

平安大华智能生活灵活配置混合型 证券投资基金 2017 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本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.....	19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
6.4 报表附注.....	25
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64
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.....	64
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.....	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	65
§8 基金份额持有人信息.....	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
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.....	67
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71
§11 备查文件目录.....	74

11.1 备查文件目录	74
11.2 存放地点	74
11.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	平安大华智能生活混合	
场内简称	-	
基金主代码	002598	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 6 月 8 日	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,215,499.31 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:	平安大华智能生活混合 A	平安大华智能生活混合 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	002598	002599
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	48,695,048.70 份	520,450.61 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，重点投资与智能生活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	本基金采取“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、投资与智能生活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×60%+中证综合债指数收益率×40%	
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。	
	平安大华智能生活混合 A	平安大华智能生活混合 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	田青
	联系电话	0755-22626828	010-67595096
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-800-4800	010-67595096
传真		0755-23997878	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		罗春风	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
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、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	平安大华智能生活混合 A	平安大华智能生活混合 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	-5,236,300.09	-58,747.69
本期利润	-2,556,201.16	-28,535.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0479	-0.0493
本期加权平均净值利润率	-5.19%	-5.42%
本期基金份额净值增长率	-4.97%	-5.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	-6,045,521.96	-70,554.07
期末可供分配基金份额利润	-0.1242	-0.1356
期末基金资产净值	43,779,667.85	461,817.77
期末基金份额净值	0.899	0.887
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-10.10%	-11.30%

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未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，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

平安大华智能生活混合 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	4.17%	0.92%	3.41%	0.40%	0.76%	0.52%
过去三个月	-3.02%	0.88%	3.75%	0.38%	-6.77%	0.50%
过去六个月	-4.97%	0.85%	6.43%	0.34%	-11.40%	0.51%
过去一年	-10.10%	0.73%	9.89%	0.41%	-19.99%	0.32%
自基金合同生效起至今	-10.10%	0.70%	9.68%	0.43%	-19.78%	0.27%

平安大华智能生活混合 C

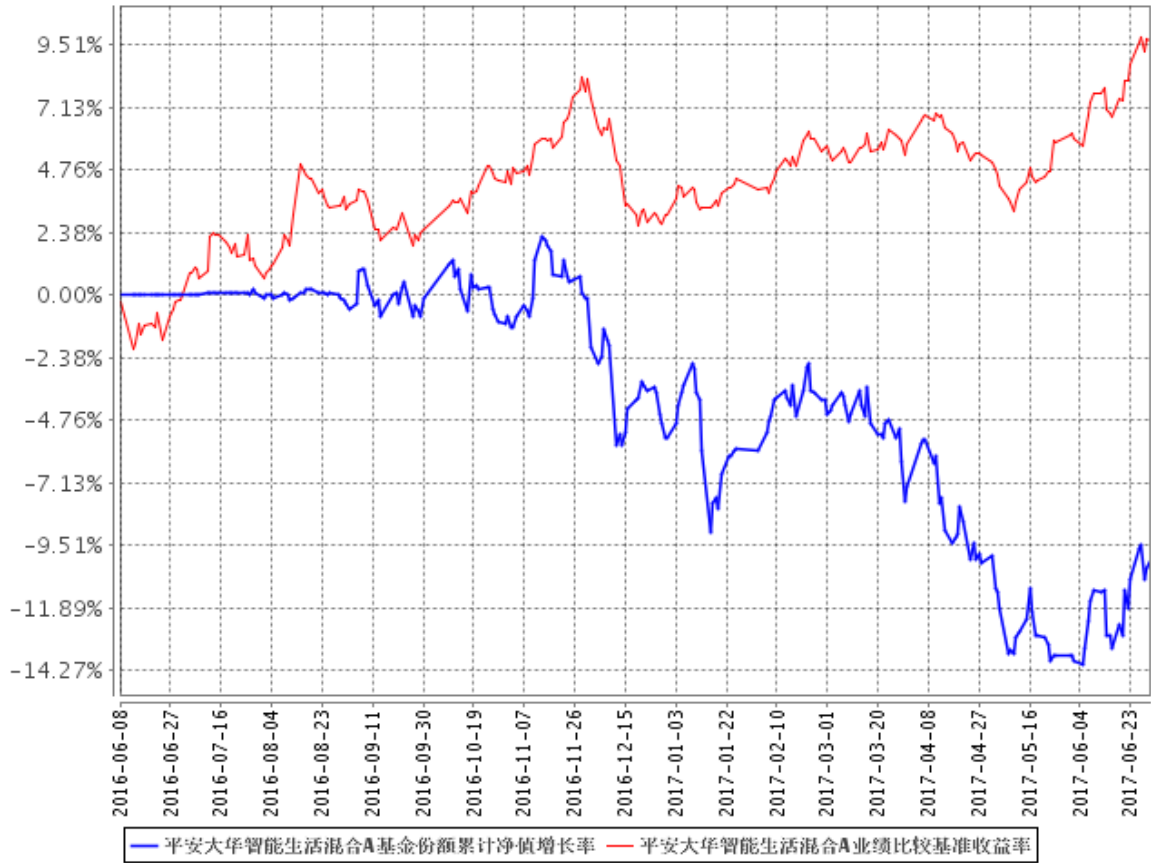
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.11%	0.91%	3.41%	0.40%	0.70%	0.51%
过去三个月	-3.17%	0.87%	3.75%	0.38%	-6.92%	0.49%
过去六个月	-5.24%	0.85%	6.43%	0.34%	-11.67%	0.51%
过去一年	-11.21%	0.73%	9.89%	0.41%	-21.10%	0.32%
自基金合同生效起至今	-11.30%	0.70%	9.68%	0.43%	-20.98%	0.27%

注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%。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。

