平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF) 2018年年度报告摘要

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3月27日

§1 重要提示及目录

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3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31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	109,488,536.29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优质产业或影响的事件,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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年4月26日(基金合同生效日)-2017年12月31日	2016年
本期已实现收益	-1,600,257.59	4,211,992.19	–
本期利润	-1,044,316.32	3,963,439.36	–
加权平均基金份额本期利润	-0.0056	0.0196	–
本期基金份额净值增长率	-0.11%	1.96%	–
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0165	0.0196	–
期末基金资产净值	111,510,201.89	206,664,491.60	–
期末基金份额净值	1.0185	1.0196	–

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
过去三个月	0.19%	0.17%	-0.49%	0.32%	0.68%	-0.15%
过去六个月	-0.43%	0.16%	0.24%	0.29%	-0.67%	-0.13%
过去一年	-0.11%	0.20%	0.78%	0.27%	-0.89%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.85%	0.17%	4.69%	0.22%	-2.84%	-0.05%

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、可投性好的大型景组合,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。

2.3.2 本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

2.3.2.2 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2017年4月26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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.本基金合同于2017年4月26日正式生效,截止报告期末已满一年.

2.2017年是合同生效当年,按实际续存期计算,不按整个自然年度进行折算.

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同于2017年4月26日生效,自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

§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,持有股权68.19%;大华资产管理有限公司,持有股权17.51%;三亚盈湾旅业有限公司,持有股权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12月31日,平安基金共管理66只公募基金,资产管理总规模2879亿元人民币。

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、平安安盈保本混合型证券投资基金、平安安享保本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、平安合赢定期开放债券型发起式证券投资基金、平安鑫荣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	–	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、平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)、平安优势产业灵活配置混合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)、平安安盈保本混合型证券投资基金、平安安心保本混合型证券投资基金、平安大华估值优势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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.自2019年1月18日起黄维不再担任本基金的基金经理,该事项已按规定在中国基金业协会办理变更手续。

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易管理制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控及报告制度》,严格执行法律法规及制度要求,从以下五个方面对交易行为进行严格控制:一是搭建平等的投资信息平台,合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则,建立科学的投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监管。四是明确投告制度和路线,根据法规及公司内部要求,分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资绩进行分析、评估,形成分析报告,由投资组合经理、督察长、总经理签署后,妥善保存备查,如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为,及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2018年宏观经济稳中有降,通胀中枢维持较低水平,社会融资余额增速持续下行,货币政策总体中性偏松,流动性保持相对宽松状态。此外,中美贸易摩擦持续发酵,市场避险情绪升温,风险偏好明显下降。在此背景下,利率债和中高等级信用债收益率大幅下行,低等级信用债受金融强监管、债务违约等影响,信用利差反而有所扩大,股票市场则出现大幅度下跌。本基金为追求稳健的投资收益,将股票仓位降至较低水平,并将主要仓位配置于高等级的中短期限信用债和利率债,同时参与了可转债的波段操作,使基金净值保持相对平稳。

权益市场方面,国内经济在过去一年具备较大的下行压力,本产品配置思路以自下而上精选个股为主,注重业绩确定性以及估值匹配度,产品业绩获得了良好的相对收益。

展望后市,我们认为聚焦价值和盈利或长确定的格局不会改变,市场主线依然会是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

截至本报告期末本基金份额净值为1.0185元;本报告期基金份额净值增长率为-0.11%,业绩比较基准收益率为0.78%。

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2019年,本基金认为随着货币政策持续偏松,社会融资余额增速有望逐步企稳,宏观经济下行幅度将有所放缓,但能否企稳反弹还有待观察。债市收益率上半年大概率呈现震荡下行走势,下半年保持低位震荡,继续下行空间有限,但是否大幅反弹取决于后续经济基本面表现。股市经过去年大幅调整之后,风险收益比明显提升。随着政策环境改善,中美贸易摩擦缓和甚至和解,经济下行幅度放缓,A股有望步入牛熊转折期,市场重心重新上移。

本基金认为流动性较好的中短端债券品种仍有较高投资价值,将保持高比例配置力度;股市则选择具有安全边际高的优质公司,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

