平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2017 年 5 月 17 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	平安大华股息精选沪港深	
场内简称	-	
基金主代码	004403	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 5 月 17 日	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	30,201,722.37 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：	平安大华股息精选沪港深 A	平安大华股息精选沪港深 C
下属分级基金的场内简称：	-	-
下属分级基金的交易代码：	004403	004404
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	27,004,247.23 份	3,197,475.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过股息价值策略构建股票组合，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量、定性相结合的方法分析宏观经济、财政及货币政策、资金供需情况等因素综合分析以及对资本市场发展趋势的判断，在评价未来一段时间各类的预期风险收益率、相关性的基础上，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，并将重点关注债券资产的收益率。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%＋恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×35%+中证综合债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	王永民

	联系电话	0755-22626828	010-66594896
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

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 5 月 17 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日		2016 年		2015 年	
	平安大华股息精选沪港深 A	平安大华股息精选沪港深 C	平安大华股息精选沪港深 A	平安大华股息精选沪港深 C	平安大华股息精选沪港深 A	平安大华股息精选沪港深 C
本期已实现收益	5,777,169.21	691,354.27	-	-	-	-
本期利润	7,805,375.14	1,504,799.49	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0844	0.0594	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	9.75%	8.70%	-	-	-	-
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	0.0975	0.0870	-	-	-	-
期末基金资产净值	29,637,313.66	3,475,587.64	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0975	1.0870	-	-	-	-

注：1.本基金基金合同于 2017 年 5 月 17 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

平安大华股息精选沪港深 A

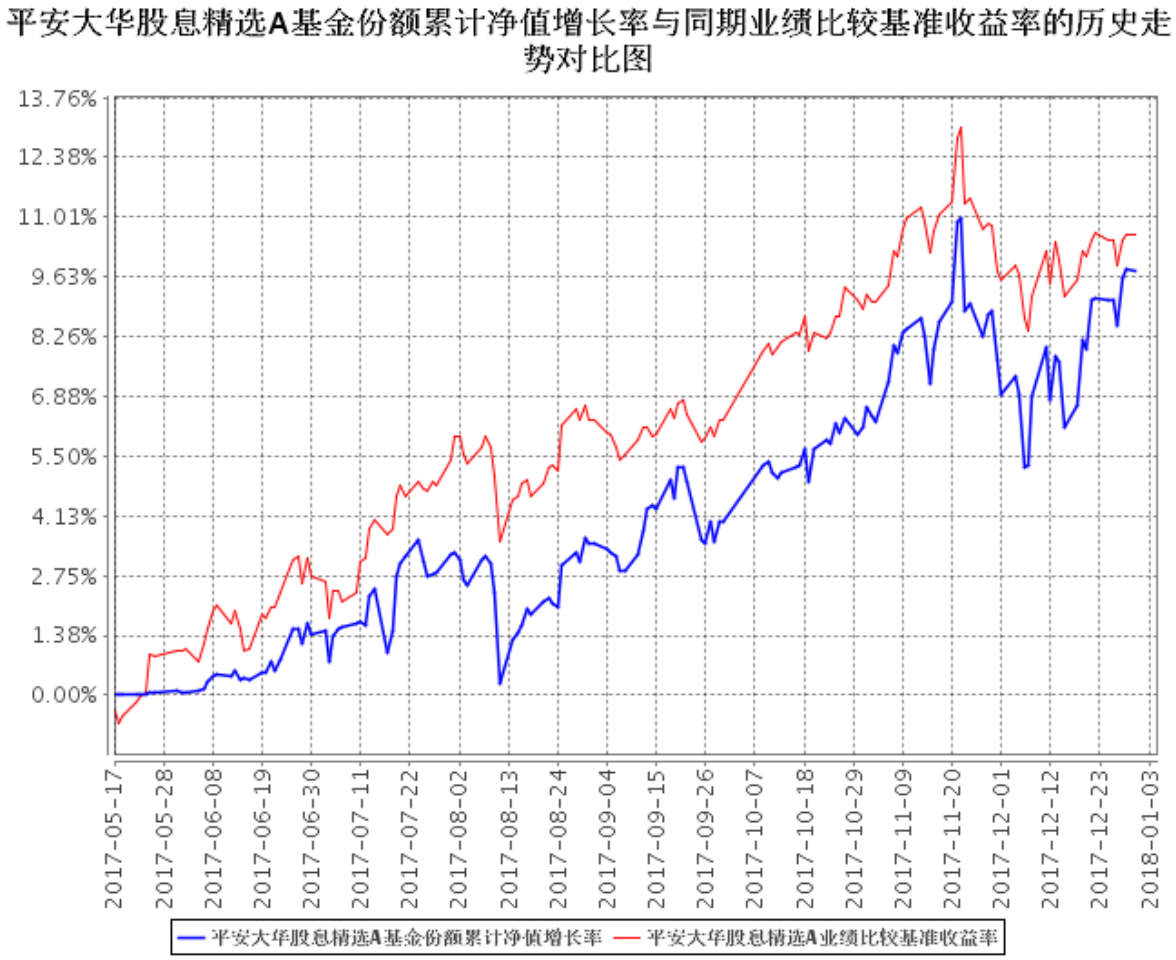
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.52%	0.72%	4.05%	0.53%	1.47%	0.19%
过去六个月	8.26%	0.62%	7.67%	0.47%	0.59%	0.15%
自基金合同生效起至今	9.75%	0.56%	10.62%	0.45%	-0.87%	0.11%

