

平安大华睿享文娱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：广发证券股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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	平安大华睿享文娱混合	
场内简称	-	
基金主代码	002450	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 3 月 29 日	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	37,696,891.14 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:	平安大华睿享文娱混合 A	平安大华睿享文娱混合 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	002450	002451
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	10,202,044.29 份	27,494,846.85 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，重点投资与文体娱乐主题相关的优质证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采用“灵活资产配置、主动投资管理”的投资策略，一方面通过大类资产配置，降低系统性风险，把握市场波动中的投资机会；另一方面利用平安大华研究平台优势，重点研究、投资与文体娱乐主题相关的证券资产，构建在中长期能够从经济转型、产业升级中受益的投资组合。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。	
	平安大华睿享文娱混合 A	平安大华睿享文娱混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安大华基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	崔瑞娟
	联系电话	0755-22626828	020-87555888
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95575
传真		0755-23997878	020-87555129

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	http://www.fund.pingan.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	平安大华睿享文娱灵活配置 A	平安大华睿享文娱灵活配置 C
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)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	-80,761.99	21,333.50
本期利润	-192,486.34	-479,005.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0196	-0.0161
本期基金份额净值增长率	-0.17%	-0.44%
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	0.1437	0.1220
期末基金资产净值	11,830,046.19	31,283,028.84
期末基金份额净值	1.160	1.138

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

平安大华睿享文娱灵活配置 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.23%	1.12%	-3.57%	0.64%	-1.66%	0.48%
过去三个月	-1.11%	0.99%	-4.07%	0.57%	2.96%	0.42%
过去六个月	-0.17%	1.03%	-4.61%	0.58%	4.44%	0.45%
过去一年	14.29%	0.95%	0.17%	0.47%	14.12%	0.48%
自基金合同生效起	16.00%	0.75%	8.58%	0.43%	7.42%	0.32%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

平安大华睿享文娱灵活配置 C

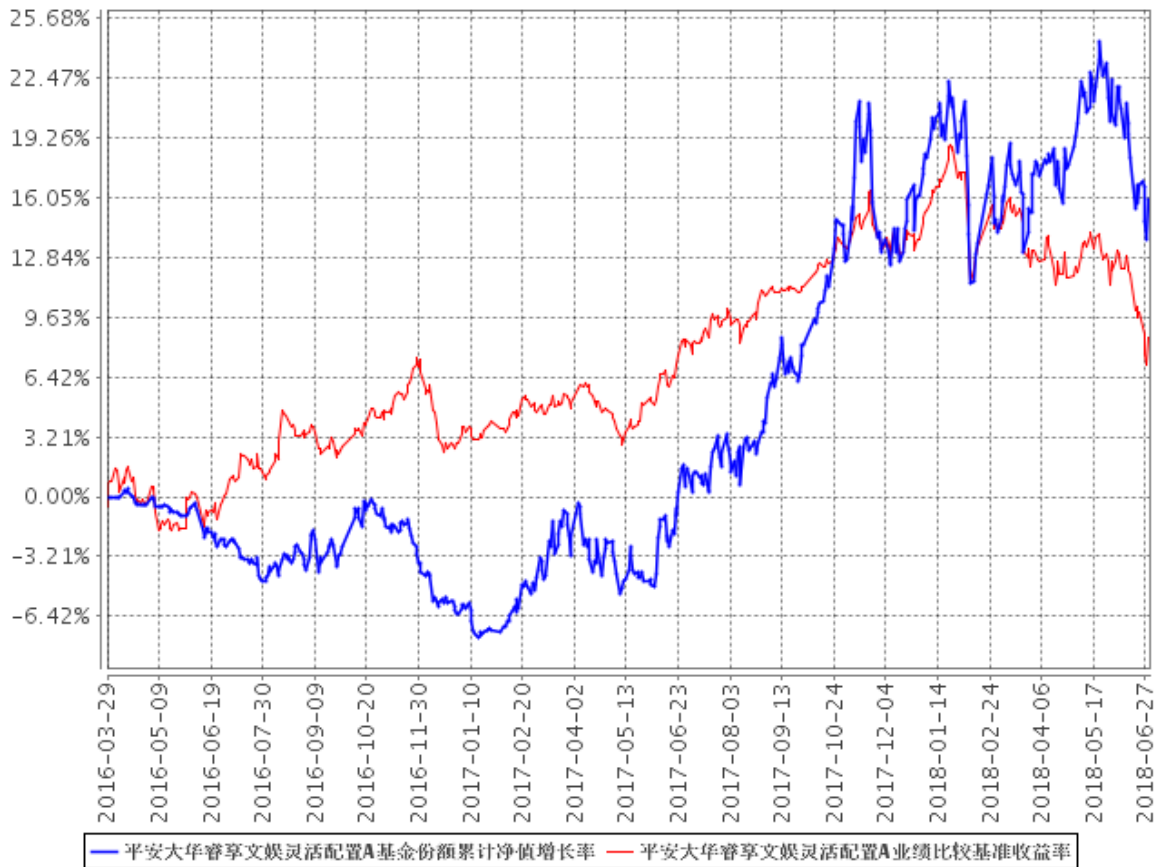
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.17%	1.11%	-3.57%	0.64%	-1.60%	0.47%
过去三个月	-1.22%	0.98%	-4.07%	0.57%	2.85%	0.41%
过去六个月	-0.44%	1.03%	-4.61%	0.58%	4.17%	0.45%
过去一年	13.69%	0.95%	0.17%	0.47%	13.52%	0.48%
自基金合同生效起至今	13.80%	0.75%	8.58%	0.43%	5.22%	0.32%

