平安大华财富宝货币市场基金

【2015】第四季度报告

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
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华财富宝货币
交易代码	000759
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月21日
报告期末基金份额总额	2,043,297,718.19份
投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据对未来短期利率变动的预测,确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法,确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1. 本期已实现收益	15,366,862.40
2. 本期利润	15,366,862.40
3. 期末基金资产净值	2,043,297,718.19

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)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损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金按日结转份额。

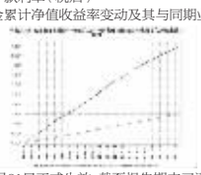
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8315%	0.0040%	0.3450%	0.0000%	0.4865%	0.0040%

业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2014年8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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申俊华	基金经理	2014年9月25日	-	7	申俊华女士,湖南大学金融学博士,7年证券基金从业经验,曾在中国中投证券有限责任公司担任固定收益研究员,2012年加入平安大华基金管理有限公司,担任固定收益研究员。2014年9月起担任平安大华财富宝货币市场基金基金经理。
WANG AO	基金经理	2015年11月4日	-	3	WANG AO先生,CAIA,FRM,费大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士,曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室,2012年9月加入平安大华基金管理有限公司,担任投资研究部固定收益研究员。2015年11月起担任平安大华财富宝货币市场基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华财富宝货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年4季度货币市场流动性整体宽松,7天回购利率季度平均维持在2.4%附近,唯有年末IPO重启后叠加年末效应,对货币市场流动性稍有冲击,但总体价格抬升幅度不大。本基金4季度资产配置在比较债券和存款相对优势的情况下,重心侧重于银行存款的配置,降低了短期融资券的配置节奏,本基金年化收益保持稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为0.8315%,同期业绩基准增长率为0.3450%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然12月中采PMI和财新PMI均强于预期,表明生产、需求、库存和价格均有所改善,但是并没有得到高频数据的印证。从上游行业看,煤炭、有色、原油价格全面下跌,波罗地海运价再创新低;从中游行业看,钢材、化工、玻璃和水泥价格全面下跌,六大发电集团耗煤量继续下跌,产能利用率仍然位于低位;从下游看,商品房销售有所回暖,家电销售增速放缓,库存依然偏高。种种迹象表明工业经济仍难言企稳,企业景气程度持续恶化,稳增长仍需要宽松的货币政策和财政政策支持。而在实体经济疲弱的背景下,财政投放力度的加大和信贷与社融的超预期增长,并未带来实际贷款的增加,企业加杠杆意愿仍然较弱。为了保证就业和防范金融风险,预计未来货币政策宽松趋势不变,财政赤字率将进一步提高,稳增长将成为16年政府首要目标。

本基金管理人依然看好在经济调整中债券的长期配置价值,现有债券收益率曲线过于平坦,短端价值突出,债券资本利得有赖于基准利率下调引导的短端收益率下滑。本基金管理人认为,未来银行间流动性依然宽松,现有资产价格整体偏低,大类资产的相对比价并无绝对突出优势,未来资产配置以灵活调整为主,保持中低久期,灵活把握市场波段操作机会。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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5000万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,412,756,181.69	69.1100
	其中:债券	1,374,528,181.69	67.2400
	资产支持证券	38,228,000.00	1.8700
2	买入返售金融资产	338,501,507.75	16.5600
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	261,871,867.61	12.8100
4	其他资产	31,055,163.50	1.5200
5	合计	2,044,184,720.55	100.0000

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.0500	
	其中:买断式回购融资	0.0000	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	81
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	40.8800	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.3800	-
2	30天(含)-60天	12.9500	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.8900	-
3	60天(含)-90天	17.5700	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.9700	-
4	90天(含)-180天	19.9500	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	7.1800	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.5200	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,790,099.62	0.9700
2	央行票据	-	-
3	金融债券	168,479,431.02	8.2500
	其中:政策性金融债	168,479,431.02	8.2500
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	661,648,058.70	32.3800
6	中期票据	-	-
7	同业存单	524,610,592.35	25.6700
8	其他	-	-
9	合计	1,374,528,181.69	67.2700
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	168,479,431.02	8.2500

