

平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资  
基金  
2018 年半年度报告 摘要

2018 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华智慧中国混合
场内简称	-
基金主代码	001297
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 9 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	879, 786, 230. 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	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金致力于发掘中国经济转型和产业升级中新技术或新模式带来的投资机会。通过重点投资与高端装备制造、工业 4.0、互联网主题相关的优质证券，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用“自下而上，个股优选”的投资策略，挖掘经济转型和产业升级中新技术或新模式带来的投资机会，重点投资高端装备制造业、工业 4.0、互联网主题相关的股票，构建在中长期能够从转型中受益的投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

## 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	方琦
	联系电话	0755-22626828	0755-22160168
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fangqi275@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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金半年度报告备置地点	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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-35,753,552.95
本期利润	-68,648,850.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0727
本期基金份额净值增长率	-12.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.5014
期末基金资产净值	438,681,199.04
期末基金份额净值	0.499

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.31%	1.62%	-6.04%	1.02%	0.73%	0.60%
过去三个月	-6.55%	1.36%	-7.61%	0.91%	1.06%	0.45%
过去六个月	-12.76%	1.51%	-9.63%	0.92%	-3.13%	0.59%
过去一年	-9.11%	1.36%	-2.44%	0.76%	-6.67%	0.60%
过去三年	-43.36%	1.66%	-14.65%	1.19%	-28.71%	0.47%
自基金合同生效起至今	-50.10%	1.65%	-25.92%	1.25%	-24.18%	0.40%

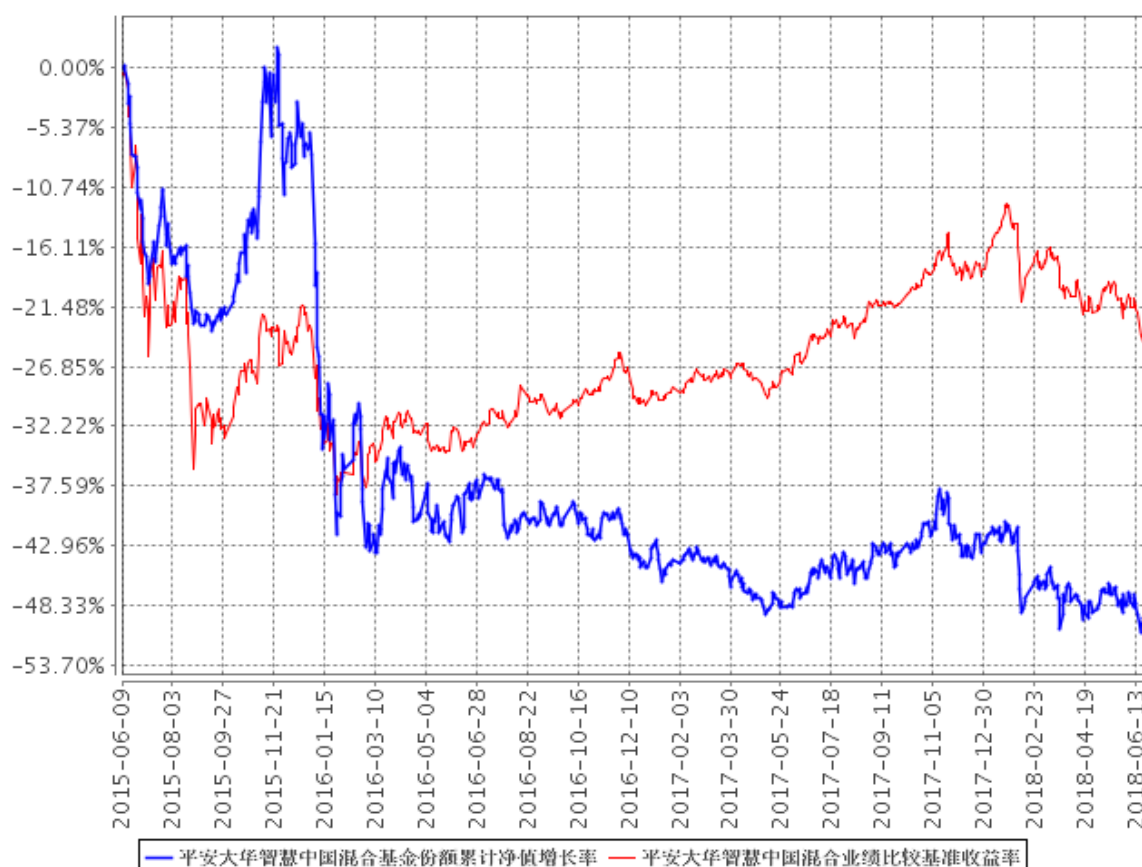
注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证综合债券指

