平安大华行业先锋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:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行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	平安大华行业先锋混合
场内简称	-
基金主代码	700001
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	2011年9月20日
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	216,647,904.44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	深入研究中国宏观经济、证券市场发展过程中的结构性和趋势性规律,把握不同行业在此变化趋势中可行的投资机会,以超越业绩比较基准表现为首要投资目标,并以追求基金资产的长期稳健回报为最终投资目标。
投资策略	本基金通过深入研究中国宏观经济、证券市场发展过程中的结构性和趋势性规律,全面准确地判断大类资产风险程度和收益前景,把握不同行业在此变化趋势中可行的投资机会。同时,重点围绕有效结合宏观研究、行业研究、量化研究和个股研究成果,转化为基金资产中长期的资本增值成果,并采用有效的风险控制措施增加投资组合收益的确定性。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金,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		平安大华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈婷芷	王永民
	联系电话	0755-22626828	010-66594896
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

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	基金管理人及基金托管人住所

§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	-2,576,117.89
本期利润	-9,513,530.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0416
本期基金份额净值增长率	-3.51%
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	0.1285
期末基金资产净值	244,477,453.41
期末基金份额净值	1.128

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未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如:基金的认购、申购、赎回费等,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

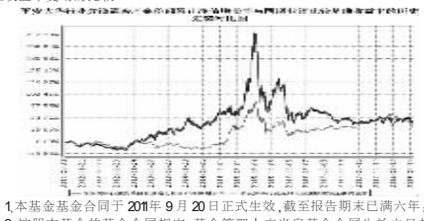
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.45%	1.46%	-6.44%	1.09%	0.99%	0.37%
过去三个月	-2.76%	1.14%	-8.17%	0.97%	5.41%	0.17%
过去六个月	-3.51%	1.22%	-10.41%	0.98%	6.90%	0.24%
过去一年	0.00%	1.12%	-2.88%	0.81%	2.88%	0.31%
过去三年	-41.28%	1.77%	-16.34%	1.26%	-24.94%	0.51%
自基金合同生效起至今	44.41%	1.66%	35.17%	1.26%	9.24%	0.40%

注:1.业绩比较基准:沪深300指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%。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。中证全债指数从沪深交易所和银行间市场挑选国债、金融债及企业债组成样本券,最大限度地涵盖了中国固定收益市场可供投资的产品,已成为广受投资者认可的投资中国固定收益市场的基准指标。本基金为混合型基金,通常状况下基金在运作过程中股票资产将在80%-90%范围内调整,中长期可能的股票仓位平均在85%左右。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准的权重分别是85%和15%。因此,该基准是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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2011年9月20日正式生效,截至报告期末已满六年;

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[2001]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		
刘杰	平安大华行业先锋混合型证券投资基金的基金经理	2018年4月23日	-	9	刘杰先生,外交学院经济学硕士研究生。曾先后担任金元证券投资银行部项目经理、天弘基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、嘉大基金管理有限公司专户投资部投资经理、基金经理等。2017年8月加入平安大华基金管理有限公司,曾担任投资研究部投资经理。现担任平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金、平安大华行业先锋混合型证券投资基金基金经理。
傅浩	平安大华行业先锋混合型证券投资基金的基金经理	2016年8月16日	-	9	傅浩先生,中山大学金融学硕士,9年证券从业经验,曾任国都证券有限责任公司行业研究员、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公司,任投资研究部投资经理,现任平安大华行业先锋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》、《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、《平安大华行业先锋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。

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。

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

2018年上半年中国经济呈现稳健运行态势,国内货币环境在金融去杠杆背景下保持中性偏谨慎,国际环境面临贸易保护等不确定因素。因此,2018年上半年本基金的投资策略为:重点关注内需驱动且对利率水平敏感度较低的行业及个股,并结合估值合理性、财务稳健性的角度选择品种。同时,对于成长性良好,资产质量健康且估值回落至合理区间的成长股也采取了择机介入的投资策略。并根据宏观、行业及个股估值等因素,动态调整投资组合。

2018年上半年,我们采取上述投资策略,寻找"有价值"+"真成长"的投资标的,并从风险可控、收益可期两个维度构建投资组合。持股周期偏中长期、操作稳健灵活,对医药、消费、及科技类成长股给予较大关注。我们希望以此投资策略进行运作,能够持续为持有人创造超额收益。

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1.128元;本报告期基金份额净值增长率为-3.51%,业绩比较基准收益率为-10.41%。

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年中国经济面临国内货币环境金融去杠杆、地产调控升级、债务违约风险暴露,而国际环境面临贸易摩擦等不确定因素,因此展望未来,我们预计中国经济存在增速放缓可能。在这种弱市环境下,我们认为证券市场仍将继续呈现结构性行情,"业绩为王"及"现金为王"将成为市场重点关注的投资方向。现金流好、杠杆率低、估值合理且业绩受政策调控影响较小的标的,将有望继续取得较好的相对收益。本基金将继续坚持价值+真成长的投资方向,加强研究覆盖,继续寻找优质标的进行投资。