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130213	13国开13	600,000	59,121,237.44	2.8900
2	041560015	15永泰能源CP001	500,000	50,307,833.73	2.4600
3	011599076	15协鑫SCP003	500,000	50,262,162.96	2.4600
4	011599266	15包钢集SCP005	500,000	50,000,195.75	2.4500
5	011599157	15路安SCP002	500,000	50,000,092.94	2.4500
6	111502850	15洛阳银行CD015	500,000	49,987,923.49	2.4500
7	111502060	15华商银行CD035	500,000	49,937,755.53	2.4400
8	111502862	15福建海峡银行CD027	500,000	49,704,518.32	2.4300
9	111502898	15渣庆银行CD019	500,000	49,700,054.78	2.4300
10	111502951	15盛京银行CD072	500,000	49,695,629.08	2.4300

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	35
报告期内偏离度的最高值	0.3524%
报告期内偏离度的最低值	0.1872%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2647%

5.7 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	期末市值	占基金资产净值比例(%)
1	1589152	15恒金1A1(总价)	300,000	25,500,000.00	1.2500
2	15DRA1	15德润A1(总价)	127,280	12,728,000.00	0.6200

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。

5.8.2

本报告期内不存在"持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券"的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	16,494,519.50
4	应收申购款	14,560,644.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	31,055,163.50

5.8.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,916,089,037.72
报告期期间基金总申购份额	3,064,550,578.46
减:报告期期间基金总赎回份额	2,937,341,897.99
报告期末基金份额总额	2,043,297,718.19

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十三次会议审议通过,由罗春风先生接替杨秀丽女士任职公司董事长职务,任职日期为2015年10月28日。该事项已于2015年10月29日公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安大华财富宝货币市场基金设立的文件

(2)平安大华财富宝货币市场基金基金合同

(3)平安大华财富宝货币市场基金托管协议

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)报告期内平安大华财富宝货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

(1)投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

(2)投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司,客户服务电话:4008004800(免长途话费)

平安大华基金管理有限公司
2016年1月21日

平安大华策略先锋混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华策略先锋混合
交易代码	700003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月29日
报告期末基金份额总额	114,457,336.08份
投资目标	通过积极进行资产配置和灵活运用多种投资策略,在有效控制风险的前提下,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,谋求基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析,结合经济周期理论,形成对不同市场周期的预测和判断,进行积极、灵活的资产配置,确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。股票投资方面,采用积极主动的投资管理策略,在构建股票投资组合时,灵活运用多种投资策略,积极挖掘和利用市场中可行的投资机会,以实现基金的投资目标。债券投资方面,以利率预期策略、类属资产配置和久期策略为主,以品种选择策略、收益率利差策略和债券置换策略为辅,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上,构建能获取长期、稳定收益的固定收益类投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	21,953,286.44
2.本期利润	34,706,122.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.4405
4.期末基金资产净值	270,502,150.69
5.期末基金份额净值	2.363

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.所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。

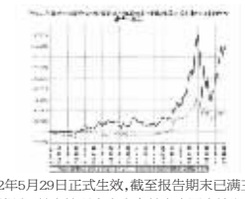
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	47.23%	2.38%	11.02%	1.00%	36.21%	1.38%

业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2012年5月29日正式生效,截至报告期末已满三年;

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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔海英	基金经理	2015年8月4日	-	3	南开大学金融学硕士,曾先后任职于博时基金管理有限公司、民生加银基金管理有限公司担任行业研究员,2013年加入平安大华基金管理有限公司,担任行业研究员,现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理、平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金经理。

1、此处的"任职日期"为基金合同生效之日,"离任日期"为公告确定的解聘日期。

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

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度A股市场走出了反弹修复行情,本基金积极在底部积极布局具有良好成长性被错杀的优质个股,在四季度反弹行情中净值上涨幅度较大,取得了较好的超额收益。但对2016年初的下跌风险预估不足,导致净值回撤幅度较大。展望2016年一季度,本基金认为急速暴跌之后,A股市场将再次迎来反弹修复行情,本基金将积极在底部布局,看好新兴产业部分个股被错杀的机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为2.363元,份额累计净值为2.463元。报告期内,本基金份额净值增长率为47.23%,同期业绩基准增长率为11.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着美联储进入加息周期、中国经济进入增速换挡关键期和结构调整阵痛期,2016年全球经济脆弱性增加。2016年主要以供给侧改革为主,供给侧改革配酿,化解过剩产能、减税等政策正配酿。财政货政政策起配合作用,货币政策宽松方向不变,但程度边际上可能不如2014-2015年。

