

平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF) 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2019 年 8 月 23 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	平安鼎弘混合(LOF)
场内简称	平安鼎弘
基金主代码	167003
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	2017年4月26日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	82,109,486.04份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年6月6日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金转为上市开放式基金(LOF)后,通过合理配置大类资产和精选投资标的,在严格控制下行风险和保持资产流动性的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金转为上市开放式基金(LOF)后,在积极把握宏观经济周期、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上,深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件,将事件性因素作为投资的主线,形成以事件驱动为核心的投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*80%
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。

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		平安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	郭明
	联系电话	0755-22626828	010-66105799
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105798

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	5,545,114.53
本期利润	5,473,483.10
加权平均基金份额本期利润	0.0575
本期基金份额净值增长率	4.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0635
期末基金资产净值	87,323,477.24
期末基金份额净值	1.0635

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	-0.82%	0.19%	1.50%	0.22%	-2.32%	-0.03%
过去三个月	-2.74%	0.25%	0.38%	0.29%	-3.12%	-0.04%
过去六个月	4.42%	0.42%	6.83%	0.30%	-2.41%	0.12%
过去一年	3.97%	0.32%	7.09%	0.30%	-3.12%	0.02%
自基金合同生效起至今	6.35%	0.25%	11.84%	0.24%	-5.49%	0.01%

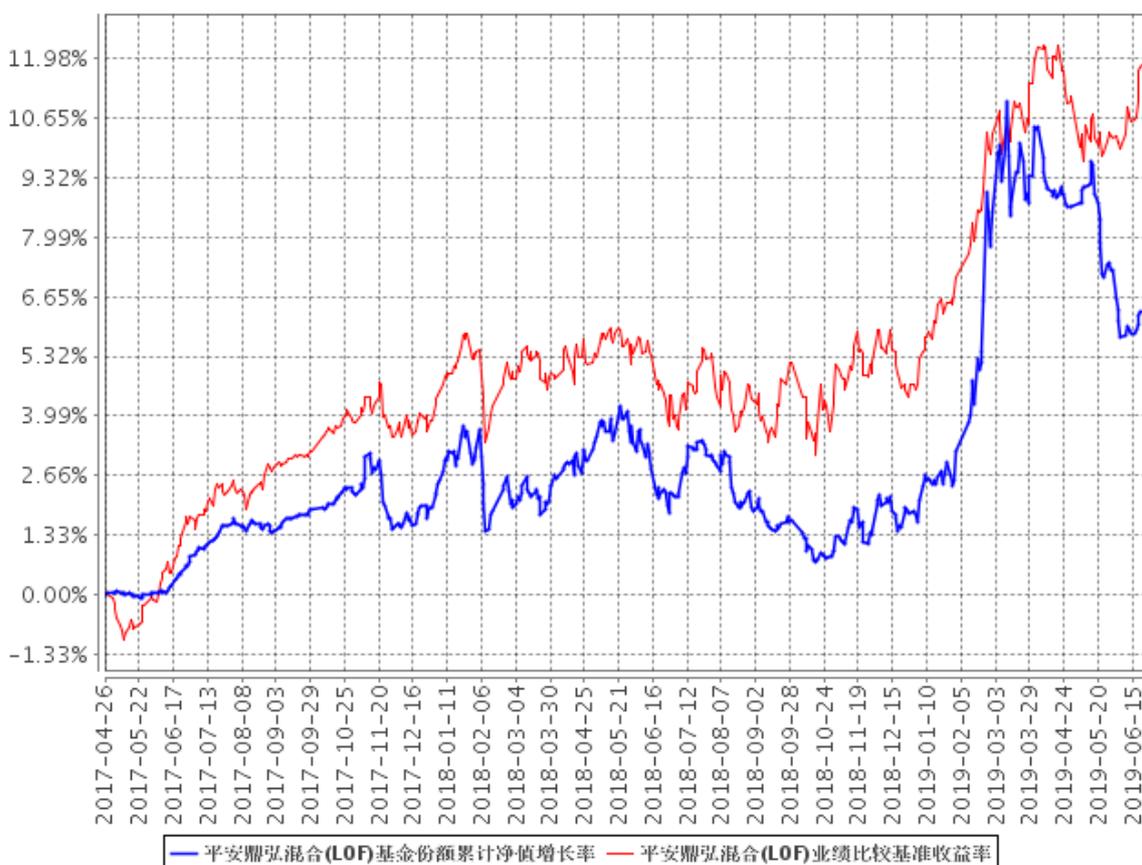
本基金业绩比较基准为中证综合债指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。沪深300指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场60%左右的市值，是中国A股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映A股市场总体发展趋势。中证综合债券指数是反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，