注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。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。

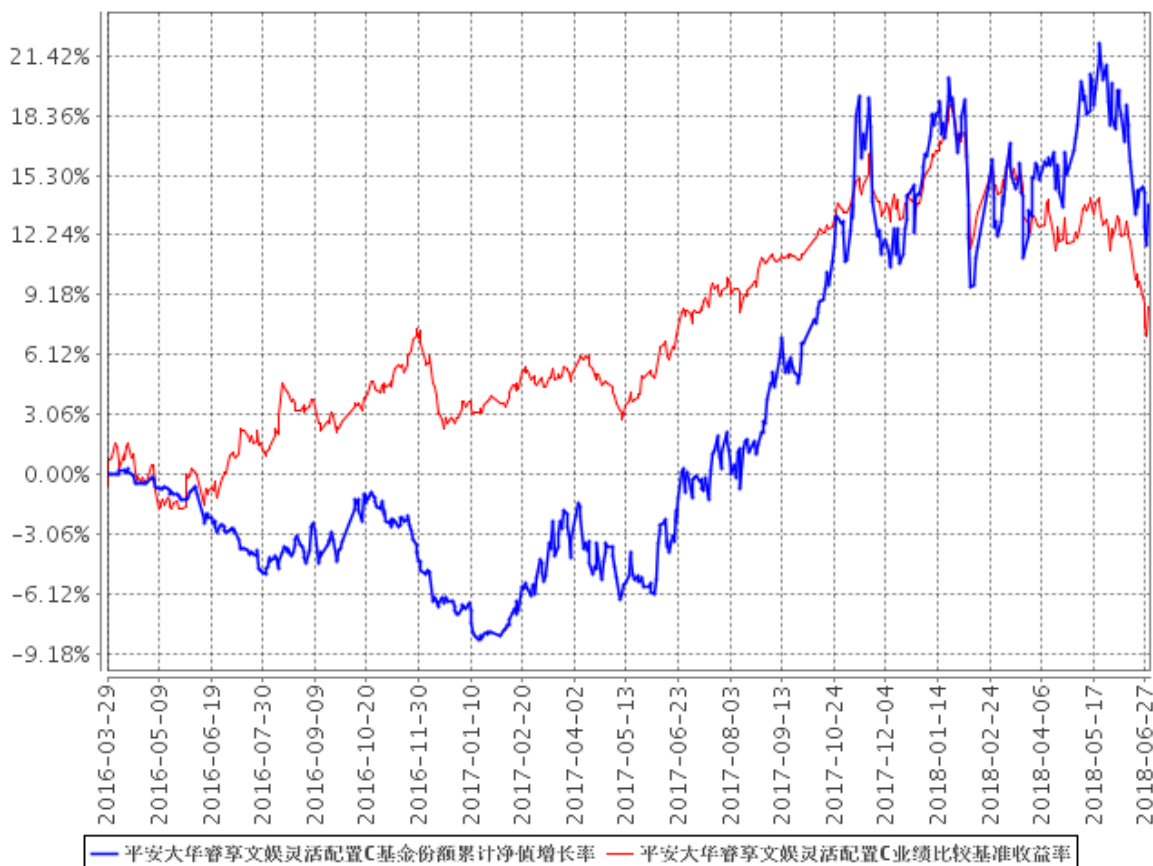
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