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

平安大华智慧中国混合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 2015 年 6 月 9 日正式生效，截至报告期末已满三年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安大华基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安大华基金总部位于深圳，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%。平安大华基金秉承“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 2018 年 6 月 30 日，平安大华基金共管理 57 只公募基金，资产管理总规模 2442 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		
神爱前	平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016 年 8 月 2 日	-	7	神爱前先生，厦门大学财政学硕士。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、《平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 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

上半年受“去杠杆”、对经济回落的担忧、以及中美贸易纠纷影响，A股大幅下跌，除了医药、食品饮料、休闲服务等少数消费板块在上半年取得微幅上涨，其他行业均大幅下跌，其中通信、电力设备、传媒、电子等科技板块、钢铁、煤炭、化工、建筑建材、有色金属等周期板块，跌幅居前。基于对经济可能逐季回落的研判，以及行业业绩增长比较，本基金在二月底三月初布局了部分科技领域的成长板块。但4月中美贸易矛盾激化，尤其中兴通讯禁运事件对市场影响



甚大，市场对科技板块前景丧失信心，相关估值大幅下折，造成本基金在 4 月份净值回撤较大。本基金相应调整投资策略，基于外部环境不确定性较高、市场风险偏好较低等市场环境，持仓进一步增持一些确定性高、稳定性强的消费类板块和个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.499 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.76%，业绩比较基准收益率为-9.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年本基金认为，市场风险仍在释放过程中，持仓布局仍以偏稳为主，等待市场寻底企稳，适时增加成长股持仓。下半年政策面正在边际改善，从“去杠杆”向“稳杠杆”转变；而中美贸易纠纷，有望在下半年告一段落，对市场冲击减少，下半年最大的隐忧或在于经济下滑的风险。因此，本基金将在下半年将逐步增加与经济相关性较弱的成长股持仓，重点关注医疗服务、新兴消费、云计算、半导体、被动元器件、新能源车等板块的反弹机会。

#### 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委员会，成员由投资管理部门、研究中心、资本市场风控监控室、基金运营部基金会计室及法律合规监察部相关人员组成。基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。

估值委员会的职责主要包括有：制订健全有效的估值政策和程序；定期对估值政策和程序进行评价等；保证基金估值的公平、合理；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；估值委员会成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。

#### **4.7 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。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 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”）在对平安大华智慧中国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。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		56,726,762.06	97,187,810.77
结算备付金		1,799,868.19	9,895,092.22
存出保证金		1,561,346.76	1,996,097.46
交易性金融资产		380,830,181.02	383,185,404.52
其中：股票投资		380,830,181.02	381,570,005.02
基金投资		-	-
债券投资		-	1,615,399.50
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		-	101,888,418.52
应收利息		15,500.84	20,123.90
应收股利		-	-
应收申购款		41,559.38	90,214.06
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		440,975,218.25	594,263,161.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		485,866.56	796,163.61
应付管理人报酬		559,999.90	754,194.43
应付托管费		93,333.31	125,699.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		962,225.74	4,010,185.35
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		192,593.70	270,733.50
负债合计		2,294,019.21	5,956,975.98
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		879,786,230.31	1,028,101,218.78
未分配利润		-441,105,031.27	-439,795,033.31
所有者权益合计		438,681,199.04	588,306,185.47
负债和所有者权益总计		440,975,218.25	594,263,161.45

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.499 元，基金份额总额 879,786,230.31 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-57,366,523.79	13,684,077.95
1.利息收入		331,833.67	659,826.23
其中：存款利息收入		331,597.43	562,951.57
债券利息收入		236.24	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	96,874.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-24,839,013.34	-15,697,999.98
其中：股票投资收益		-29,261,380.97	-20,812,096.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益		403,354.85	-
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		4,019,012.78	5,114,096.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-32,895,297.80	28,668,035.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		35,953.68	54,216.17

