

平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金

2017 年年度报告 摘要

2017 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 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。

本报告期自 2017 年 1 月 23 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华量化混合	
场内简称	-	
基金主代码	003959	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 1 月 23 日	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	21,006,430.24 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:	平安大华量化混合 A	平安大华量化混合 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	003959	003960
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	20,985,581.31 份	20,848.93 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用数量化投资模型，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取数量化方法，运用行业轮动投资时钟的资产配置逻辑，形成对大类资产预期收益及风险的判断，确定资产配置的具体比例，并相应采取进取或防守的投资风格，力求有效降低基金投资系统性风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	平安大华基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正
	联系电话	0755-22626828
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn
客户服务电话	400-800-4800	95511-3
传真	0755-23997878	0755-82080387

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日		2016 年		2015 年	
	平安大华量化混合 A	平安大华量化混合 C	平安大华量化混合 A	平安大华量化混合 C	平安大华量化混合 A	平安大华量化混合 C
本期已实现收益	-5,150,680.83	-508.54	-	-	-	-
本期利润	-5,282,785.21	-536.97	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0604	-0.0268	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	0.07%	-2.79%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0007	-0.0279	-	-	-	-
期末基金资产净值	20,999,765.76	20,266.35	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0007	0.9721	-	-	-	-

1. 本基金基金合同于 2017 年 01 月 23 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

平安大华量化混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	④		
过去三个月	-2.21%	0.05%	2.58%	0.48%	-4.79%	-0.43%
过去六个月	-1.79%	0.05%	5.37%	0.42%	-7.16%	-0.37%
自基金合同生效起至今	0.07%	0.31%	10.38%	0.39%	-10.31%	-0.08%

平安大华量化混合 C

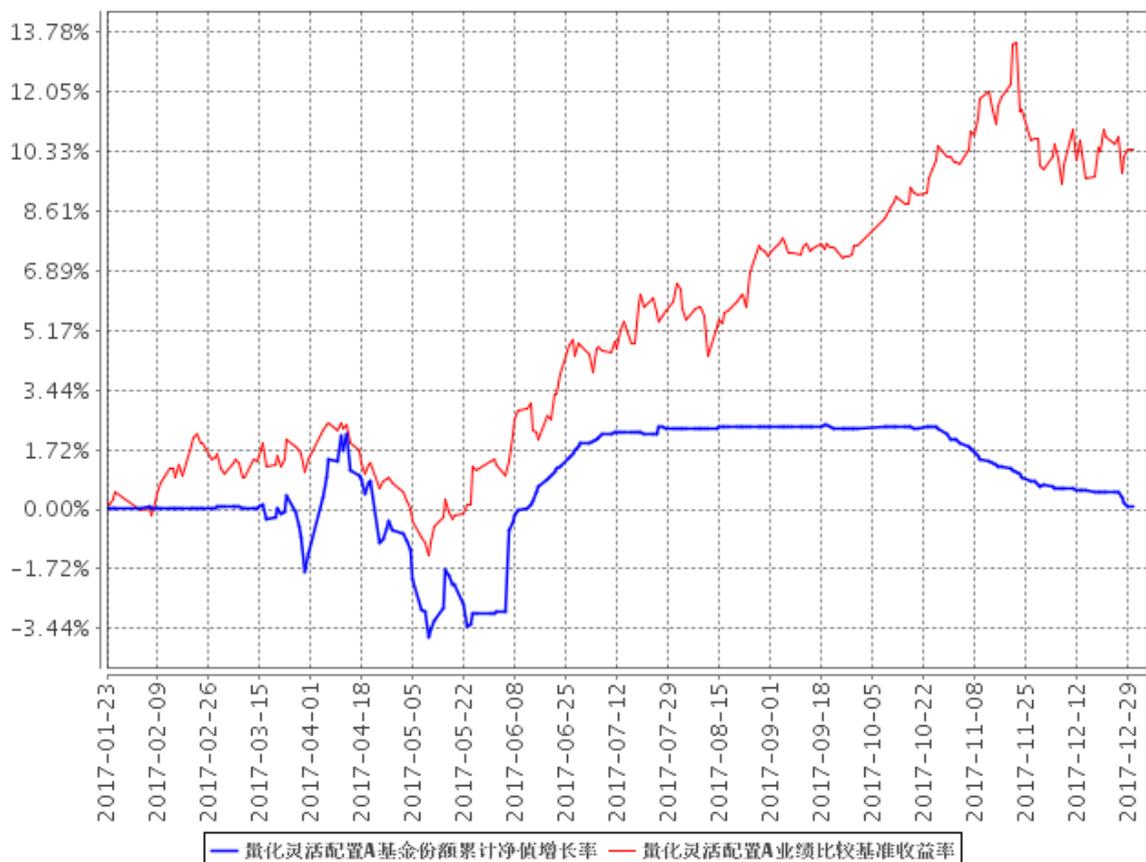
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.41%	0.05%	2.58%	0.48%	-4.99%	-0.43%
过去六个月	-2.17%	0.05%	5.37%	0.42%	-7.54%	-0.37%
自基金合同生效起至今	-2.79%	0.27%	10.38%	0.39%	-13.17%	-0.12%

本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*60%+中债综合指数收益率*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。中债综合指数具有较高的知名度和市场影响力。该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