随着汇率短期趋稳、大股东减持新规、注册制改革预期引导等,A股调整风险逐步得到释放。就2016年一季度来看,本基金将增持部分跌幅大的新兴行业个股,看好大数据、云计算、VR、医疗、新能源等细分板块的阶段性投资机会。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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5000万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	215,822,497.14	73.82
	其中:股票	215,822,497.14	73.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	75,124,506.02	25.70
8	其他资产	1,409,823.42	0.48
9	合计	292,356,826.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	123,168,992.38	45.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	70.05	0.00
F	批发和零售业	34,545,791.00	12.77
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	48,753,452.70	18.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,970,000.00	1.47
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	5,363,009.01	1.98
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	21,182.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	215,822,497.14	79.79

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000078	海王生物	604,600	14,486,216.00	5.36
2	300327	中颖电子	300,500	11,929,850.00	4.41
3	300322	硕贝德	600,000	11,700,000.00	4.33
4	300113	顺网科技	104,200	10,562,754.00	3.90
5	002464	金利科技	120,000	9,752,400.00	3.61
6	300098	高新兴	455,300	9,556,747.00	3.53
7	300299	富春通信	200,000	9,414,000.00	3.48
8	300310	宜通世纪	150,000	9,349,500.00	3.46
9	002273	水晶光电	204,700	8,310,820.00	3.07
10	000835	长城动漫	368,800	8,168,314.00	3.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末无债券投资。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末无债券投资。

5.6 报告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

本基金报告期末无资产支持证券投资。

5.7 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

本基金报告期末无贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金报告期末无权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末无股指期货投资。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	199,546.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,535.28
5	应收申购款	1,193,741.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,409,823.42

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	42,068,750.15
报告期期间基金总申购份额	173,130,672.89
减:报告期期间基金总赎回份额	100,742,086.96
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	114,457,336.08

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十三次会议审议通过,由罗春风先生接替杨秀丽女士任职公司董事长职务,任职日期为2015年10月28日。该事项已于2015年10月29日公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安大华策略先锋混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华策略先锋混合型证券投资基金托管协议

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)报告期内平安大华策略先锋混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

(1)投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

(2)投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司,客户服务电话:4008004800(免长途话费)

平安大华基金管理有限公司
2016年1月21日

平安大华日增利货币市场基金

【2015】第四季度报告

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
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华日增利货币市场
交易代码	000279
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月3日
报告期末基金份额总额	29,947,660,176.13份
投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据对未来短期利率变动的预测,确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法,确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1. 本期已实现收益	184,415,156.52
2. 本期利润	184,415,156.52
3. 期末基金资产净值	29,947,660,176.13

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)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损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金按日结转份额。

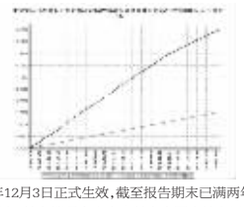
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7676%	0.0015%	0.3450%	0.0000%	0.4226%	0.0015%

业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2013年12月3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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙健	基金经理	2013年12月3日	-	14	自2001年起,先后在湘财证券资产管理部、中国太平人寿保险公司投资部/太平资产管理公司从事投资工作,2006年起,分别在摩根士丹利华鑫基金公司、银华基金公司担任基金经理。2011年9月加入平安基金,任投资研究部固定收益研究员,现担任平安大华保本混合型证券投资基金基金经理、平安大华添利债券型证券投资基金基金经理、平安大华日增利货币市场基金基金经理、平安大华鑫安混合型证券投资基金基金经理、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理、平安大华鑫享混合型证券投资基金基金经理、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华日增利货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年4季度货币市场流动性整体宽松,7天回购利率季度平均维持在2.4%附近,唯有年末IPO重启后叠加年末效应,对货币市场流动性稍有冲击,但总体价格抬升幅度不大。本基金4季度资产配置在比较债券和存款相对优势的情况下,重心侧重于银行存款的配置,降低了短期融资券的配置节奏,本基金年化收益保持稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为0.7676%,同期业绩基准增长率为0.3450%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然12月中采PMI和财新PMI均强于预期,表明生产、需求、库存和价格均有所改善,但是并没有得到高频数据的印证。从上游行业看,煤炭、有色、原油价格全面下跌,波罗地海运价再创新低;从中游行业看,钢材、化工、玻璃和水泥价格全面下跌,六大发电集团耗煤量继续下跌,产能利用