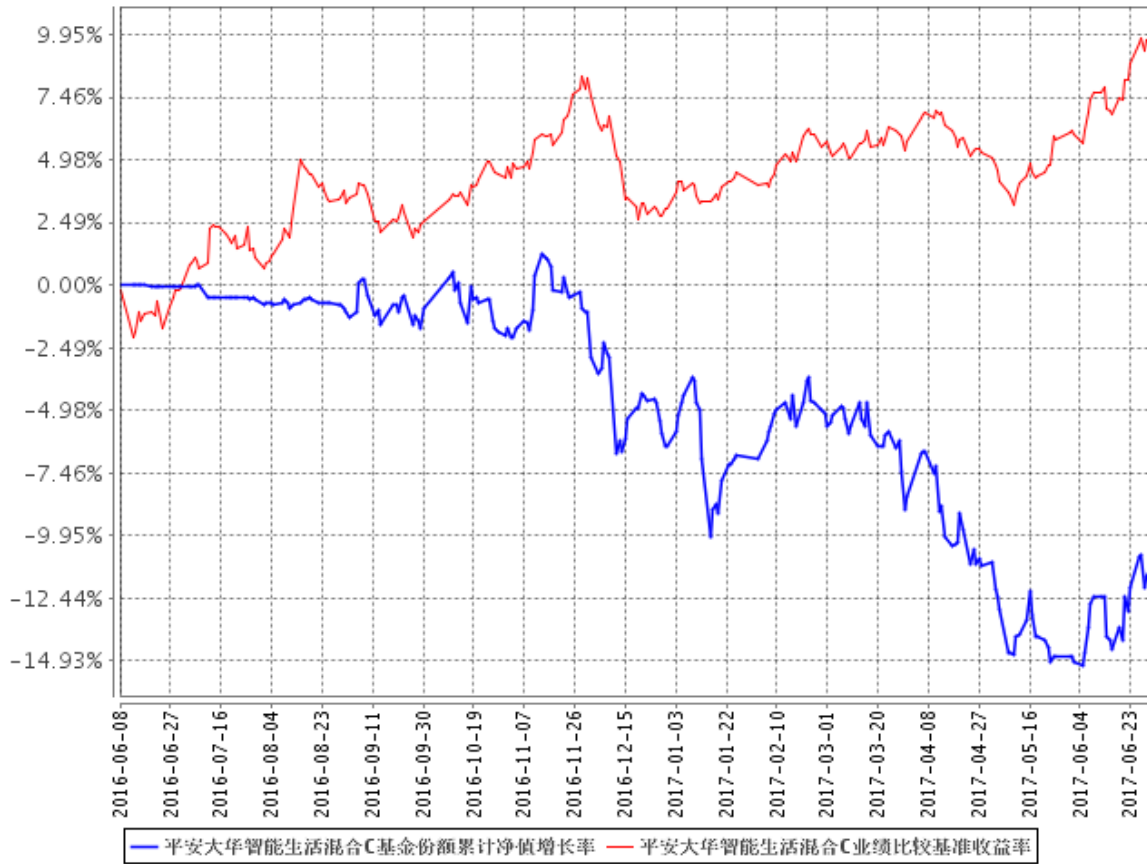
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

平安大华智能生活混合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



平安大华智能生活混合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 6 月 8 日正式生效，截至报告期末已满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安大华”）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		
孙健	平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理、投资研究部执行总经理	2016 年 6 月 8 日	-	16 年	孙健先生，投资研究部执行总经理，基金经理，硕士。曾任湘财证券有限责任公司资产管理总部投资经理，中国太平人寿保险有限公司投资部、太平资产管理有限公司组合投资经理，摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理，银华基金管理有限公司固定收益部副总监、银华货币市场基金基金经理、银华

					<p>信用债券型基金基金经理。2011 年 9 月加入平安大华基金公司，任投资研究部固定收益研究员，现担任“平安大华添利债券型证券投资基金”、“平安大华日增利货币市场基金”、“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”、“平安大华安享保本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”、“平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金”、“平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。</p>
神爱前	平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016 年 7 月 25 日	-	8	<p>厦门大学财政学硕士，8 年证券从业经验，曾任第一创业证券研究所行业研究员、民生证券研究所高级研究员、第一创业证券资产管理部高级研究员，2014 年 12 月加入平安大华基金管理公司，任投资研究部高级研究员，现任平安大华策略先锋混合型</p>

					证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
傅浩	平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017年3月29日	-	8	中山大学金融学硕士，8年证券从业经验，曾任国都证券有限责任公司行业研究员、广发证券资产管理（广东）有限公司投资经理，2016年5月加入平安大华基金管理公司，任投资研究部投资经理，现任平安大华行业先锋混合型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置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。
- 3、基金经理孙健因工作需要从2017年7月4日起不再担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华智能生活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《证券投资基金管理人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

一季度 A 股市场迎来春季行情，市场热点和投资机会较多。一方面，围绕着经济复苏主线展开行情，投资主线以偏周期的钢铁、建筑为代表。另一方面，以白酒和家电为代表的稳定增长消费板块也稳步上涨。在一季度，产品组合主要围绕经济复苏主线布局了偏周期的建筑和钢铁建材板块，获得了一定的投资收益，但周期板块波动较大，持续性不如消费板块，总体上看，一季度的配置虽然抓住了部分热点板块，但和今年以来的主流行情板块还是有所偏差。

4 月份以来 A 股市场经历了较大的波动，我们认为存在政策和流动性两方面的原因。在 4-5 月份市场经历短期的风险偏好上升后快速回落，加上金融去杠杆对市场流动性的边际负面影响，市场经历今年以来最大的一波单边下跌。6 月初，央行为防止季末流动性紧张的局面出现，提前在月初进行了一系列公开市场操作改善市场的流动性状况，这带来了 6 月份市场的反弹。

产品组合净值在 4-5 月份回撤较大，客观上有市场整体单边下跌的因素，主观上来看，在 4 月份我们对于金融去杠杆政策的影响估计不足导致组合仓位保持在较高的水平。配置方向上看，我们虽然配置了较高比例的大消费，但是也存在例如“一带一路”这类回调较大的板块配置，并

没有有效规避市场的下跌。

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智能生活混合 A 基金份额净值为 0.899 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.97%；截至本报告期末平安大华智能生活混合 C 基金份额净值为 0.887 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.24%；同期业绩比较基准收益率为 6.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前的时点，我们认为市场整体的大环境没有发生大的变化：1) 市场利率在金融去杠杆的大环境下易上难下。2) 在监管的大环境下，市场风险偏好难以出现大幅上行，市场对业绩的确定性和低估值板块和行业的偏好短期难以改变。我们认为未来改变这种格局事件可能是：1) 经济超预期下滑，货币政策重回宽松。2) 十九大后改革力度加强，市场风险偏好快速回升。

基于以上判断，下半年以大消费为代表的低估值蓝筹板块和行业依然会是我们配置的主线。同时，基于对明年的布局，我们会逐步关注中长期成长逻辑确定的板块，包括：新能源汽车产业链、消费电子、5G 产业链等成长性板块。