列)			
<b>减：二、费用</b>		11,282,326.96	18,637,471.11
1. 管理人报酬		3,759,479.16	5,124,101.53
2. 托管费		626,579.89	854,016.86
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		6,685,189.17	12,437,898.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		211,077.89	221,454.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-68,648,850.75	-4,953,393.16
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-68,648,850.75	-4,953,393.16

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	1,028,101,218.78	-439,795,033.31	588,306,185.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-68,648,850.75	-68,648,850.75
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）	-148,314,988.47	67,338,852.79	-80,976,135.68
其中：1. 基金申购款	10,263,157.71	-4,879,926.41	5,383,231.30
2. 基金赎回款	-158,578,146.18	72,218,779.20	-86,359,366.98
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）	879,786,230.31	-441,105,031.27	438,681,199.04



1,796,990,659.12 份基金份额，其中认购资金利息折合 193,162.94 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《平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率× 80% + 中证综合债券指数收益率× 20%。

#### 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》、《平安大华智慧中国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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

#### 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

本基金在本报告期间无须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 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.7.2 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
平安大华基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“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	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	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司的联营公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	41,390,433.15	0.81%	-	-

#### 6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	29,441.09	0.79%	29,441.09	3.06%

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。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,759,479.16	5,124,101.53
其中：支付销售机构的客户维护费	1,475,896.67	2,019,408.20

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。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	626,579.89	854,016.86

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。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的销售服务费。

## 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.8.4.1 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于本期未运用固有资金投资本基金。

**6.4.8.4.2 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。

**6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
平安银行-活期存款	56,726,762.06	271,006.38	47,691,062.97	476,885.61

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，活期存款按银行同业利率计息。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

**6.4.9.2 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	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
------	------	------	------	-------	------	--------	-------	--------	--------	----

				价						
603939	益丰 药房	2018 年 4月 17日	重大 事项	59.72	2018 年 7月 16日	65.69	130,500	7,885,760.24	7,793,460.00	-

注：本基金截至 2018 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。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.10.1 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。

#### 6.4.10.2 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。

#### 6.4.10.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 8 月 24 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	380,830,181.02	86.36
	其中：股票	380,830,181.02	86.36
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	58,526,630.25	13.27
7	其他各项资产	1,618,406.98	0.37
8	合计	440,975,218.25	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	628.00	0.00
C	制造业	259,212,115.41	59.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	79,944,367.66	18.22
G	交通运输、仓储和邮政业	108,893.38	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,884,620.84	0.43

J	金融业	312,099.90	0.07
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	79,391.50	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	29,902,722.34	6.82
R	文化、体育和娱乐业	9,232,556.00	2.10
S	综合	-	-
	合计	380,830,181.02	86.81

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	477,700	22,523,555.00	5.13
2	600763	通策医疗	436,182	21,228,977.94	4.84
3	000963	华东医药	439,290	21,195,742.50	4.83
4	600529	山东药玻	870,300	21,174,399.00	4.83
5	000895	双汇发展	649,400	17,150,654.00	3.91
6	600690	青岛海尔	857,275	16,511,116.50	3.76
7	603708	家家悦	741,312	16,301,450.88	3.72
8	600887	伊利股份	542,000	15,121,800.00	3.45
9	600176	中国巨石	1,286,040	13,156,189.20	3.00
10	600867	通化东宝	546,000	13,087,620.00	2.98