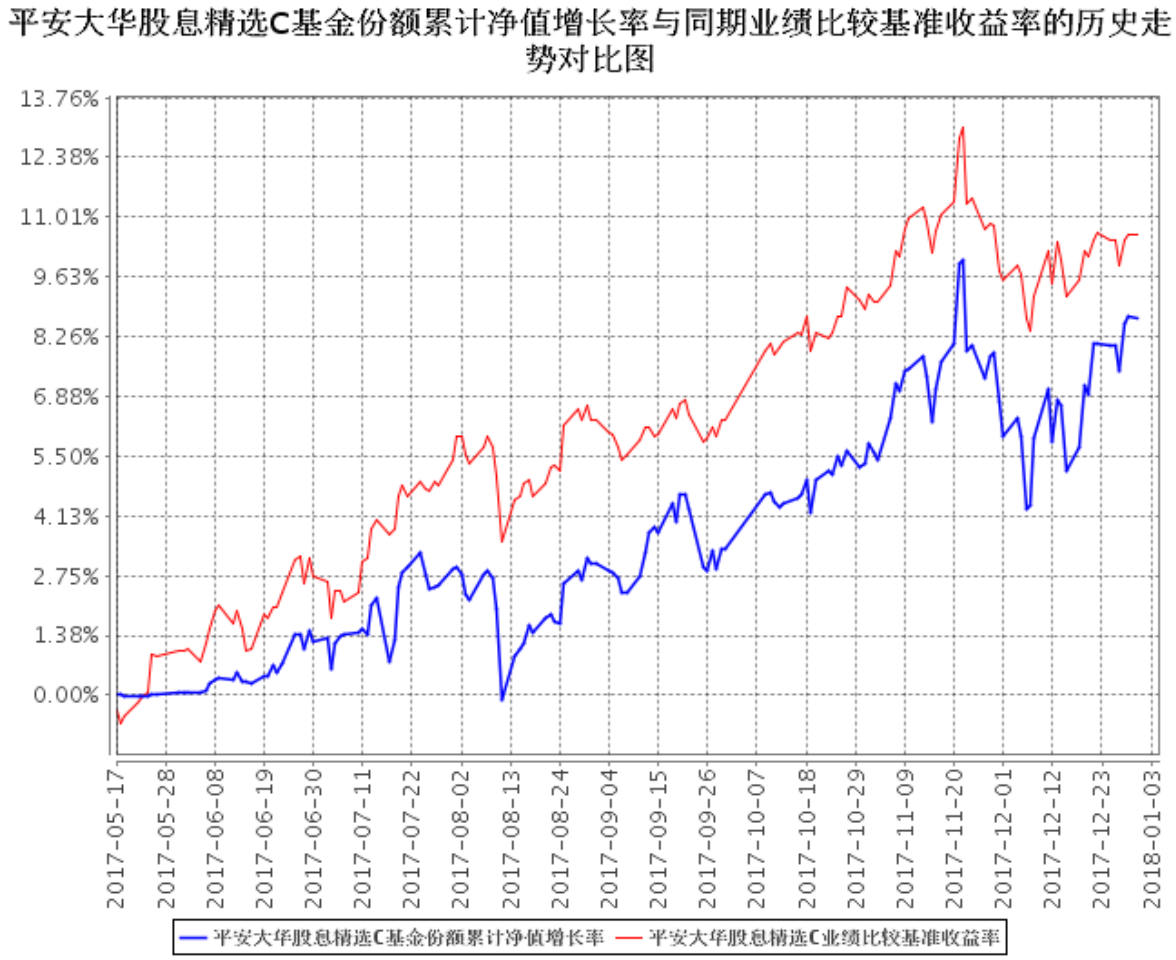
平安大华股息精选沪港深 C

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	5.17%	0.72%	4.05%	0.53%	1.12%	0.19%
过去六个月	7.39%	0.62%	7.67%	0.47%	-0.28%	0.15%
自基金合同生效起至今	8.70%	0.56%	10.62%	0.45%	-1.92%	0.11%

注：1、业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*35%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*35%+中证综合债券指数收益率*30%。其中，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综合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、短期融资券以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基准。恒生指数时香港最早的股票市场指数之一，作为香港蓝筹股指数，恒生指数度量并反映市值最大及成交最活跃的香港上市公司表现。本基金为普通股票型基金，通常状况下基金在运作过程中股票资产将在 80%-95%范围内调整。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准的权重分别是 70%和 30%。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

