平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 2018年半年度报告摘要

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。

基金托管人平安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。

原平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金报告期自2018年1月1日至2018年1月19日止,平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)报告期自2018年1月20日至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(转型后)

基金名称	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	平安大华鼎泰混合
场内简称	平安鼎泰
基金主代码	167001
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	2016年7月21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	462,721,029.60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	2016年10月18日

本基金转型日期为2018年1月20日,上述份额日期为2018年6月30日

2.1 基金基本情况(转型前)

基金名称	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	平安大华鼎泰混合
场内简称	平安鼎泰
基金主代码	167001
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2016年7月21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	1,318,879,411.68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	2016年10月18日

本基金转型日期为2018年1月20日,上述份额日期为2018年1月19日

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	本基金转为上市开放式基金(LOF)后,积极发掘可能对上市公司当前或未来价值产生重大影响的各类事件,通过筛选、鉴别事件信息扩散对资产价格的影响模式、选择最具有竞争优势的标的,在控制风险的前提下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,并更名为平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF),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×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

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	在严格控制风险的前提下,在基金合同生效后18个月内,灵活运用宏观预期投资等投资策略,充分挖掘市场投资机会,力争基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在合同生效后18个月内(含第18个月),通过对宏观经济、行业分析轮动效应与定向增发项目优势的深入研究基础上,利用定向增发项目的事件性特征与折价优势,优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资,将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线,形成以定向增发为核心的投资策略。
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

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
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路6033号平安金融中心34层	深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路6033号平安金融中心34层	深圳市罗湖区深南东路5047号
邮政编码		518048	518001
法定代表人		罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日
本期已实现收益	-59,962,550.82
本期利润	-56,713,777.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0976
本期加权平均净值利润率	-12.93%
本期基金份额净值增长率	-31.39%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月30日
期末可供分配利润	-145,247,763.22
期末可供分配基金份额利润	-0.3139
期末基金资产净值	317,473,266.38
期末基金份额净值	0.6861
3.1.3 累计期末指标	2018年6月30日
基金份额累计净值增长率	-31.39%

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。

转型前

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年1月19日
本期已实现收益	-120,763,017.32
本期利润	-6,318,402.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0048
本期加权平均净值利润率	-0.60%
本期基金份额净值增长率	-0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2018年1月19日
期末可供分配利润	-177,837,797.89
期末可供分配基金份额利润	-0.1348
期末基金资产净值	1,046,905,498.59
期末基金份额净值	0.7938
3.1.3 累计期末指标	2018年1月19日
基金份额累计净值增长率	-20.62%

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(转型后)

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

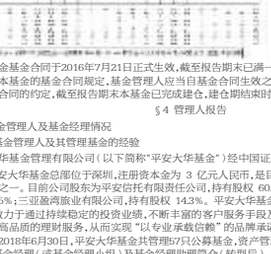
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.91%	1.41%	-3.57%	0.64%	-3.34%	0.77%
过去三个月	-8.79%	1.13%	-4.07%	0.57%	-4.72%	0.56%
自基金合同生效起至今	-13.57%	1.03%	-7.52%	0.60%	-6.05%	0.43%

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。

注:本基金在2018年1月20日转型,转型前过去一个月、过去三个月无完整数据,过去六个月为2018年1月1日至2018年1月19日,过去一年为2017年7月1日至2018年1月19日,基金合同生效以来为合同成立日至2018年1月19日。

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7月21日正式生效,截至报告期末已满一年;

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%;三亚盈鸿旅业有限公司,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(转型后)

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		
刘俊廷	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理	2016年7月21日	–	6	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。现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF),平安大华鼎益灵活配置混合型证券投资基金、平安大华新兴混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华保本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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型前)

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		
刘俊廷	平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2016年7月21日	–	6	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。现任平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鼎益灵活配置混合型证券投资基金、平安大华新兴混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华保本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、《平安大华鼎泰灵活配置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。

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

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")于2016年7月21日成立,自2018年1月20日起,本基金已转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"平安大华-鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)"。

目前A股不再是典型普涨普跌牛熊市,个股区间涨幅已是南辕北辙。资本市场改革及国际化正在深刻改变A股原有生态,"劣币驱逐良币"的历史一去不复返,绩优股的牛市仍在进行,绩劣股熊市愈演愈烈。因此在报告期内的投资标的选择上,本基金更关注主板中绩优、低估、高分红的蓝筹龙马,或者是中小创中业绩真实、内生成长的新经济领军企业。报告期内,本基金未参与新的定向增发。本基金持有的已经解禁的定增股票,基金管理人已经开始择机进行减持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末,本报告期(2018年1月20日-2018年6月30日)份额净值增长率为-13.57%,同期业绩比较基准增长率为-7.52%;

