平安大华保本混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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
送出日期:2017年3月30日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2017年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

普华永道中天会计师事务所为基金财务出具了无保留意见的审计报告,基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明,请投资者注意阅读。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华保本混合
基金主代码	700004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月11日
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
报告期末基金份额总额	458,172,010.69份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采用投资组合保险技术,以保本期到期时本金安全为目标,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长和保本期收益的最大化。
投资策略	采用恒定比例组合保险策略,动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例,以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标,并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于股票基金和一般混合基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安大华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	田青
	联系电话	0755-22626828	010-67595096
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话?		400-800-4800	010-67595096
传真		0755-23997878	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	11,384,884.48	28,289,090.85	51,262,606.67
本期利润	6,479,322.08	29,650,352.91	61,534,781.83
加权平均基金份额本期利润	0.0121	0.0905	0.1570
本期基金份额净值增长率	1.00%	5.39%	13.58%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.2122	0.2017	0.1881
期末基金资产净值	464,640,886.25	589,384,396.34	371,925,595.34
期末基金份额净值	1.014	1.004	1.188

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.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,而非当期发生数);

3.上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

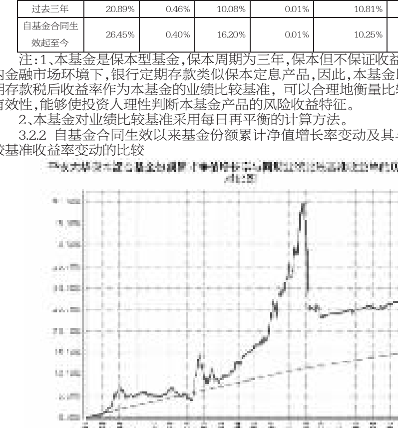
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.88%	0.12%	0.66%	0.01%	-1.54%	0.11%
过去六个月	0.00%	0.09%	1.32%	0.01%	-1.32%	0.08%
过去一年	1.00%	0.11%	2.66%	0.01%	-1.66%	0.10%
过去三年	20.89%	0.46%	10.08%	0.01%	10.81%	0.45%
自基金合同生效起至今	26.45%	0.40%	16.20%	0.01%	10.25%	0.39%

注:1、本基金是保本型基金,保本周期为三年,保本但不保证收益率。在目前国内金融市场环境下,银行定期存款类似保本定息产品,因此,本基金以三年银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准,可以合理地衡量比较基金保本的有效性,能够使投资人理性判断本基金产品的风险收益特征。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

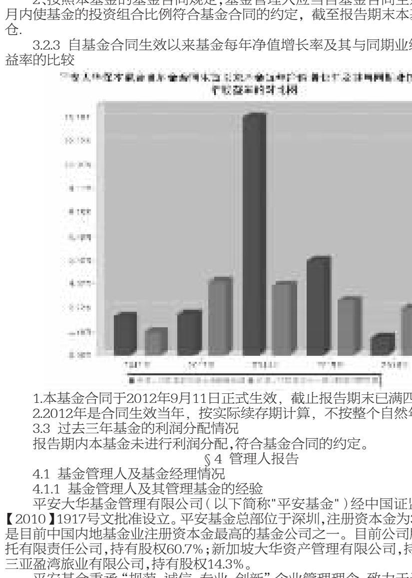
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1、本基金基金合同于2012年9月11日正式生效,截至报告期末已满四年;

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



1.本基金合同于2012年9月11日正式生效,截止报告期末已满四年.

2.2012年是合同生效当年,按实际续存期计算,不按整个自然年度进行折算.

3.3 过去三年基金的利润分配情况

报告期内本基金未进行利润分配,符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司(以下简称"平安基金")经中国证监会证监许可【2010】1917号文批准设立。平安基金总部位于深圳,注册资本金为3亿元人民币,是目前中国内地基金业注册资本金最高的基金公司之一。目前公司股东为平安信托有限责任公司,持有股权60.7%;新加坡大华资产管理有限公司,持有股权25%;三亚盈湾旅业有限公司,持有股权14.3%。