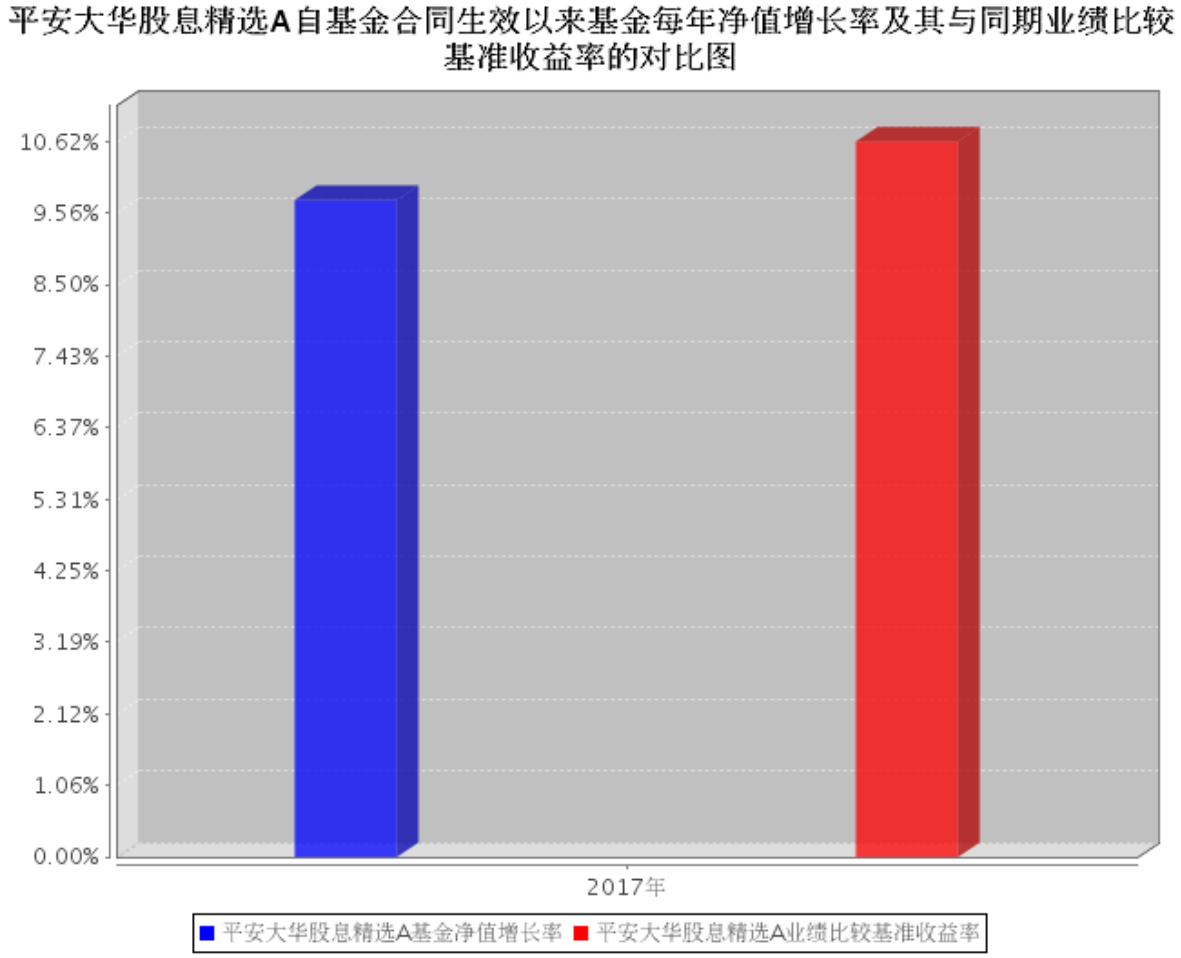

平安大华股息精选A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
13.76%
12.38%
11.01%
9.63%
8.26%
6.88%
5.50%
4.13%
2.75%
1.38%
0.00%
2017-05-17
2017-05-28
2017-06-08
2017-06-19
2017-06-30
2017-07-11
2017-07-22
2017-08-02
2017-08-13
2017-08-24
2017-09-04
2017-09-15
2017-09-26
2017-10-07
2017-10-18
2017-10-29
2017-11-09
2017-11-20
2017-12-01
2017-12-12
2017-12-23
2018-01-03
平安大华股息精选A基金份额累计净值增长率
平安大华股息精选A业绩比较基准收益率