报告期内本基金未进行利润分配,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,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)2018年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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第23322号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安鼎弘混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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,公允反映了平安鼎弘混合型证券投资基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于平安鼎弘混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	–
其他事项	–
其他信息	–
管理层和治理层对财务报表的责任	平安鼎弘混合基金的基金管理人平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估平安鼎弘混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算平安鼎弘混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督平安鼎弘混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三)评价基金管理人管理层所选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对平安鼎弘混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致平安鼎弘混合基金不能持续经营。 (五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	曹翠丽 陈怡
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
审计报告日期	2019年3月25日

§7 年度财务报表

7.1 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:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	38,896,535.66	14,766,540.14
结算备付金		357,351.37	4,634,369.64
存出保证金		74,748.00	44,243.11
交易性金融资产	7.4.7.2	113,887,976.19	222,076,675.11
其中:股票投资		14,032,945.00	19,877,766.68
基金投资		–	–
债券投资		99,855,031.19	202,198,908.43
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产	7.4.7.3	–	–
买入返售金融资产	7.4.7.4	–	20,000,000.00
应收证券清算款		6,716,229.62	1,751,609.88
应收利息	7.4.7.5	1,998,017.11	4,077,255.55
应收股利		–	–
应收申购款		98.81	–
递延所得税资产		–	–
其他资产	7.4.7.6	–	–
资产总计		161,930,956.76	267,350,693.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31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	7.4.7.3	–	–
卖出回购金融资产款		38,000,000.00	56,000,000.00
应付证券清算款		11,818,385.30	4,165,954.68
应付赎回款		47,943.17	–
应付管理人报酬		116,679.35	210,123.55
应付托管费		24,308.20	43,775.73
应付销售服务费		–	–
应付交易费用	7.4.7.7	112,339.99	100,782.84
应交税费		2,345.29	–
应付利息		31,734.25	-24,434.97
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债	7.4.7.8	267,019.32	190,000.00
负债合计		50,420,754.87	60,686,201.83
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	109,488,536.29	202,701,052.24
未分配利润	7.4.7.10	2,021,665.60	3,963,439.36
所有者权益合计		111,510,201.89	206,664,491.60
负债和所有者权益总计		161,930,956.76	267,350,693.43

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0185元,基金份额总额109,488,536.29份。

7.2 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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一.收入		4,637,670.20	8,974,357.98
1.利息收入		8,343,551.02	7,603,649.11
其中:存款利息收入	7.4.7.11	248,824.90	165,054.73
债券利息收入		8,005,430.45	6,720,019.58
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		89,295.67	718,574.80
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		-4,307,214.58	1,619,261.70
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-3,846,612.94	904,030.56
基金投资收益		–	–
债券投资收益	7.4.7.13	-747,242.07	641,809.14
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	–	–
贵金属投资收益	7.4.7.14	–	–
衍生工具收益	7.4.7.15	–	–
股利收益	7.4.7.16	286,640.43	73,422.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	555,941.27	-248,552.83
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	45,392.49	–
减:二.费用		5,681,986.52	5,010,918.62
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,308,979.90	1,681,769.87
2. 托管费	7.4.10.2.2	481,037.55	350,368.75
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	–	–
4. 交易费用	7.4.7.19	1,079,848.84	262,799.49
5. 利息支出		1,417,168.06	2,440,256.70
其中:卖出回购金融资产支出		1,417,168.06	2,440,256.70
6. 税金及附加		25,186.09	–
7. 其他费用	7.4.7.20	369,766.08	275,723.81
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-1,044,316.32	3,963,439.36
减:所得税费用		–	–
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		-1,044,316.32	3,963,439.36

7.3 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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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)	–	-1,044,316.32	-1,044,316.32
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)	-93,212,515.95	-897,457.44	-94,109,973.39
其中:1.基金申购款	9,751.81	136.95	9,888.76
2.基金赎回款	-93,222,267.76	-897,594.39	-94,119,862.15
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)	109,488,536.29	2,021,665.60	111,510,201.89
项目	上年度可比期间 2017年4月26日(基金合同生效日)至2017年12月31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	–	202,701,052.24
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	3,963,439.36	3,963,439.36
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	3,963,439.36	206,664,491.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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,本基金的封闭期内自基金合同生效之日起(含)至18个月月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×20%+中证综合债指数收益率×80%。

7.4.2 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日及以后颁布颁布的《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7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度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12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2017年4月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力,本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项。包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债,本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易