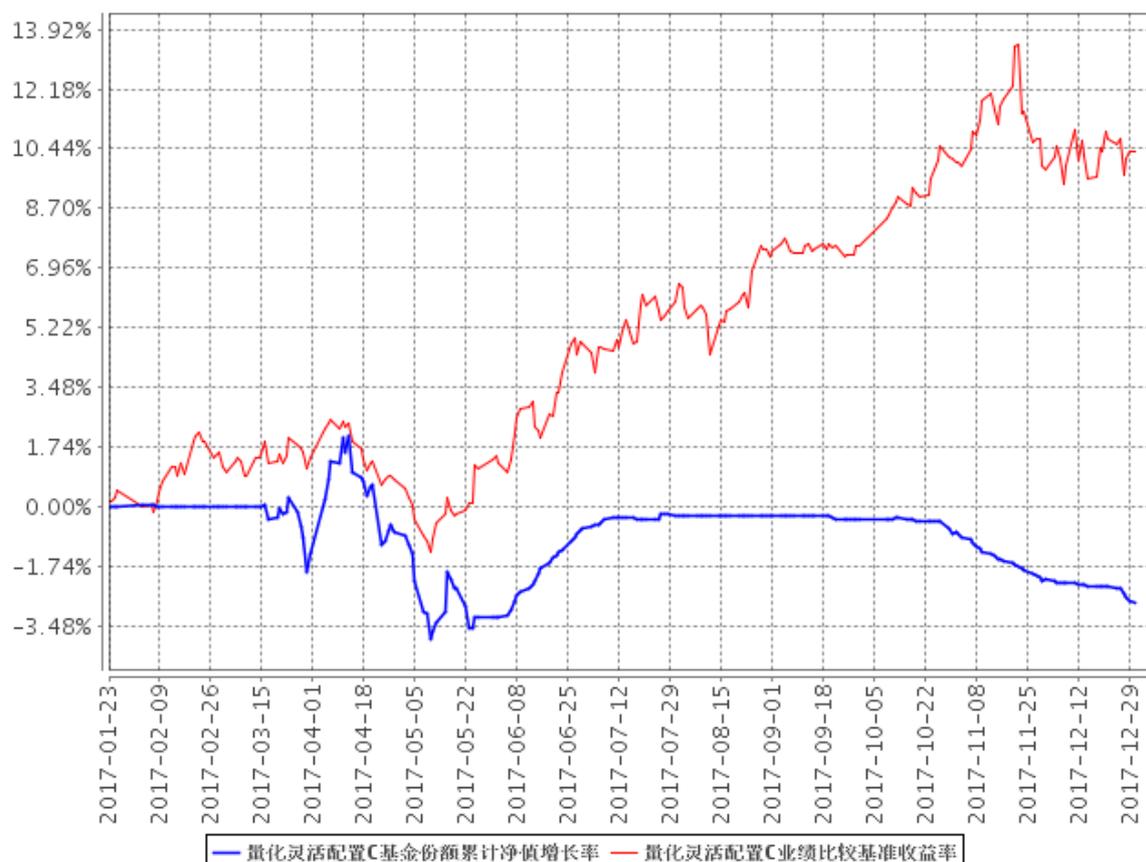
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

量化灵活配置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



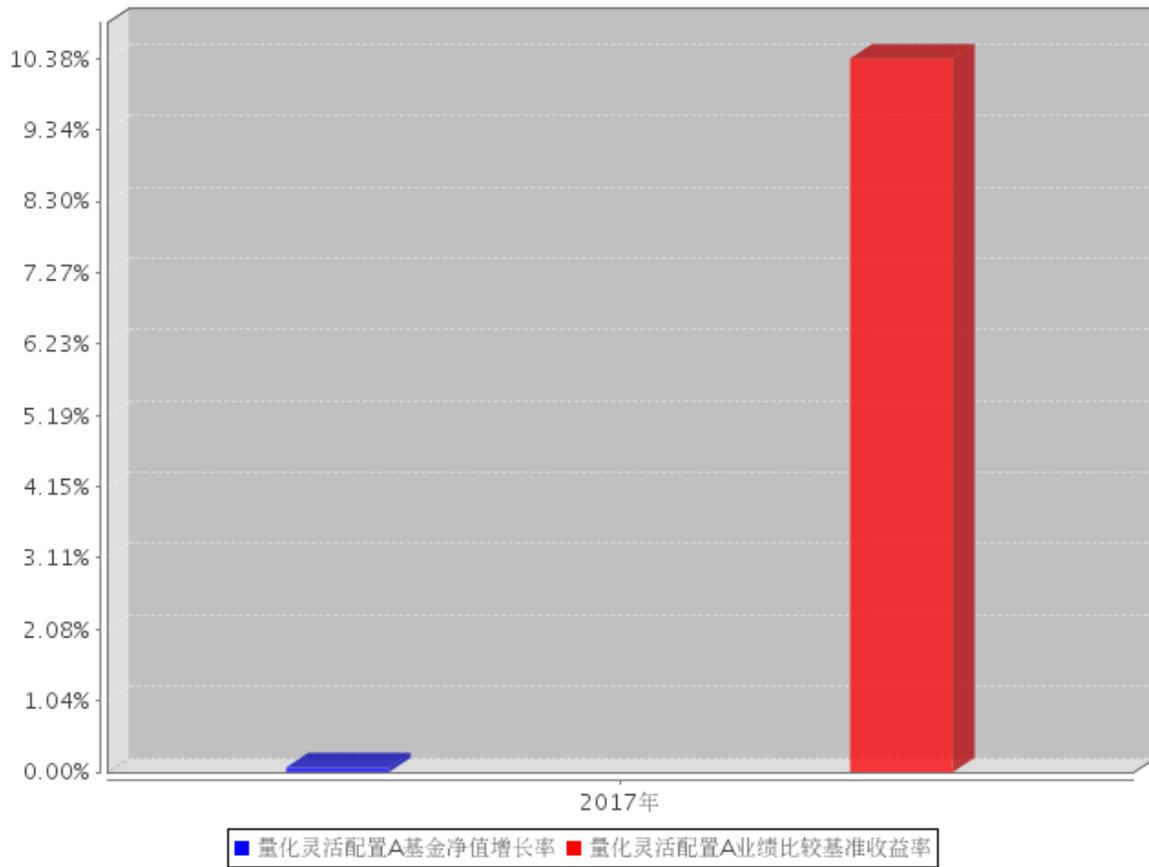
量化灵活配置C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