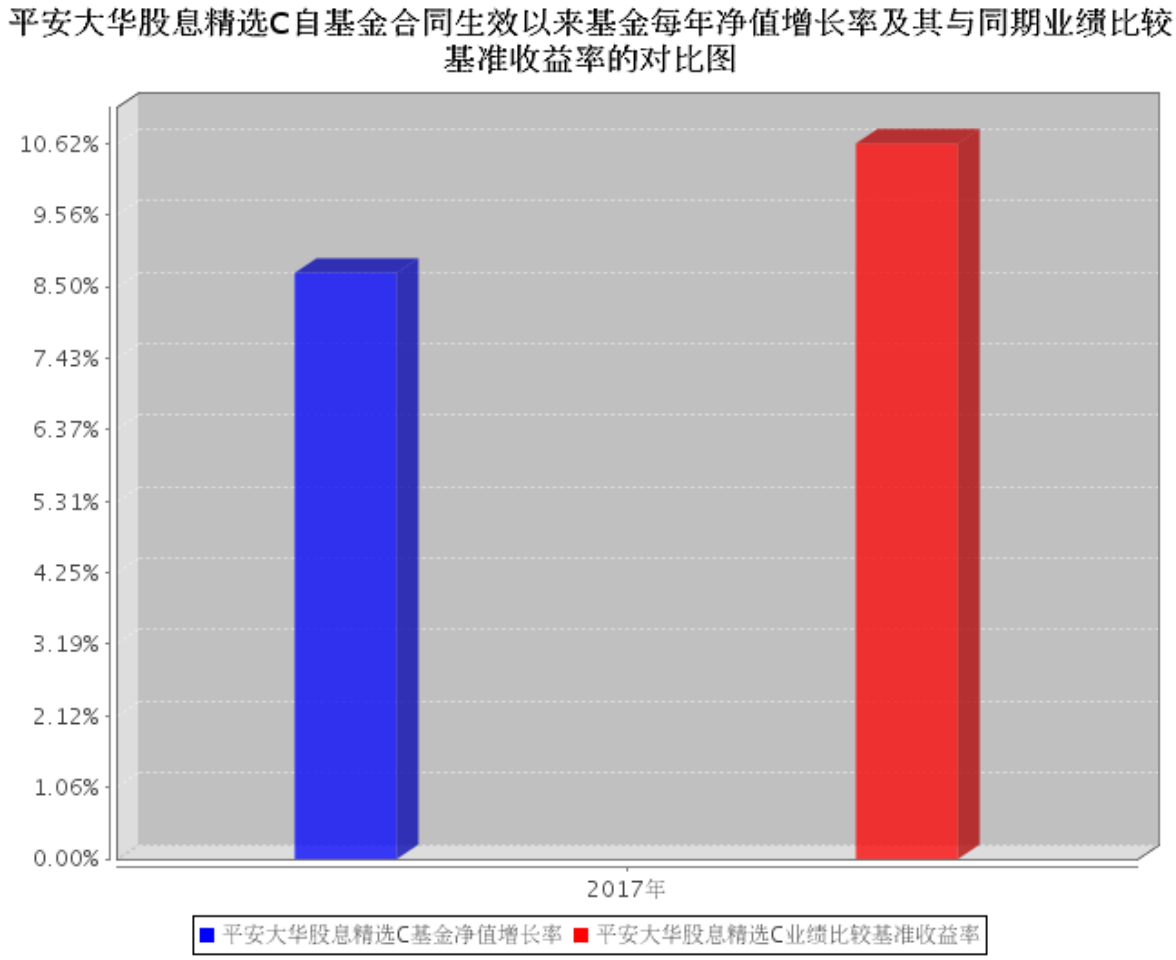


1、本基金基金合同于 2017 年 5 月 17 日正式生效，截至报告期末未满一年；

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





1. 本基金合同于 2017 年 5 月 17 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

本基金基金合同于 2017 年 5 月 17 日正式生效，截止报告期末本基金未进行利润分配。

§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，不断丰富的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		
施旭	平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理	2017 年 5 月 17 日	-	7	施旭先生，哥伦比亚大学金融数学硕士，曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券，于 2015 年加入平安大华基金，任衍生品投资中心量化研究员，现任平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《平安大华股息精选沪港深股票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

回顾 2017 年，A 股市场整体稳步上涨，在政府监管加强的环境下，市场风格逐步转变，价值投资理念逐步被市场认同。食品饮料、家电为代表的白马蓝筹股出现了结构性的牛市行情，海外资金、机构资金等都逐步的进入 A 股市场，为市场注入了流动性。并且在机构投资者的影响下，大盘蓝筹估值有所修复，中小板、创业板风险有一定释放。回顾港股全年呈现上涨行情，在盈利和估值双升的带动下，涨幅领先全球股市，赚钱效应明显。整体港股活跃度有所提升，内地投资者明显增加，为港股注入了新的流动性。从全球来看，港股仍然具有估值优势。报告期内，本基金坚持以价值投资为主线，把握细分行业龙头业绩增长和估值重构等机会，精选具有高股息属性的上市公司，把握住了市场的主体机会，总体净值保持了平稳增长。本基金根据对市场投资逻辑的判断，坚持以价值投资为主线，把握细分行业龙头业绩增长和估值重构等机会，精选具有高股息属性的上市公司，把握住了市场的主体机会，总体净值保持了平稳增长。

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股息精选 A 基金份额净值为 1.0975 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.75%；截至本报告期末平安大华股息精选 C 基金份额净值为 1.0870 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.70%；同期业绩比较基准收益率为 10.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 18 年 A 股市场，当前我国经济基本面韧性较强，预期部分行业盈利有望持续改善；短期来看，市场还不具备条件进行全面的风格切换，核心线索依然在金融地产板块的估值修复逻辑和通胀链的景气上升预期。站在中期角度，在目前政府防范金融风险的大前提下，市场监管难以放松，中小股票外延式业绩扩张受到影响，同时在市场利率难以放松下行的大环境下，预计市场流动性将进一步流向有确定性业绩和符合国家未来产业方向的核心优质个股，行业龙头股将获得持续性的估值溢价。长期看，投资者结构也逐步向以机构投资者为主导的市场转变，企业的盈利质量和治理水平将越发重要。在目前强监管及机构投资者主导市场的大环境下，我们认为市场将延续结构性行情。展望港股 2018 年，市场依旧处在一个估值上修，企业盈利改善的行情中，依然看好其投资价值。相对 A 股，港股依然具有一定的估值优势，且有大量稀缺性的优质行业龙头公司，将对港股股指上行带来正面影响。港股行情未来有望继续保持以基本面驱动、中国核心资产崛起为主线的全球资金配置逻辑。因此，本基金将积极把握沪港深两地投资机会，争取获得超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部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 10 月 31 日至 2017 年 12 月 29 日，已出现连续 44 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。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金（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。

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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 22933 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	平安大华股息精选沪港深股票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股息精选沪港深基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 5 月 17 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	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。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安大华股息精选沪港深基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	–
其他事项	–
其他信息	–
管理层和治理层对财务报表的责任	平安大华股息精选沪港深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”）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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安大华股息精选沪港深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股息精选沪港深基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督平安大华股息精选沪港深基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (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。 （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。 （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。 （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，就可能导致对平安大华股息精选沪港深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。然而未来的事项或情况可能导致平安大华股息精选沪港深基金不能持续经营。 （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。 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。	
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：平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金