平安大华睿享文娱灵活配置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



平安大华睿享文娱灵活配置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 2016 年 3 月 29 日正式生效，截至报告期末已满两年；
- 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		
黄维	平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016 年 8 月 24 日	-	7	黄维先生，北京大学微电子学硕士，曾先后任广发证券股份有限公司研究员、广发证券资产管理（广东）有限公司投资经理。2016 年 5 月加入平安大华基金管理有限公司，现任平安大华睿享文娱灵活配置混合性证券投资基金、平安大华鼎弘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、《平安大华睿享文娱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

本产品今年以来配置主线聚焦在成长性好以及盈利确定的板块，如信息文娱消费、医药、汽车和食品饮料等板块，标的以业绩白马为主，产品净值相对收益显著。展望后市，我们认为聚焦价值和盈利确定的格局不会改变，市场主线依然会是这些代表消费升级和制造升级的产业，我们将在此基础上，精选个股，聚焦行业龙头，在盈利驱动的市场结构中，成长确定的个股将大概率能带来良好的投资回报。

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睿享文娱灵活配置 A 基金份额净值为 1.160 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.17%；截至本报告期末平安大华睿享文娱灵活配置 C 基金份额净值为 1.138 元，

本报告期基金份额净值增长率为-0.44%；同期业绩比较基准收益率为-4.61%。

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 年上半年市场拐头向下，调整幅度明显，我们认为主要源于以下几个原因：1) 国内经济存在一定的下行压力，房地产和基建投资在去杠杆的大背景下持续承压，对相关产业链企业的盈利预期产生负面影响；2) 监管层对去杠杆的推动使到市场资金面收紧，从而使到估值中枢承压。在指数下行的背景下，结构分化显著，部分医药股和消费股表现较好，如果说去年是“二八行情”，那今年就是“一九行情”。展望未来，在去杠杆和经济新旧动能转换的大背景下，结构分化行情将持续，以消费升级和制造升级为代表的新经济产业或是超额收益的方向。

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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，截至报告期末，以上情况未消除。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，且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

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，本基金托管人在对《平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金》的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金的管理人平安大华基金管理有限公司在平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安大华基金管理有限公司编制和披露的平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安大华睿享文娱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
资产：			
银行存款		15,324,540.49	7,485,596.35
结算备付金		286,918.65	719,457.09
存出保证金		233,393.83	217,268.90
交易性金融资产		26,668,617.60	33,787,946.51
其中：股票投资		26,668,617.60	33,787,946.51
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		1,903,395.61	2,571,853.47
应收利息		2,760.05	1,802.28
应收股利		-	-
应收申购款		115,440.44	55,798.95
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		44,535,066.67	44,839,723.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		735,563.88	1,294,219.11
应付赎回款		304,312.88	73,703.23
应付管理人报酬		55,970.23	53,818.33
应付托管费		9,328.38	8,969.73
应付销售服务费		21,899.49	24,901.44
应付交易费用		191,097.13	443,376.10

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		103,819.65	210,027.69
负债合计		1,421,991.64	2,109,015.63
所有者权益：			
实收基金		37,696,891.14	37,299,241.85
未分配利润		5,416,183.89	5,431,466.07
所有者权益合计		43,113,075.03	42,730,707.92
负债和所有者权益总计		44,535,066.67	44,839,723.55

注：

1. 报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 37,696,891.14 份，其中下属 A 类基金份额 10,202,044.29 份，C 类基金份额 27,494,846.85 份。下属 A 类基金份额净值 1.160 元，C 类基金份额净值 1.138 元。

6.2 利润表

会计主体：平安大华睿享文娱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
一、收入		1,160,501.83	5,974,464.44
1.利息收入		46,380.41	85,830.78
其中：存款利息收入		46,380.41	77,607.11
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	8,223.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,648,249.59	4,348,729.06
其中：股票投资收益		1,402,461.29	4,025,970.38
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		245,788.30	322,758.68
3.公允价值变动收益（损失以		-612,063.28	1,534,880.02

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		77,935.11	5,024.58
减:二、费用		1,831,993.60	2,431,670.47
1. 管理人报酬		345,204.81	364,371.08
2. 托管费		57,534.21	60,728.54
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	137,732.48	162,127.70
4. 交易费用		1,178,841.34	1,686,675.63
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		112,680.76	157,767.52
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-671,491.77	3,542,793.97
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-671,491.77	3,542,793.97

