平安大华添利债券型证券投资基金

[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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华添利债券
交易代码	700005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月27日
报告期末基金份额总额	93,663,629.65份
投资目标	在严格控制投资风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略,在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上,主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种,构建及调整固定收益投资组合,以期获得和产品期限匹配的债券收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种。预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

下属分级基金的基金简称	平安大华添利债券A	平安大华添利债券C
下属分级基金的交易代码	700005	700006
报告期末下属分级基金的份额总额	61,469,501.28份	32,194,128.37份

§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)	
	平安大华添利债券A	平安大华添利债券C
1. 本期已实现收益	685,269.98	290,010.35
2. 本期利润	771,104.68	342,474.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0105	0.0091
4. 期末基金资产净值	85,004,622.72	43,918,651.85
5. 期末基金份额净值	1.383	1.364

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

平安大华添利债券A

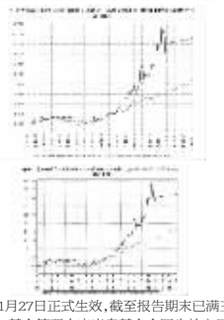
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.80%	0.04%	2.75%	0.07%	-1.95%	-0.03%

平安大华添利债券C

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	0.66%	0.04%	2.75%	0.07%	-2.09%	-0.03%

业绩比较基准:中证全债指数收益率

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11月27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。

§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	2012年11月27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、平安大华安鑫分红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。

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、《平安大华添利债券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

2015年来债券收益率持续下降,高等级债券收益率均下落至4%以下,债券收益的长期性价比下降,短期有利息价值和回避风险资产波动的价值。本基金管理人认为一般性债券收益率有一定下行空间,但已不适应大规模加杠杆长久期操作,对于目标收益率期望应回归到理性位置才能控制住投资风险。近期可转债发行提速,随着股票市场走弱存量可转债估值偏高,2016年存在先价值回归再价值发现的过程,重点关注新发可转债上市定价存在相对博弈的价值。

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A份额净值为1.383元,份额累计净值为1.383元。报告期内,本基金份额净值增长率为0.8%,同期业绩基准增长率为2.75%。本基金C份额净值为1.364元,份额累计净值为1.364元。报告期内,本基金份额净值增长率为0.66%,同期业绩基准增长率为2.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

供给侧改革的目的是促进产能供需平衡,同时促动产业升级提升效率。短期供给侧改革主要影响过剩产能行业,会出现一些企业的关停并转,对经济增速有下拉影响。中长期随着过剩产能出清或局部改善,供需平衡,产品价格会回升。在清理过剩产能的同时,转型促动各个行业通过互联网,智能制造,技术升级等方式提升产品质量和管理效率。供给侧改革会引起资本市场重新定价,股票市场波动不可避免,对于转型发展又有供给侧改善的行业和公司具备相对的发展优势。债券市场在供给侧改革中享受无风险利率下行的利好,同时也面临过剩行业信用利差扩大的负面影响,随着改革成效凸显,经济增速回升,债券市场中长期面临利率抬升风险。如果经济在底部徘徊时间拉长,债券市场在低利率水平享受稳定的有息收益。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	115,675,139.50	89.33
	其中:债券	115,675,139.50	89.33
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断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	10,986,592.65	8.48
7	其他资产	2,826,511.44	2.18
8	合计	129,488,243.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票 。

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

本基金本报告期末未持有股票 。

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,004,000.00	3.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,534,000.00	15.93
	其中:政策性金融债	20,534,000.00	15.93
4	企业债券	13,433,669.50	10.42
5	企业短期融资券	75,450,000.00	58.52
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,253,470.00	0.97
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	115,675,139.50	89.72

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140201	14国开01	100,000	10,318,000.00	8.00
2	150212	15国开12	100,000	10,216,000.00	7.92
3	041568009	15圣农CP001	100,000	10,121,000.00	7.85
4	136006	15鲁星01	100,000	10,055,000.00	7.80
5	041577005	15蓝色光标CP001	100,000	10,027,000.00	7.78

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

本基金本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

本基金本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

本基金本报告期末无权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

基金投资的前十名股票没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,761.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,744,256.26
5	应收申购款	68,496.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,826,511.44

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	140,470.00	0.11

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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

项目	平安大华添利债券A	平安大华添利债券C
报告期期初基金份额总额	81,037,877.65	43,739,431.71
报告期期间基金总申购份额	11,959,770.94	3,793,704.37
减:报告期期间基金总赎回份额	31,528,147.31	15,339,007.71
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	61,469,501.28	32,194,128.37

§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添利债券型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华添利债券型证券投资基金基金合同

(3)平安大华添利债券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)报告期内平安大华添利债券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

平安大华鑫享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: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12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华鑫享混合型
交易代码	001609
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月28日
报告期末基金份额总额	2,931,440,625.77份
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过对不同资产类别优化配置及组合精选,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市场趋势和预期收益风险的比较判别,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,以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。本基金采用多因素分析框架,从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、市场投资价值、资金供求因素、证券市场运行内在动量等方面,采取定量和定性结合的分析方法,对证券市场投资机会与风险进行综合研判,注重风险与收益平衡。本基金将挑选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定增长。
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	本基金是混合型,属于中高风险收益水平的基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、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	平安银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	鑫享A	鑫享C
下属分级基金的交易代码	001609	001610
报告期末下属分级基金的份额总额	84,694,461.81份	2,846,746,163.96份

§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)	
	鑫享A	鑫享C
1. 本期已实现收益	1,526,892.67	342,351.60
2. 本期利润	2,981,045.39	2,968,681.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0326	0.0023
4. 期末基金资产净值	87,053,470.06	2,933,577,537.81
5. 期末基金份额净值	1.028	1.031

