

平安大华鼎信债券型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告

2018 年 3 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

报告送出日期：2018 年 4 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金本报告期自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 23 日止，平安大华鼎信债券型证券投资基金本报告期自 2018 年 3 月 24 日至 2018 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

转型后：

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 平安大华鼎信债券 |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 002988 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式。 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 3 月 24 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 500,028,970.32 份 |
| 投资目标 | 在谨慎投资的前提下，力争战胜业绩比较基准，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。 |
| 投资策略 | 转型为“平安大华鼎信债券型证券投资基金”后，本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率（税后）+1.5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险均高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。 |
| 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 |

备注：本基金转型日期为 2018 年 3 月 24 日，该日起平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金转型为平安大华鼎信债券型证券投资基金，此处的基金份额日期为 2018 年 3 月 31 日。

转型前：

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 平安大华鼎信定开债 |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 002988 |
| 基金运作方式 | 契约型、定期开放式。本基金拟设定运作周期，运作周期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一个自由开放期结束之日次日起（包括该日）18 个月的期间。运作周期结束之后第一个工作日起进入自由开放期，每个自由开放期为 5 至 20 个工作日，自由开放期的具体期间由基金管理人最迟于自由开放期的 2 日前进行公告。 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 7 月 21 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 500,029,962.48 份 |
| 投资目标 | 在谨慎投资的前提下，力争战胜业绩比较基准，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。 |
| 投资策略 | 本基金在封闭期内，通过对宏观经济周期、行业前景预测和发债主体公司研究的综合运用，主要采取利率策略、信用策略、折价与套利等积极投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上，深入挖掘价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率（税后）+1.5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险均高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。 |
| 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 |

备注：本基金转型日期为 2018 年 3 月 24 日，该日起平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金转型为平安大华鼎信债券型证券投资基金，此处的期末份额日期为 2018 年 3 月 23 日。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现**3.1 主要财务指标（转型后）**

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018 年 3 月 24 日 — 2018 年 3 月 31 日） |
|-----------------|--|
| 1. 本期已实现收益 | 372,976.17 |
| 2. 本期利润 | 1,381,558.49 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0028 |
| 4. 期末基金资产净值 | 527,509,672.39 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0550 |

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. 所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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018年1月1日—2018年3月23日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 5,194,964.53 |
| 2. 本期利润 | 8,554,381.11 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0171 |
| 4. 期末基金资产净值 | 526,129,158.84 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0522 |

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. 所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（转型后）

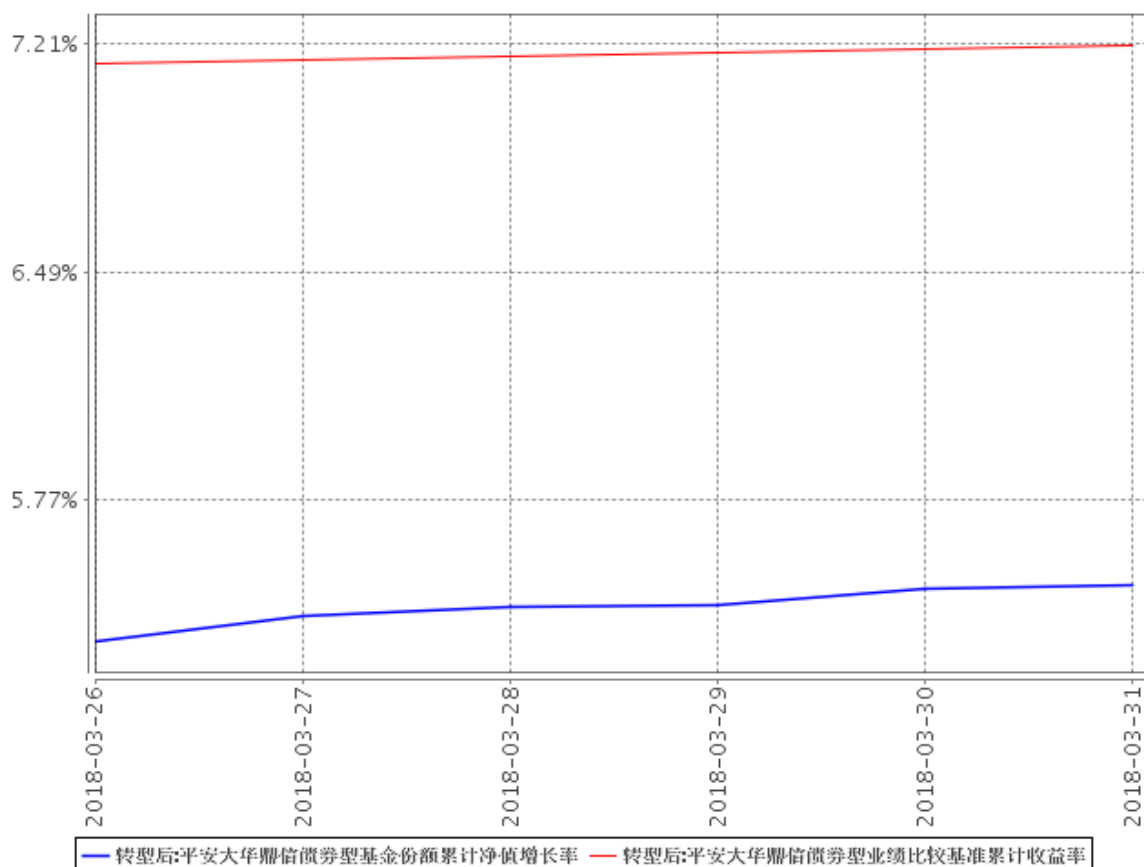
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 |
|-------------------------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 2018年3月 26日至2018 年3月31日 | 0.27% | 0.04% | 0.09% | 0.01% | 0.18% | 0.03% |