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 平安大华睿享文娱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)	37,299,241.85	5,431,466.07	42,730,707.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-671,491.77	-671,491.77
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)	397,649.29	656,209.59	1,053,858.88
其中: 1.基金申购款	35,626,689.22	6,348,561.83	41,975,251.05
2. 基金赎回款	-35,229,039.93	-5,692,352.24	-40,921,392.17
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）	37,696,891.14	5,416,183.89	43,113,075.03
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	58,326,789.30	-4,096,342.12	54,230,447.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	3,542,793.97	3,542,793.97
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）	-16,910,471.08	690,516.32	-16,219,954.76
其中：1.基金申购款	390,548.84	-18,484.40	372,064.44
2.基金赎回款	-17,301,019.92	709,000.72	-16,592,019.20
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）	41,416,318.22	136,968.17	41,553,286.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安大华睿享文娱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]第 170 号《关于准予平安大华睿享文娱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《平安大华睿享文娱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人民币 399,836,477.64 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(2016)第 335 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 399,852,632.86 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,155.22 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，基金托管人为广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华睿享文娱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× 50% + 中证综合债券指数收益率× 50%。

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》、《平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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
广发证券股份有限公司(“广发证券”)	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
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、 基金销售机构
中国平安人寿保险股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、 基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 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
广发证券	783,252,904.40	100.00%	1,130,101,564.93	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

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	
	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
广发证券	-	-	25,100,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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
广发证券	713,778.53	100.00%	191,097.13	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	1,029,861.52	100.00%	574,079.46	100.00%

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	345,204.81	364,371.08
其中：支付销售机构的客户维护费	154,432.28	182,749.47

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	57,534.21	60,728.54

注：支付基金托管人广发证券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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华睿享文娱灵活配置 A	平安大华睿享文娱灵活配置 C	合计
平安大华基金管理有限公司	-	17,406.01	17,406.01
广发证券股份有限公司	-	82,433.23	82,433.23
平安银行股份有限公司	-	2,674.48	2,674.48
上海陆金所基金销售有限公司	-	93.58	93.58
中国平安人寿保险股份有限公司	-	32,723.97	32,723.97
合计	-	135,331.27	135,331.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	平安大华睿享文娱 灵活配置 A	平安大华睿享文娱 灵活配置 C	合计
平安大华基金管理有限 公司	-	2,515.71	2,515.71
广发证券股份有限公司	-	154,583.11	154,583.11
平安银行股份有限公司	-	1,572.54	1,572.54
上海陆金所基金销售有 限公司	-	3.62	3.62
合计	-	158,674.98	158,674.98

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

日销售服务费 = C 类基金前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

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

本基金于本期及上年度可比期间均未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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券	15,324,540.49	38,199.10	3,948,927.31	68,254.26

注：本基金的银行存款由基金托管人广发证券保管，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

本基金于本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

本基金于本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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
600745	闻泰科技	2018 年 4 月 17 日	重大事项	26.29	-	-	15,400	447,265.00	404,866.00	-

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 08 月 27 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	26,668,617.60	59.88
	其中：股票	26,668,617.60	59.88
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	15,611,459.14	35.05
7	其他各项资产	2,254,989.93	5.06
8	合计	44,535,066.67	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	-	-
C	制造业	22,220,487.60	51.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,238,291.00	5.19
G	交通运输、仓储和邮政业	410,552.00	0.95
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	1,799,287.00	4.17
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	26,668,617.60	61.86

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	600741	华域汽车	85,900	2,037,548.00	4.73
2	601799	星宇股份	31,500	1,886,535.00	4.38
3	002727	一心堂	49,500	1,606,275.00	3.73
4	603228	景旺电子	31,900	1,577,136.00	3.66
5	002206	海利得	290,000	1,447,100.00	3.36
6	600763	通策医疗	28,100	1,367,627.00	3.17
7	600660	福耀玻璃	53,000	1,362,630.00	3.16
8	300628	亿联网络	19,700	1,298,427.00	3.01
9	002304	洋河股份	9,400	1,237,040.00	2.87
10	600104	上汽集团	34,000	1,189,660.00	2.76