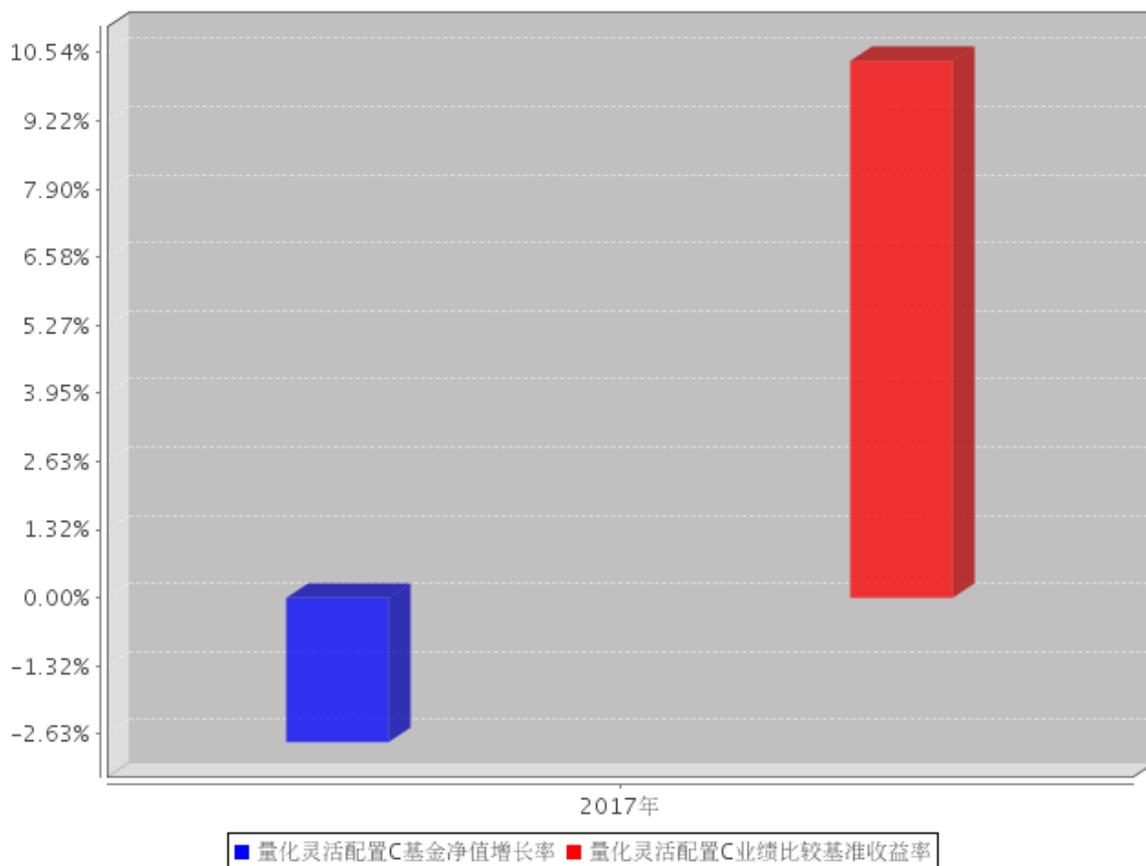
- 1、本基金基金合同于 2017 年 1 月 23 日正式生效，截至报告期末未满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓。建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

量化灵活配置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



量化灵活配置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 2017 年 1 月 23 日正式生效，截止报告期末未满一年。
2. 2017 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 过去三年基金的利润分配情况

- 1、本基金基金合同于 2017 年 01 月 23 日正式生效，截至报告期末未满一年；
- 2、遵照本基金基金合同的规定，本报告期内未进行利润分配。

§ 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 2017 年 12 月 31 日，平安基金共管理 46 只公募基金，资产管理总规模 1795 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		
刘俊廷	平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017年9月6日	-	6	刘俊廷先生，硕士研究生，曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎弘混合型证券投资基金、平安大华鼎沣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
李黄海	平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017年1月23日	2017年9月13日	14	李黄海先生，美国南加州大学博士，曾先后任职于民生加银基金金融工程与产品开发部执行总监，易方达基金投资发展部总监助理，摩根士丹利华鑫基金数量化投资部投资经理。2015年9月加入平安大华基金管理有限公司，曾任平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫荣混合型证券投资基金基金经理。

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《平安大华量化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

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《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

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

本基金成立于 2017 年 1 月 23 日，至 2017 年 3 月底，基金已经完成建仓，投资运作主要在今年第二季度。2017 年 4、5 月份期间，A 股市场个股分化严重，这种“二八分化”的行情，非常不利于本基金数量化投资运作，因为数量化投资倾向于分散化选股组合。2017 年 6 月 30 日以后，本基金根据定量和定性的分析采取了审慎的基金操作，股票一直保持低仓位运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末量化灵活配置 A 基金份额净值为 1.0007 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.07%，同期业绩比较基准收益率为 10.38%；截至本报告期末量化灵活配置 C 基金份额净值为 0.9721 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.79%；同期业绩比较基准收益率为 10.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年经济增速或将有所放缓，但更加高质量、可持续。经济总体稳中趋缓、稳中有进、均衡发展。从中长期来看，中国经济内生增长动能将逐步修复，居民收入的改善正在逐渐传导到消费，消费的回暖，尤其是可选消费的回暖正在逐渐兑现。目前中国工业行业产能利用率已经攀升至较高水平，随着产能利用率的提高，未来资本开支的扩张将是一个确定性较高的趋势。消费方面，居民收入增速的反弹对于 2018 年的消费增速有很强的支撑作用。证券市场方面，本基金管理人认为，无论是传统行业还是新兴行业，都不乏结构性的机会。大小之间的差异弱化，但追求业绩的确定性依旧是市场的主线。价值投资为主导的市场风格已经深入人心，未来的价值的挖掘将更加专业，有业绩潜力和未来前景良好具有竞争力的公司将被市场挖掘。