平安基金秉承"规范、诚信、专业、创新"企业管理理念,致力于通过持续稳定的投资业绩,不断丰富的客户服务手段及服务内容,为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务,从而实现"以专业承载信赖"的品牌承诺,成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至2016年12月31日,平安基金共管理29只开放式基金,资产管理总规模超836亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
孙健	本基金的基金经理	2012年9月11日	–	16	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,现担任平安大华保本混合型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华日增利货币市场基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外告之日。证券从业的含义遵行协会《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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人制定并下发了《平安大华基金管理有限责任公司公平交易管理制度》、《平安大华基金管理有限责任公司异常交易监控及报告制度》,严格执行法律法规及制度要求,从以下五个方面对交易行为进行严格控制:一是搭建平等的投资信息平台,合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则,建立科学的投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线,根据法规及公司内部要求,分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估,形成分析报告,由投资组合经理、督察长、总经理签署后,妥善保存备查,如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为,及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口,对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期连续四个季度期间内的交易情况进行了同向交易价差分析,各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差,不存在不公平交易的情况。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

保本基金个股选择以有内涵价值标的,高ROE, 低PB,个股增速超过行业增速,符合国家产业政策方向,符合行业周期变动趋势,主要以底部买入为主,保持中等适中的仓位等待系统性风险集中释放时抄底市场恐慌性波动的利润。

本基金以保本3年周期相匹配的债券投资为主,中短期债券占比较高,虽然受到债券调整影响,但是久期风险可控,未来随着短期债券陆续到期具备再投资优势,基金债券部分也没有杠杆,在合适的机会具备再杠杆的投资能力。2017年受到美联储加息,贸易争端,政策从严去杠杆的持续影响,债券市场波动仍不可避免,短期利率上行的空间相对有限,短期债券以持有为主,中长期债券把握波段操作机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为1.014 元,份额累计净值为1.265元。报告期内,本基金份额净值增长率为1.00%,同期业绩基准增长率为2.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年股市的高点取决于对IPO有序发行的有效承接力。市场跌破3000点概率依旧存在,在经济基本面不出现转折性大幅恶化的情况下,对某些不利事项的集中反映,是市场波段操作的机会。

债券市场所受宏观环境、政策监管、期限利差、信用利差影响,使得配置价值进入可投区域,但是并没有反映出最恶化情景的预期,未来经济复苏持续性,通货膨胀超预期,对中长期债券的负面不确定性有待进一步明确。利率债券受政策预期和年末流动性调整第一个阶段差不多结束,但是目前经济数据依旧较强,美国加息进程可能超预期,对中国利率水平牵制作用风险有待释放,时间点看通胀数据和加息数据都在第二季度进一步发酵,届时将根据经济增长的动力和利率回升的水平,判断中长期债券是否有资本利得投资价值。

可转债随着股票市场回暖,值得增加投资比例,重点关注进攻性强的弹性转债和保护性强的绝对价格低转债。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发,严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时,确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部门按照规定的权限和程序,通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法,对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核,发现问题及时提出改进建议,并督促相关部门进行整改,同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训,开展了多次培训活动,加强对员工行为的管理,增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

报告期内,本基金管理人所管理的基金运作合法合规,基金合同得到严格履行,有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组,由投研部、运营部及监察稽核部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订,负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性,保证基金估值的公平、合理,特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金基金合同的规定,本报告期内未进行利润分配。

4.9报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第22038号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	平安大华保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的平安大华保本混合型证券投资基金(以下简称"平安大华保本混合基金")的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表,2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是平安大华保本混合基金 的基金管理人平安大华基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为,上述平安大华保本混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了平安大华保本混合基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	曹翠丽	边晓红
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号普华永道中心11楼	
审计报告日期	2017年3月29日	

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:平安大华保本混合型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资?产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资?产:			
银行存款		95,479,230.10	217,491,244.83
结算备付金		1,620,072.99	2,857,142.86
存出保证金		122,688.23	233,148.48
交易性金融资产		370,268,300.89	390,138,810.89
其中:股票投资		906,451.09	20,139.94
基金投资		–	–
债券投资		369,361,849.80	390,118,670.95
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		50,000,000.00	–
应收证券清算款		–	–
应收利息		4,862,050.22	5,005,190.21
应收股利		–	–
应收申购款		–	26,123.47
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		522,352,342.43	615,751,660.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负?债:			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		50,000,000.00	20,670,197.70
应付赎回款		3,633,516.75	985,187.56
应付管理人报酬		486,272.78	608,683.55
应付托管费		81,045.46	101,447.28
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		476,906.19	3,387,000.30
应交税费		2,822,287.81	235,200.00
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		211,427.19	379,548.01
负债合计		57,711,456.18	26,367,264.40
所有者权益:			
实收基金		367,398,325.93	470,937,173.23
未分配利润		97,242,560.32	118,447,223.11
所有者权益合计		464,640,886.25	589,384,396.34
负债和所有者权益总计		522,352,342.43	615,751,660.74