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	300122	智飞生物	9,605,611.95	22.48
2	601601	中国太保	8,815,940.35	20.63
3	002304	洋河股份	8,450,955.38	19.78
4	600741	华域汽车	7,648,314.53	17.90
5	600029	南方航空	7,218,538.00	16.89
6	001979	招商蛇口	7,181,286.00	16.81
7	600030	中信证券	6,891,167.00	16.13
8	600104	上汽集团	6,322,917.49	14.80
9	600887	伊利股份	6,051,171.00	14.16
10	601336	新华保险	5,791,783.01	13.55
11	002078	太阳纸业	5,774,365.00	13.51
12	300142	沃森生物	5,717,118.00	13.38
13	000830	鲁西化工	5,384,461.10	12.60
14	601233	桐昆股份	4,795,817.00	11.22
15	600740	山西焦化	4,496,367.00	10.52
16	002179	中航光电	4,495,419.61	10.52
17	600690	青岛海尔	4,448,420.39	10.41
18	601877	正泰电器	4,443,215.18	10.40
19	002032	苏泊尔	4,402,803.00	10.30
20	600519	贵州茅台	4,272,488.00	10.00
21	300232	洲明科技	4,075,009.20	9.54
22	000858	五粮液	3,985,085.00	9.33
23	603595	东尼电子	3,731,630.00	8.73
24	300476	胜宏科技	3,690,894.60	8.64
25	000069	华侨城 A	3,668,803.00	8.59
26	000651	格力电器	3,648,160.00	8.54
27	000333	美的集团	3,538,865.00	8.28
28	603228	景旺电子	3,527,690.00	8.26
29	600048	保利地产	3,417,733.00	8.00
30	002648	卫星石化	3,367,321.00	7.88
31	002680	长生生物	3,364,848.00	7.87
32	601888	中国国旅	3,317,660.58	7.76
33	600115	东方航空	3,309,776.00	7.75
34	601398	工商银行	3,164,723.00	7.41
35	300628	亿联网络	3,129,598.10	7.32
36	002027	分众传媒	3,076,918.00	7.20

37	600196	复星医药	3,074,443.00	7.19
38	600809	山西汾酒	3,007,473.71	7.04
39	600660	福耀玻璃	2,942,700.86	6.89
40	000581	威孚高科	2,897,587.37	6.78
41	600019	宝钢股份	2,897,290.00	6.78
42	600585	海螺水泥	2,889,711.04	6.76
43	603626	科森科技	2,741,769.00	6.42
44	002044	美年健康	2,707,428.60	6.34
45	601939	建设银行	2,693,849.00	6.30
46	002859	洁美科技	2,667,592.00	6.24
47	600581	八一钢铁	2,623,486.00	6.14
48	601988	中国银行	2,598,961.00	6.08
49	601818	光大银行	2,597,538.00	6.08
50	600529	山东药玻	2,596,011.44	6.08
51	601607	上海医药	2,530,276.46	5.92
52	000671	阳光城	2,527,932.00	5.92
53	002268	卫士通	2,487,610.75	5.82
54	000921	海信科龙	2,400,771.00	5.62
55	603799	华友钴业	2,368,048.00	5.54
56	000338	潍柴动力	2,366,385.00	5.54
57	002419	天虹股份	2,346,676.00	5.49
58	601111	中国国航	2,292,861.20	5.37
59	600779	水井坊	2,280,797.00	5.34
60	002614	奥佳华	2,265,863.98	5.30
61	600745	闻泰科技	2,198,091.00	5.14
62	603040	新坐标	2,163,228.00	5.06
63	601288	农业银行	2,142,819.00	5.01
64	600276	恒瑞医药	2,124,819.00	4.97
65	600383	金地集团	2,074,816.00	4.86
66	601088	中国神华	2,044,418.00	4.78
67	002472	双环传动	2,039,309.00	4.77
68	601799	星宇股份	2,010,944.00	4.71
69	603179	新泉股份	2,002,910.18	4.69
70	002727	一心堂	1,990,661.00	4.66
71	600426	华鲁恒升	1,989,041.00	4.65
72	601699	潞安环能	1,975,677.20	4.62

