

平安大华策略先锋混合型证券投资基金

[2015]第一季度报告

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:2015年4月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性、准确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的约定,于2015年4月16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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3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 约定型开放式

基金合同生效日 2012年5月29日

报告期末基金份额总额 47,799,489.95份

投资目标 通过资产配置及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的投资机会,追求基金的持续增值。

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、行业景气度、资金供求、估值水平、行业配置、收益差利差策略和资产配置策略为辅,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、稳定的回报的投资组合。

业绩比较基准 深证300指数收益×60%+中证国债指数收益×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,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

报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)

1.本期已实现收益 25,317,861.69

2.本期利润 24,421,171.49

3.加权平均基金份额本期利润 0.4569

4.期末基金份额净值 88,311,262.31

5.期末基金份额 1,848

1.本期已实现收益金额收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除非关联交易的本期利润,扣除非关联交易的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据。

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(1) 净值增长(2) 业绩比较基准 收益差(3) 基准收益率(4) ①-③ ②-④

过去三个月 34.01% 1.76% 9.21% 1.10% 24.80% 0.66%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

图示:平安大华策略先锋混合型证券投资基金成立以来的净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

1.本基金基金合同于2012年5月29日正式生效,截至报告期末已满二年;

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,建仓期间除对各项资产配置比例符合合同约定外。

3.4 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

黄健军 基金经理 2013年5月29日 - 8 2007年5月先后在平安银行、平安基金管理公司从事行业研究工作,在长盛基金管理公司担任基金经理,2010年1月加入平安大华基金管理有限公司,任投资研究部研究员、基金经理,2012年5月加入平安大华基金管理有限公司,任平安大华策略先锋型证券投资基金基金经理,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则,履行基金合同约定的职责,并以基金份额持有人最大利益为原则,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、稳定的回报的投资组合。

4.2 公平交易的执行情况

4.2.1 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。

4.2.2 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。

4.3 报告期内基金的停牌、暂停赎回情况

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

本基金于报告期内不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的停牌、暂停赎回情况

4.4.1 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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.6 报告期内基金的停牌、暂停赎回情况

本基金于报告期内未出现连续20个工作日基金的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 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 58,939,361.87 63.32

其中:股票 58,939,361.87 63.32

2 固定收益投资 6,610,057.50 7.10

其中:债券 6,610,057.50 7.10

3 货币市场基金 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 其他资产投资 - -

其中,买入返售金融资产的买入返售基金 - -

6 银行存款和结算备付金合计 14,973,206.14 16.09

7 其他资产 12,564,940.83 13.50

8 合计 93,087,566.34 100.00

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)扣除非关联交易相关费用后的金额,本期利润为本期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据。

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(1) 净值增长(2) 业绩比较基准 收益差(3) 基准收益率(4) ①-③ ②-④

过去三个月 23.58% 29.1% 12.62% 15.0% 10.96% 0.45%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

图示:平安大华策略先锋混合型证券投资基金成立以来的净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

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.基金产品概况

3.2.3 基金净值表现

3.2.4 主要财务指标和基金净值表现

3.2.5 主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)

1.本期已实现收益 95,261,400.83

2.本期利润 156,655,467.76

3.加权平均基金份额本期利润 0.2831

4.期末基金份额净值 762,571,743.37

5.期末基金份额 1,520

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)扣除非关联交易相关费用后的金额,本期利润为本期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据。

3.2.6 基金净值表现

3.2.7 主要财务指标和基金净值表现

3.2.8 主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2015年1月1日起至3月31日止)

1.本期已实现收益 95,261,400.83

2.本期利润 156,655,467.76

3.加权平均基金份额本期利润 0.2831

4.期末基金份额净值 762,571,743.37

5.期末基金份额 1,520

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)扣除非关联交易相关费用后的金额,本期利润为本期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据。

3.2.9 基金净值表现

3.2.10 主要财务指标和基金净值表现

3.2.11 主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2015年1月1日起至3月31日止)

1.本期已实现收益 95,261,400.83

2.本期利润 156,655,467.76

3.加权平均基金份额本期利润 0.2831

4.期末基金份额净值 762,571,743.37

5.期末基金份额 1,520

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)扣除非关联交易相关费用后的金额,本期利润为本期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据。

3.2.12 基金净值表现

3.2.13 主要财务指标和基金净值表现

3.2.14 主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2015年1月1日起至3月31日止)

1.本期已实现收益 95,261,400.83

2.本期利润 156,655,467.76

3.加权平均基金份额本期利润 0.2831

4.期末基金份额净值 762,571,743.37

5.期末基金份额 1,520

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)扣除非关联交易相关费用后的金额,本期利润为本期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据。

3.2.15 基金净值表现

3.2.16 主要财务指标和基金净值表现

3.2.17 主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2015年1月1日起至3月31日止)

1.本期已实现收益 95,261,400.83

2.本期利润 156,655,467.76

3.加权平均基金份额本期利润 0.2831

4.期末基金份额净值 762,571,743.37

5.期末基金份额 1,520

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)扣除非关联交易相关费用后的金额,本期利润为本期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据。

3.2.18 基金净值表现

3.2.19 主要财务指标和基金净值表现

3.2.20 主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2015年1月1日起至3月31日止)

1.本期已实现收益 95,261,400.83

2.本期利润 156,655,467.76

3.加权平均基金份额本期利润 0.2831

4.期末基金份额净值 762,571,743.37

5.期末基金份额 1,520

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)扣除非关联交易相关费用后的金额,本期利润为本期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据。

3.2.21 基金净值表现

3.2.22 主要财务指标和基金净值表现