## 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	601336	新华保险	58,001,126.57	9.86
2	601998	中信银行	57,119,477.54	9.71
3	002024	苏宁易购	46,116,654.95	7.84
4	600690	青岛海尔	40,372,675.87	6.86
5	600048	保利地产	39,006,073.88	6.63
6	601601	中国太保	37,568,559.72	6.39
7	001979	招商蛇口	37,527,226.31	6.38
8	600887	伊利股份	36,566,794.32	6.22
9	600016	民生银行	35,252,603.00	5.99
10	300383	光环新网	34,285,457.00	5.83
11	002202	金风科技	33,693,075.94	5.73
12	601398	工商银行	33,073,813.56	5.62
13	002036	联创电子	31,574,731.67	5.37
14	000651	格力电器	31,264,188.92	5.31
15	601939	建设银行	29,771,169.00	5.06
16	601628	中国人寿	29,352,495.00	4.99
17	600036	招商银行	29,345,123.00	4.99
18	002648	卫星石化	29,342,886.10	4.99
19	600585	海螺水泥	28,571,684.33	4.86
20	002373	千方科技	28,543,408.00	4.85
21	601012	隆基股份	27,724,314.62	4.71
22	600352	浙江龙盛	27,721,781.00	4.71
23	601288	农业银行	27,477,992.00	4.67
24	002709	天赐材料	27,044,944.74	4.60
25	601919	中远海控	26,770,766.00	4.55
26	601111	中国国航	26,112,451.40	4.44
27	300364	中文在线	25,443,724.45	4.32
28	002236	大华股份	25,389,513.03	4.32
29	000333	美的集团	25,198,970.84	4.28
30	300098	高新兴	25,022,423.73	4.25
31	000050	深天马A	24,677,827.49	4.19
32	002192	融捷股份	23,810,956.98	4.05
33	002384	东山精密	23,715,606.61	4.03
34	600522	中天科技	23,683,495.71	4.03
35	601818	光大银行	23,482,732.00	3.99



36	300324	旋极信息	23,385,486.28	3.98
37	000681	视觉中国	23,281,636.00	3.96
38	000895	双汇发展	22,954,630.95	3.90
39	300274	阳光电源	22,697,643.98	3.86
40	601899	紫金矿业	22,621,475.19	3.85
41	000858	五粮液	22,532,348.00	3.83
42	600438	通威股份	22,009,867.00	3.74
43	600176	中国巨石	21,972,682.74	3.73
44	600028	中国石化	21,585,850.00	3.67
45	300367	东方网力	21,358,129.09	3.63
46	601877	正泰电器	21,322,290.04	3.62
47	002123	梦网集团	21,300,185.76	3.62
48	601699	潞安环能	20,737,943.50	3.53
49	002544	杰赛科技	20,671,673.32	3.51
50	000963	华东医药	20,384,174.13	3.46
51	600763	通策医疗	19,929,648.06	3.39
52	600529	山东药玻	19,176,382.86	3.26
53	603160	汇顶科技	18,302,900.64	3.11
54	601166	兴业银行	17,814,271.00	3.03
55	603993	洛阳钼业	17,813,708.00	3.03
56	600606	绿地控股	17,779,187.78	3.02
57	002009	天奇股份	17,576,185.00	2.99
58	000961	中南建设	17,505,873.00	2.98
59	000069	华侨城A	17,251,659.20	2.93
60	300323	华灿光电	17,216,236.62	2.93
61	600118	中国卫星	17,185,237.00	2.92
62	002074	国轩高科	17,141,348.53	2.91
63	601988	中国银行	17,068,922.00	2.90
64	603708	家家悦	16,816,708.56	2.86
65	000039	中集集团	16,473,965.85	2.80
66	603883	老百姓	15,995,209.00	2.72
67	600172	黄河旋风	15,807,525.20	2.69
68	600483	福能股份	15,715,328.54	2.67
69	300070	碧水源	15,669,982.18	2.66
70	601231	环旭电子	15,625,210.23	2.66
71	600797	浙大网新	15,600,340.00	2.65

72	002334	英威腾	15,333,077.15	2.61
73	002440	闰土股份	14,725,478.69	2.50
74	002013	中航机电	14,714,123.17	2.50
75	300310	宜通世纪	14,522,590.00	2.47
76	300476	胜宏科技	14,230,910.80	2.42
77	601222	林洋能源	14,033,441.50	2.39
78	300296	利亚德	13,638,020.13	2.32
79	600298	安琪酵母	13,575,887.15	2.31
80	002477	雏鹰农牧	13,369,989.82	2.27
81	000059	华锦股份	13,056,586.42	2.22
82	600271	航天信息	13,044,680.00	2.22
83	300294	博雅生物	12,784,531.19	2.17
84	002142	宁波银行	12,677,549.08	2.15
85	600332	白云山	12,610,245.56	2.14
86	600115	东方航空	12,158,844.45	2.07
87	600867	通化东宝	12,121,890.22	2.06
88	000537	广宇发展	11,847,207.00	2.01
89	002235	安妮股份	11,843,080.00	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	002202	金风科技	76,810,745.39	13.06
2	601998	中信银行	56,645,851.86	9.63
3	601336	新华保险	55,047,759.58	9.36
4	601601	中国太保	51,661,848.06	8.78
5	002024	苏宁易购	46,578,136.45	7.92
6	601231	环旭电子	39,852,718.10	6.77
7	601111	中国国航	39,131,533.94	6.65
8	600048	保利地产	38,014,028.11	6.46
9	300383	光环新网	36,792,581.36	6.25
10	001979	招商蛇口	35,796,711.53	6.08
11	600690	青岛海尔	35,630,788.17	6.06
12	000858	五粮液	35,075,581.14	5.96
13	000651	格力电器	34,382,145.02	5.84

