平安大华财富宝货币市场基金

【2015】第二季度报告

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:2015年7月18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2015年7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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30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	1,032,162,328.11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4月1日 - 2015年6月30日)
1. 本期已实现收益	16,660,625.27
2.本期利润	16,660,625.27
3.期末基金资产净值	1,032,162,328.11

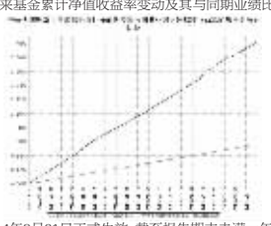
注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
3、本基金按日结转份额。

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	1.2357%	0.0103%	0.3413%	0.0000%	0.8944%	0.0103%

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,截至报告期末未满一年;
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		
孙健	基金经理	2014年8月21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、平安大华财富宝货币市场基金基金经理、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理、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。
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。

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年第二季度货币市场在两率相继下调的带动下量松价跌,唯有第二季度末在传统季节性因素影响下稍有收紧,7天回购利率季度平均维持在2.5%附近,期间IPO对货币市场的冲击式微。本基金资产配置从季初债券和存款均衡配置逐渐战略性增加债券仓位,同时降低利率相对较低的存款占比,使得本基金年化收益保持稳定增长。

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1.2357%,同期业绩基准增长率为0.3412%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年财政货币政策持续加码,但仍未阻止宏观经济基本面的整体颓势,虽然房地产销量大幅回转是众多疲弱指标中的一抹亮色,但仍因库存过高被质疑地产投资回升不可存续,其余领域更未出现好转的迹象。我们预计为了避免权益市场流动性危机向金融机构和实体经济蔓延,确保流动性宽松是货币当局的首要任务,但也需谨防救助不力导致流动性紧张波及银行间市场,因此,本基金管理人未来操作思路以安全性和流动性为主要准则,增配短期债券资产,增加类现金资产,提高组合的信用评级。

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	580,688,998.95	54.6400
	其中:债券	580,688,998.95	54.6400
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	229,801,187.20	21.6200
	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	235,333,168.52	22.1500
4	其他资产	16,851,569.82	1.5900
5	合计	1,062,674,924.49	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	2.7700	
	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	29,999,865.00	2.9100
	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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

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	29.4900	2.9100
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.8600	-
2	30天(含)-60天	33.0400	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.8800	-
3	60天(含)-90天	10.6900	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.9600	-
4	90天(含)-180天	13.5700	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	14.5300	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		101.3200	2.9100

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,149,676.49	9.7000
	其中:政策性金融债	100,149,676.49	9.7000
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	480,539,322.46	46.5600
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	580,688,998.95	56.2600
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	100,149,676.49	9.7000

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	60,718,173.15	5.8800
2	041455036	14鲁焦化CP002	600,000	60,124,666.66	5.8300
3	041458075	14广汇汽车CP001	500,000	50,148,307.15	4.8600
4	011599266	15包钢集SCP005	500,000	50,001,005.28	4.8400
5	011599157	15路安SCP002	500,000	50,000,898.37	4.8400
6	041455032	14景田资CP001	400,000	40,232,770.14	3.9000
7	041471010	14岚桥CP001	400,000	39,839,816.78	3.8600
8	041460082	14广汇集团CP001	300,000	30,075,325.92	2.9100
9	041464063	14华西CP002	300,000	30,019,751.61	2.9100
10	041566004	15粤珠江CP001	300,000	30,002,020.08	2.9100

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	47
报告期内偏离度的最高值	0.4141%
报告期内偏离度的最低值	0.1657%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3045%

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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	16,851,569.82
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	16,851,569.82

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	1,239,627,674.69
报告期期间基金总申购份额	5,127,172,497.12
减:报告期期间基金总赎回份额	5,334,637,843.70
报告期期末基金份额总额	1,032,162,328.11

§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十五次会议审议通过,由汪涛先生任职公司副总经理职务,任职日期为2015年6月16日。该事项已于 2015 年 6月1 7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
2015年7月18日

平安大华日增利货币市场基金

【2015】第二季度报告

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:2015年7月18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2015年7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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华日增利货币
交易代码	000379
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	13,587,152,442.88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4月1日 - 2015年6月30日)
1. 本期已实现收益	149,480,274.22
2.本期利润	149,480,274.22
3.期末基金资产净值	13,587,152,442.88

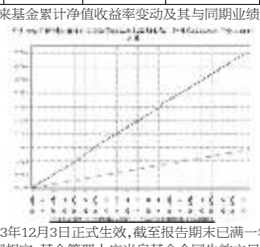
注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
3、本基金按日结转份额。

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	1.0312%	0.0042%	0.3413%	0.0000%	0.6899%	0.0042%

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		
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、平安大华财富宝货币市场基金基金经理、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理、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。

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年第二季度货币市场在两率相继下调的带动下量松价跌,唯有二季度末在传统季节性因素影响下稍有收紧,7天回购利率季度平均维持在2.5%附近,期间IPO对货币市场的冲击式微。本基金资产配置从季初债券和存款均衡配置逐渐战略性增加债券仓位,同时降低利率相对较低的存款占比,使得本基金年化收益保持稳定增长。

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1.0312%,同期业绩基准增长率为0.3412%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年财政货币政策持续加码,但仍未阻止宏观经济基本面的整体颓势,虽然房地产销量大幅回转是众多疲弱指标中的一抹亮色,但仍因库存过高被质疑地产投资回升不可存续,其余领域更未出现好转的迹象。我们预计为了避免权益市场流动性危机向金融机构和实体经济蔓延,确保流动性宽松是货币当局的首要任务,但也需谨防救助不力导致流动性紧张波及银行间市场,因此,本基金管理人未来操作思路以安全性和流动性为主要准则,增配短期债券资产,增加类现金资产,提高组合的信用评级。