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

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，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。估值工作组的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 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

本基金自 2017 年 6 月 6 日至 2017 年 12 月 29 日，已出现连续 144 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。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已于 2018 年 2 月 12 日决定以通讯方式召开平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，审议《关于终止平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同及进行基金财产清算的议案》。

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金持有人数低于 200 人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由平安大华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 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	带强调事项段的无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 22916 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	平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附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，公允反映了平安大华量化混合基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营

	成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安大华量化混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注，如财务报表附注“7.4.2 会计报表的编制基础”所述，平安大华量化混合基金的基金管理人平安大华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)拟在资产负债表日后清算平安大华量化混合基金的剩余资产。因此，上述平安大华量化混合基金的财务报表以清算基础编制。该事项不影响已发表的审计意见。</p>
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安大华量化混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算平安大华量化混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。参见财务报表附注 7.4.2 有关以清算基础编制财务报表的说明。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安大华量化混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保</p>

	<p>持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对平安大华量化混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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)
注册会计师的姓名	曹翠丽 边晓红
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		20,578,439.80	-
结算备付金		109,090.90	-
存出保证金		1,071.54	-
交易性金融资产		486,552.00	-
其中：股票投资		486,552.00	-
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		-	-
应收利息		5,497.54	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		21,180,651.78	-
负债和所有者权益			
	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		26,042.33	-
应付托管费		4,340.39	-
应付销售服务费		13.66	-
应付交易费用		223.29	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		130,000.00	-
负债合计		160,619.67	-
所有者权益：			
实收基金		21,006,430.24	-
未分配利润		13,601.87	-
所有者权益合计		21,020,032.11	-
负债和所有者权益总计		21,180,651.78	-

注：

1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 21,006,430.24 份，其中下属 A 类基金份额 20,985,581.31 份，C 类基金份额 20,848.93 份。下属 A 类基金份额净值 1.0007 元，C 类基金份额净值 0.9721 元。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 23 日(基 金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		-2,922,136.52	-
1.利息收入		1,300,647.75	-
其中：存款利息收入		203,877.73	-
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		1,096,770.02	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,527,474.43	-
其中：股票投资收益		-4,762,887.95	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-357,480.00	-
股利收益		592,893.52	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-132,132.81	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		436,822.97	-
减：二、费用		2,361,185.66	-
1. 管理人报酬	7.4.7.2.1	1,269,162.48	-
2. 托管费	7.4.7.2.2	211,527.07	-
3. 销售服务费	7.4.7.2.3	149.33	-
4. 交易费用		658,446.78	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		221,900.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,283,322.18	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,283,322.18	-

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 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）	200,020,898.82	-	200,020,898.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-5,283,322.18	-5,283,322.18
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）	-179,014,468.58	5,296,924.05	-173,717,544.53
其中：1. 基金申购款	1,003,581.44	5,192.69	1,008,774.13
2. 基金赎回款	-180,018,050.02	5,291,731.36	-174,726,318.66
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）	21,006,430.24	13,601.87	21,020,032.11
项目	上年度可比期间 2016年1月1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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-	-
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

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安大华量化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]1485号《关于准予平安大华量化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《平安大华量化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200,020,898.81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(2017)第070号验资报告予以验证。

经向中国证监会备案,《平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,020,898.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 0.01 份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华量化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上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司短期公司债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货,以及法律法规或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。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 60%+中债综合指数收益率 \times 40%。

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》、《平安大华量化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。

根据《平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于 2018 年 3 月 14 日表决通过的《关于终止平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同及进行基金财产清算的议案》以及基金管理人平安大华基金管理有限公司于 2018 年 3 月 16 日发布的《平安大华基金管理有限公司关于平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金于 2018 年 3 月 16 日进入财产清算期,详情参见附注 7.4.8.2 资产负债表日后事项,因此本基金财务报表以清算基础编制。于 2017 年 12 月 31 日,所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量,负债以预计需要清偿的金额计量,其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。。

7.4.3 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 23 日(基金合同生效日)至 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.5 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) 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。

7.4.6 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
平安银行	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
中国平安保险（集团）股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.7.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 23 日（基金合同生	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31
----	-----------------------------	---

	效日)至 2017 年 12 月 31 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	1,269,162.48	-
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

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:

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数。}$$

7.4.7.2.2 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 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	211,527.07	-

注:支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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:

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数。}$$

7.4.7.2.3 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 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华量化混合 A	平安大华量化混合 C	合计
平安大华	-	149.33	149.33
合计	-	149.33	149.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华量化混合 A	平安大华量化混合 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:

$$\text{C 类基金日销售服务费} = \text{C 类基金前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数。}$$

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	
	2017年1月23日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	平安大华量化混合 A	平安大华量化混合 C
基金合同生效日(2017年1月23日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	985,075.13	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	985,075.13	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.6900%	-

项目	上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日	
	平安大华量化混合 A	平安大华量化混合 C
基金合同生效日(2017年1月23日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.7.4.2 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

本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.7.5 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 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
平安银行-活期存款	20,578,439.80	166,051.79	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.7.6 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发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.7.7 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。

7.4.8 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

7.4.9 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 2017 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 486,552.00 元，无属于第二层次以及第三层次的余额。

(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 2017 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资产。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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	486,552.00	2.30
	其中：股票	486,552.00	2.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,687,530.70	97.67
8	其他各项资产	6,569.08	0.03
9	合计	21,180,651.78	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	486,552.00	2.31
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	486,552.00	2.31