14	600016	民生银行	33,505,266.08	5.70
15	600519	贵州茅台	33,172,292.67	5.64
16	601398	工商银行	33,135,943.72	5.63
17	002036	联创电子	31,662,020.42	5.38
18	002373	千方科技	31,369,150.49	5.33
19	000039	中集集团	30,755,436.25	5.23
20	601939	建设银行	30,173,623.83	5.13
21	002648	卫星石化	29,475,708.95	5.01
22	601012	隆基股份	29,210,079.87	4.97
23	600036	招商银行	28,318,974.70	4.81
24	601628	中国人寿	27,805,295.79	4.73
25	601288	农业银行	27,363,016.00	4.65
26	600585	海螺水泥	27,285,040.70	4.64
27	300098	高新兴	26,828,432.71	4.56
28	600352	浙江龙盛	26,729,540.96	4.54
29	600383	金地集团	25,420,008.00	4.32
30	300324	旋极信息	25,154,330.50	4.28
31	000333	美的集团	25,135,674.58	4.27
32	601919	中远海控	25,031,077.00	4.25
33	000050	深天马A	24,447,287.95	4.16
34	600522	中天科技	23,954,127.02	4.07
35	300364	中文在线	23,449,382.53	3.99
36	600115	东方航空	23,149,810.52	3.93
37	300367	东方网力	23,001,768.70	3.91
38	600438	通威股份	22,936,726.00	3.90
39	600029	南方航空	22,694,882.00	3.86
40	601877	正泰电器	22,435,791.09	3.81
41	002192	融捷股份	22,058,815.40	3.75
42	600970	中材国际	21,504,065.48	3.66
43	002597	金禾实业	21,297,565.28	3.62
44	002544	杰赛科技	21,208,365.40	3.60
45	000681	视觉中国	20,921,099.00	3.56
46	601699	潞安环能	20,572,470.59	3.50
47	601899	紫金矿业	20,539,967.48	3.49
48	300274	阳光电源	20,539,868.96	3.49
49	601818	光大银行	20,488,808.00	3.48
50	002123	梦网集团	20,021,906.50	3.40
51	600028	中国石化	19,831,707.00	3.37

52	600887	伊利股份	19,328,490.38	3.29
53	002384	东山精密	19,263,425.52	3.27
54	000671	阳光城	19,095,256.16	3.25
55	600176	中国巨石	18,781,512.28	3.19
56	600486	扬农化工	18,589,166.50	3.16
57	603160	汇顶科技	18,011,617.00	3.06
58	600741	华域汽车	17,970,875.98	3.05
59	600118	中国卫星	17,928,490.33	3.05
60	603993	洛阳钼业	17,467,645.00	2.97
61	601166	兴业银行	17,312,485.00	2.94
62	600332	白云山	17,308,849.46	2.94
63	002236	大华股份	17,130,172.00	2.91
64	300070	碧水源	16,982,422.04	2.89
65	002009	天奇股份	16,959,627.79	2.88
66	600606	绿地控股	16,248,950.00	2.76
67	000961	中南建设	15,882,681.00	2.70
68	300323	华灿光电	15,818,669.00	2.69
69	600172	黄河旋风	15,811,251.80	2.69
70	601988	中国银行	15,621,268.00	2.66
71	002440	闰土股份	15,596,116.71	2.65
72	002709	天赐材料	15,582,436.27	2.65
73	600483	福能股份	15,089,837.36	2.56
74	600797	浙大网新	14,843,585.10	2.52
75	000069	华侨城 A	14,277,273.07	2.43
76	002334	英威腾	14,029,307.83	2.38
77	300310	宜通世纪	13,553,754.88	2.30
78	002013	中航机电	13,371,440.56	2.27
79	002477	雏鹰农牧	13,304,503.16	2.26
80	601222	林洋能源	13,177,329.00	2.24
81	002074	国轩高科	12,487,918.76	2.12
82	300294	博雅生物	12,391,690.28	2.11
83	000059	华锦股份	12,208,754.00	2.08