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

平安鼎弘混合(LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2017 年 4 月 26 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13亿元人民币。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股份68.19%；大华资产管理有限公司，持有股份17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份14.3%。

平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至2019年6月30日，平安基金共管理83只公募基金，公募基金管理总规模2877亿元人民币。

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		
高勇标	平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)的基金经理	2017年6月27日	-	8	高勇标先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017年4月加入平安基金管理有限公司，任投资研究部固定收益组投资经理，现任平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安安享灵活配置混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、平安惠泽纯债债券型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安中

					短债债券型证券投资基金、平安惠鸿纯债债券型证券投资基金、平安合意定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金基金经理。
刘俊廷	平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)的基金经理	2017年4月26日	-	7	刘俊廷先生,中国科学院研究生院硕士。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。2014年12月加入平安基金管理有限公司,现任平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、平安鼎越灵活配置混合型证券投资基金、平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安安心灵活配置混合型证券投资基金、平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金、平安新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理。
黄维	平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)的基金经理	2017年5月5日	2019年1月18日	8	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月加入平安基金管理有限公司,现任平安睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金、平安优势产业灵活配置混合型证券投资基金、平安安盈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、《平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)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。

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连续四个季度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。

4.3.2 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

2019年上半年宏观经济继续下滑，不过幅度有所放缓；通胀水平受猪肉价格上涨影响略有抬升，但总体较为温和可控。货币政策维持相对宽松状态，但同时强调“不搞大水漫灌”、防止“流动性幻觉”；社会融资余额增速企稳回升，企业融资需求有所改善。受上述因素影响，上半年利率债收益率呈区间震荡走势，信用债在一系列宽信用政策的推动下，整体表现较强，中高信用等级信用

利差继续压缩。股票市场则出现先扬后抑走势，本基金为追求稳健的投资收益，股票仓位根据市场情况先增后减，同时参与了可转债的波段操作，使基金净值表现保持相对平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，单位份额净值为 1.0635，累计份额净值为 1.0635，份额净值增长率为 4.42%，同期业绩比较基准增长率为 6.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金认为债市收益率重心有望继续震荡下行。一方面，经济内生动能仍然不足，基本面仍然偏弱；通胀压力阶段性高点已过，对货币政策的制约减弱；另一方面，货币政策降成本、控风险依然是核心目标，未来宽松主基调未变；此外，欧美日等发达国家经济持续疲弱，全球降息潮来临，对国内债市同样偏友好。不过，考虑到国内货币政策以结构性调整为主，不搞大水漫灌，下半年资金面预期可能会有反复。综上，本基金认为流动性较好的中短端品种仍有较高投资价值，将保持高比例配置力度。对于长端品种，将根据经济形势和市场情况进行波段操作，以增强基金整体收益率。股市则选择业绩稳健，估值较低的龙头展望下半年，本基金认为债市收益率重心有望继续震荡下行。一方面，经济内生动能仍然不足，基本面仍然偏弱；通胀压力阶段性高点已过，对货币政策的制约减弱；另一方面，货币政策降成本、控风险依然是核心目标，未来宽松主基调未变；此外，欧美日等发达国家经济持续疲弱，全球降息潮来临，对国内债市同样偏友好。不过，考虑到国内货币政策以结构性调整为主，不搞大水漫灌，下半年资金面预期可能会有反复。综上，本基金认为流动性较好的中短端品种仍有较高投资价值，将保持高比例配置力度。对于长端品种，将根据经济形势和市场情况进行波段操作，以增强基金整体收益率。股市则选择业绩稳健，估值较低的龙头白马股，以及有政策红利驱动的主题标的。白马股，以及有政策红利驱动的主题标的。