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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对平安大华行业先锋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,对本基金管理人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。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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)、投资组合报告等数据真实、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:平安大华行业先锋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		34,419,579.19	42,990,905.56
结算备付金		1,718,184.48	2,865,066.32
存出保证金		188,742.43	237,547.66
交易性金融资产		206,072,429.98	246,834,389.83
其中:股票投资		193,838,380.08	246,834,389.83
基金投资		-	-
债券投资		12,234,049.90	-
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		4,944,678.67	3,862,998.25
应收利息		147,209.11	7,155.32
应收股利		-	-
应收申购款		44,981.24	73,493.32
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		247,535,805.10	296,871,556.26
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		344,348.67	11,231,192.55
应付赎回款		500,997.29	419,065.26
应付管理人报酬		312,491.27	349,455.27
应付托管费		52,081.86	58,242.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		499,314.96	1,280,353.57
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,349,117.64	1,425,964.96
负债合计		3,058,351.69	14,764,274.18
所有者权益:			
实收基金		216,647,904.44	241,233,514.27
未分配利润		27,829,548.97	40,873,767.81
所有者权益合计		244,477,453.41	282,107,282.08
负债和所有者权益总计		247,535,805.10	296,871,556.26

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.128元,累计份额净值1.408元,基金份额总额216,647,904.44份。

6.2利润表

会计主体:平安大华行业先锋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		-4,489,082.02	10,128,146.67
1.利息收入		579,895.83	210,217.80
其中:存款利息收入		126,407.50	210,217.80
债券利息收入		243,397.25	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		210,091.08	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,851,385.21	2,129,852.73
其中:股票投资收益		-496,536.84	-361,467.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-10,172.67	-
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		2,358,094.72	2,491,320.04
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-6,937,412.57	7,778,001.44
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		17,049.51	10,074.70
减:二、费用		5,024,448.44	11,828,834.89
1.管理人报酬		1,952,507.94	2,380,745.47
2.托管费		325,417.98	396,790.93
3.销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4.交易费用		2,546,050.82	8,842,257.74
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		200,471.70	209,040.75
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-9,513,530.46	-1,700,688.22
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-9,513,530.46	-1,700,688.22

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:平安大华行业先锋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)	241,233,514.27	40,873,767.81	282,107,282.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期净利润)	-	-9,513,530.46	-9,513,530.46
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)	-24,585,609.83	-3,530,688.38	-28,116,298.21
其中:1.基金申购款	10,906,075.03	1,661,024.79	12,567,099.82
2.基金赎回款	-35,491,684.86	-5,191,713.17	-40,683,398.03
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)	216,647,904.44	27,829,548.97	244,477,453.41

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)	292,993,192.19	39,514,807.65	332,507,999.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期净利润)	-	-1,700,688.22	-1,700,688.22
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)	-21,260,103.48	-3,002,060.76	-24,262,164.24
其中:1.基金申购款	11,076,955.20	1,442,714.80	12,519,670.00
2.基金赎回款	-32,337,058.68	-4,444,775.56	-36,781,834.24
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)	271,733,088.71	34,812,058.67	306,545,147.38

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

平安大华行业先锋混合型证券投资基金(原名为平安大华行业先锋股票型证券投资基金,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[2011]第1111号《关于核准平安大华行业先锋股票型证券投资基金募集的批复》的核准,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《平安大华行业先锋股票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3,197,219,239.94元,经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2011)验字第60937497_H01号验资报告。经向中国证监会备案,《平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金合同》于2011年9月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,198,155,247.37份基金份额,其中认购资金利息折合936,007.43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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,平安大华行业先锋股票型证券投资基金于2015年8月5日公告后更名为平安大华行业先锋混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华行业先锋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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-40%,其中权证投资比例不高于基金资产净值的3%,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%。

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》、《平安大华行业先锋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
中国银行股份有限公司(中国银行)	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
深证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

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
平安证券股份有限公司	5,297,798.00	0.29%	319,661,434.42	5.10%

6.4.8.12债券交易

本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.13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
平安证券股份有限公司	30,500,000.00	4.30%	-	-

6.4.8.14权证交易

本基金本报告期内无通过关联方进行的权证交易。

6.4.8.15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
平安证券股份有限公司	4,934.02	0.34%	4,934.02	0.99%
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
平安证券股份有限公司	297,700.93	5.77%	237,782.36	8.88%

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	1,952,507.94	2,380,745.47
其中:支付销售机构的客户维护费	504,393.14	622,799.58

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	325,417.98	396,790.93

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日的基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算方法如下:

日托管费=前一日的基金资产净值×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

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期期末和上年度可比期末均未投资本基金。

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
银行存款利息收入	-	-	-	-
深圳中行存款	34,419,579.19	105,874.75	29,364,789.24	165,445.31

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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
000540	中天金融	2017年8月18日	重大事项	4.18	-	-	12,450	65,699.00	52,041.00	-

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

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	193,838,380.08	78.31
	其中:股票	193,838,380.08	78.31
2	固定收益投资	12,234,049.90	4.94
	其中:债券	12,234,049.90	4.94
	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	36,137,763.67	14.60
7	其他各项资产	5,325,611.45	2.15
8	合计	247,535,805.10	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	7,771,608.00	3.18
C	制造业	116,248,632.18	47.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,844,278.45	8.12
G	交通运输、仓储和邮政业	9,937,967.86	4.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,427,776.00	3.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	52,041.00	0.02
L	租赁和商务服务业	16,288,653.30	6.66
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.03