截至转型前报告期末,本报告期(2018年1月1日-2018年1月19日)份额净值增长率为-0.60%,同期业绩比较基准增长率为3.15%。

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,伴随国内金融强监管、中美贸易摩擦、汇率变化等因素,市场震荡下跌,风险偏好回落。在此背景下,经济增速或将有所放缓,但更加高质量、可持续。经济总体稳中趋缓、稳中有进、均衡发展。我国经济有韧性、外汇储备充足、汇率预期稳定,也决定了人民币汇率贬值空间有限。短期极端悲观的情绪使得市场已经处于中期的底部区域。风雨之后,彩虹可期。展望2018年下半年,投资风格上,追求业绩的确定性依旧是市场的主线,市场风格之争将逐步淡化,业绩为王依旧为贯穿全年的投资逻辑。

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,平安银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(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,完全履职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)(转型后)

6.1 资产负债表(转型后)

会计主体:平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

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
资 产:		
银行存款	6.4.7.1	18,979,140.39
结算备付金		2,547,129.48
存出保证金		517,799.93
交易性金融资产	6.4.7.2	295,511,201.96
其中:股票投资		295,511,201.96
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	6.4.7.3	–
买入返售金融资产	6.4.7.4	–
应收证券清算款		2,146,200.40
应收利息	6.4.7.5	12,036.48
应收股利		–
应收申购款		998.50
递延所得税资产		–
其他资产	6.4.7.6	–
资产总计		319,714,507.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30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		–
应付证券清算款		682,969.03
应付赎回款		427,458.11
应付管理人报酬		414,412.90
应付托管费		69,068.83
应付销售服务费		–
应付交易费用	6.4.7.7	464,520.00
应交税费		–
应付利息		–
应付利润		–
递延所得税负债		–
其他负债	6.4.7.8	182,811.89
负债合计		2,241,240.76
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	462,721,029.60
未分配利润	6.4.7.10	-145,247,763.22
所有者权益合计		317,473,266.38
负债和所有者权益总计		319,714,507.14

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.6861元,累计份额净值0.6861元,基金份额总额462,721,029.60份。

6.2 利润表

会计主体:平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入		-51,714,235.49
1.利息收入		1,061,375.34
其中:存款利息收入	6.4.7.11	366,660.38
债券利息收入		73,631.43
资产支持证券利息收入		–
买入返售金融资产收入		621,083.53
其他利息收入		–
2.投资收益(损失以"-"填列)		-57,890,719.25
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-60,709,609.41
基金投资收益		–
债券投资收益	6.4.7.13	2,683.03
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	2,816,207.13
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	3,248,773.29
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	1,866,335.13
减:二、费用		4,999,542.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,966,646.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	494,441.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	–
4. 交易费用	6.4.7.19	1,366,083.45
5. 利息支出		–
其中:卖出回购金融资产支出		–
6. 其他费用	6.4.7.20	172,370.92
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-56,713,777.53
减:所得税费用		–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-56,713,777.53

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月20日(基金合同生效日)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)	1,318,879,411.68	-271,973,913.09	1,046,905,498.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-56,713,777.53	-56,713,777.53
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)	-856,158,382.08	183,439,927.40	-672,718,454.68
其中:1.基金申购款	1,032,384.27	-238,237.89	794,146.38
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-857,190,766.35	183,678,165.29	-673,512,601.06
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)	462,721,029.60	-145,247,763.22	317,473,266.38

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:

_____罗春风_____ _____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

平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")于2016年7月21日成立,根据《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")及《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称"《招募说明书》")及相关公告的规定,根据本基金基金合同的约定,本基金的封闭期为基金合同生效之日(包括基金合同生效之日)至18个月(含18个月)后的对应日止(若该日为非工作日或无该对应日,则为该日之前的最后一个工作日)。本基金的封闭期为2016年7月21日至2018年1月19日。封闭期届满后,即自2018年1月20日起,本基金转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)",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《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等)、债券资产(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等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)、现金资产等货币市场工具,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

自本基金转换为上市开放式基金后,股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%,投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金净值的5%;本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;基金资产总值不得超过基金资产净值的140%。

本基金的业绩比较基准是:沪深300指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×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》、《平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金合同》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20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

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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、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
三亚盈鸿旅业有限公司	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: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

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

本基金于本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

本基金于本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

本基金于本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.5 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20日(基金合同生效日)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	16,177.33	2.06%	16,177.33	3.48%

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,966,646.56
其中:支付销售机构的客户维护费	610,454.28

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	494,441.11

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。

6.4.7.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的销售服务费。

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 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20日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期	18,979,140.39	366,660.38

本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.7.6 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。

6.4.7.7 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。

6.4.8 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 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	说明
000875	吉电股份	2017年1月3日	2019年1月4日	非公开发行流通受限	5.60	2.69	8,928,573	50,000,008.80	24,017,861.37	–
002344	海宁皮城	2016年12月22日	2018年12月26日	非公开发行流通受限	10.70	4.60	3,453,650	36,954,055.00	15,886,790.00	–
300370	安控科技	2016年9月7日	2018年9月13日	非公开发行流通受限	9.28	3.33	4,146,554	24,050,010.88	13,808,024.82	–
600579	天华院	2016年9月12日	2018年9月10日	非公开发行流通受限