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	上年度末

		2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		2,038,446.83	-
结算备付金		1,111,823.64	-
存出保证金		24,909.70	-
交易性金融资产		30,518,174.73	-
其中：股票投资		30,518,174.73	-
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		493.72	-
应收股利		-	-
应收申购款		800.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		33,694,648.62	-
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		3.90	-
应付赎回款		310,740.10	-
应付管理人报酬		42,822.23	-
应付托管费		7,137.02	-
应付销售服务费		2,459.12	-
应付交易费用		117,913.08	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		100,671.87	-
负债合计		581,747.32	-
所有者权益：			
实收基金		30,201,722.37	-
未分配利润		2,911,178.93	-
所有者权益合计		33,112,901.30	-

负债和所有者权益总计		33,694,648.62	-

注：（1）报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 30,201,722.37 份，其中下属 A 类基金份额 27,004,247.23 份，C 类基金份额 3,197,475.14 份。下属 A 类基金份额净值 1.0975 元，C 类基金份额净值 1.0870 元。

（2）本基金合同于 2017 年 5 月 17 日生效，实际报告期间为 2017 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日，因此无需披露比较数据。

7.2 利润表

会计主体：平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 5 月 17 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 5 月 17 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		11,439,686.57	-
1.利息收入		1,056,130.34	-
其中：存款利息收入		131,373.89	-
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		924,756.45	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,974,669.99	-
其中：股票投资收益		5,423,451.39	-
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		-	-
股利收益		1,551,218.60	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		2,841,651.15	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		567,235.09	-
减：二、费用		2,129,511.94	-
1．管理人报酬	7.4.8.2.1	1,127,614.73	-
2．托管费	7.4.8.2.2	187,935.77	-
3．销售服务费	7.4.8.2.3	129,127.15	-

4．交易费用		513,930.60	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用		170,903.69	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,310,174.63	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,310,174.63	-

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 5 月 17 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 5 月 17 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）	301,436,789.32	-	301,436,789.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	9,310,174.63	9,310,174.63
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）	-271,235,066.95	-6,398,995.70	-277,634,062.65
其中：1.基金申购款	1,473,943.81	63,247.03	1,537,190.84
2.基金赎回款	-272,709,010.76	-6,462,242.73	-279,171,253.49
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）	30,201,722.37	2,911,178.93	33,112,901.30
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	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金(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]2506 号《关于准予平安大华股息精选沪港深股票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《平安大华股息精选沪港深股票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 301,260,380.30 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 319 号 验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 301,436,789.32 份基金份额，其中认购资金利息折合 176,409.02 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，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发

行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、港股通标的股票、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等)，债券资产(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)，资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)，现金资产等货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%，其中投资于国内依法发行上市的股票比例为基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票比例为基金资产的 0-95%；投资于股息主题相关的证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的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×35%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算) ×35%+中证综合债券指数收益率×30%。

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》、《平安大华股息精选沪港深股票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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 5 月 17 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 5 月 17 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳

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
中国银行	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、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
上海陆金所基金销售有限公司(“陆金所”)	基金管理人最终控股母公司的联营公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 5 月 17 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	
	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	98,049,522.94	27.41%	-	-

7.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期内未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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 5 月 17 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	
	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

平安证券	986,700,000.00	17.58%	-	-

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权证交易。

7.4.7.1.5 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5月17日(基金合同生效日)至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
平安证券	56,143.07	21.53%	22,815.31	23.37%
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 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.7.2 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 5 月 17 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,127,614.73	-
其中：支付销售机构的客户维护费	358,643.01	-

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 5 月 17 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
当期发生的基金应支付的托管费	187,935.77	-

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：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%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 5 月 17 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		
	平安大华股息精选沪港深 A	平安大华股息精选沪港深 C	合计
平安大华基金管理有限公司	-	29.48	29.48
平安证券	-	237.03	237.03
陆金所	-	68.38	68.38
中国银行	-	7,375.88	7,375.88
合计	-	7,710.77	7,710.77
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		
	平安大华股息精选沪港深 A	平安大华股息精选沪港深 C	合计

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

C 类基金日销售服务费＝C 类基金前一日基金资产净值 X 0.80%/ 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固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期内未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.7.5 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 5 月 17 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
中国银行-活期	2,038,446.83	88,198.44	-	-

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

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
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大事项	7.35	-	-	73,900	504,737.00	543,165.00	-
600664	哈药股份	2017 年 9 月 28 日	重大事项	6.11	2018 年 2 月 27 日	6.00	10,900	63,002.00	66,599.00	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.8.3 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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
合计				-	-

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 29,908,410.73 元，属于第二层次的余额为 609,764.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于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	30,518,174.73	90.57
	其中：股票	30,518,174.73	90.57
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	3,150,270.47	9.35
8	其他各项资产	26,203.42	0.08
9	合计	33,694,648.62	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	492,689.17	1.49
C	制造业	5,524,963.71	16.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	427,166.00	1.29
E	建筑业	826,285.00	2.50
F	批发和零售业	326,712.00	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	226,480.00	0.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	478,608.00	1.45
J	金融业	4,018,021.00	12.13
K	房地产业	1,304,705.00	3.94
L	租赁和商务服务业	222,464.00	0.67
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	13,848,093.88	41.82