73	600066	宇通客车	1,923,328.84	4.50
74	300357	我武生物	1,911,071.20	4.47
75	000860	顺鑫农业	1,862,850.00	4.36
76	002901	大博医疗	1,819,806.08	4.26
77	000703	恒逸石化	1,795,815.00	4.20
78	300418	昆仑万维	1,792,800.00	4.20
79	603788	宁波高发	1,786,540.00	4.18
80	600990	四创电子	1,769,944.77	4.14
81	600771	广誉远	1,717,499.00	4.02
82	300367	东方网力	1,597,940.00	3.74
83	000725	京东方 A	1,590,575.00	3.72
84	600028	中国石化	1,563,380.00	3.66
85	600867	通化东宝	1,556,909.00	3.64
86	002206	海利得	1,556,272.00	3.64
87	002262	恩华药业	1,552,360.00	3.63
88	300567	精测电子	1,541,474.00	3.61
89	002466	天齐锂业	1,539,402.00	3.60
90	300630	普利制药	1,526,868.37	3.57
91	601933	永辉超市	1,516,415.00	3.55
92	002511	中顺洁柔	1,482,561.00	3.47
93	300003	乐普医疗	1,424,793.00	3.33
94	600754	锦江股份	1,423,428.00	3.33
95	600297	广汇汽车	1,375,078.77	3.22
96	600038	中直股份	1,368,152.00	3.20
97	603989	艾华集团	1,365,220.00	3.19
98	600763	通策医疗	1,353,494.72	3.17
99	002372	伟星新材	1,343,937.50	3.15
100	300323	华灿光电	1,343,051.00	3.14
101	300316	晶盛机电	1,342,135.00	3.14
102	600211	西藏药业	1,332,926.00	3.12
103	600461	洪城水业	1,330,354.00	3.11
104	603337	杰克股份	1,330,140.00	3.11
105	300389	艾比森	1,329,806.00	3.11
106	002202	金风科技	1,318,394.00	3.09
107	300045	华力创通	1,317,248.00	3.08
108	603883	老百姓	1,315,910.00	3.08

109	600036	招商银行	1,313,071.00	3.07
110	601155	新城控股	1,301,440.40	3.05
111	601899	紫金矿业	1,296,570.00	3.03
112	000960	锡业股份	1,262,095.00	2.95
113	000887	中鼎股份	1,196,093.00	2.80
114	300601	康泰生物	1,194,157.00	2.79
115	300596	利安隆	1,190,504.00	2.79
116	300183	东软载波	1,142,017.00	2.67
117	603517	绝味食品	1,117,614.00	2.62
118	002048	宁波华翔	1,117,254.10	2.61
119	002493	荣盛石化	1,116,418.00	2.61
120	600056	中国医药	1,115,623.00	2.61
121	600720	祁连山	1,086,823.00	2.54
122	002035	华帝股份	1,069,325.00	2.50
123	002563	森马服饰	1,044,465.00	2.44
124	002142	宁波银行	1,016,070.40	2.38
125	002222	福晶科技	1,012,074.11	2.37
126	601688	华泰证券	1,004,597.00	2.35
127	002672	东江环保	992,495.00	2.32
128	603708	家家悦	972,721.60	2.28
129	002128	露天煤业	962,396.00	2.25
130	002019	亿帆医药	955,385.00	2.24
131	002589	瑞康医药	908,640.00	2.13
132	002690	美亚光电	907,259.00	2.12
133	300144	宋城演艺	907,031.00	2.12
134	000963	华东医药	896,644.00	2.10
135	300383	光环新网	894,372.00	2.09
136	000066	中国长城	893,792.00	2.09
137	002449	国星光电	893,693.00	2.09
138	300351	永贵电器	889,973.00	2.08
139	600760	中航沈飞	888,940.00	2.08
140	002195	二三四五	886,428.00	2.07
141	300012	华测检测	884,916.00	2.07
142	002124	天邦股份	882,138.00	2.06
143	300673	佩蒂股份	881,365.00	2.06
144	600329	中新药业	876,167.00	2.05

145	300010	立思辰	874,593.00	2.05
146	600271	航天信息	874,540.40	2.05
147	002508	老板电器	870,155.00	2.04
148	603387	基蛋生物	869,027.98	2.03
149	600885	宏发股份	867,963.63	2.03
150	002460	赣锋锂业	865,150.00	2.02
151	300470	日机密封	861,342.62	2.02
152	000933	神火股份	860,922.00	2.01
153	002146	荣盛发展	857,249.00	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	601601	中国太保	10,526,067.00	24.63
2	300122	智飞生物	9,706,427.58	22.72
3	002304	洋河股份	9,046,043.58	21.17
4	600029	南方航空	7,565,426.18	17.70
5	601336	新华保险	7,337,405.62	17.17
6	001979	招商蛇口	7,212,590.18	16.88
7	600104	上汽集团	7,163,924.68	16.77
8	600030	中信证券	6,914,956.00	16.18
9	300142	沃森生物	6,594,525.00	15.43
10	600741	华域汽车	5,853,709.91	13.70
11	000651	格力电器	5,742,204.00	13.44
12	002032	苏泊尔	5,710,105.49	13.36
13	600519	贵州茅台	5,698,196.72	13.34
14	000830	鲁西化工	5,510,211.79	12.90
15	002078	太阳纸业	5,505,053.47	12.88
16	600887	伊利股份	5,219,542.00	12.21
17	600740	山西焦化	4,861,145.00	11.38
18	000858	五粮液	4,840,715.00	11.33
19	601877	正泰电器	4,683,466.19	10.96
20	601233	桐昆股份	4,640,573.62	10.86
21	600690	青岛海尔	4,337,831.97	10.15
22	600809	山西汾酒	4,188,705.69	9.80