业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税后）+1.5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

平安大华鼎信债券型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、平安大华鼎信债券型证券投资基金由平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金转型而来，变更后基金成立日为 2018 年 3 月 24 日正式生效，截至报告期末未满半年；
- 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未完成建仓。

3.2 基金净值表现（转型前）

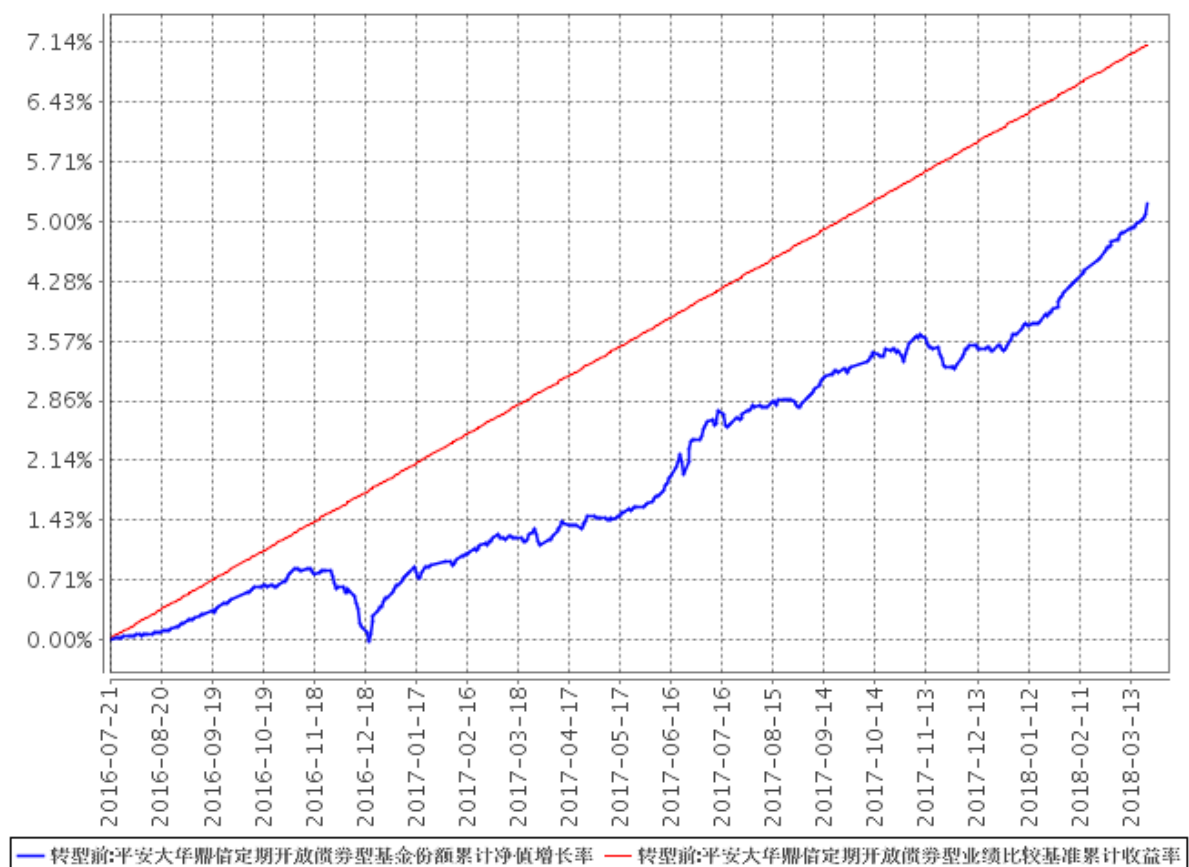
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 |
|---------------------------------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 23 日 | 1.65% | 0.03% | 0.90% | 0.01% | 0.75% | 0.02% |