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

鑫享A

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	3.21%	0.19%	6.89%	0.50%	-3.68%	-0.31%

鑫享C

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	3.10%	0.18%	6.89%	0.50%	-3.79%	-0.32%

业绩比较基准:沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%

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2015年7月28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,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		
孙健	基金经理	2015年7月28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。
李黄海	基金经理	2015年11月4日	-	14	李黄海先生,美国南加州大学博士,曾先后任职于民生加银基金金融工程与产品开发部执行总监、易方达基金投资发展部总监助理,摩根士丹利华鑫基金数量化投资部投资经理。2015年9月加入平安大华基金管理有限公司,2015年11月起担任平安大华鑫享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

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。

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《平安大华鑫享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

三年期债券收益率持续下降,高等级债券收益率均下落至4%以下,债券收益的长期性价比下降,短期有利息价值和回避风险资产波动的价值。本基金管理人认为一般性债券收益率有一定下行空间,但已不适应大规模加杠杆长久期操作,对于目标收益率期望应回到理性位置才能控制住投资风险。近期可转债发行提速,随着股票市场走弱存量可转债估值偏高,2016年存在先价值回归再价值发现的过程,重点关注新发可转债上市定价存在相对博弈的价值。

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A份额净值为1.028元,份额累计净值为1.028元。报告期内,本基金份额净值增长率为3.21%,同期业绩基准增长率为6.89%。本基金C份额净值为1.031元,份额累计净值为1.031元。报告期内,本基金份额净值增长率为3.1%,同期业绩基准增长率为6.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

供给侧改革的目的是促进产能供需平衡,同时促动产业升级提升效率。短期供给侧改革主要影响过剩产能行业,会出现一些企业的关停并转,对经济增速有下拉影响。中长期随着过剩产能出清或局部改善,供需平衡,产品价格会回升。在清理过剩产能的同时,转型促动各个行业通过互联网,智能制造,技术升级等方式提升产品质量和管理效率。供给侧改革会引起资本市场重新定价,股票市场波动不可避免,对于转型发展又有供给侧改善的行业和公司具备相对的发展优势。债券市场在供给侧改革中享受无风险利率下行的利好,同时也面临过剩行业信用利差扩大的负面影响,随着改革成效凸显,经济增速回升,债券市场中长期面临利率抬升风险。如果经济在底部徘徊时间拉长,债券市场在低利率水平享受稳定的有息收益。

对于权益市场,关注3000点附近政策和市场的承受力,随着市场指数下移,低估值,蓝筹,高分红型价值股优势逐渐显现,小盘成长股取决于指数稳定状态下博弈价值。可转债则需关注由于股票市场恐慌性下跌的可转债博弈价值。

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	31,867,729.00	1.05
	其中:股票	31,867,729.00	1.05
2	固定收益投资	40,721,964.27	1.35
	其中:债券	40,721,964.27	1.35
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,777,893,746.84	58.75
	其中:买断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	1,174,247,921.36	38.80
7	其他资产	1,515,040.31	0.05
8	合计	3,026,246,401.78	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	16,154,140.21	0.53
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	613,147.00	0.02
E	建筑业	2,391,368.11	0.08
F	批发和零售业	972,815.44	0.03
G	交通运输,仓储和邮政业	505,489.00	0.02
H	住宿和餐饮业	129,528.00	0.00
I	信息传输,软件和信息技术服务业	6,626,124.46	0.22
J	金融业	1,989,789.00	0.07
K	房地产业	1,076,192.36	0.04
L	租赁和商务服务业	176,508.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	93,390.00	0.00
N	水利,环境和公共设施管理业	468,952.00	0.02
O	居民服务,修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,431.42	0.00
R	文化,体育和娱乐业	502,790.00	0.02
S	综合	61,064.00	0.00
	合计	31,867,729.00	1.06

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	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.04
2	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.03
3	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.03
4	300495	美尚生态	6,375	569,223.75	0.02
5	601009	南京银行	20,100	355,770.00	0.01
6	002782	可立克	13,312	283,146.24	0.01
7	300370	安控科技	14,300	279,708.00	0.01
8	300182	捷成股份	11,200	268,800.00	0.01
9	002786	银宝山新	9,630	263,476.80	0.01
10	300497	富祥股份	5,523	237,654.69	0.01

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	公允价值(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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,070,000.00	1.33
6	中期票据	-	-
7	可转债	651,964.27	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,721,964.27	1.35

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011599613	15广田SCP002	100,000	10,036,000.00	0.33
2	011599691	15杉杉SCP0003	100,000	10,021,000.00	0.33
3	041560077	15鲁金茂CP001	100,000	10,022,000.00	0.33
4	041560035	15峰峰CP004	100,000	9,984,000.00	0.33
5	123001	蓝标转债	6,520	651,964.27	0.02

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

本基金本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

本基金本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

本基金本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

本基金本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	117,492.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,381,043.51
5	应收申购款	16,504.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,515,040.31

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中不存在流通受限情况

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

项目	鑫享A	鑫享C
报告期期初基金份额总额	96,624,321.79	36,199,895.67
报告期期间基金总申购份额	1,573,082.37	2,817,435,332.27
减:报告期期间基金总赎回份额	13,502,942.35	6,889,064.98
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	84,694,461.81	2,846,746,163.96

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.34

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鑫享混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华鑫享混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华鑫享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)报告期内平安大华鑫享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

平安大华行业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	平安大华行业先锋混合
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	310,965,843.57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行评的投资机会,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秉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	本基金为混合型基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。
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	10,190,669.63
2.本期利润	84,638,630.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.2676
4.期末基金资产净值	533,584,697.98
5.期末基金份额净值	1.716

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	18.02%	2.30%	14.44%	1.42%	3.58%	0.88%

业绩比较基准:沪深300指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%

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