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.014元,基金份额总额458,172,010.69份。

7.2 利润表

会计主体:平安大华保本混合型证券投资基金

本报告期: 2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项?目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		15,973,337.58	41,482,909.44
1.利息收入		14,987,679.40	8,586,497.94
其中:存款利息收入		816,812.07	1,235,490.78
债券利息收入		13,539,602.26	6,648,269.33
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		631,265.07	702,737.83
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		5,433,587.92	30,861,677.75
其中:股票投资收益		3,436,744.55	14,665,847.15
基金投资收益		–	–
债券投资收益		1,845,984.42	15,860,022.69
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		150,858.95	335,807.91
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-4,905,562.40	1,361,262.06
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		457,632.66	673,471.69
减:二、费用		9,494,015.50	11,832,556.53
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	6,528,403.82	4,257,178.47
2. 托管费	7.4.8.2.2	1,088,067.24	709,529.83
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	–	–
4. 交易费用		1,413,317.22	6,160,702.99
5. 利息支出		7,002.27	288,530.93
其中:卖出回购金融资产支出		7,002.27	288,530.93
6. 其他费用		457,224.95	416,614.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		6,479,322.08	29,650,352.91
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		6,479,322.08	29,650,352.91

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:平安大华保本混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	470,937,173.23	118,447,223.11	589,384,396.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	6,479,322.08	6,479,322.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-103,538,847.30	-27,683,984.87	-131,222,832.17
其中:1.基金申购款	7,881,716.71	2,058,067.37	9,939,784.08
2.基金赎回款	-111,420,564.01	-29,742,052.24	-141,162,616.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	367,398,325.93	97,242,560.32	464,640,886.25
项目	**上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 实收基金**	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益(基金净值)	313,036,070.53	58,889,524.81	371,925,595.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	29,650,352.91	29,650,352.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	157,901,102.70	29,907,345.39	187,808,448.09
其中:1.基金申购款	414,084,514.66	104,765,297.35	518,849,812.01
2.基金赎回款	-256,183,411.96	-74,857,951.96	-331,041,363.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	470,937,173.23	118,447,223.11	589,384,396.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 – 至 – 财务报表由下列负责人签署:

______罗春风______ ______林婉文______ ____陈星____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安大华保本混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]第566号《关于核准平安大华保本混合型证券投资基金募集的批复》核准,由平安大华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,019,088,309.57 元,业经安永华明会计师事务所安永华明(2012)验字第60937497_B02号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华保本混合型证券投资基金基金合同》于2012年9月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,019,276,286.73 份基金份额,其中认购资金利息折合187,977.16份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"建设银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行交易的债券、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、货币市场工具以及法律法规允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金在保本期内投资稳健资产占基金资产的比例不低于60%;基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;投资风险资产占基金资产的比例不高于40%;基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的3%。本基金的业绩比较基准为每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人平安大华基金管理有限公司于2017年3月2X日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安大华保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4本报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错事项。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
上海陆金所资产管理有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构

注:于本期,并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
平安证券股份有限公司	65,590,988.64	6.39%	2,086,581,357.24	48.06%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
平安证券股份有限公司	20,359,989.05	5.35%	10,959,211.83	4.89%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
平安证券股份有限公司	–	–	31,000,000.00	2.98%

7.4.8.1.4 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 成交金额	占当期权证成交总额的比例	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 成交金额	占当期权证成交总额的比例

本报告期内无通过关联方进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
平安证券	61,084.99	7.69%	61,084.99	12.82%
关联方名称	**上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 当期佣金**	**占当期佣金总量的比例(%)**	**期末应付佣金余额**	**占期末应付佣金总额的比例(%)**
平安证券	1,899,618.23	54.64%	1,899,618.23	56.27%