业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税后）+1.5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

平安大华鼎信定期开放债券型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 7 月 21 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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---------|-------------------------|------------------|-----------------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| WANG AO | 平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金基金经理 | 2016 年 7 月 21 日 | 2018 年 3 月 23 日 | 5 | WANG AO 先生，CAIA、FRM，CFA，澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士，曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012 年 9 月加入平安大华基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益研究员。现任平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠裕债券型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 余斌 | 平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金基金经理 | 2017 年 10 月 16 日 | 2018 年 3 月 23 日 | 5 | 余斌先生，西安财经学院学士，哈尔滨工业大学硕士。先后担任大公国际资信评估有限公司评级部分析师、华西证券股份有限公司固定收益总部项目经理、长城证券股份有限公司资产管理部信用研究员、华创证券有限责任公司投资银行资本市场部高级副总监。2015 年 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 10 月加入平安大华基金管理有限公司，任投资研究部固定收益研究员。现任“平安大华惠享纯债债券型证券投资基金”、“平安大华惠利纯债债券型证券投资基金”、“平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金”、“平安大华惠定期开放债券型证券投资基金”、“平安大华惠裕债券型证券投资基金”、“平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金”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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---------|---------------------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| WANG AO | 平安大华鼎信债券型证券投资基金基金经理 | 2018 年 3 月 24 日 | - | 5 | WANG AO 先生，CAIA、FRM，CFA，澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士，曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012 年 9 月加入平安大华基金管理有限公司，担任投资研究部固定收益研究员。现任平安大华鼎信债券型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投 |

| | | | | | |
|----|---------------------|-----------------|---|---|--|
| | | | | | 资基金、平安大华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠裕债券型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华鼎越定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 余斌 | 平安大华鼎信债券型证券投资基金基金经理 | 2018 年 3 月 24 日 | - | 5 | 余斌先生，西安财经学院学士，哈尔滨工业大学硕士。先后担任大公国际资信评估有限公司评级部分析师、华西证券股份有限公司固定收益总部项目经理、长城证券股份有限公司资产管理部信用研究员、华创证券有限责任公司投资银行资本市场部高级副总监。2015 年 10 月加入平安大华基金管理有限公司，任投资研究部固定收益研究员。现任“平安大华惠享纯债债券型证券投资基金”、“平安大华惠利纯债债券型证券投资基金”、“平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金”、“平安大华鼎信债券型证券投资基金”、“平安大华惠裕债券型证券投资基金”、“平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金”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

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华鼎信债券型证券投资基金基金合同》（转型前：《平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金基金合同》）和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年一季度在资金面整体较松、基本面预期弱化、中美贸易战持续升级等因素刺激下，债券市场迎来了一波较大的牛市，各类债券涨幅较大。报告期内本基金未参与权益类投资，加杠杆买入高等级信用债，使得一季度基金净值保持了稳步增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 3 月 31 日，本基金份额净值为 1.0550 元；本报告期（2018 年 3 月 24 日至 2018 年 3 月 31 日），基金份额净值增长率为 0.27%，业绩比较基准收益率为 0.09%。

截至 2018 年 3 月 23 日，本基金份额净值为 1.0522 元；本报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 23 日），基金份额净值增长率为 1.65%，业绩比较基准收益率为 0.90%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

转型前：

本基金本报告期内出现连续 20 个工作日基金持有人数低于 200 人的情形。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 个工作日基金资产净值低于 5000 万的情形。