8.2.2 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。

8.3 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	002504	*ST 弘高	77,600	486,552.00	2.31

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	000686	东北证券	9,866,800.37	46.94
2	000600	建投能源	5,651,376.21	26.89
3	601098	中南传媒	5,170,508.52	24.60
4	000625	长安汽车	4,748,026.00	22.59
5	002450	康得新	4,522,203.00	21.51
6	600741	华域汽车	4,213,521.33	20.05
7	000921	海信科龙	4,074,162.32	19.38
8	000651	格力电器	3,891,143.91	18.51
9	601012	隆基股份	3,787,542.92	18.02

10	600068	葛洲坝	3,548,932.00	16.88
11	000776	广发证券	3,458,289.00	16.45
12	600690	青岛海尔	3,359,452.53	15.98
13	601211	国泰君安	3,308,024.41	15.74
14	002100	天康生物	3,256,851.67	15.49
15	000997	新大陆	3,252,443.00	15.47
16	002573	清新环境	3,232,601.71	15.38
17	002597	金禾实业	3,205,008.44	15.25
18	600887	伊利股份	3,141,462.00	14.95
19	600004	白云机场	2,789,512.00	13.27
20	002636	金安国纪	2,760,657.19	13.13
21	600153	建发股份	2,715,623.40	12.92
22	002244	滨江集团	2,714,287.00	12.91
23	600708	光明地产	2,702,167.21	12.86
24	600350	山东高速	2,689,416.00	12.79
25	002736	国信证券	2,611,222.00	12.42
26	600183	生益科技	2,574,429.16	12.25
27	000858	五粮液	2,504,803.57	11.92
28	300017	网宿科技	2,167,189.00	10.31
29	600015	华夏银行	2,057,205.00	9.79
30	600563	法拉电子	2,023,237.90	9.63
31	002236	大华股份	1,920,979.00	9.14
32	603288	海天味业	1,772,108.72	8.43
33	000910	大亚圣象	1,759,871.02	8.37
34	600089	特变电工	1,708,545.00	8.13
35	002202	金风科技	1,684,303.99	8.01
36	601899	紫金矿业	1,674,559.00	7.97
37	600475	华光股份	1,666,340.00	7.93
38	600755	厦门国贸	1,658,352.09	7.89
39	600123	兰花科创	1,628,103.00	7.75
40	000020	深华发A	1,599,577.97	7.61
41	002304	洋河股份	1,536,053.53	7.31
42	601009	南京银行	1,512,322.00	7.19
43	600066	宇通客车	1,495,053.78	7.11
44	000980	众泰汽车	1,478,167.19	7.03
45	601633	长城汽车	1,472,351.06	7.00

46	600886	国投电力	1,462,032.00	6.96
47	600282	南钢股份	1,432,277.00	6.81
48	600104	上汽集团	1,419,545.28	6.75
49	601939	建设银行	1,354,328.00	6.44
50	000650	仁和药业	1,344,427.00	6.40
51	000863	三湘印象	1,321,337.89	6.29
52	002142	宁波银行	1,253,878.91	5.97
53	000540	中天金融	1,231,909.00	5.86
54	000002	万科A	1,231,284.98	5.86
55	601155	新城控股	1,230,430.00	5.85
56	000036	华联控股	1,229,798.10	5.85
57	600743	华远地产	1,224,381.55	5.82
58	600823	世茂股份	1,215,828.00	5.78
59	600048	保利地产	1,212,747.68	5.77
60	600340	华夏幸福	1,212,030.00	5.77
61	002146	荣盛发展	1,209,287.00	5.75
62	000671	阳光城	1,202,839.00	5.72
63	601607	上海医药	1,185,179.78	5.64
64	000732	泰禾集团	1,182,385.11	5.63
65	600196	复星医药	1,166,372.00	5.55
66	600422	昆药集团	1,164,637.00	5.54
67	000999	华润三九	1,162,477.00	5.53
68	002519	银河电子	1,162,341.47	5.53
69	600466	蓝光发展	1,151,841.00	5.48
70	600062	华润双鹤	1,149,749.42	5.47
71	002294	信立泰	1,149,465.50	5.47
72	002437	誉衡药业	1,148,376.37	5.46
73	000423	东阿阿胶	1,141,745.29	5.43
74	600511	国药股份	1,132,091.62	5.39
75	002071	长城影视	1,131,311.00	5.38
76	000719	中原传媒	1,127,683.00	5.36
77	600757	长江传媒	1,127,418.67	5.36
78	600664	哈药股份	1,107,093.00	5.27
79	601600	中国铝业	1,080,270.00	5.14
80	002465	海格通信	1,047,120.00	4.98
81	000839	中信国安	1,031,425.00	4.91

82	300360	炬华科技	1,027,665.00	4.89
83	002179	中航光电	1,023,958.52	4.87
84	002070	*ST 众和	995,158.00	4.73
85	600019	宝钢股份	990,816.00	4.71
86	000826	启迪桑德	989,743.00	4.71
87	002415	海康威视	978,175.72	4.65
88	002466	天齐锂业	966,714.66	4.60
89	000550	江铃汽车	966,703.90	4.60
90	002504	*ST 弘高	963,107.29	4.58
91	600060	海信电器	959,382.00	4.56
92	002601	龙蟠佰利	937,789.00	4.46
93	000059	华锦股份	934,041.00	4.44
94	601186	中国铁建	933,282.00	4.44
95	600299	安迪苏	926,599.44	4.41
96	600585	海螺水泥	917,124.00	4.36
97	600039	四川路桥	915,694.00	4.36
98	002065	东华软件	912,540.72	4.34
99	000055	方大集团	911,836.00	4.34
100	601668	中国建筑	908,008.00	4.32
101	000789	万年青	900,791.00	4.29
102	600850	华东电脑	894,154.68	4.25
103	000932	*ST 华菱	891,811.00	4.24
104	000908	景峰医药	868,919.00	4.13
105	000919	金陵药业	866,255.00	4.12
106	000568	泸州老窖	865,657.00	4.12
107	000100	TCL 集团	855,154.00	4.07
108	002152	广电运通	804,565.00	3.83
109	600525	长园集团	794,691.00	3.78
110	600383	金地集团	784,784.00	3.73
111	601006	大秦铁路	784,473.00	3.73
112	000900	现代投资	782,848.00	3.72
113	000531	穗恒运 A	732,274.91	3.48
114	600674	川投能源	726,279.20	3.46
115	000543	皖能电力	721,844.00	3.43
116	600236	桂冠电力	719,192.00	3.42
117	600760	中航沈飞	710,699.00	3.38