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

本基金本报告期内自 4 月 14 日至 6 月 30 日，出现连续 53 个工作日基金资产净值低于 5000 万的情形。截止本报告期末，以上情形未消除。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安大华智能生活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	6.4.7.1	4,413,874.32	3,751,187.49
结算备付金		1,017,654.21	1,763,267.68
存出保证金		114,568.03	60,887.14
交易性金融资产	6.4.7.2	36,489,379.06	49,276,240.80
其中：股票投资		36,489,379.06	49,276,240.80
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,883,599.06	-
应收利息	6.4.7.5	1,103.09	1,831.59
应收股利		-	-
应收申购款		1,100.00	200.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		44,921,277.77	54,853,614.70
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,096.05	87,751.41
应付管理人报酬		53,838.09	70,997.19
应付托管费		8,973.02	11,832.90
应付销售服务费		241.52	284.81
应付交易费用	6.4.7.7	458,859.04	288,606.50
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	148,784.43	110,330.72
负债合计		679,792.15	569,803.53
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	49,215,499.31	57,404,674.00
未分配利润	6.4.7.10	-4,974,013.69	-3,120,862.83
所有者权益合计		44,241,485.62	54,283,811.17
负债和所有者权益总计		44,921,277.77	54,853,614.70

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，平安大华智能生活混合 A 基金份额净值 0.899 元，基金份额总额 48,695,048.70 份；平安大华智能生活混合 C 基金份额净值 0.887 元，基金份额总额 520,450.61 份。平安大华智能生活混合份额总额合计为 49,215,499.31 份。

6.2 利润表

会计主体：平安大华智能生活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6月8日(基金合 同生效日)至2016年6 月30日
一、收入		-587,865.84	238,728.25
1.利息收入		71,051.89	238,728.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	62,820.64	81,042.20
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		8,231.25	157,686.05
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,381,523.35	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,746,262.81	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	364,739.46	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,710,311.52	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	12,294.10	-
减：二、费用		1,996,870.42	338,483.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	371,084.53	232,053.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	61,847.42	38,675.49

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,567.39	43,660.74
4. 交易费用	6.4.7.19	1,400,900.33	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	161,470.75	24,093.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,584,736.26	-99,754.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,584,736.26	-99,754.78

注：本基金于 2016 年 6 月 8 日成立，故上年可比期间从 2016 年 6 月 8 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：平安大华智能生活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）	57,404,674.00	-3,120,862.83	54,283,811.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,584,736.26	-2,584,736.26
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	-8,189,174.69	731,585.40	-7,457,589.29

填列)			
其中：1.基金申购款	600,931.26	-57,458.23	543,473.03
2.基金赎回款	-8,790,105.95	789,043.63	-8,001,062.32
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）	49,215,499.31	-4,974,013.69	44,241,485.62
项目	上年度可比期间 2016年6月8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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-56,094.04	-56,094.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	257,449,054.11	-	257,449,054.11
其中：1.基金申购款	257,449,054.11	-	257,449,054.11
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)	257,449,054.11	-56,094.04	257,392,960.07
---------------------	----------------	------------	----------------

注：本基金于 2016 年 6 月 8 日成立，故上年可比期间从 2016 年 6 月 8 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	_____ 林婉文	_____ 胡明
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安大华智能生活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[2015]2556 号《关于准予平安大华智能生活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《平安大华平安大华智能生活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，首次募集期间为 2016 年 4 月 25 日至 2016 年 6 月 3 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 257,395,319.81 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司(2016)验字第 608 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 06 月 08 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 257,449,054.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 53,734.30 份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华平安大华智能生活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允许基金投资的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等）以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%。

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》、《平安大华智能生活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 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公

司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	4,413,874.32

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,413,874.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	34,964,719.09	36,489,379.06	1,524,659.97
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	34,964,719.09	36,489,379.06	1,524,659.97

注：本年度本基金所投资的股票中，无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	644.45
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	412.20
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	46.44
合计	1,103.09

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	458,859.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	458,859.04

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16.91
预提费用	148,767.52
合计	148,784.43

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安大华智能生活混合 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,829,878.04	56,829,878.04
本期申购	510,497.91	510,497.91
本期赎回(以“-”号填列)	-8,645,327.25	-8,645,327.25
- 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	48,695,048.70	48,695,048.70

金额单位：人民币元

平安大华智能生活混合 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	574,795.96	574,795.96
本期申购	90,433.35	90,433.35

本期赎回(以“-”号填列)	-144,778.70	-144,778.70
- 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	520,450.61	520,450.61

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安大华智能生活混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,531,891.49	-1,552,194.40	-3,084,085.89
本期利润	-5,236,300.09	2,680,098.93	-2,556,201.16
本期基金份额交易产生的变动数	722,669.62	2,236.58	724,906.20
其中：基金申购款	-49,087.17	-1,094.95	-50,182.12
基金赎回款	771,756.79	3,331.53	775,088.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,045,521.96	1,130,141.11	-4,915,380.85

单位：人民币元

平安大华智能生活混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-21,244.20	-15,532.74	-36,776.94
本期利润	-58,747.69	30,212.59	-28,535.10
本期基金份额交易产生的变动数	9,437.82	-2,758.62	6,679.20

其中：基金申购款	-6,438.27	-837.84	-7,276.11
基金赎回款	15,876.09	-1,920.78	13,955.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-70,554.07	11,921.23	-58,632.84

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	54,565.46
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	7,423.72
其他	831.46
合计	62,820.64

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	539,780,867.32
减：卖出股票成本总额	543,527,130.13
买卖股票差价收入	-3,746,262.81

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券买卖差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期未发生贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	364,739.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	364,739.46

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	2,710,311.52
——股票投资	2,710,311.52
——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	2,710,311.52

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	12,208.62
转换费收入	85.48
合计	12,294.10

注：

- 1、本基金的赎回费率按持有期间递减，对于 A 类基金份额持有人，对持续持有期少于 7 日的投资人收取不低于 1.5% 的赎回费，对持续持有期少于 30 日的投资人收取不低于 0.75% 的赎回费，并

将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于 3 个月的投资人收取不低于 0.5% 的赎回费，并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 个月的投资人收取不低于 0.5% 的赎回费，并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 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。对于 C 类基金份额持有人，对于赎回时份额持有不满 30 天的，收取的赎回费全额计入基金财产；对赎回时份额持有期长于 30 天（含 30 天）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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,400,900.33
银行间市场交易费用	-
合计	1,400,900.33