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。

4.7 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 5,000 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，本基金托管人在对平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)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，平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)的管理人——平安基金管理有限公司在平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)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，平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)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

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)2019年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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：平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	31,730,433.86	38,896,535.66
结算备付金		1,907,193.11	357,351.37
存出保证金		74,322.81	74,748.00
交易性金融资产	6.4.7.2	57,572,467.57	113,887,976.19
其中：股票投资		1,968,106.00	14,032,945.00
基金投资		-	-
债券投资		55,604,361.57	99,855,031.19
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	6,716,229.62
应收利息	6.4.7.5	347,777.40	1,998,017.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	98.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		91,632,194.75	161,930,956.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	38,000,000.00
应付证券清算款		4,001,071.74	11,818,385.30
应付赎回款		52,693.47	47,943.17
应付管理人报酬		86,163.56	116,679.35
应付托管费		17,950.72	24,308.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	25,914.37	112,339.99
应交税费		676.37	2,345.29

应付利息		-	31,734.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	124,247.28	267,019.32
负债合计		4,308,717.51	50,420,754.87
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	82,109,486.04	109,488,536.29
未分配利润	6.4.7.10	5,213,991.20	2,021,665.60
所有者权益合计		87,323,477.24	111,510,201.89
负债和所有者权益总计		91,632,194.75	161,930,956.76

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0635 元，累计份额净值 1.0635 元，基金份额总额 82,109,486.04 份。

6.2 利润表

会计主体：平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
一、收入		6,845,756.95	4,235,720.55
1.利息收入		1,500,729.35	5,154,474.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	51,520.83	114,522.85
债券利息收入		1,383,067.97	5,014,812.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		66,140.55	25,139.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,395,694.64	-606,394.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,380,628.55	-929,081.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,015,066.09	131,611.83
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	191,075.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-71,631.43	-312,359.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	20,964.39	-
减：二、费用		1,372,273.85	3,548,604.95

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	605,519.59	1,240,186.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	126,149.92	258,372.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	267,800.71	635,120.86
5. 利息支出		228,549.49	1,209,902.14
其中：卖出回购金融资产支出		228,549.49	1,209,902.14
6. 税金及附加		2,375.37	16,700.97
7. 其他费用	6.4.7.20	141,878.77	188,322.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,473,483.10	687,115.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,473,483.10	687,115.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	109,488,536.29	2,021,665.60	111,510,201.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,473,483.10	5,473,483.10
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）	-27,379,050.25	-2,281,157.50	-29,660,207.75
其中：1.基金申购款	92,173.14	8,362.13	100,535.27
2.基金赎回款	-27,471,223.39	-2,289,519.63	-29,760,743.02
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）	82,109,486.04	5,213,991.20	87,323,477.24

项目	上年度可比期间 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)	202,701,052.24	3,963,439.36	206,664,491.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	687,115.60	687,115.60
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)	202,701,052.24	4,650,554.96	207,351,607.20

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	林婉文	张南南
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)(原名为平安大华鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安大华鼎弘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]3140号《关于准予平安大华鼎弘混合型证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于2018年10月25日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鼎弘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 202,573,315.75 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 231 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华鼎弘混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 202,701,052.24 份基金份额,其中认购资金利息折合 127,736.49 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”),登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

经深交所深证上[2017]338 号文审核同意,本基金 34,793,864.00 份基金份额于 2017 年 6 月 6 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华鼎弘混合型证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安鼎弘混合型证券投资基金。