118	000630	铜陵有色	681,676.00	3.24
119	600782	新钢股份	669,204.00	3.18
120	000009	中国宝安	664,515.00	3.16
121	600649	城投控股	658,615.00	3.13
122	000069	华侨城 A	657,720.00	3.13
123	300182	捷成股份	650,604.39	3.10
124	000537	广宇发展	650,060.00	3.09
125	002563	森马服饰	647,671.00	3.08
126	000957	中通客车	644,579.00	3.07
127	600261	阳光照明	643,566.97	3.06
128	002078	太阳纸业	642,937.00	3.06
129	000488	晨鸣纸业	639,544.27	3.04
130	300202	聚龙股份	638,581.00	3.04
131	000598	兴蓉环境	638,321.00	3.04
132	002701	奥瑞金	638,240.00	3.04
133	300287	飞利信	637,802.00	3.03
134	002090	金智科技	630,382.24	3.00
135	601199	江南水务	627,193.00	2.98
136	600168	武汉控股	625,210.00	2.97
137	601231	环旭电子	601,787.16	2.86
138	300033	同花顺	594,427.00	2.83
139	000587	金洲慈航	579,813.92	2.76
140	000060	中金岭南	572,941.00	2.73
141	002497	雅化集团	572,215.00	2.72
142	600398	海澜之家	571,787.00	2.72
143	600177	雅戈尔	565,819.00	2.69
144	600583	海油工程	563,431.90	2.68
145	600703	三安光电	561,260.00	2.67
146	600271	航天信息	553,293.00	2.63
147	600891	秋林集团	548,823.20	2.61
148	601390	中国中铁	545,237.40	2.59
149	600697	欧亚集团	537,378.00	2.56
150	600839	四川长虹	525,962.00	2.50
151	002562	兄弟科技	524,298.00	2.49
152	000501	鄂武商 A	524,138.00	2.49
153	600502	安徽水利	520,518.00	2.48

154	600694	大商股份	519,630.00	2.47
155	603838	四通股份	518,498.00	2.47
156	601636	旗滨集团	517,018.00	2.46
157	600291	西水股份	500,327.00	2.38
158	600362	江西铜业	498,765.31	2.37
159	002458	益生股份	494,280.80	2.35
160	600064	南京高科	487,753.00	2.32
161	601628	中国人寿	483,021.00	2.30
162	600582	天地科技	480,516.00	2.29
163	601601	中国太保	478,500.00	2.28
164	600835	上海机电	458,074.01	2.18
165	000876	新希望	454,512.00	2.16
166	002477	雏鹰农牧	446,180.00	2.12
167	601336	新华保险	445,953.00	2.12
168	600191	华资实业	439,639.00	2.09
169	600894	广日股份	436,109.00	2.07
170	600507	方大特钢	431,755.00	2.05
171	600808	马钢股份	431,012.00	2.05

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	000686	东北证券	9,437,056.22	44.90
2	000600	建投能源	8,534,847.26	40.60
3	601098	中南传媒	4,973,103.08	23.66
4	002450	康得新	4,702,884.21	22.37
5	600741	华域汽车	4,680,725.39	22.27
6	000651	格力电器	4,260,258.64	20.27
7	000625	长安汽车	4,243,575.53	20.19
8	000921	海信科龙	3,883,435.36	18.47
9	600690	青岛海尔	3,800,966.92	18.08
10	002573	清新环境	3,489,830.10	16.60
11	600068	葛洲坝	3,472,041.97	16.52
12	601012	隆基股份	3,427,502.18	16.31
13	000776	广发证券	3,393,869.89	16.15

14	601211	国泰君安	3,374,504.00	16.05
15	000997	新大陆	3,249,980.54	15.46
16	600887	伊利股份	3,248,448.92	15.45
17	002597	金禾实业	3,074,262.50	14.63
18	600153	建发股份	2,902,718.90	13.81
19	002100	天康生物	2,758,951.34	13.13
20	600004	白云机场	2,752,522.95	13.09
21	000858	五粮液	2,722,930.62	12.95
22	002244	滨江集团	2,607,078.56	12.40
23	002736	国信证券	2,478,373.68	11.79
24	600708	光明地产	2,445,764.72	11.64
25	600350	山东高速	2,434,105.00	11.58
26	600183	生益科技	2,349,785.00	11.18
27	002636	金安国纪	2,314,094.30	11.01
28	002236	大华股份	2,098,824.50	9.98
29	600340	华夏幸福	2,025,163.00	9.63
30	600563	法拉电子	1,984,581.08	9.44
31	600015	华夏银行	1,954,625.99	9.30
32	603288	海天味业	1,929,498.50	9.18
33	002146	荣盛发展	1,824,140.00	8.68
34	300017	网宿科技	1,754,786.30	8.35
35	600089	特变电工	1,674,909.20	7.97
36	600475	华光股份	1,674,114.00	7.96
37	600755	厦门国贸	1,660,508.00	7.90
38	000910	大亚圣象	1,656,064.51	7.88
39	600104	上汽集团	1,614,750.00	7.68
40	601899	紫金矿业	1,604,039.77	7.63
41	600123	兰花科创	1,570,299.00	7.47
42	002202	金风科技	1,524,495.00	7.25
43	600886	国投电力	1,506,589.27	7.17
44	002304	洋河股份	1,502,919.45	7.15
45	601633	长城汽车	1,432,277.00	6.81
46	600066	宇通客车	1,423,622.93	6.77
47	601939	建设银行	1,423,556.00	6.77
48	601009	南京银行	1,400,060.80	6.66
49	000020	深华发A	1,337,837.00	6.36
50	600282	南钢股份	1,321,725.65	6.29
51	601607	上海医药	1,320,343.00	6.28