23	002179	中航光电	4,155,667.52	9.73
24	603595	东尼电子	4,019,700.00	9.41
25	300232	洲明科技	3,963,098.00	9.27
26	002680	长生生物	3,936,631.00	9.21
27	601939	建设银行	3,799,867.84	8.89
28	600048	保利地产	3,618,820.00	8.47
29	600036	招商银行	3,608,229.90	8.44
30	000333	美的集团	3,581,904.42	8.38
31	300476	胜宏科技	3,491,512.20	8.17
32	002648	卫星石化	3,424,169.80	8.01
33	000671	阳光城	3,385,407.00	7.92
34	600115	东方航空	3,349,130.00	7.84
35	601888	中国国旅	3,336,533.10	7.81
36	000069	华侨城 A	3,326,338.00	7.78
37	600196	复星医药	3,157,043.00	7.39
38	601398	工商银行	3,134,149.00	7.33
39	600019	宝钢股份	3,117,110.00	7.29
40	600585	海螺水泥	2,885,454.00	6.75
41	002027	分众传媒	2,874,932.00	6.73
42	002859	洁美科技	2,861,708.00	6.70
43	000581	威孚高科	2,757,253.00	6.45
44	002268	卫士通	2,721,893.46	6.37
45	600581	八一钢铁	2,518,214.00	5.89
46	603626	科森科技	2,512,715.00	5.88
47	601607	上海医药	2,484,611.00	5.81
48	600529	山东药玻	2,417,184.00	5.66
49	601988	中国银行	2,374,554.00	5.56
50	002419	天虹股份	2,348,656.00	5.50
51	002511	中顺洁柔	2,336,966.00	5.47
52	603799	华友钴业	2,322,502.00	5.44
53	601818	光大银行	2,300,843.00	5.38
54	000703	恒逸石化	2,294,447.50	5.37
55	600779	水井坊	2,278,544.00	5.33
56	601111	中国国航	2,277,998.00	5.33
57	000338	潍柴动力	2,266,020.00	5.30
58	002048	宁波华翔	2,264,802.00	5.30
59	603040	新坐标	2,253,517.00	5.27
60	600276	恒瑞医药	2,175,224.00	5.09

61	002044	美年健康	2,174,316.60	5.09
62	300316	晶盛机电	2,155,313.00	5.04
63	002202	金风科技	2,147,353.00	5.03
64	300357	我武生物	2,146,233.00	5.02
65	600745	闻泰科技	2,135,005.30	5.00
66	000921	海信科龙	2,133,023.00	4.99
67	603179	新泉股份	2,103,053.22	4.92
68	600426	华鲁恒升	2,054,786.00	4.81
69	603228	景旺电子	2,046,714.00	4.79
70	002901	大博医疗	2,036,785.16	4.77
71	603708	家家悦	2,029,782.00	4.75
72	002472	双环传动	2,022,013.00	4.73
73	600383	金地集团	2,008,704.00	4.70
74	601088	中国神华	2,001,550.00	4.68
75	603788	宁波高发	1,938,561.50	4.54
76	000860	顺鑫农业	1,937,261.00	4.53
77	601699	潞安环能	1,925,531.00	4.51
78	601288	农业银行	1,904,427.00	4.46
79	002128	露天煤业	1,854,065.00	4.34
80	600066	宇通客车	1,832,293.54	4.29
81	300418	昆仑万维	1,795,064.00	4.20
82	300630	普利制药	1,792,500.00	4.19
83	300628	亿联网络	1,772,624.00	4.15
84	002019	亿帆医药	1,757,706.90	4.11
85	300567	精测电子	1,747,017.00	4.09
86	600990	四创电子	1,723,236.85	4.03
87	601899	紫金矿业	1,702,747.00	3.98
88	600660	福耀玻璃	1,588,444.00	3.72
89	002262	恩华药业	1,546,294.40	3.62
90	600028	中国石化	1,520,214.00	3.56
91	300367	东方网力	1,517,062.00	3.55
92	000725	京东方 A	1,496,728.00	3.50
93	002466	天齐锂业	1,486,335.00	3.48
94	601933	永辉超市	1,430,988.00	3.35
95	600038	中直股份	1,419,513.00	3.32
96	600754	锦江股份	1,417,833.00	3.32
97	600346	恒力股份	1,404,946.00	3.29
98	300389	艾比森	1,362,797.00	3.19