根据《平安大华鼎弘混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)至 18 个月后对应日前一个工作日止,本基金在封闭期内不办理申购赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所(以下简称“深交所”)转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF),投资人可在基金的开放日办理申购和赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鼎弘混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他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、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 20%+中证综合债指数收益率 \times 80%。

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》、《平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 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[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》、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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产

品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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
平安基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	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
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
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、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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	-	-	54,573,938.79	11.17%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	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 成交总额的比例
平安证券	61,888,523.60	11.03%	8,937,263.51	8.43%

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
平安证券	105,700,000.00	7.06%	375,766,000.00	7.53%

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 2019年1月1日至2019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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	38,818.40	11.17%	-	-

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。

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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	605,519.59	1,240,186.17
其中：支付销售机构的客	56,353.44	372,765.65

户维护费		
------	--	--

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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 × 1.20%/ 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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	126,149.92	258,372.11

注：支付基金托管行工商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

无

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

无

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

无

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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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
中国工商银行	31,730,433.86	38,139.52	1,532,471.46	75,391.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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（2019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**

6.4.9.1.1 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019年6月20日	2019年7月8日	新债未上市	100.00	100.00	240	23,999.79	23,999.79	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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。

§ 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	1,968,106.00	2.15
	其中：股票	1,968,106.00	2.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	55,604,361.57	60.68
	其中：债券	55,604,361.57	60.68
	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	33,637,626.97	36.71
8	其他各项资产	422,100.21	0.46
9	合计	91,632,194.75	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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,968,106.00	2.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,968,106.00	2.25

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	600036	招商银行	54,700	1,968,106.00	2.25

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半年度报告正文。

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	603233	大参林	5,133,928.73	4.60
2	300014	亿纬锂能	3,809,118.00	3.42
3	600036	招商银行	3,108,233.55	2.79
4	600031	三一重工	2,377,760.00	2.13
5	300498	温氏股份	2,080,520.28	1.87
6	601688	华泰证券	2,028,294.00	1.82

7	002234	民和股份	1,902,252.00	1.71
8	600566	济川药业	1,665,111.00	1.49
9	002100	天康生物	1,650,412.00	1.48
10	300609	汇纳科技	1,648,506.00	1.48
11	002368	太极股份	1,608,447.00	1.44
12	002299	圣农发展	1,595,112.00	1.43
13	300601	康泰生物	1,528,812.00	1.37
14	300012	华测检测	1,447,246.00	1.30
15	600845	宝信软件	1,404,876.00	1.26
16	300496	中科创达	1,369,046.00	1.23
17	300520	科大国创	1,332,961.00	1.20
18	300274	阳光电源	1,257,097.72	1.13
19	002348	高乐股份	1,136,280.00	1.02
20	601818	光大银行	1,113,982.00	1.00

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。

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	603233	大参林	4,675,762.40	4.19
2	300014	亿纬锂能	3,916,241.00	3.51
3	300271	华宇软件	2,525,283.00	2.26
4	600529	山东药玻	2,478,881.80	2.22
5	600031	三一重工	2,431,861.00	2.18
6	300498	温氏股份	2,029,373.00	1.82
7	601688	华泰证券	2,010,439.00	1.80
8	600845	宝信软件	2,009,554.00	1.80
9	002100	天康生物	1,737,505.00	1.56
10	600566	济川药业	1,730,271.00	1.55
11	300609	汇纳科技	1,716,237.00	1.54
12	002234	民和股份	1,600,310.00	1.44
13	002368	太极股份	1,579,037.00	1.42
14	300012	华测检测	1,478,778.00	1.33
15	300601	康泰生物	1,458,921.42	1.31
16	002299	圣农发展	1,390,699.88	1.25

17	300496	中科创达	1,386,703.00	1.24
18	002876	三利谱	1,365,114.00	1.22
19	300520	科大国创	1,326,476.30	1.19
20	300274	阳光电源	1,250,670.44	1.12

