
147	600779	水井坊	1,276,088.00	2.35
148	300450	先导智能	1,266,792.00	2.34
149	000423	东阿阿胶	1,257,227.00	2.32
150	601117	中国化学	1,252,990.00	2.31
151	000488	晨鸣纸业	1,217,612.00	2.25
152	603816	顾家家居	1,160,180.00	2.14
153	002089	新海宜	1,086,172.00	2.00

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000049	德赛电池	10,527,751.18	19.41
2	600183	生益科技	10,206,368.97	18.82
3	002635	安洁科技	9,972,796.87	18.39
4	002456	欧菲光	9,731,587.38	17.94
5	600068	葛洲坝	9,214,684.29	16.99
6	601668	中国建筑	9,043,067.42	16.68
7	002475	立讯精密	8,777,781.01	16.19
8	600104	上汽集团	8,533,437.40	15.74
9	002236	大华股份	8,155,442.42	15.04
10	601009	南京银行	7,474,091.40	13.78
11	600660	福耀玻璃	6,815,121.78	12.57
12	002449	国星光电	6,772,514.47	12.49
13	300258	精锻科技	6,767,590.74	12.48
14	002185	华天科技	6,739,125.80	12.43
15	600056	中国医药	6,510,605.08	12.01

16	603186	华正新材	6,136,233.94	11.32
17	600519	贵州茅台	5,736,258.61	10.58
18	601699	潞安环能	5,499,192.52	10.14
19	600703	三安光电	5,439,012.39	10.03
20	002466	天齐锂业	5,295,430.02	9.76
21	002206	海利得	5,228,055.43	9.64
22	603989	艾华集团	5,014,777.24	9.25
23	603626	科森科技	4,986,548.73	9.20
24	601233	桐昆股份	4,946,502.94	9.12
25	000709	河钢股份	4,830,755.28	8.91
26	600569	安阳钢铁	4,773,274.48	8.80
27	600110	诺德股份	4,677,832.70	8.63
28	002241	歌尔股份	4,674,468.13	8.62
29	000596	古井贡酒	4,591,427.69	8.47
30	300628	亿联网络	4,388,333.10	8.09
31	600741	华域汽车	4,304,737.57	7.94
32	300232	洲明科技	4,280,242.67	7.89
33	300332	天壕环境	4,272,782.95	7.88
34	000059	华锦股份	4,259,184.27	7.85
35	601398	工商银行	4,238,723.28	7.82
36	002008	大族激光	4,149,678.49	7.65
37	002045	国光电器	4,074,235.92	7.51
38	000568	泸州老窖	4,001,257.35	7.38
39	601006	大秦铁路	3,813,168.84	7.03
40	601633	长城汽车	3,774,757.67	6.96
41	300136	信维通信	3,771,587.04	6.95
42	600584	长电科技	3,692,601.48	6.81
43	601799	星宇股份	3,686,524.92	6.80
44	600887	伊利股份	3,534,900.82	6.52
45	300219	鸿利智汇	3,529,339.64	6.51
46	000983	西山煤电	3,474,125.34	6.41
47	600399	抚顺特钢	3,472,982.70	6.40
48	002032	苏泊尔	3,426,915.30	6.32
49	603986	兆易创新	3,425,918.74	6.32
50	600004	白云机场	3,386,152.35	6.24
51	000651	格力电器	3,335,587.63	6.15
52	300323	华灿光电	3,316,803.06	6.12
53	002027	分众传媒	3,146,575.13	5.80

54	600028	中国石化	3,142,714.15	5.80
55	601336	新华保险	3,098,305.08	5.71
56	601225	陕西煤业	3,088,201.58	5.69
57	002636	金安国纪	3,051,122.25	5.63
58	601607	上海医药	3,039,950.48	5.61
59	603228	景旺电子	3,021,730.60	5.57
60	600066	宇通客车	3,020,276.06	5.57
61	002838	道恩股份	3,017,057.50	5.56
62	002384	东山精密	3,004,631.20	5.54
63	300183	东软载波	2,974,381.59	5.48
64	600029	南方航空	2,906,774.68	5.36
65	300408	三环集团	2,900,736.91	5.35
66	603368	柳州医药	2,893,811.78	5.34
67	600585	海螺水泥	2,892,539.20	5.33
68	600015	华夏银行	2,794,118.70	5.15
69	603239	浙江仙通	2,672,039.38	4.93
70	601186	中国铁建	2,665,938.35	4.92
71	000018	神州长城	2,581,245.59	4.76
72	600325	华发股份	2,566,931.40	4.73
73	300200	高盟新材	2,553,558.65	4.71
74	002415	海康威视	2,543,713.17	4.69
75	000333	美的集团	2,528,491.74	4.66
76	600563	法拉电子	2,436,855.70	4.49
77	300145	中金环境	2,410,516.27	4.44
78	601155	新城控股	2,279,243.33	4.20
79	002053	云南能投	2,276,053.56	4.20
80	601288	农业银行	2,268,809.77	4.18
81	600297	广汇汽车	2,224,708.37	4.10
82	002583	海能达	2,213,731.19	4.08
83	000089	深圳机场	2,178,688.88	4.02
84	601939	建设银行	2,173,569.29	4.01
85	601601	中国太保	2,172,783.75	4.01
86	002142	宁波银行	2,169,578.27	4.00
87	300476	胜宏科技	2,153,741.70	3.97
88	000666	经纬纺机	2,146,810.57	3.96
89	600977	中国电影	2,124,481.00	3.92
90	600141	兴发集团	2,085,144.57	3.84
91	002677	浙江美大	2,066,321.57	3.81