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	522,234.77	1.58
B 消费者非必需品	6,069,977.18	18.33
C 消费者常用品	-	-
D 能源	1,312,395.42	3.96
E 金融	710,456.63	2.15
F 医疗保健	601,537.55	1.82
G 工业	679,176.88	2.05
H 信息技术	3,751,831.57	11.33
I 电信服务	823,613.77	2.49
J 公用事业	459,683.63	1.39
K 房地产	1,739,173.45	5.25
合计	16,670,080.85	50.34

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	00700	腾讯控股	6,700	2,273,842.38	6.87
2	00868	信义玻璃	240,000	2,042,295.31	6.17
3	00019	太古股份公司 A	22,500	1,360,756.99	4.11
4	00386	中国石油化工股份	274,000	1,312,395.42	3.96
5	01999	敏华控股	118,000	732,875.73	2.21
6	00425	敏实集团	18,000	709,436.82	2.14
7	601398	工商银行	108,300	671,460.00	2.03
8	600036	招商银行	22,600	655,852.00	1.98
9	02018	瑞声科技	5,500	640,892.20	1.94
10	601288	农业银行	164,800	631,184.00	1.91

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	00700	腾讯控股	4,989,766.73	15.07
2	000919	金陵药业	4,388,567.02	13.25
3	600660	福耀玻璃	4,313,465.12	13.03
4	00019	太古股份公司Ａ	3,907,922.96	11.80
5	000895	双汇发展	3,728,966.82	11.26
6	00386	中国石油化工股份	3,720,574.53	11.24
7	601398	工商银行	3,309,631.00	9.99
8	00868	信义玻璃	2,516,254.04	7.60
9	002242	九阳股份	2,242,694.64	6.77
10	603000	人民网	2,009,123.78	6.07
11	00303	VTECH HOLDINGS	1,964,166.60	5.93
12	601009	南京银行	1,888,488.00	5.70
13	00836	华润电力	1,872,277.39	5.65
14	601688	华泰证券	1,857,841.00	5.61
15	00811	新华文轩	1,812,497.04	5.47
16	600018	上港集团	1,801,311.00	5.44
17	01071	华电国际电力股份	1,778,367.49	5.37
18	02380	中国电力	1,772,653.09	5.35
19	601877	正泰电器	1,688,218.10	5.10
20	600859	王府井	1,663,129.60	5.02
21	000651	格力电器	1,575,549.00	4.76
22	600028	中国石化	1,554,032.00	4.69
23	600987	航民股份	1,541,533.99	4.66
24	600563	法拉电子	1,537,410.40	4.64
25	002304	洋河股份	1,522,947.40	4.60
26	600048	保利地产	1,498,384.00	4.53
27	600036	招商银行	1,478,109.00	4.46
28	01999	敏华控股	1,478,016.40	4.46
29	000876	新 希 望	1,471,564.00	4.44
30	002294	信立泰	1,372,440.03	4.14
31	002146	荣盛发展	1,351,231.98	4.08
32	600009	上海机场	1,335,851.88	4.03
33	601288	农业银行	1,327,542.00	4.01
34	601211	国泰君安	1,303,497.00	3.94
35	600023	浙能电力	1,298,868.00	3.92

36	00992	联想集团	1,277,197.46	3.86
37	00002	中电控股	1,274,558.38	3.85
38	00941	中国移动	1,273,263.86	3.85
39	002311	海大集团	1,270,721.58	3.84
40	00552	中国通信服务	1,246,524.40	3.76
41	000488	晨鸣纸业	1,228,892.00	3.71
42	02038	富智康集团	1,212,193.26	3.66
43	601668	中国建筑	1,211,811.12	3.66
44	000002	万　科Ａ	1,210,135.00	3.65
45	00008	电讯盈科	1,196,115.41	3.61
46	600020	中原高速	1,195,968.00	3.61
47	00315	数码通电讯	1,191,157.44	3.60
48	002508	老板电器	1,185,786.44	3.58
49	002714	牧原股份	1,181,717.10	3.57
50	600583	海油工程	1,173,810.00	3.54
51	002662	京威股份	1,172,456.00	3.54
52	600029	南方航空	1,158,930.00	3.50
53	02333	长城汽车	1,150,161.13	3.47
54	600064	南京高科	1,130,816.00	3.42
55	600585	海螺水泥	1,117,953.53	3.38
56	600900	长江电力	1,103,591.00	3.33
57	600816	安信信托	1,101,599.40	3.33
58	601199	江南水务	1,098,342.00	3.32
59	00425	敏实集团	1,095,916.72	3.31
60	300146	汤臣倍健	1,058,770.62	3.20
61	00165	中国光大控股	1,049,249.95	3.17
62	603001	奥康国际	1,016,552.50	3.07
63	601098	中南传媒	1,004,308.66	3.03
64	601601	中国太保	986,450.00	2.98
65	600750	江中药业	985,814.00	2.98
66	600271	航天信息	977,221.00	2.95
67	601678	滨化股份	971,329.23	2.93
68	600114	东睦股份	956,406.00	2.89
69	300124	汇川技术	952,429.62	2.88
70	600019	宝钢股份	949,538.00	2.87
71	600015	华夏银行	947,376.00	2.86