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	85,084,221.56
卖出股票收入（成交）总额	98,620,319.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	35,050,500.00	40.14
	其中：政策性金融债	35,050,500.00	40.14
4	企业债券	6,722,760.00	7.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	13,831,101.57	15.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,604,361.57	63.68

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	190210	19 国开 10	200,000	20,064,000.00	22.98
2	190203	19 国开 03	100,000	9,936,000.00	11.38
3	112690	18 广发 01	66,000	6,722,760.00	7.70
4	108602	国开 1704	50,000	5,050,500.00	5.78
5	132013	17 宝武 EB	25,250	2,523,485.00	2.89

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

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。

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	74,322.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	347,777.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	422,100.21

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132013	17 宝武 EB	2,523,485.00	2.89
2	132007	16 凤凰 EB	1,978,000.00	2.27
3	132011	17 浙报 EB	1,567,040.00	1.79
4	110040	生益转债	1,330,300.00	1.52
5	127005	长证转债	1,159,800.00	1.33
6	128027	崇达转债	1,154,975.28	1.32
7	132006	16 皖新 EB	1,151,480.00	1.32
8	128036	金农转债	677,850.00	0.78
9	113517	曙光转债	541,750.00	0.62
10	123002	国祯转债	243,092.50	0.28

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不存在流通受限的情况。

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

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
547	150,108.75	74,007,990.00	90.13%	8,101,496.04	9.87%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	李文	50,018.00	27.27%
2	张益慧	30,011.00	16.36%
3	熊艳	21,005.00	11.45%
4	金福元	19,002.00	10.36%
5	钱中明	13,739.00	7.49%
6	林育麟	11,200.00	6.11%
7	刘志萍	10,003.00	5.45%
8	鲍志兰	5,702.00	3.11%
9	湛艳	5,001.00	2.73%
10	郑红梅	4,001.00	2.18%

8.3 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	312.80	0.0004%

8.4 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	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（2017年4月26日）基金份额总额	202,701,052.24
本报告期期初基金份额总额	109,488,536.29
本报告期期间基金总申购份额	92,173.14
减：本报告期期间基金总赎回份额	27,471,223.39
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	82,109,486.04

§ 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

1、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2、经平安基金管理有限公司（以下简称“公司”）2019年第三次股东会议审议通过，由薛世峰先生接替李兆良先生任职公司的独立董事，任职日期为2019年6月7日。

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，公司收到监管机构对我司采取责令改正措施的决定、对相关责任人出具警示函的决定。公司高度重视，制定并实施相关整改措施，及时向监管机构提交整改报告。报告期内，公司已完成整改。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	
中泰证券	2	87,604,197.38	47.69%	62,311.87	47.69%	-
太平洋证券	3	58,938,817.95	32.08%	41,923.01	32.08%	-
中信建投	2	29,776,595.70	16.21%	21,180.17	16.21%	-
海通证券	4	4,158,589.00	2.26%	2,957.90	2.26%	-
爱建证券	2	3,226,340.55	1.76%	2,294.75	1.76%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	新增

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
中泰证券	179,967,586.78	32.09%	516,540,000.00	34.48%	-	-
太平洋证券	138,044,321.82	24.61%	295,650,000.00	19.73%	-	-

中信建投	43,152,475.56	7.69%	10,000,000.00	0.67%	-	-
海通证券	63,956,652.23	11.40%	85,000,000.00	5.67%	-	-
爱建证券	69,641,887.81	12.42%	485,213,000.00	32.39%	-	-
平安证券	61,888,523.60	11.03%	105,700,000.00	7.06%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	4,239,442.24	0.76%	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

§ 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	2019/01/01—2019/06/30	34,003,590.00	0.00	0.00	34,003,590.00	41.41%
	2	2019/01/01—2019/06/30	40,004,400.00	0.00	0.00	40,004,400.00	48.72%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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 5,000 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。</p>							

平安基金管理有限公司

2019年8月23日