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	119,014.74
银行间账户维护费	9,000.00
银行费用	3,703.23
合计	161,470.75

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理公司	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
中国建设银行股份有限公司	基金销售机构、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 6 月 8 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
平安证券股份有限公 司	17,828,865.46	1.67%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
平安证券股份有 限公司	16,604.04	2.17%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年6月8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

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 6 月 8 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	371,084.53	232,053.07
其中：支付销售机构的客户维护费	243,778.66	108,555.16

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=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 6 月 8 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	61,847.42	38,675.49

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式为：

日托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.10.2.3 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 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		
	平安大华智能生活 混合 A	平安大华智能生活 混合 C	合计
平安银行股份有限公司	-	222.85	222.85
平安大华基金管理公司	-	10.20	10.20
上海陆金所资产管理有 限公司	-	0.17	0.17
合计	-	233.22	233.22
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 6 月 8 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		
	平安大华智能生活 混合 A	平安大华智能生活 混合 C	合计
平安银行股份有限公司	-	413.10	413.10
平安大华基金管理公司	-	2,884.97	2,884.97
合计	-	3,298.07	3,298.07

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 0.6% 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 × 0.6% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年6月8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
中国建设银行有限公司	4,413,874.32	644.45	87,627,197.83	8,956.55

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期内无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 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
600795	国电电力	2017年6月5日	重大事项	3.60	-	-	125,000	441,250.00	450,000.00	-

		日							
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制订了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.1 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资（2016 年 12 月 31 日：同）

6.4.13.1.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有债券投资。

6.4.13.1.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有债券投资。

6.4.13.2 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证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持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 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.3.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,413,874.32	-	-	-	-	-	4,413,874.32
结算备付金	1,017,654.21	-	-	-	-	-	1,017,654.21
存出保证金	114,568.03	-	-	-	-	-	114,568.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	36,489,379.06	36,489,379.06
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,883,599.06	2,883,599.06
应收利息	-	-	-	-	-	1,103.09	1,103.09
应收申购款	-	-	-	-	-	1,100.00	1,100.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,546,096.56	-	-	-	-	39,375,181.21	44,921,277.77
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,096.05	9,096.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	53,838.09	53,838.09
应付托管费	-	-	-	-	-	8,973.02	8,973.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-	241.52	241.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	458,859.04	458,859.04
其他负债	-	-	-	-	-	148,784.43	148,784.43
负债总计	-	-	-	-	-	679,792.15	679,792.15

利率敏感度缺口	5,546,096.56	-	-	-	-	-38,695,389.06	44,241,485.62
上年度末 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	3,751,187.49	-	-	-	-	-	3,751,187.49
结算备付金	1,763,267.68	-	-	-	-	-	1,763,267.68
存出保证金	60,887.14	-	-	-	-	-	60,887.14
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-49,276,240.80	49,276,240.80
应收利息	-	-	-	-	-	1,831.59	1,831.59
应收申购款	-	-	-	-	-	200.00	200.00
资产总计	5,575,342.31	-	-	-	-	-49,278,272.39	54,853,614.70
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	87,751.41	87,751.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,997.19	70,997.19
应付托管费	-	-	-	-	-	11,832.90	11,832.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	284.81	284.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	288,606.50	288,606.50
其他负债	-	-	-	-	-	110,330.72	110,330.72
负债总计	-	-	-	-	-	569,803.53	569,803.53
利率敏感度缺口	5,575,342.31	-	-	-	-	-48,708,468.86	54,283,811.17

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

6.4.13.3.1.2 利率风险的敏感性分析

于2017年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2016年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016年12月31日：同)。

6.4.13.3.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.3.3 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。本基金投资组合中股票等权益类资产投资占基金资产的比例范围为 0-95%，其中投资于智能生活主题相关的行业证券资产不低于非现金基金资产的 80%，其中权证投资占基金资产净值的 0-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券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。

6.4.13.3.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	36,489,379.06	82.48	49,276,240.80	90.78
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产—权证投资		-	-	-
其他		-	-	-
合计	36,489,379.06	82.48	49,276,240.80	90.78

6.4.13.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	基金业绩比较基准增加 5%	431,136.98	-
	基金业绩比较基准减少 5%	-431,136.98	-

业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 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	36,489,379.06	81.23
	其中：股票	36,489,379.06	81.23
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	5,431,528.53	12.09
7	其他各项资产	3,000,370.18	6.68
8	合计	44,921,277.77	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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	912,426.00	2.06
C	制造业	26,109,383.46	59.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	450,000.00	1.02

E	建筑业	1,088,465.00	2.46
F	批发和零售业	3,554,047.60	8.03
G	交通运输、仓储和邮政业	890,136.00	2.01
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	-	-
K	房地产业	2,609,495.00	5.90
L	租赁和商务服务业	444,448.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	430,978.00	0.97
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	36,489,379.06	82.48

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600104	上汽集团	104,336	3,239,632.80	7.32
2	000651	格力电器	62,818	2,586,217.06	5.85
3	000858	五粮液	40,200	2,237,532.00	5.06
4	002241	歌尔股份	92,242	1,778,425.76	4.02

5	000333	美的集团	40,200	1,730,208.00	3.91
6	000050	深天马 A	79,100	1,627,087.00	3.68
7	603626	科森科技	21,793	1,420,467.74	3.21
8	000725	京东方 A	319,800	1,330,368.00	3.01
9	600153	建发股份	102,700	1,327,911.00	3.00
10	000959	首钢股份	189,000	1,321,110.00	2.99
11	600048	保利地产	131,500	1,311,055.00	2.96
12	600546	山煤国际	272,900	1,307,191.00	2.95
13	000002	万 科 A	52,000	1,298,440.00	2.93
14	300410	正业科技	34,223	1,235,450.30	2.79
15	002635	安洁科技	31,715	1,148,717.30	2.60
16	601800	中国交建	68,500	1,088,465.00	2.46
17	000968	蓝焰控股	63,100	912,426.00	2.06
18	600018	上港集团	140,400	890,136.00	2.01
19	600884	杉杉股份	53,400	879,498.00	1.99
20	600741	华域汽车	22,000	533,280.00	1.21
21	600566	济川药业	13,400	509,602.00	1.15
22	600522	中天科技	42,100	507,305.00	1.15
23	600987	航民股份	36,300	470,448.00	1.06
24	000488	晨鸣纸业	36,200	466,980.00	1.06
25	603660	苏州科达	11,400	466,830.00	1.06
26	600297	广汇汽车	61,620	463,998.60	1.05
27	600285	羚锐制药	41,000	460,430.00	1.04
28	600521	华海药业	21,800	458,672.00	1.04
29	002221	东华能源	41,700	454,947.00	1.03
30	600795	国电电力	125,000	450,000.00	1.02
31	002027	分众传媒	32,300	444,448.00	1.00
32	600703	三安光电	22,500	443,250.00	1.00