52	600743	华远地产	1,264,733.08	6.02
53	002142	宁波银行	1,257,647.30	5.98
54	600196	复星医药	1,248,456.00	5.94
55	000036	华联控股	1,242,641.00	5.91
56	601155	新城控股	1,234,892.92	5.87
57	000980	众泰汽车	1,218,885.00	5.80
58	000999	华润三九	1,209,501.70	5.75
59	600511	国药股份	1,206,963.00	5.74
60	600048	保利地产	1,190,842.00	5.67
61	000423	东阿阿胶	1,184,073.00	5.63
62	002294	信立泰	1,179,959.18	5.61
63	600062	华润双鹤	1,177,984.00	5.60
64	000650	仁和药业	1,177,127.00	5.60
65	000002	万科A	1,177,095.00	5.60
66	000540	中天金融	1,165,906.00	5.55
67	000863	三湘印象	1,153,146.37	5.49
68	000671	阳光城	1,141,164.00	5.43
69	600823	世茂股份	1,140,127.70	5.42
70	002466	天齐锂业	1,138,213.40	5.41
71	002415	海康威视	1,122,982.00	5.34
72	000732	泰禾集团	1,087,862.35	5.18
73	600757	长江传媒	1,030,300.00	4.90
74	002437	誉衡药业	1,023,290.00	4.87
75	002071	长城影视	1,003,188.85	4.77
76	002465	海格通信	998,958.27	4.75
77	601600	中国铝业	997,066.00	4.74
78	600466	蓝光发展	991,923.00	4.72
79	000719	中原传媒	990,310.14	4.71
80	000568	泸州老窖	986,018.15	4.69
81	600422	昆药集团	979,442.32	4.66
82	002179	中航光电	958,623.17	4.56
83	601668	中国建筑	954,391.57	4.54
84	002601	龙鳞佰利	944,191.00	4.49
85	600019	宝钢股份	941,393.00	4.48
86	002065	东华软件	903,196.82	4.30
87	600585	海螺水泥	901,183.00	4.29
88	601186	中国铁建	889,150.00	4.23
89	002519	银河电子	888,906.12	4.23

90	000826	启迪桑德	884,636.00	4.21
91	300360	炬华科技	872,610.00	4.15
92	000100	TCL 集团	860,278.00	4.09
93	600664	哈药股份	848,066.00	4.03
94	600060	海信电器	839,608.04	3.99
95	601006	大秦铁路	836,383.00	3.98
96	600383	金地集团	836,232.00	3.98
97	600299	安迪苏	827,962.44	3.94
98	600850	华东电脑	816,508.44	3.88
99	000789	万年青	813,545.00	3.87
100	000839	中信国安	807,058.00	3.84
101	000059	华锦股份	797,022.00	3.79
102	000932	*ST 华菱	787,302.00	3.75
103	600039	四川路桥	785,759.88	3.74
104	000919	金陵药业	768,023.00	3.65
105	000908	景峰医药	763,035.95	3.63
106	000550	江铃汽车	747,878.08	3.56
107	000900	现代投资	741,241.00	3.53
108	002152	广电运通	740,767.00	3.52
109	002497	雅化集团	733,891.35	3.49
110	600674	川投能源	723,548.00	3.44
111	000069	华侨城 A	710,374.61	3.38
112	000055	方大集团	703,192.00	3.35
113	600525	长园集团	696,405.00	3.31
114	000531	穗恒运 A	668,423.00	3.18
115	600236	桂冠电力	657,075.00	3.13
116	000543	皖能电力	648,453.65	3.08
117	000537	广宇发展	637,543.00	3.03
118	601231	环旭电子	637,179.00	3.03
119	000598	兴蓉环境	629,853.00	3.00
120	002090	金智科技	620,067.60	2.95
121	300182	捷成股份	619,379.00	2.95
122	000488	晨鸣纸业	619,246.33	2.95
123	002563	森马服饰	615,159.00	2.93
124	600703	三安光电	613,465.00	2.92
125	000630	铜陵有色	595,675.00	2.83
126	002078	太阳纸业	594,822.00	2.83
127	600782	新钢股份	586,012.00	2.79