72	002701	奥瑞金	942,402.02	2.85
73	00270	粤海投资	935,837.45	2.83
74	600012	皖通高速	911,978.66	2.75
75	00001	长和	902,265.27	2.72
76	02018	瑞声科技	886,786.29	2.68
77	02020	安踏体育	877,133.95	2.65
78	600741	华域汽车	865,376.00	2.61
79	000157	中联重科	849,632.00	2.57
80	002007	华兰生物	830,203.00	2.51
81	600177	雅戈尔	827,496.00	2.50
82	601006	大秦铁路	826,306.00	2.50
83	601186	中国铁建	824,576.00	2.49
84	600030	中信证券	817,253.00	2.47
85	600153	建发股份	815,216.90	2.46
86	000402	金 融 街	809,461.00	2.44
87	00914	海螺水泥	804,989.50	2.43
88	002008	大族激光	804,636.34	2.43
89	600703	三安光电	795,662.54	2.40
90	00308	香港中旅	788,166.48	2.38
91	601328	交通银行	785,692.00	2.37
92	000761	本钢板材	782,843.00	2.36
93	000333	美的集团	777,434.67	2.35
94	002649	博彦科技	764,432.00	2.31
95	00688	中国海外发展	758,950.61	2.29
96	002050	三花智控	749,848.96	2.26
97	600089	特变电工	748,951.00	2.26
98	600642	申能股份	745,365.00	2.25
99	000625	长安汽车	742,782.00	2.24
100	002643	万润股份	727,225.00	2.20
101	002518	科士达	718,027.00	2.17
102	00696	中国民航信息网络	713,930.14	2.16
103	002454	松芝股份	712,377.00	2.15
104	002191	劲嘉股份	709,507.38	2.14
105	600688	上海石化	703,027.88	2.12
106	600606	绿地控股	694,868.00	2.10
107	600369	西南证券	681,902.00	2.06

108	600755	厦门国贸	678,086.00	2.05
109	601998	中信银行	675,792.00	2.04
110	300039	上海凯宝	663,555.71	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。

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	600660	福耀玻璃	4,436,061.79	13.40
2	000919	金陵药业	4,288,508.30	12.95
3	00700	腾讯控股	4,121,495.48	12.45
4	000895	双汇发展	3,826,143.21	11.55
5	601398	工商银行	2,822,447.00	8.52
6	00019	太古股份公司Ａ	2,333,673.04	7.05
7	002242	九阳股份	2,293,497.00	6.93
8	603000	人民网	2,110,333.99	6.37
9	00386	中国石油化工股份	2,027,470.88	6.12
10	601688	华泰证券	1,966,443.00	5.94
11	601009	南京银行	1,891,390.60	5.71
12	600018	上港集团	1,844,661.00	5.57
13	600859	王府井	1,834,894.30	5.54
14	601877	正泰电器	1,823,512.84	5.51
15	002714	牧原股份	1,789,742.33	5.40
16	002304	洋河股份	1,776,657.20	5.37
17	600048	保利地产	1,718,616.56	5.19
18	00836	华润电力	1,708,155.86	5.16
19	00811	新华文轩	1,672,260.41	5.05
20	000488	晨鸣纸业	1,624,929.00	4.91
21	600987	航民股份	1,608,076.00	4.86
22	600563	法拉电子	1,568,156.50	4.74
23	02380	中国电力	1,561,967.06	4.72
24	01071	华电国际电力股份	1,526,490.97	4.61
25	000876	新 希 望	1,505,270.00	4.55
26	002294	信立泰	1,435,302.00	4.33
27	00303	VTECH HOLDINGS	1,402,993.20	4.24
28	000651	格力电器	1,351,353.00	4.08
29	600816	安信信托	1,350,860.12	4.08

30	002146	荣盛发展	1,341,153.00	4.05
31	002311	海大集团	1,340,563.00	4.05
32	600020	中原高速	1,314,381.00	3.97
33	600009	上海机场	1,304,857.46	3.94
34	600023	浙能电力	1,270,047.00	3.84
35	600585	海螺水泥	1,262,146.00	3.81
36	300146	汤臣倍健	1,233,363.00	3.72
37	601678	滨化股份	1,180,021.20	3.56
38	002662	京威股份	1,147,818.00	3.47
39	600064	南京高科	1,142,250.10	3.45
40	600583	海油工程	1,140,138.00	3.44
41	00941	中国移动	1,112,881.62	3.36
42	002508	老板电器	1,109,652.00	3.35
43	600028	中国石化	1,099,242.00	3.32
44	000002	万　科Ａ	1,088,085.00	3.29
45	00315	数码通电讯	1,069,415.47	3.23
46	600271	航天信息	1,065,078.00	3.22
47	601199	江南水务	1,044,930.00	3.16
48	00992	联想集团	1,044,872.36	3.16
49	600029	南方航空	1,035,021.53	3.13
50	300124	汇川技术	1,023,472.00	3.09
51	600750	江中药业	992,120.98	3.00
52	600015	华夏银行	971,511.00	2.93
53	603001	奥康国际	968,089.21	2.92
54	00868	信义玻璃	963,906.92	2.91
55	601211	国泰君安	962,177.00	2.91
56	600114	东睦股份	955,630.72	2.89
57	000761	本钢板材	915,533.87	2.76
58	600012	皖通高速	914,298.98	2.76
59	600036	招商银行	914,104.00	2.76
60	00002	中电控股	909,157.20	2.75
61	601098	中南传媒	902,585.80	2.73
62	002701	奥瑞金	898,378.00	2.71
63	601006	大秦铁路	859,032.00	2.59
64	600755	厦门国贸	853,645.00	2.58
65	002008	大族激光	848,978.00	2.56
66	601186	中国铁建	840,212.00	2.54
67	002007	华兰生物	839,499.00	2.54