33	600276	恒瑞医药	8,700	440,133.00	0.99
34	002573	清新环境	22,900	430,978.00	0.97
35	600519	贵州茅台	900	424,665.00	0.96
36	002271	东方雨虹	10,595	393,074.50	0.89

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	002271	东方雨虹	9,437,537.68	17.39
2	000049	德赛电池	7,805,091.50	14.38
3	601111	中国国航	7,609,875.83	14.02
4	601668	中国建筑	6,732,639.41	12.40
5	603626	科森科技	6,706,051.29	12.35
6	600153	建发股份	6,558,897.67	12.08
7	000651	格力电器	6,507,173.00	11.99
8	601336	新华保险	6,101,145.00	11.24
9	002045	国光电器	5,943,306.00	10.95
10	002677	浙江美大	5,874,392.32	10.82
11	600690	青岛海尔	5,767,385.30	10.62
12	002573	清新环境	5,589,093.04	10.30
13	000333	美的集团	5,581,455.01	10.28
14	002241	歌尔股份	5,531,352.70	10.19
15	600068	葛洲坝	5,485,757.56	10.11
16	000725	京东方 A	5,321,165.00	9.80
17	002831	裕同科技	5,280,448.00	9.73
18	000065	北方国际	5,049,356.52	9.30
19	000090	天健集团	4,830,316.70	8.90

20	300136	信维通信	4,797,948.05	8.84
21	600123	兰花科创	4,781,553.00	8.81
22	000619	海螺型材	4,453,504.00	8.20
23	000910	大亚圣象	4,392,934.71	8.09
24	600172	黄河旋风	4,160,690.00	7.66
25	600166	福田汽车	4,120,067.00	7.59
26	002281	光迅科技	4,028,282.74	7.42
27	600104	上汽集团	4,008,490.00	7.38
28	002456	欧菲光	4,006,831.90	7.38
29	002036	联创电子	4,001,117.81	7.37
30	002838	道恩股份	3,959,253.00	7.29
31	002126	银轮股份	3,821,214.80	7.04
32	600741	华域汽车	3,814,220.76	7.03
33	000983	西山煤电	3,646,468.00	6.72
34	000050	深天马 A	3,551,899.83	6.54
35	000858	五 粮 液	3,550,364.33	6.54
36	000906	浙商中拓	3,548,352.00	6.54
37	001979	招商蛇口	3,493,449.24	6.44
38	300124	汇川技术	3,415,271.00	6.29
39	600841	上柴股份	3,407,630.90	6.28
40	300408	三环集团	3,392,128.00	6.25
41	002372	伟星新材	3,351,945.84	6.17
42	000059	华锦股份	3,323,941.00	6.12
43	000921	海信科龙	3,301,887.12	6.08
44	002035	华帝股份	3,234,370.20	5.96
45	002766	索菱股份	3,155,732.80	5.81
46	600660	福耀玻璃	3,141,888.43	5.79
47	002475	立讯精密	3,091,554.00	5.70

48	300183	东软载波	3,079,948.00	5.67
49	002511	中顺洁柔	3,069,640.86	5.65
50	000423	东阿阿胶	3,063,448.75	5.64
51	000151	中成股份	3,052,654.00	5.62
52	600521	华海药业	3,011,262.14	5.55
53	601117	中国化学	2,991,799.00	5.51
54	600886	国投电力	2,960,673.00	5.45
55	002508	老板电器	2,788,331.40	5.14
56	601233	桐昆股份	2,733,510.23	5.04
57	601288	农业银行	2,687,798.00	4.95
58	300495	美尚生态	2,672,929.00	4.92
59	300410	正业科技	2,651,542.24	4.88
60	603898	好莱客	2,636,227.00	4.86
61	601601	中国太保	2,616,795.00	4.82
62	000823	超声电子	2,599,973.00	4.79
63	000418	小天鹅A	2,582,790.00	4.76
64	601800	中国交建	2,562,470.00	4.72
65	300098	高新兴	2,549,851.58	4.70
66	002635	安洁科技	2,545,515.80	4.69
67	000980	众泰汽车	2,516,304.00	4.64
68	002419	天虹股份	2,512,341.65	4.63
69	600527	江南高纤	2,483,905.00	4.58
70	300450	先导智能	2,480,270.00	4.57
71	601798	蓝科高新	2,457,501.00	4.53
72	601155	新城控股	2,420,764.52	4.46
73	600579	天华院	2,362,302.96	4.35
74	002501	利源精制	2,359,190.06	4.35
75	002705	新宝股份	2,351,039.00	4.33

76	000537	广宇发展	2,345,529.00	4.32
77	600884	杉杉股份	2,334,086.51	4.30
78	000610	西安旅游	2,316,988.00	4.27
79	000785	武汉中商	2,293,489.63	4.22
80	600340	华夏幸福	2,268,660.00	4.18
81	601628	中国人寿	2,247,576.95	4.14
82	600731	湖南海利	2,242,394.00	4.13
83	601996	丰林集团	2,233,047.00	4.11
84	002187	广百股份	2,231,983.00	4.11
85	600619	海立股份	2,219,489.00	4.09
86	601007	金陵饭店	2,215,978.00	4.08
87	601009	南京银行	2,211,060.00	4.07
88	300057	万顺股份	2,207,297.00	4.07
89	603167	渤海轮渡	2,207,047.00	4.07
90	600618	氯碱化工	2,205,765.00	4.06
91	600305	恒顺醋业	2,205,195.20	4.06
92	600856	中天能源	2,204,473.45	4.06
93	000570	苏常柴A	2,204,378.00	4.06
94	600029	南方航空	2,202,613.38	4.06
95	600790	轻纺城	2,192,550.00	4.04
96	000529	广弘控股	2,161,808.00	3.98
97	600865	百大集团	2,159,988.83	3.98
98	000417	合肥百货	2,156,070.00	3.97
99	600509	天富能源	2,140,164.00	3.94
100	600218	全柴动力	2,084,482.99	3.84
101	600889	南京化纤	2,039,239.00	3.76
102	300128	锦富技术	2,034,155.00	3.75
103	002229	鸿博股份	2,029,941.00	3.74

