

平安大华保本混合型证券投资基金

[2015]第三季度报告

基金管理人：平安大华基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送达日期：2015年10月27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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利。

基金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。

本报告期中财务数据未经审计。

本报吿期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安大华保本混合
交易代码	700004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月1日
报告期末基金份额总额	100,412,776,935份

投资目标 通过积极的投资运作，力求在保持资产在稳健资产和风险资产之间的合理配置，力求为基金份额持有人提供稳定的现金流和低风险的绝对回报。

投资策略 采用定比申购赎回策略，动态调整资产在稳健资产和风险资产之间的比例配置，并以此基础上实现基金的绝对回报。

业绩比较基准 每个开放周期的前三个月定期存款利率+0.5%。

风险收益特征 本基金属于货币市场基金中的低风险品种，高预期收益和预期风险高于货币基金，低于股票基金和一般混合基金。

基金管理人 平安大华基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
			1	2
1	权证投资	4,289,990.60	1.76	
	其中：股票	4,289,990.60	1.76	
2	固定收益投资	-	-	-
	其中：债券	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
3	黄金投资	-	-	-
4	金融衍生品投资	-	-	-
5	买入返售金融资产	-	-	-
	其中：质押式回购的买入返售金融资产	-	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	230,628,318.83	94.37	
7	其他资产	9,408,475.17	3.87	
8	合计	344,366,794.20	100.00	

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
			1	2
1	权证投资	4,289,990.60	1.76	
	其中：股票	4,289,990.60	1.76	
2	固定收益投资	-	-	-
	其中：债券	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
3	黄金投资	-	-	-
4	金融衍生品投资	-	-	-
5	买入返售金融资产	-	-	-
	其中：质押式回购的买入返售金融资产	-	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	230,628,318.83	94.37	
7	其他资产	9,408,475.17	3.87	
8	合计	344,366,794.20	100.00	

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7月1日 - 2015年9月30日) 2015年1-9月

1.本期已实现收益 -44,444,207.01

2.本期利润 -35,746,390.00

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1796

4.期末基金资产净值 236,520,096.95

5.期末基金份额净值 1.241

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，本期利润指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示列示。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金份额净值增长率为及其与同期业绩比较基准收益率的比较

每个开放周期的前三个月定期存款利率的百分比。

风险收益特征 本基金属于货币市场基金中的低风险品种，高预期收益和预期风险高于货币基金，低于股票基金和一般混合基金。

基金管理人 平安大华基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）

§ 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间		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙健	基金经理	2012年9月11日	-	14	由2001年起先后在国元证券、华泰资产管理有限公司从事股权投资工作，2006年起分别在华泰资产管理有限公司、平安大华基金管理有限公司担任股权投资总监、基金经理，现担任平安大华基金管理有限公司基金经理、平安大华先锋混合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、平安大华保本混合型证券投资基金基金经理。

1.此前的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的离职日期。

2.证券从业人员从行业协会、证券业协会从业人员资格管理办法的相关规定。

3.本期报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华基金管理有限公司基金销售业务规范》和《平安大华基金管理有限公司基金销售行为规范指引》的规定，遵循公平、公开、公正的原则，严格控制风险，确保基金持有人的利益不受损害并得到公平对待。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.3 公平交易制度的执行情况

4.3.4 公平交易制度的执行情况

4.3.5 公平交易制度的执行情况

4.3.6 公平交易制度的执行情况

4.3.7 公平交易制度的执行情况

4.3.8 公平交易制度的执行情况

4.3.9 公平交易制度的执行情况

4.3.10 公平交易制度的执行情况

4.3.11 公平交易制度的执行情况

4.3.12 公平交易制度的执行情况

4.3.13 公平交易制度的执行情况

4.3.14 公平交易制度的执行情况

4.3.15 公平交易制度的执行情况

4.3.16 公平交易制度的执行情况

4.3.17 公平交易制度的执行情况

4.3.18 公平交易制度的执行情况

4.3.19 公平交易制度的执行情况

4.3.20 公平交易制度的执行情况

4.3.21 公平交易制度的执行情况

4.3.22 公平交易制度的执行情况

4.3.23 公平交易制度的执行情况

4.3.24 公平交易制度的执行情况

4.3.25 公平交易制度的执行情况

4.3.26 公平交易制度的执行情况

4.3.27 公平交易制度的执行情况

4.3.28 公平交易制度的执行情况

4.3.29 公平交易制度的执行情况

4.3.30 公平交易制度的执行情况

4.3.31 公平交易制度的执行情况

4.3.32 公平交易制度的执行情况

4.3.33 公平交易制度的执行情况

4.3.34 公平交易制度的执行情况

4.3.35 公平交易制度的执行情况

4.3.36 公平交易制度的执行情况

4.3.37 公平交易制度的执行情况

4.3.38 公平交易制度的执行情况

4.3.39 公平交易制度的执行情况

4.3.40 公平交易制度的执行情况

4.3.41 公平交易制度的执行情况

4.3.42 公平交易制度的执行情况

4.3.43 公平交易制度的执行情况

4.3.44 公平交易制度的执行情况

4.3.45 公平交易制度的执行情况

4.3.46 公平交易制度的执行情况

4.3.47 公平交易制度的执行情况

4.3.48 公平交易制度的执行情况

4.3.49 公平交易制度的执行情况

4.3.50 公平交易制度的执行情况

4.3.51 公平交易制度的执行情况

4.3.52 公平交易制度的执行情况

4.3.53 公平交易制度的执行情况

4.3.54 公平交易制度的执行情况

4.3.55 公平交易制度的执行情况

4.3.56 公平交易制度的执行情况

4.3.57 公平交易制度的执行情况

4.3.58 公平交易制度的执行情况

4.3.59 公平交易制度的执行情况

4.3.60 公平交易制度的执行情况

4.3.61 公平交易制度的执行情况

4.3.62 公平交易制度的执行情况

4.3.63 公平交易制度的执行情况

4.3.64 公平交易制度的执行情况

4.3.65 公平交易制度的执行情况

4.3.66 公