

B342 信息披露 Disclosure

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
报告送出日期：2015年10月27日

§1 重要提示
基金管理人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法律责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容，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预示其未来表现。投资者有风险，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。
本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

基金名称	
平安大华保本混合	
基金简称	
平安大华保本混合	
基金代码	
070000	
基金运作方式	
契约型开放式	
基金合同生效日	
2012年09月11日	
报告期末基金份额总额	
190,612,776.83份	
投资目标	
采用投资组合管理技术，以保本为前提，在安全的基础上，通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增值和长期资本增值，并控制基金资产净值波动率，实现基金资产的长期增值。	
投资策略	
本基金采用“稳健资产+风险资产”的配置策略，在控制基金资产净值波动率的前提下，通过资产配置，在保证保本的前提下，力争实现基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	
每个保本周期届满日的前三年银行定期存款利率。	
风险收益特征	
本基金属于证券投资基金中的低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票基金、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	
基金保证人	
中国投融资担保有限公司(原名“中国投融资担保有限公司”)	

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	
单位：人民币元	
报告期末	
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	-0.1786
4.期末基金资产净值	236,520,086.36
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基金净值表现。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期末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	-11.17%	0.67%	0.71%	0.01%	-11.88%	0.66%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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9月11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在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。建仓期结束的各项资产配置比例符合基金合同的约定。

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间	证券从业年限	说明
姓名	职务	任职日期	离任日期	
孙健	基金经理	2012年09月11日	-	14

自2001年起，先后在鹏华证券资产管理部、中国平安人寿保险有限公司、中国平安资产管理公司从事投资工作，2006年起，历任鹏华基金、前海基金、任投资研究部固定收益研究员，现任平安大华保本混合型证券投资基金基金经理，平安大华增利货币市场基金基金经理，平安大华季利货币市场基金基金经理，平安大华季利货币市场基金基金经理，平安大华季利货币市场基金基金经理，平安大华季利货币市场基金基金经理。

1.此处的“任职日期”为基金合同生效日，“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 投资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、《平安大华保本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，并未有损害基金份额持有人利益、损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

截至2015年9月30日，本基金份额净值为1.241元，份额累计净值为1.241元。报告期内，本基金份额净值增长率为-11.17%，同期业绩比较基准收益率为0.71%。

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.37 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.39 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.41 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.43 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.45 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.46 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.47 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.48 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.49 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.50 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.51 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.52 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.53 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.54 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.55 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.56 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.57 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.58 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.59 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.60 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.61 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.62 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.63 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.64 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.65 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.66 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.67 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.68 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.69 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.70 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.71 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.72 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.73 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.74 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.75 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.76 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.77 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.78 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.79 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.80 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.81 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.82 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.83 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.84 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.85 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.86 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.87 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.88 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.89 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.90 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.91 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.92 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.93 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.94 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.95 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.96 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.97 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.98 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.99 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.100 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

平安大华鑫享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：平安银行股份有限公司
报告送出日期：2015年10月27日

§1 重要提示
基金管理人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法律责任。
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10月26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预示其未来表现。投资者有风险，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。
本报告自2015年7月28日起至9月30日止。