转型后：

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万的情形。

§ 5 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 554,544,044.56 | 97.43 |
| | 其中：债券 | 554,544,044.56 | 97.43 |
| | 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 | 860,996.77 | 0.15 |
| 8 | 其他资产 | 13,749,824.39 | 2.42 |
| 9 | 合计 | 569,154,865.72 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 30,051,000.00 | 5.70 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,051,000.00 | 5.70 |
| 4 | 企业债券 | 102,678,050.00 | 19.46 |
| 5 | 企业短期融资券 | 160,646,000.00 | 30.45 |
| 6 | 中期票据 | 260,549,000.00 | 49.39 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 619,994.56 | 0.12 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 554,544,044.56 | 105.12 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 101468005 | 14 中铝业 MTN001 | 400,000 | 40,656,000.00 | 7.71 |
| 2 | 101782001 | 17 河钢集 MTN007 | 400,000 | 40,384,000.00 | 7.66 |
| 3 | 101759023 | 17 中化工 MTN001 | 400,000 | 40,224,000.00 | 7.63 |
| 4 | 011753065 | 17 荣盛 SCP004 | 400,000 | 40,164,000.00 | 7.61 |
| 5 | 011800037 | 18 晋煤 SCP001 | 400,000 | 40,156,000.00 | 7.61 |

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注**5.10.1**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.10.2

本基金本报告期末持有股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 812.04 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,080,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 11,669,012.35 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|---------------|
| 9 | 合计 | 13,749,824.39 |
|---|----|---------------|

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 515,194,694.56 | 97.47 |
| | 其中：债券 | 515,194,694.56 | 97.47 |
| | 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 | 544,271.31 | 0.10 |
| 8 | 其他资产 | 12,827,206.64 | 2.43 |
| 9 | 合计 | 528,566,172.51 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 30,063,000.00 | 5.71 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,063,000.00 | 5.71 |
| 4 | 企业债券 | 64,005,700.00 | 12.17 |
| 5 | 企业短期融资券 | 160,569,000.00 | 30.52 |
| 6 | 中期票据 | 259,937,000.00 | 49.41 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 619,994.56 | 0.12 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 515,194,694.56 | 97.92 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 101468005 | 14 中铝业 MTN001 | 400,000 | 40,600,000.00 | 7.72 |
| 2 | 101782001 | 17 河钢集 MTN007 | 400,000 | 40,284,000.00 | 7.66 |
| 3 | 011753065 | 17 荣盛 SCP004 | 400,000 | 40,148,000.00 | 7.63 |
| 4 | 011772032 | 17 鲁钢铁 SCP005 | 400,000 | 40,128,000.00 | 7.63 |
| 5 | 011800037 | 18 晋煤 SCP001 | 400,000 | 40,120,000.00 | 7.63 |

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 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情况。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.11.2

本基金本报告期末持有股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 812.04 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 12,826,394.60 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,827,206.64 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

| | |
|--|----------------|
| 基金合同生效日（2018年3月24日）基金份 额总额 | 500,029,962.48 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额 | 0.00 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额 | 992.16 |
| 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） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 500,028,970.32 |

本基金转型日期为 2018 年 3 月 24 日，此处的期末份额日期为 2018 年 3 月 31 日

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 500,034,307.94 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 391.77 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,737.23 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 500,029,962.48 |

本基金转型日期为 2018 年 3 月 24 日，此处的期末份额日期为 2018 年 3 月 23 日

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 |
| 机构 | 1 | 20180101 - 20180331 | 500,008,000.00 | 0.00 | 0.00 | 500,008,000.00 | 100.00% |

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2016 年 7 月 21 日成立，根据《平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）及《平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及相关公告的规定，本基金的首个自由开放期自 2018 年 1 月 23 日起至 2018 年 2 月 23 日止，因在本自由开放期最后一日日终触

发本基金的转型条件，根据《基金合同》的约定，本基金自 2018 年 3 月 24 日起正式转型为“平安大华鼎信债券型证券投资基金”。投资人欲了解详情，可阅读在本公司官网发布的相关公告。

（《关于平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金转型为平安大华鼎信债券型证券投资基金及相关业务规则的提示性公告》、《关于平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金转型为平安大华鼎信债券型证券投资基金的公告》、《平安大华基金管理有限公司关于平安大华鼎信债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》）

§ 9 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- （1）中国证监会批准平安大华鼎信债券型证券投资基金设立的文件
- （2）平安大华鼎信债券型证券投资基金基金合同
- （3）平安大华鼎信债券型证券投资基金托管协议
- （4）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （5）报告期内平安大华鼎信债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

10.3 查阅方式

- （1）投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。
- （2）投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）。

平安大华基金管理有限公司
2018 年 4 月 20 日