92	000858	五 粮 液	2,055,567.45	3.79
93	002681	奋达科技	2,028,851.26	3.74
94	600076	康欣新材	2,026,875.07	3.74
95	600566	济川药业	2,026,628.16	3.74
96	000937	冀中能源	2,026,490.00	3.74
97	600036	招商银行	2,018,852.61	3.72
98	300097	智云股份	2,015,262.80	3.72
99	600688	上海石化	2,013,264.00	3.71
100	300308	中际装备	2,007,442.54	3.70
101	600884	杉杉股份	2,001,173.25	3.69
102	000826	启迪桑德	1,976,380.26	3.64
103	603355	莱克电气	1,943,250.30	3.58
104	300100	双林股份	1,939,979.72	3.58
105	601169	北京银行	1,933,593.06	3.57
106	603328	依顿电子	1,928,254.55	3.56
107	002572	索菲亚	1,899,415.22	3.50
108	002126	银轮股份	1,892,623.79	3.49
109	000725	京东方 A	1,832,575.95	3.38
110	002714	牧原股份	1,810,083.78	3.34
111	000910	大亚圣象	1,769,705.40	3.26
112	600030	中信证券	1,751,644.00	3.23
113	000661	长春高新	1,729,622.90	3.19
114	000899	赣能股份	1,724,168.71	3.18
115	002501	利源精制	1,712,232.00	3.16
116	300433	蓝思科技	1,684,231.00	3.11
117	600048	保利地产	1,672,974.00	3.08
118	603589	口子窖	1,657,449.80	3.06
119	002831	裕同科技	1,614,822.24	2.98
120	002611	东方精工	1,611,497.80	2.97
121	600477	杭萧钢构	1,602,128.80	2.95
122	600548	深高速	1,597,534.71	2.95
123	002064	华峰氨纶	1,571,719.00	2.90
124	600039	四川路桥	1,565,964.80	2.89
125	002472	双环传动	1,565,646.92	2.89
126	601818	光大银行	1,529,013.00	2.82
127	600596	新安股份	1,527,344.00	2.82
128	000069	华侨城 A	1,515,195.43	2.79
129	000925	众合科技	1,496,605.00	2.76

130	603609	禾丰牧业	1,489,473.96	2.75
131	300070	碧水源	1,487,685.52	2.74
132	002826	易明医药	1,482,551.60	2.73
133	603040	新坐标	1,417,816.05	2.61
134	601328	交通银行	1,417,692.00	2.61
135	000823	超声电子	1,402,945.92	2.59
136	002050	三花智控	1,334,972.52	2.46
137	000999	华润三九	1,327,188.10	2.45
138	600326	西藏天路	1,325,561.55	2.44
139	603179	新泉股份	1,323,984.00	2.44
140	600779	水井坊	1,307,425.00	2.41
141	601111	中国国航	1,303,932.00	2.40
142	600565	迪马股份	1,285,604.56	2.37
143	300450	先导智能	1,281,186.90	2.36
144	000423	东阿阿胶	1,280,988.00	2.36
145	600889	南京化纤	1,275,816.00	2.35
146	300537	广信材料	1,273,784.60	2.35
147	000065	北方国际	1,265,061.08	2.33
148	002311	海大集团	1,257,615.18	2.32
149	603816	顾家家居	1,131,447.35	2.09
150	601117	中国化学	1,097,295.50	2.02
151	002089	新海宜	1,096,995.38	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	573,538,274.94
卖出股票收入（成交）总额	556,563,289.99

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资。

7.7 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投资。

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投资。

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

本基金本报告期内无股指期货投资。

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

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	284,329.92
2	应收证券清算款	1,001,856.92
3	应收股利	-
4	应收利息	1,182.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,287,368.91

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600795	国电电力	1,312,200.00	3.16	重大事项

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
平安大华睿享文娱混合 A	260	24,873.01	0.00	0.00%	6,466,982.14	100.00%
平安大华睿享文娱混合 C	1,307	26,740.12	4,500.63	0.01%	34,944,835.45	99.99%
合计	1,548	26,754.73	4,500.63	0.01%	41,411,817.59	99.99%

8.2 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	平安大华睿享文娱混合 A	166,201.94	2.5700%
	平安大华睿享文娱混合 C	423,030.79	1.2104%
	合计	589,232.73	1.4227%

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	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	平安大华睿享文娱混合 A	10~50

有本开放式基金	平安大华睿享文娱混合 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	平安大华睿享文娱混合 A	0
	平安大华睿享文娱混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安大华睿享文娱混合 A	平安大华睿享文娱混合 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	9,302,622.08	49,024,167.22
本报告期基金总申购份额	210,335.44	180,213.40
减：本报告期基金总赎回份额	3,045,975.38	14,255,044.54
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,466,982.14	34,949,336.08

§ 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

1、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第三十八次会议审议通过，由付强先生任职公司副总经理，任职日期为 2017 年 1 月 20 日。

2、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由李兆良先生、李娟娟女士、刘雪生先生、潘汉腾先生接替曹勇先生、刘茂山先生、郑学定先生、黄士林先生任职公司第三届董事会董事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

3、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由巢傲文先生、李峥女士接替张云平、毛晴峰先生为第三届监事会监事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
广发证券	2	1,130,101,564.93	100.00%	1,029,861.52	100.00%	-

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
广发证券	-	-	25,100,000.00	100.00%	-	-

平安大华基金管理有限公司
2017年8月28日