平安大华鑫享混合证券投资基金	
基金简称	
平安大华鑫享混合	
基金代码	
001009	
基金运作方式	
契约型开放式	
基金合同生效日	
2015年07月28日	
报告期末基金份额总额	
132,624,217.46份	
投资目标	
在严格控制风险的基础上，通过在不同资产类别间优化配置和组合管理，力求实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	
本基金根据各类资产的行情趋势和预期收益风险的比较判断，对股票、债券及货币市场工具等类别资产比例进行动态调整，以期在投资中实现风险和收益的优化平衡。本基金采用多因素分析模型，从宏观经济、政策预期、市场利率水平、市场估值、信用状况、流动性、证券市场运行在动态等方面，采取定量和定性相结合的方法，对证券市场投资机会与风险进行综合研判，并据此进行资产配置。本基金将积极寻求具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	
30%×沪深300指数收益率+70%×中证全债指数收益率	
风险收益特征	
本基金属混合型基金，其中风险收益水平高于股票基金，预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金、低风险股票基金。	
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	
下属分级基金的基本情况	
鑫享A	鑫享C
1. 基金合同生效日	2015年07月28日
2. 基金合同生效日	2015年07月28日
3. 基金合同生效日	2015年07月28日
4. 基金合同生效日	2015年07月28日
5. 基金合同生效日	2015年07月28日
6. 基金合同生效日	2015年07月28日
7. 基金合同生效日	2015年07月28日
8. 基金合同生效日	2015年07月28日
9. 基金合同生效日	2015年07月28日
10. 基金合同生效日	2015年07月28日
11. 基金合同生效日	2015年07月28日
12. 基金合同生效日	2015年07月28日
13. 基金合同生效日	2015年07月28日
14. 基金合同生效日	2015年07月28日
15. 基金合同生效日	2015年07月28日
16. 基金合同生效日	2015年07月28日
17. 基金合同生效日	2015年07月28日
18. 基金合同生效日	2015年07月28日
19. 基金合同生效日	2015年07月28日
20. 基金合同生效日	2015年07月28日
21. 基金合同生效日	2015年07月28日
22. 基金合同生效日	2015年07月28日
23. 基金合同生效日	2015年07月28日
24. 基金合同生效日	2015年07月28日
25. 基金合同生效日	2015年07月28日
26. 基金合同生效日	2015年07月28日
27. 基金合同生效日	2015年07月28日
28. 基金合同生效日	2015年07月28日
29. 基金合同生效日	2015年07月28日
30. 基金合同生效日	2015年07月28日
31. 基金合同生效日	2015年07月28日
32. 基金合同生效日	2015年07月28日
33. 基金合同生效日	2015年07月28日
34. 基金合同生效日	2015年07月28日
35. 基金合同生效日	2015年07月28日
36. 基金合同生效日	2015年07月28日
37. 基金合同生效日	2015年07月28日
38. 基金合同生效日	2015年07月28日
39. 基金合同生效日	2015年07月28日
40. 基金合同生效日	2015年07月28日
41. 基金合同生效日	2015年07月28日
42. 基金合同生效日	2015年07月28日
43. 基金合同生效日	2015年07月28日
44. 基金合同生效日	2015年07月28日
45. 基金合同生效日	2015年07月28日
46. 基金合同生效日	2015年07月28日
47. 基金合同生效日	2015年07月28日
48. 基金合同生效日	2015年07月28日
49. 基金合同生效日	2015年07月28日
50. 基金合同生效日	2015年07月28日
51. 基金合同生效日	2015年07月28日
52. 基金合同生效日	2015年07月28日
53. 基金合同生效日	2015年07月28日
54. 基金合同生效日	2015年07月28日
55. 基金合同生效日	2015年07月28日
56. 基金合同生效日	2015年07月28日
57. 基金合同生效日	2015年07月28日
58. 基金合同生效日	2015年07月28日
59. 基金合同生效日	2015年07月28日
60. 基金合同生效日	2015年07月28日
61. 基金合同生效日	2015年07月28日
62. 基金合同生效日	2015年07月28日
63. 基金合同生效日	2015年07月28日
64. 基金合同生效日	2015年07月28日
65. 基金合同生效日	2015年07月28日
66. 基金合同生效日	2015年07月28日
67. 基金合同生效日	2015年07月28日
68. 基金合同生效日	2015年07月28日
69. 基金合同生效日	2015年07月28日
70. 基金合同生效日	2015年07月28日
71. 基金合同生效日	2015年07月28日
72. 基金合同生效日	2015年07月28日
73. 基金合同生效日	2015年07月28日
74. 基金合同生效日	2015年07月28日
75. 基金合同生效日	2015年07月28日
76. 基金合同生效日	2015年07月28日
77. 基金合同生效日	2015年07月28日
78. 基金合同生效日	2015年07月28日
79. 基金合同生效日	2015年07月28日
80. 基金合同生效日	2015年07月28日
81. 基金合同生效日	2015年07月28日
82. 基金合同生效日	2015年07月28日
83. 基金合同生效日	2015年07月28日
84. 基金合同生效日	2015年07月28日
85. 基金合同生效日	2015年07月28日
86. 基金合同生效日	2015年07月28日
87. 基金合同生效日	2015年07月28日
88. 基金合同生效日	2015年07月28日
89. 基金合同生效日	2015年07月28日
90. 基金合同生效日	2015年07月28日
91. 基金合同生效日	2015年07月28日
92. 基金合同生效日	2015年07月28日
93. 基金合同生效日	2015年07月28日
94. 基金合同生效日	2015年07月28日
95. 基金合同生效日	2015年07月28日
96. 基金合同生效日	2015年07月28日
97. 基金合同生效日	2015年07月28日
98. 基金合同生效日	2015年07月28日
99. 基金合同生效日	2015年07月28日
100. 基金合同生效日	2015年07月28日