99	300323	华灿光电	1,342,001.00	3.14
100	000887	中鼎股份	1,324,895.00	3.10
101	603337	杰克股份	1,312,366.00	3.07
102	002372	伟星新材	1,311,362.00	3.07
103	600297	广汇汽车	1,290,069.00	3.02
104	600461	洪城水业	1,278,359.00	2.99
105	603989	艾华集团	1,273,334.00	2.98
106	000960	锡业股份	1,262,972.00	2.96
107	601222	林洋能源	1,254,658.50	2.94
108	002035	华帝股份	1,215,685.00	2.84
109	002614	奥佳华	1,213,932.00	2.84
110	300045	华力创通	1,213,096.00	2.84
111	300601	康泰生物	1,203,985.00	2.82
112	300183	东软载波	1,196,669.00	2.80
113	603517	绝味食品	1,126,466.00	2.64
114	002142	宁波银行	1,100,243.00	2.57
115	600056	中国医药	1,099,118.00	2.57
116	002493	荣盛石化	1,089,071.00	2.55
117	600720	祁连山	1,069,765.12	2.50
118	600211	西藏药业	1,055,198.00	2.47
119	601155	新城控股	1,044,894.00	2.45
120	002563	森马服饰	1,033,138.00	2.42
121	002222	福晶科技	1,008,562.00	2.36
122	000963	华东医药	1,001,865.00	2.34
123	601688	华泰证券	998,803.00	2.34
124	300003	乐普医疗	970,986.00	2.27
125	002672	东江环保	963,215.00	2.25
126	300012	华测检测	959,518.00	2.25
127	300673	佩蒂股份	926,969.00	2.17
128	600329	中新药业	919,569.00	2.15
129	002449	国星光电	910,885.00	2.13
130	002589	瑞康医药	908,695.00	2.13
131	600885	宏发股份	904,991.05	2.12
132	300383	光环新网	888,485.00	2.08
133	300010	立思辰	887,700.00	2.08
134	300351	永贵电器	880,829.93	2.06
135	300144	宋城演艺	878,141.10	2.06
136	002690	美亚光电	874,279.86	2.05

137	600760	中航沈飞	868,179.00	2.03
138	002508	老板电器	860,192.00	2.01
139	000066	中国长城	858,653.00	2.01
140	603515	欧普照明	858,434.00	2.01

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	387,671,588.74
卖出股票收入（成交）总额	395,581,315.66

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资情况。

7.10.2 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。

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情况。

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

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	233,393.83
2	应收证券清算款	1,903,395.61
3	应收股利	-
4	应收利息	2,760.05
5	应收申购款	115,440.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,254,989.93

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中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
平安大华睿享文娱灵活配置 A	387	26,361.87	0.00	0.00%	10,202,044.29	100.00%
平安大华睿享文娱灵活配置 C	3,010	9,134.50	4,500.63	0.02%	27,490,346.22	99.98%
合计	3,378	11,159.53	4,500.63	0.01%	37,692,390.51	99.99%

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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安大华睿享文娱灵活配置 A	110,487.36	1.0830%
	平安大华睿享文娱灵活配置 C	421,605.50	1.5334%
	合计	532,092.86	1.4115%

基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，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）

。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安大华睿享文娱灵活配置 A	0
	平安大华睿享文娱灵活配置 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	平安大华睿享文娱灵活配置 A	0
	平安大华睿享文娱灵活配置 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安大华睿享文 娱灵活配置 A	平安大华睿享文 娱灵活配置 C
基金合同生效日（2016 年 3 月 29 日）基金 份额总额	56,180,305.55	343,672,327.31
本报告期期初基金份额总额	5,002,570.44	32,296,671.41
本报告期基金总申购份额	8,177,952.46	27,448,736.76
减：本报告期基金总赎回份额	2,978,478.61	32,250,561.32
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,202,044.29	27,494,846.85

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	
广发证券	2	783,252,904.40	100.00%	713,778.53	100.00%	-

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。

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

本基金租用的证券公司交易单元本期无其他证券投资。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20180101-20180208	9,424,626.33	-	9,424,626.33	-	0.00%
	2	20180212-20180213	9,424,626.33	-	9,424,626.33	-	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。

上述持有份额占比的计算中，分母采用本基金下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

平安大华基金管理有限公司
2018 年 8 月 27 日