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。
下属分级基金的风险收益特征	平安大华睿享文娱混合A:- 平安大华睿享文娱混合C:-

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	陈释正	崔瑞明
	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

基金规模	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%	0.84%	-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%
自基金合同生效起至今	16.00%	0.75%	8.58%	0.43%	7.42%	0.32%

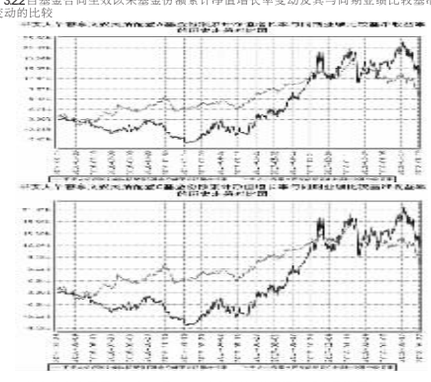
平安大华睿享文娱灵活配置C

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%	0.84%	-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



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[2013]197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%;三亚盈海旅业有限公司,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,不断丰富的客户服务手段及服务内容,为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务,从而实现"以专业承载信赖"的品牌承诺,成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至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		
黄隽	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	黄隽先生,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型证券投资基金、平安大华惠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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华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投票和债券的同向交易价差专项分析,对本报告期内,两两组合同单日、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、交易占优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的真实、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
负债和所有者权益合计		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"-"号填列)		- 612,063.28	1,534,880.02
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(本期利润)	-	- 671,491.77	- 671,491.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(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(本期利润)	-	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(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:

罗春凤 林婉文 胡明

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

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70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0335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。

(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
三亚盈海旅业有限公司	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
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150%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×150%/当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	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
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末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
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