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	8,985,953,796.02	62.13
	其中:债券	8,985,953,796.02	62.13
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	200,500,491.85	1.39
	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	5,061,035,062.33	35.00
4	其他资产	214,640,302.26	1.48
5	合计	14,462,129,652.46	100.00

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	3.40	
	其中:买断式回购融资	0.00	
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	864,998,062.50	6.37
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本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	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

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	34.87	6.37
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.77	-
2	30天(含)-60天	13.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.63	-
3	60天(含)-90天	15.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.56	-
4	90天(含)-180天	15.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.03	-
5	180天(含)-397天(含)	26.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.86	6.37

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,165,654,509.09	8.58
	其中:政策性金融债	1,165,654,509.09	8.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	7,820,299,286.93	57.56
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	8,985,953,796.02	66.14
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	814,878,069.09	6.00

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	011524003	15中冶SCP003	2,900,000	289,994,144.60	2.13
2	041466024	14包钢CP001	2,500,000	250,252,001.61	1.84
3	011599266	15包钢集SCP005	2,500,000	250,004,514.91	1.84
4	100236	10国开36	2,200,000	220,094,722.26	1.62
5	011599306	15西南水泥SCP001	2,000,000	200,027,375.12	1.47
6	011599157	15路安SCP002	1,500,000	150,002,464.87	1.10
7	130235	13国开35	1,400,000	140,219,707.64	1.03
8	120227	12国开27	1,400,000	140,158,997.05	1.03
9	090205	09国开05	1,300,000	130,681,717.74	0.96
10	041460111	14永泰能源CP002	1,300,000	129,644,502.39	0.95

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	29
报告期内偏离度的最高值	0.4305%
报告期内偏离度的最低值	0.1077%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2568%

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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	179,288,668.14
4	应收申购款	35,351,634.12
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	214,640,302.26

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	12,132,469,902.71
报告期期间基金总申购份额	40,441,477,960.66
减:报告期期间基金总赎回份额	38,986,795,420.49
报告期期末基金份额总额	13,587,152,442.88

§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十五次会议审议通过,由汪涛先生任职公司副总经理职务,任职日期为2015年6月16日。该事项已于 2015 年 6月1 7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日增利货币市场基金设立的文件
(2)平安大华日增利货币市场基金基金合同
(3)平安大华日增利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)报告期内平安大华日增利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
2015年7月18日

平安大华行业先锋股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月18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2015年7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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华行业先锋股票
交易代码	700001
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
报告期末基金份额总额	369,338,257.24份
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	从全球、区域的宏观层面(经济增长、通货膨胀和利息的预期)出发,依据工业增加值与CPI的变动划分经济周期的不同阶段(复苏、扩张、滞涨、萧条)。同时,将行业非系统风险均值与其分布的GINI系数结合运用,全面准确地判断大类资产风险程度和收益前景,统筹考量短、中、长期资产配置比例。股票投资在投资时钟策略基础上来持自下而上选股理念,精选有成长潜力的优质股票构建投资组合。债券投资以目标久期管理和品种选择策略为主,以收益率利差策略、债券置换策略为辅,构造能获取稳定收益的固定收益类投资品种组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率X85%+中证全债指数收益率X15%
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	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4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	221,392,721.59
2.本期利润	210,556,505.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.4840
4.期末基金资产净值	709,670,143.64
5.期末基金份额净值	1.921

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;

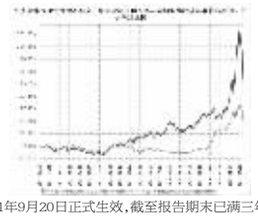
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	26.38%	3.46%	9.44%	2.22%	16.94%	1.24%

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2011年9月20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		
胡昆明	基金经理	2014年9月12日	-	13	北京大学光华管理学院硕士,13年证券基金从业经验,曾先后任职于巨田证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、平安资产管理有限公司担任行业研究员、行业研究经理、高级行业研究经理,2009年加入平安大华基金管理有限公司,担任行业研究员,现任平安大华行业先锋股票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、《平安大华行业先锋股票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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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年上半年,在宏观经济增速下滑的背景下,政府稳增长措施不断出台,多次的降息降准为市场提供了充裕的资金,同时也降低了社会融资成本,为股权投资带来了巨大的市场机会。具体表现在二级市场上,"一带一路"、"创业创新"所代表的优势产能和转型创新公司,股价均出现大幅上涨。本基金管理人及时抓住了市场机会,在二季度迅速调整仓位,将大部分资产配置于转型创新的行业和公司,加大计算机、精准医疗等行业,取得了较好的业绩。但由于半年末市场迅速下跌,特别是创业板指数快速大幅的下跌,也让基金净值大幅回落。但我们相信,杠杆资金对市场助涨助跌的作用,会让市场选择出未来更具优势和竞争力的公司。因此,下半年我们将精挑个股,争取获得个股的阿法收益,从而体现专业投资的能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.921元,份额累计净值为2.201元。报告期内,本基金份额净值增长率为26.38%,同期业绩基准增长率为9.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管市场在二季度末大幅下跌,但宏观经济处于企稳的态势,资金仍然宽松,监管政策越来越有利用市场的发展,A股市场仍是一个值得投资的场所,我们仍然看好后市的发展。

本基金管理人认为在市场调整后,会让市场选择出未来更具优势和竞争力的公司,下半年我们将精挑个股,争取