104	002185	华天科技	2,021,423.83	3.72
105	600477	杭萧钢构	2,002,017.00	3.69
106	603799	华友钴业	1,995,980.00	3.68
107	600240	华业资本	1,995,261.00	3.68
108	603993	洛阳钼业	1,989,739.00	3.67
109	300258	精锻科技	1,981,567.38	3.65
110	601689	拓普集团	1,964,526.00	3.62
111	600814	杭州解百	1,951,417.00	3.59
112	601607	上海医药	1,926,016.85	3.55
113	000568	泸州老窖	1,799,950.00	3.32
114	601006	大秦铁路	1,782,857.44	3.28
115	601939	建设银行	1,770,610.00	3.26
116	000002	万科A	1,760,185.00	3.24
117	000581	威孚高科	1,758,267.00	3.24
118	601965	中国汽研	1,754,997.80	3.23
119	002616	长青集团	1,751,581.00	3.23
120	300566	激智科技	1,735,339.00	3.20
121	601231	环旭电子	1,720,059.00	3.17
122	300007	汉威科技	1,701,479.00	3.13
123	600125	铁龙物流	1,649,599.00	3.04
124	600993	马应龙	1,625,855.00	3.00
125	600383	金地集团	1,608,152.48	2.96
126	300471	厚普股份	1,601,698.00	2.95
127	300054	鼎龙股份	1,601,662.00	2.95
128	300373	扬杰科技	1,596,030.00	2.94
129	300207	欣旺达	1,593,272.00	2.94
130	300484	蓝海华腾	1,589,290.00	2.93
131	002019	亿帆医药	1,577,475.00	2.91

132	601766	中国中车	1,573,609.90	2.90
133	300458	全志科技	1,571,897.00	2.90
134	002341	新纶科技	1,571,602.00	2.90
135	600976	健民集团	1,571,480.85	2.89
136	300038	梅泰诺	1,571,109.35	2.89
137	600048	保利地产	1,570,696.00	2.89
138	002008	大族激光	1,556,177.00	2.87
139	600335	国机汽车	1,552,708.00	2.86
140	300145	中金环境	1,541,918.00	2.84
141	002624	完美世界	1,541,812.94	2.84
142	002139	拓邦股份	1,537,950.00	2.83
143	603737	三棵树	1,534,061.31	2.83
144	000018	神州长城	1,531,989.00	2.82
145	002611	东方精工	1,529,174.50	2.82
146	002682	龙洲股份	1,524,142.00	2.81
147	603040	新坐标	1,523,435.00	2.81
148	601989	中国重工	1,522,807.00	2.81
149	300406	九强生物	1,508,550.00	2.78
150	300332	天壕环境	1,507,424.00	2.78
151	600452	涪陵电力	1,498,197.00	2.76
152	600885	宏发股份	1,495,019.99	2.75
153	603788	宁波高发	1,488,304.00	2.74
154	300236	上海新阳	1,466,577.05	2.70
155	603239	浙江仙通	1,464,452.17	2.70
156	002284	亚太股份	1,463,021.77	2.70
157	000069	华侨城A	1,451,487.00	2.67
158	600266	北京城建	1,418,857.00	2.61
159	600518	康美药业	1,415,167.37	2.61

160	300595	欧普康视	1,414,213.00	2.61
161	002433	太安堂	1,405,640.00	2.59
162	002344	海宁皮城	1,376,393.26	2.54
163	000969	安泰科技	1,373,452.82	2.53
164	603006	黎明股份	1,370,765.00	2.53
165	600546	山煤国际	1,331,443.00	2.45
166	000959	首钢股份	1,323,224.00	2.44
167	000968	蓝焰控股	1,319,393.00	2.43
168	603160	汇顶科技	1,313,189.00	2.42
169	002236	大华股份	1,298,107.00	2.39
170	002032	苏泊尔	1,292,710.00	2.38
171	600368	五洲交通	1,290,152.00	2.38
172	300349	金卡智能	1,271,629.00	2.34
173	600977	中国电影	1,237,144.00	2.28
174	300415	伊之密	1,147,368.44	2.11
175	603833	欧派家居	1,138,227.70	2.10
176	601398	工商银行	1,089,509.00	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。

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	002271	东方雨虹	9,142,922.19	16.84
2	601111	中国国航	7,978,967.16	14.70
3	000049	德赛电池	7,769,809.90	14.31
4	601668	中国建筑	6,617,662.42	12.19
5	601336	新华保险	6,018,064.04	11.09

6	002677	浙江美大	5,988,270.18	11.03
7	002045	国光电器	5,879,773.00	10.83
8	600690	青岛海尔	5,826,373.46	10.73
9	603626	科森科技	5,489,002.33	10.11
10	600068	葛洲坝	5,342,422.00	9.84
11	002573	清新环境	5,151,000.84	9.49
12	002831	裕同科技	5,146,443.00	9.48
13	600153	建发股份	5,086,804.91	9.37
14	000065	北方国际	5,021,010.17	9.25
15	600814	杭州解百	5,007,569.00	9.22
16	300136	信维通信	4,971,596.34	9.16
17	000090	天健集团	4,896,290.71	9.02
18	000619	海螺型材	4,788,098.00	8.82
19	600123	兰花科创	4,622,966.76	8.52
20	000910	大亚圣象	4,399,751.72	8.11
21	000651	格力电器	4,370,113.26	8.05
22	002456	欧菲光	4,187,884.83	7.71
23	000725	京东方 A	4,034,632.27	7.43
24	600172	黄河旋风	4,016,213.38	7.40
25	002241	歌尔股份	3,964,755.19	7.30
26	002036	联创电子	3,927,245.11	7.23
27	002281	光迅科技	3,904,044.64	7.19
28	600166	福田汽车	3,882,501.92	7.15
29	002838	道恩股份	3,852,637.20	7.10
30	000333	美的集团	3,836,648.61	7.07
31	000906	浙商中拓	3,791,869.00	6.99
32	000018	神州长城	3,628,034.60	6.68
33	002126	银轮股份	3,593,108.30	6.62