128	600261	阳光照明	582,649.97	2.77
129	300287	飞利信	570,696.00	2.72
130	600760	中航沈飞	567,685.00	2.70
131	601199	江南水务	561,273.00	2.67
132	600177	雅戈尔	558,837.89	2.66
133	000009	中国宝安	557,792.00	2.65
134	002701	奥瑞金	557,658.60	2.65
135	600649	城投控股	552,609.00	2.63
136	600291	西水股份	550,414.00	2.62
137	600168	武汉控股	548,615.45	2.61
138	000587	金洲慈航	547,179.70	2.60
139	601390	中国中铁	539,537.00	2.57
140	300033	同花顺	537,373.00	2.56
141	300202	聚龙股份	536,637.00	2.55
142	600398	海澜之家	528,681.00	2.52
143	601628	中国人寿	522,162.00	2.48
144	000060	中金岭南	511,094.00	2.43
145	601336	新华保险	510,909.00	2.43
146	600271	航天信息	505,545.00	2.41
147	000957	中通客车	502,099.63	2.39
148	601601	中国太保	501,086.00	2.38
149	002562	兄弟科技	491,308.00	2.34
150	002477	雏鹰农牧	490,921.00	2.34
151	601636	旗滨集团	489,280.00	2.33
152	600583	海油工程	487,317.00	2.32
153	000501	鄂武商 A	485,878.16	2.31
154	600694	大商股份	481,735.18	2.29
155	600839	四川长虹	453,321.00	2.16
156	002070	*ST 众和	452,981.00	2.15
157	000876	新 希 望	451,128.00	2.15
158	600835	上海机电	451,057.00	2.15
159	600507	方大特钢	450,556.00	2.14
160	600697	欧亚集团	445,538.00	2.12
161	600808	马钢股份	440,506.00	2.10
162	600064	南京高科	440,257.46	2.09
163	600502	安徽水利	431,190.38	2.05
164	600891	秋林集团	428,686.19	2.04
165	600362	江西铜业	427,221.00	2.03

166	603838	四通股份	424,058.39	2.02
167	600582	天地科技	423,040.00	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。

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	255,883,641.76
卖出股票收入（成交）总额	250,502,069.00

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。

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。

8.7 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投资。

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。

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。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

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。

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	1,071.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,497.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,569.08

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

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	持有人	户均持有的基	持有人结构
----	-----	--------	-------

级别	户数 (户)	金份额	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
平安大华量化混合 A	15	1,399,038.75	20,984,075.13	99.99%	1,506.18	0.01%
平安大华量化混合 C	186	112.09	0.00	0.00%	20,848.93	100.00%
合计	201	104,509.60	20,984,075.13	99.89%	22,355.11	0.11%

1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	平安大华量化混合 A	499.88	0.0024%
	平安大华量化混合 C	100.01	0.4797%
	合计	599.89	0.0029%

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	平安大华量化混合 A	0
	平安大华量化混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安大华量化混合 A	0
	平安大华量化混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安大华量化混 合 A	平安大华量化混 合 C
基金合同生效日（2017 年 1 月 23 日）基金份 额总额	199,999,098.81	21,800.01
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	998,431.70	5,149.74
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	180,011,949.20	6,100.82
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）	-	-
本报告期末基金份额总额	20,985,581.31	20,848.93

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金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第四次职工代表大会审议通过，由李峥女士接替毛晴峰为第三届监事会职工监事，任职日期为 2017 年 2 月 17 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。

4、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，由巢傲文先生接替张云平为第三届监事会监事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

5、经平安大华基金管理有限公司第三届董事会第二次会议通过，同意选举罗春风先生为第三届董事会董事长；同意聘任肖宇鹏先生为总经理；同意聘任付强先生、林婉文女士、汪涛先生为副总经理；同意聘任陈特正先生为督察长兼董事会秘书，任职日期为 2017 年 7 月 13 日。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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 50,000.00 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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
天风证券	2	122,417,224.46	24.21%	87,075.50	24.11%	-
恒泰证券	4	77,627,990.36	15.35%	56,769.60	15.72%	-
川财证券	1	43,342,732.11	8.57%	30,829.00	8.53%	新增 1 个
中信建投	2	42,752,990.95	8.46%	30,410.16	8.42%	-
兴业证券	1	36,867,824.12	7.29%	26,224.16	7.26%	-
英大证券	1	36,486,758.72	7.22%	25,953.12	7.19%	-
海通证券	2	23,784,457.90	4.70%	16,918.00	4.68%	-
华创证券	2	21,549,242.92	4.26%	15,327.94	4.24%	-
长江证券	1	20,338,531.09	4.02%	14,466.76	4.01%	-
东方证券	1	20,194,407.77	3.99%	14,364.31	3.98%	-
华泰证券	2	15,017,421.14	2.97%	10,682.47	2.96%	-
安信证券	2	13,356,410.62	2.64%	9,500.60	2.63%	-
方正证券	2	10,495,538.54	2.08%	7,465.41	2.07%	-
中泰证券	1	9,177,134.26	1.82%	6,527.72	1.81%	-

西南证券	1	5,381,863.06	1.06%	3,828.21	1.06%	-
华林证券	2	2,691,797.92	0.53%	1,914.51	0.53%	-
东北证券	5	2,468,393.53	0.49%	1,755.85	0.49%	新增 2 个
东兴证券	2	1,234,514.50	0.24%	878.09	0.24%	-
广发证券	2	240,609.04	0.05%	219.27	0.06%	-
国联证券	2	95,870.80	0.02%	68.18	0.02%	-
光大证券	2	43,838.10	0.01%	31.18	0.01%	-
财富证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中银国际	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
渤海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	新增 4 个
联讯证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
国信证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
开源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	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。

3、本基金本报告期内停止租用交易单元：广发证券（深圳 1 个）。

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
天风证券	-	-	507,500,000.00	12.58%	-	-
恒泰证券	-	-	527,000,000.00	13.06%	-	-
川财证券	-	-	321,000,000.00	7.96%	-	-
中信建投	-	-	429,200,000.00	10.64%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	70,000,000.00	1.74%	-	-
华创证券	-	-	323,000,000.00	8.01%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	198,500,000.00	4.92%	-	-
华泰证券	-	-	124,000,000.00	3.07%	-	-
安信证券	-	-	68,600,000.00	1.70%	-	-
方正证券	-	-	498,800,000.00	12.37%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	196,500,000.00	4.87%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	239,000,000.00	5.93%	-	-
光大证券	-	-	103,500,000.00	2.57%	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	329,000,000.00	8.16%	-	-
华福证券	-	-	34,100,000.00	0.85%	-	-

开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	64,000,000.00	1.59%	-	-

平安大华基金管理有限公司
2018 年 3 月 29 日