注:

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,528,403.82	4,257,178.47
其中:支付销售机构的客户维护费	2,389,142.09	1,556,689.60

注:支付基金管理人平安大华的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,088,067.24	709,529.83

注:支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	–
获得销售服务费的各关联方名称	**上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费**
合计	–

本基金本报告期内及上年度可比期间均无销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
银行间市场交易的各关联方名称	**上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 债券交易金额 基金买入**	**基金卖出**	**基金逆回购 交易金额**	**利息收入**	**基金正回购 交易金额**	**利息支出**

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入
深圳建行活期存款	95,479,230.10	800,337.17	217,491,244.83	956,297.81

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内无参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.10.1.1?受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	–
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	–
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	–

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002664	信质电机	2016年12月16日	重大事项	25.39	–	–	1,000	25,599.01	25,390.00	–
002400	省广股份	2016年11月28日	重大事项	13.79	–	–	1,000	14,298.75	13,790.00	–
002567	唐人神	2016年12月22日	重大事项	12.64	2017年1月3日	12.75	1,000	12,152.17	12,640.00	–
002635	安洁科技	2016年11月8日	重大事项	36.40	2017年2月8日	33.50	100	3,033.16	3,640.00	–
000711	京蓝科技	2016年10月19日	重大事项	32.54	2017年3月13日	29.29	100	1,852.60	3,254.00	–
300367	东方网力	2016年12月15日	重大事项	20.04	–	–	100	2,525.36	2,004.00	–
600406	国电南瑞	2016年12月28日	重大事项	16.63	–	–	100	1,324.52	1,663.00	–

注:本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金未从事银行间市场债券正回购交易,无质押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止,本基金未从事证券交易所债券正回购交易,无质押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为7,741,476.79元,属于第二层次的余额为362,526,824.10元,无属于第三层次的余额(2015年12月31日:第一层次7,055.70元,第二层次390,131,755.19元,无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2015年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	906,451.09	0.17
	其中:股票	906,451.09	0.17
2	固定收益投资	369,361,849.80	70.71
	其中:债券	369,361,849.80	70.71
	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	50,000,000.00	9.57
	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	97,099,303.09	18.59
7	其他各项资产	4,984,738.45	0.95
8	合计	522,352,342.43	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	23,280.00	0.01
B	采矿业	115,360.00	0.02
C	制造业	539,503.09	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	17,447.00	0.00
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,529.00	0.01
J	金融业	–	–
K	房地产业	3,254.00	0.00
L	租赁和商务服务业	56,890.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	1,340.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	99,848.00	0.02
S	综合	–	–
	合计	906,451.09	0.20

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期期末未投资沪港通股票。

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300410	正业科技	1,000	53,980.00	0.01
2	300408	三环集团	3,000	47,640.00	0.01
3	002343	慈文传媒	1,000	45,170.00	0.01
4	600547	山东黄金	1,000	36,510.00	0.01
5	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
6	002699	美盛文化	1,000	33,800.00	0.01
7	600338	西藏珠峰	1,000	28,980.00	0.01
8	002712	思美传媒	1,000	28,600.00	0.01
9	002664	信质电机	1,000	25,390.00	0.01
10	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000861	海印股份	18,345,763.46	3.11
2	600496	精工钢构	17,653,413.38	3.00
3	002236	大华股份	12,941,857.35	2.20
4	600273	嘉化能源	12,165,269.99	2.06
5	600688	上海石化	10,260,290.00	1.74
6	000554	泰山石油	10,027,894.65	1.70
7	600583	海油工程	8,770,386.86	1.49
8	002496	辉丰股份	8,762,918.54	1.49
9	000059	华锦股份	8,508,438.00	1.44
10	600856	中天能源	8,500,152.78	1.44
11	600888	新疆众和	8,472,115.44	1.44
12	600270	外运发展	8,150,230.61	1.38
13	600114	东睦股份	8,121,002.16	1.38
14	002554	惠博普	7,859,672.81	1.33
15	600703	三安光电	7,218,320.24	1.22
16	000603	盛达矿业	7,027,856.81	1.19
17	002444	巨星科技	6,909,667.00	1.17
18	601088	中国神华	6,138,247.53	1.04
19	600004	白云机场	6,041,525.76	1.03
20	002510	天汽模	6,026,445.52	1.02