34	000983	西山煤电	3,558,471.15	6.56
35	001979	招商蛇口	3,505,238.23	6.46
36	300408	三环集团	3,484,580.46	6.42
37	600841	上柴股份	3,451,749.60	6.36
38	600741	华域汽车	3,340,559.26	6.15
39	300124	汇川技术	3,336,907.72	6.15
40	000423	东阿阿胶	3,220,100.17	5.93
41	000059	华锦股份	3,217,303.93	5.93
42	002766	索菱股份	3,198,344.55	5.89
43	002372	伟星新材	3,195,483.69	5.89
44	002511	中顺洁柔	3,144,074.66	5.79
45	002035	华帝股份	3,138,180.77	5.78
46	600660	福耀玻璃	3,071,009.00	5.66
47	002475	立讯精密	3,056,990.60	5.63
48	000921	海信科龙	3,056,471.73	5.63
49	600886	国投电力	2,989,655.84	5.51
50	000151	中成股份	2,918,205.01	5.38
51	000400	许继电气	2,861,061.42	5.27
52	601117	中国化学	2,850,323.60	5.25
53	300183	东软载波	2,836,594.63	5.23
54	601996	丰林集团	2,739,528.00	5.05
55	601288	农业银行	2,738,441.00	5.04
56	002508	老板电器	2,731,578.92	5.03
57	601601	中国太保	2,704,693.00	4.98
58	300495	美尚生态	2,671,329.00	4.92
59	000418	小天鹅A	2,617,239.89	4.82
60	601007	金陵饭店	2,606,097.00	4.80
61	000823	超声电子	2,599,629.98	4.79

62	601718	际华集团	2,582,951.00	4.76
63	601233	桐昆股份	2,575,004.00	4.74
64	300450	先导智能	2,567,014.60	4.73
65	002419	天虹股份	2,532,843.65	4.67
66	600521	华海药业	2,524,256.00	4.65
67	300098	高新兴	2,517,905.98	4.64
68	002345	潮宏基	2,492,255.28	4.59
69	601155	新城控股	2,450,509.74	4.51
70	600527	江南高纤	2,442,925.00	4.50
71	603898	好莱客	2,439,181.80	4.49
72	600497	驰宏锌锗	2,394,096.00	4.41
73	002242	九阳股份	2,368,621.55	4.36
74	002622	融钰集团	2,367,146.00	4.36
75	600731	湖南海利	2,356,393.00	4.34
76	002705	新宝股份	2,346,927.00	4.32
77	000980	众泰汽车	2,327,086.96	4.29
78	601798	蓝科高新	2,303,389.00	4.24
79	000537	广宇发展	2,301,618.00	4.24
80	002519	银河电子	2,301,001.00	4.24
81	300057	万顺股份	2,289,634.00	4.22
82	600579	天华院	2,285,502.35	4.21
83	000878	云南铜业	2,270,632.00	4.18
84	600787	中储股份	2,266,679.00	4.18
85	000610	西安旅游	2,265,681.00	4.17
86	000529	广弘控股	2,264,131.00	4.17
87	600826	兰生股份	2,253,893.00	4.15
88	000417	合肥百货	2,234,348.00	4.12
89	603167	渤海轮渡	2,234,046.00	4.12

90	600305	恒顺醋业	2,231,090.80	4.11
91	002187	广百股份	2,229,901.00	4.11
92	601628	中国人寿	2,227,491.86	4.10
93	600340	华夏幸福	2,219,609.00	4.09
94	600856	中天能源	2,217,297.00	4.08
95	600790	轻纺城	2,216,620.00	4.08
96	600618	氯碱化工	2,214,125.00	4.08
97	002452	长高集团	2,204,725.00	4.06
98	000718	苏宁环球	2,202,481.00	4.06
99	601009	南京银行	2,193,940.00	4.04
100	600865	百大集团	2,191,635.60	4.04
101	000733	振华科技	2,182,337.25	4.02
102	600415	小商品城	2,181,322.00	4.02
103	600509	天富能源	2,177,698.00	4.01
104	002501	利源精制	2,168,017.87	3.99
105	000997	新大陆	2,134,487.00	3.93
106	600029	南方航空	2,128,650.00	3.92
107	000785	武汉中商	2,115,542.00	3.90
108	600889	南京化纤	2,105,204.00	3.88
109	002229	鸿博股份	2,072,434.96	3.82
110	000570	苏常柴A	2,057,339.99	3.79
111	600218	全柴动力	2,046,972.06	3.77
112	603799	华友钴业	2,031,003.40	3.74
113	600477	杭萧钢构	2,030,114.74	3.74
114	002185	华天科技	1,998,977.00	3.68
115	600619	海立股份	1,996,903.00	3.68
116	000936	华西股份	1,989,111.00	3.66
117	000530	大冷股份	1,960,892.00	3.61

118	300110	华仁药业	1,958,314.00	3.61
119	601689	拓普集团	1,935,763.00	3.57
120	601607	上海医药	1,934,212.40	3.56
121	000066	中国长城	1,933,434.00	3.56
122	600240	华业资本	1,908,253.18	3.52
123	300258	精锻科技	1,897,969.32	3.50
124	603993	洛阳钼业	1,886,251.00	3.47
125	601965	中国汽研	1,870,962.00	3.45
126	300128	锦富技术	1,862,901.00	3.43
127	000050	深天马 A	1,802,372.00	3.32
128	000568	泸州老窖	1,790,150.00	3.30
129	601231	环旭电子	1,787,689.37	3.29
130	601006	大秦铁路	1,776,556.84	3.27
131	000581	威孚高科	1,747,071.60	3.22
132	601939	建设银行	1,741,319.00	3.21
133	300373	扬杰科技	1,695,056.00	3.12
134	300566	激智科技	1,676,088.00	3.09
135	300484	蓝海华腾	1,671,033.84	3.08
136	300207	欣旺达	1,668,742.00	3.07
137	300007	汉威科技	1,656,482.20	3.05
138	002341	新纶科技	1,647,353.74	3.03
139	600993	马应龙	1,636,897.00	3.02
140	600125	铁龙物流	1,614,773.00	2.97
141	600335	国机汽车	1,602,015.00	2.95
142	002616	长青集团	1,593,913.00	2.94
143	300236	上海新阳	1,583,603.76	2.92
144	002008	大族激光	1,561,060.00	2.88
145	601766	中国中车	1,552,088.00	2.86