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	2,587,827,306.56
卖出股票收入（成交）总额	2,526,623,351.29

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投资。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内无股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

2017 年 10 月 31 日，上交所公告，通策医疗投资股份有限公司（以下简称“公司”）及时

任董事长赵玲玲、董事会秘书黄浴华、财务总监王毅因公司实施重大资产重组未按规定履行相应披露义务、收购资产会计处理不一致导致定期报告信息披露不准确，对其给予通报批评，并上报证监会及计入上市公司诚信档案。

本基金管理人认为，该事项对公司的生产经营不会造成重大不利影响，我们对该证券的投资严格执行了内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 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	1,561,346.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,500.84
5	应收申购款	41,559.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,618,406.98

### 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

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限。

### 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

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
14,516	60,608.03	0.00	0.00%	879,786,230.31	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	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	76,564.90	0.0087%

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月9日）基金份额总额	1,796,990,659.12
本报告期期初基金份额总额	1,028,101,218.78
本报告期基金总申购份额	10,263,157.71
减：本报告期基金总赎回份额	158,578,146.18
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	879,786,230.31

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。



## § 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，本基金管理人、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
兴业证券	1	591,853,327.77	11.58%	420,987.40	11.36%	-
恒泰证券	4	436,380,322.26	8.54%	319,125.12	8.61%	-
银河证券	2	335,124,377.55	6.56%	238,373.83	6.43%	-
方正证券	2	311,841,971.35	6.10%	221,813.29	5.99%	-
广发证券	2	301,067,409.54	5.89%	274,363.42	7.41%	-
安信证券	3	299,403,390.19	5.86%	212,966.23	5.75%	新增 1 个

东北证券	7	232,191,729.35	4.54%	165,158.00	4.46%	新增 2 个
天风证券	2	225,458,722.92	4.41%	160,367.98	4.33%	-
长江证券	1	216,705,519.08	4.24%	154,142.75	4.16%	-
光大证券	2	200,372,495.66	3.92%	142,525.29	3.85%	-
西南证券	1	194,193,998.52	3.80%	138,130.20	3.73%	-
东兴证券	2	183,535,896.97	3.59%	130,548.94	3.52%	-
国信证券	2	180,088,604.36	3.52%	128,095.76	3.46%	-
东方证券	1	174,566,757.84	3.41%	124,167.10	3.35%	-
中银国际	1	161,524,060.27	3.16%	114,892.85	3.10%	-
万联证券	2	160,344,741.95	3.14%	114,053.95	3.08%	-
华泰证券	2	140,986,892.50	2.76%	100,282.01	2.71%	-
海通证券	2	137,932,968.09	2.70%	98,112.29	2.65%	-
民生证券	1	137,897,803.90	2.70%	98,087.69	2.65%	-
华福证券	2	137,020,255.41	2.68%	97,463.04	2.63%	-
财富证券	1	119,791,418.43	2.34%	85,207.71	2.30%	-
华创证券	2	95,041,411.14	1.86%	67,602.54	1.82%	-
中泰证券	1	74,946,725.71	1.47%	53,309.63	1.44%	-
平安证券	4	41,390,433.15	0.81%	29,441.09	0.79%	-
中信建投	2	10,671,277.85	0.21%	7,590.41	0.20%	-
国联证券	2	9,008,518.00	0.18%	6,407.96	0.17%	-
东吴证券	2	2,529,196.56	0.05%	1,798.93	0.05%	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	新增
中信证券	2	-	-	-	-	新增
申万宏源	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-

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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	1,480,310.72	81.94%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	326,350.00	18.06%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

广州证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

平安大华基金管理有限公司  
2018 年 8 月 24 日