68	002050	三花智控	836,823.00	2.53
69	601668	中国建筑	836,748.00	2.53
70	002518	科士达	832,323.45	2.51
71	000402	金 融 街	830,896.97	2.51
72	600703	三安光电	814,112.00	2.46
73	00552	中国通信服务	813,698.71	2.46
74	600177	雅戈尔	813,410.00	2.46
75	601328	交通银行	793,374.00	2.40
76	02333	长城汽车	773,010.55	2.33
77	01999	敏华控股	770,702.07	2.33
78	00008	电讯盈科	744,577.29	2.25
79	002191	劲嘉股份	735,414.00	2.22
80	600089	特变电工	733,519.56	2.22
81	601288	农业银行	725,799.00	2.19
82	002454	松芝股份	721,502.00	2.18
83	600642	申能股份	715,812.00	2.16
84	000625	长安汽车	714,419.00	2.16
85	02038	富智康集团	708,056.08	2.14
86	600019	宝钢股份	705,918.00	2.13
87	00270	粤海投资	699,956.78	2.11
88	00425	敏实集团	699,358.72	2.11
89	600900	长江电力	696,486.00	2.10
90	601998	中信银行	694,314.00	2.10
91	600606	绿地控股	689,981.00	2.08
92	600369	西南证券	688,729.00	2.08
93	002649	博彦科技	687,372.00	2.08
94	600741	华域汽车	677,253.00	2.05
95	002643	万润股份	663,672.00	2.00

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	189,967,837.72
卖出股票收入（成交）总额	167,714,765.53

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

本报告期末本基金未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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	24,909.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	493.72
5	应收申购款	800.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,203.42

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
平安大华股息精选沪港深A	466	57,949.03	1,041,724.85	3.86%	25,962,522.38	96.14%
平安大华股息精选	165	19,378.64	0.00	0.00%	3,197,475.14	100.00%

沪港深 C						
合计	621	48,634.01	1,041,724.85	3.45%	29,159,997.52	96.55%

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）。

9.3 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	平安大华股息精选沪港深 A	2,497.79	0.0092%
	平安大华股息精选沪港深 C	0.00	0.0000%
	合计	2,497.79	0.0083%

9.4 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	平安大华股息精选沪港深 A	0
	平安大华股息精选沪港深 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安大华股息精选沪港深 A	0
	平安大华股息精选沪港深 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安大华股息精选沪港深 A	平安大华股息精选沪港深 C
基金合同生效日（2017 年 5 月 17 日）基金份额总额	191,878,691.19	109,558,098.13
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	894,827.87	579,115.94

减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	165,769,271.83	106,939,738.93
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	27,004,247.23	3,197,475.14

§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先生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。

6、2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按照相关规定备案、公告。

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核或处罚等情况。

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽核或处罚等情况。

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	
平安证券	2	98,049,522.94	27.41%	56,143.07	21.53%	-
兴业证券	2	66,838,754.97	18.69%	47,965.18	18.40%	-
民生证券	2	59,985,145.57	16.77%	43,867.92	16.82%	-
银河证券	2	23,142,469.76	6.47%	21,552.57	8.27%	-
国金证券	1	15,730,140.49	4.40%	14,649.44	5.62%	-
广发证券	1	13,767,437.54	3.85%	12,821.80	4.92%	-
华泰证券	1	13,293,979.18	3.72%	9,456.19	3.63%	-
国泰君安	2	11,758,576.14	3.29%	8,363.66	3.21%	新增 2 个
招商证券	2	11,507,336.16	3.22%	10,716.71	4.11%	-
中信证券	2	11,502,833.75	3.22%	10,712.85	4.11%	-
西藏东方财富	2	5,924,620.38	1.66%	4,214.20	1.62%	新增 2 个
西南证券	1	5,423,913.35	1.52%	3,858.12	1.48%	-
安信证券	2	5,330,087.22	1.49%	3,897.88	1.49%	-
长江证券	1	3,625,247.00	1.01%	3,376.16	1.29%	-
中金公司	2	3,240,799.65	0.91%	3,018.15	1.16%	-
中泰证券	1	2,814,120.00	0.79%	2,001.73	0.77%	-
中银国际	1	2,554,479.15	0.71%	1,817.11	0.70%	-
东方证券	2	1,580,042.00	0.44%	1,155.50	0.44%	-
华信证券	2	1,106,086.00	0.31%	786.74	0.30%	新增 2 个
南京证券	1	507,012.00	0.14%	360.64	0.14%	新增 1 个

长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
申万证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
方正证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

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。

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
平安证券	-	-	986,700,000.00	17.58%	-	-
兴业证券	-	-	1,313,100,000.00	23.39%	-	-
民生证券	-	-	774,700,000.00	13.80%	-	-
银河证券	-	-	1,034,200,000.00	18.42%	-	-
国金证券	-	-	674,700,000.00	12.02%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	625,000,000.00	11.13%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	205,000,000.00	3.65%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20171025-20171030	0.00	10,005,300.00	10,005,300.00	0.00	0.00%
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份							

额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

平安大华基金管理有限公司

2018 年 3 月 29 日