146	600976	健民集团	1,551,452.62	2.86
147	002624	完美世界	1,550,188.00	2.86
148	300471	厚普股份	1,539,160.00	2.84
149	002139	拓邦股份	1,538,717.17	2.83
150	002635	安洁科技	1,538,288.35	2.83
151	600383	金地集团	1,536,775.00	2.83
152	600518	康美药业	1,513,812.00	2.79
153	300595	欧普康视	1,510,333.00	2.78
154	603737	三棵树	1,509,184.80	2.78
155	300458	全志科技	1,507,484.47	2.78
156	603239	浙江仙通	1,506,729.43	2.78
157	002611	东方精工	1,496,314.33	2.76
158	002019	亿帆医药	1,494,875.50	2.75
159	600452	涪陵电力	1,493,207.80	2.75
160	300145	中金环境	1,484,635.80	2.73
161	300038	梅泰诺	1,484,190.00	2.73
162	600885	宏发股份	1,478,289.00	2.72
163	603040	新坐标	1,464,086.45	2.70
164	300054	鼎龙股份	1,461,603.54	2.69
165	603788	宁波高发	1,444,916.00	2.66
166	002682	龙洲股份	1,443,109.00	2.66
167	600884	杉杉股份	1,418,263.95	2.61
168	002284	亚太股份	1,416,647.00	2.61
169	300406	九强生物	1,408,185.16	2.59
170	600368	五洲交通	1,400,152.40	2.58
171	000069	华侨城A	1,397,978.00	2.58
172	601800	中国交建	1,383,186.00	2.55
173	002433	太安堂	1,382,832.00	2.55

174	601989	中国重工	1,370,096.00	2.52
175	300332	天壕环境	1,363,748.54	2.51
176	000969	安泰科技	1,357,712.32	2.50
177	000858	五粮液	1,355,527.63	2.50
178	002032	苏泊尔	1,348,693.40	2.48
179	002344	海宁皮城	1,340,712.00	2.47
180	002236	大华股份	1,326,430.00	2.44
181	002200	云投生态	1,319,697.00	2.43
182	600266	北京城建	1,302,859.88	2.40
183	300349	金卡智能	1,296,271.59	2.39
184	300410	正业科技	1,293,001.47	2.38
185	603969	银龙股份	1,290,421.00	2.38
186	603160	汇顶科技	1,281,052.00	2.36
187	600977	中国电影	1,182,644.00	2.18
188	600295	鄂尔多斯	1,148,949.50	2.12
189	603006	黎明股份	1,143,534.24	2.11
190	300083	劲胜智能	1,141,779.00	2.10
191	300446	乐凯新材	1,132,666.50	2.09
192	603833	欧派家居	1,128,819.00	2.08
193	300415	伊之密	1,109,022.00	2.04
194	601398	工商银行	1,093,765.00	2.01

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	528,029,956.87
卖出股票收入（成交）总额	539,780,867.32

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

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股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	114,568.03
2	应收证券清算款	2,883,599.06
3	应收股利	-
4	应收利息	1,103.09
5	应收申购款	1,100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,000,370.18

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 智 能 生 活 混 合 A	577	84,393.50	0.00	0.00%	48,695,048.70	100.00%
平 安 大 华 智 能 生 活 混 合 C	53	9,819.82	0.00	0.00%	520,450.61	100.00%
合计	623	78,997.59	0.00	0.00%	49,215,499.31	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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 智能生活 混合 A	114.64	0.0002%
	平安大华 智能生活	0.00	0.0000%

	混合 C		
	合计	114.64	0.0002%

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 有本开放式基金	平安大华智能生活混 合 A	0
	平安大华智能生活混 合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	平安大华智能生活混 合 A	0
	平安大华智能生活混 合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安大华智能生 活混合 A	平安大华智能生 活混合 C
基金合同生效日（2016 年 6 月 8 日）基金份 额总额	257,449,054.11	-
本报告期期初基金份额总额	56,829,878.04	574,795.96
本报告期基金总申购份额	510,497.91	90,433.35
减：本报告期基金总赎回份额	8,645,327.25	144,778.70
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	48,695,048.70	520,450.61

§ 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	
国信证券	1	350,619,303.34	32.84%	249,393.22	32.54%	-
信达证券	2	260,978,459.44	24.44%	185,633.26	24.22%	-
中信建投	1	260,469,365.18	24.39%	185,272.35	24.17%	新增
华创证券	2	87,873,868.33	8.23%	62,504.88	8.16%	-
长城证券	1	76,697,071.45	7.18%	54,554.74	7.12%	-
平安证券	1	17,828,865.46	1.67%	16,604.04	2.17%	-
中投证券	1	13,343,890.99	1.25%	12,427.31	1.62%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

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。

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	成交金额	占当期债 券回购	成交金额	占当期权证 成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
国信证券	-	-	28,300,000.00	100.00%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 第 4 季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2017 年 1 月 19 日
2	关于旗下部分基金新增凤凰金信（银川）投资管理有限公 司为销售机构及费率优惠的 公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2017 年 1 月 19 日
3	平安大华智能生活灵活配置 混合型证券投资基金招募说 明书（更新）及摘要（2016 年第 1 期）	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2017 年 1 月 21 日
4	平安大华基金管理有限公司 高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、公 司网站	2017 年 1 月 23 日
5	平安大华智能生活灵活配置	中国证券报、上海证	2017 年 3 月 30 日

	混合型证券投资基金基金经理变更公告	券报、证券时报、公司网站	
6	平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 30 日
7	关于旗下部分基金新增扬州国信嘉利投资理财有限公司为销售机构同时开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 31 日
8	关于旗下部分基金新增深圳盈信基金销售有限公司为销售机构同时开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 17 日
9	关于旗下部分基金新增苏州财路基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 18 日
10	平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 24 日
11	关于旗下部分基金参加首创证券申购、定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 26 日
12	关于旗下部分基金参与银河证券费率调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 5 月 25 日
13	关于旗下部分基金新增基煜基金为销售机构及开通基金	中国证券报、上海证券报、证券时报、公	2017 年 6 月 10 日

	转换业务、参与其费率优惠活 动的公告	司网站	
--	-----------------------	-----	--

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、平安大华智能生活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、报告期内平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

11.3 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 8 月 28 日