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000861	海印股份	18,537,530.74	3.15
2	600496	精工钢构	17,522,381.00	2.97
3	002236	大华股份	12,468,162.35	2.12
4	600273	嘉化能源	12,454,299.58	2.11
5	600688	上海石化	10,227,069.00	1.74
6	000554	泰山石油	10,047,201.05	1.70
7	002496	辉丰股份	9,452,138.65	1.60
8	000059	华锦股份	8,897,110.00	1.51
9	002554	惠博普	8,855,907.00	1.50
10	600583	海油工程	8,665,019.15	1.47
11	600856	中天能源	8,534,505.90	1.45
12	600888	新疆众和	8,500,939.89	1.44
13	600114	东睦股份	8,446,667.56	1.43
14	600270	外运发展	8,114,609.51	1.38
15	000603	盛达矿业	7,273,769.62	1.23
16	600703	三安光电	7,098,210.40	1.20
17	002444	巨星科技	6,846,086.22	1.16
18	600004	白云机场	6,513,051.72	1.11
19	002510	天汽模	6,396,965.00	1.09
20	601088	中国神华	6,234,910.30	1.06

注:卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	512,325,218.72
卖出股票收入(成交)总额	514,893,690.75

注:"买入股票成本"或"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	96,302,000.00	20.73
5	企业短期融资券	169,064,000.00	36.39
6	中期票据	97,068,800.00	20.89
7	可转债(可交换债)	6,927,049.80	1.49
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	369,361,849.80	79.49

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1180165	11佛山公控债	300,000	31,980,000.00	6.88
2	101551025	15均胜电子MTN001	300,000	30,498,000.00	6.56
3	136006	15鲁星01	300,000	29,961,000.00	6.45
4	011698225	16辽成大SCP004	300,000	29,901,000.00	6.44
5	041670006	16怡亚通CP003	300,000	29,802,000.00	6.41

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1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。

8.10.2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。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1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情况。

8.11.2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情况。

8.11.3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情况。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	122,688.23
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,862,050.22
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,984,738.45

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值?	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	3,628,800.00	0.78
2	128010	顺昌转债	3,100,744.80	0.67

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002664	信质电机	25,390.00	0.01	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
3,929	116,612.88	4,999,182.41	1.09%	453,172,828.28	98.91%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年9月11日?)基金份额总额	1,019,276,286.73
本报告期期初基金份额总额	587,287,637.88
本报告期基金总申购份额	9,828,032.85
减:本报告期基金总赎回份额	138,943,660.04
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	458,172,010.69

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。?

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、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,由陈特正先生接替肖宇鹏先生任职公司督察长职务,任职日期为2016年1月21日,该事项已于2016年1月22日公告。

2、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十六次会议审议通过,由肖宇鹏先生接替罗春风先生任职公司总经理职务,任职日期为2016年1月22日,该事项已于2016年1月23日公告。

3、经平安大华基金管理有限公司2016年第三次股东大会审议通过《关于更换第二届董事会会议的议案》,同意由叶杨诗明女士代替王世荣先生出任董事。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内,本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务3年。报告期内应支付给该事务所的报酬为70,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
华创证券	2	497,642,426.56	48.46%	353,972.83	44.55%	–
中投证券	1	226,191,904.40	22.03%	210,653.05	26.51%	–
国信证券	1	203,746,918.05	19.84%	144,923.36	18.24%	新增1个
平安证券	1	65,590,988.64	6.39%	61,084.99	7.69%	–
长城证券	1	33,739,547.49	3.29%	23,998.86	3.02%	–
方正证券	2	–	–	–	–	–

1、基金交易单元的选择标准如下:

(1)研究实力

(2)业务服务水平

(3)综合类研究服务对投资业绩贡献度

(4)专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准,考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	292,126,823.03	76.70%	680,000,000.00	79.72%	–	–
中投证券	66,195,268.21	17.38%	–	–	–	–
国信证券	1,930,169.70	0.51%	173,000,000.00	20.28%	–	–
平安证券	20,359,989.05	5.35%	–	–	–	–
长城证券	247,302.59	0.06%	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–

注:本基金租用的证券公司交易单元本期无权证交易。

平安大华基金管理有限公司

2017年3月30日