平安大华鑫安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	平安大华鑫安混合
基金主代码	001664
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	305,312,241.31份
基金合同存续期	不定期

下属分级基金的基金简称:	平安大华鑫安A	平安大华鑫安C
下属分级基金的交易代码:	001664	001665
报告期末下属分级基金的份额总额	283,503,287.31份	21,808,954.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会,力求在严格控制风险的基础上,实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金将在资产配置允许的范围内,采取相对灵活的资产配置策略,使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测,对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整,以规避或分散市场风险,提高基金风险调整后的收益。本基金以自上而下的投资策略,大类资产,动态控制组合风险,力争长期、稳定的回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%
风险收益特征	本基金是混合型基金,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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	王永民
	联系电话	0755-22626828	010-66594896
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

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12月11日(基金合同生效日)-2015年12月31日		2014年	
	平安大华鑫安A	平安大华鑫安C	平安大华鑫安A	平安大华鑫安C	平安大华鑫安A	平安大华鑫安C
本期已实现收益	1,925,555.21	412,040.26	-5,604.72	-31,191.75	-	-
本期利润	13,268.22	242,152.75	-5,604.72	-31,191.75	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0001	0.0045	0.0000	-0.0002	-	-
本期基金份额净值增长率	-0.10%	-0.50%	0.00%	0.00%	-	-
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	-0.0014	-0.0045	0.0000	-0.0002	-	-
期末基金资产净值	283,103,119.30	21,710,575.08	264,837,051.88	129,764,811.80	-	-
期末基金份额净值	0.999	0.995	1.000	1.000	-	-

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

平安大华鑫安A

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	-1.19%	0.18%	-0.36%	0.32%	-0.83%	-0.14%
过去六个月	-1.09%	0.14%	2.26%	0.33%	-3.35%	-0.19%
过去一年	-0.10%	0.11%	-2.97%	0.57%	2.87%	-0.46%
自基金合同生效起至今	-0.10%	0.11%	-1.17%	0.57%	1.07%	-0.46%

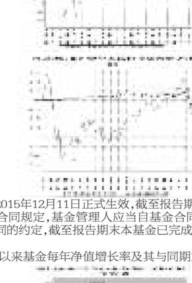
平安大华鑫安C

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	-1.39%	0.19%	-0.36%	0.32%	-1.03%	-0.13%
过去六个月	-1.29%	0.15%	2.26%	0.33%	-3.55%	-0.18%
过去一年	-0.50%	0.12%	-2.97%	0.57%	2.47%	-0.45%
自基金合同生效起至今	-0.50%	0.12%	-1.17%	0.57%	0.67%	-0.45%

注:1、业绩比较基准:沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%。沪深300指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场,覆盖了沪深市场60%左右的市值,是中国A股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合,能够反映A股市场总体发展趋势。中证全债指数从沪深交易所和银行间市场挑选国债、金融债及企业债组成样本券,最大限度地涵盖了中国固定收益市场可供投资的产品,已成为广受投资者认可的投资中国固定收益市场的基准指标。本基金为混合型基金,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。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

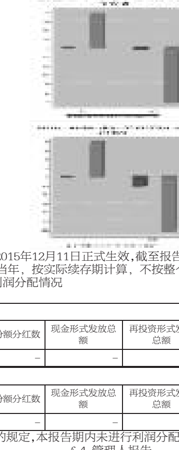
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1、本基金基金合同于2015年12月11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,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定.

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、本基金基金合同于2015年12月11日正式生效,截至报告期末已满一年;

2、2015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

单位:人民币元

平安大华鑫安A

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
合计	-	-	-	-	

平安大华鑫安C

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
合计	-	-	-	-	

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 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	2015年12月11日	2016年12月27日	15	孙健先生,基金经理,硕士,1975年生。曾任湘财证券有限责任公司资产管理总部投资经理,中国太平人寿保险有限公司投资部、太平资产管理有限公司组合投资经理,摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理、银华货币市场证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金基金经理。2011年9月加入平安大华基金公司,任投资研究部固定收益研究员,现担任"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"、"平安大华保本混合型证券投资基金"、"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。
李黄海	本基金的基金经理	2016年7月20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,现任平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金基金经理。
黄维	本基金的基金经理	2016年8月18日	-	6	北京大学微电子学硕士,6年证券从业经验,曾先后任广发证券资产管理(广东)有限公司研究员、投资经理,2016年5月加入平安大华基金管理有限公司,现任平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
施旭	本基金的基金经理	2016年12月27日	-	7	施旭先生,哥伦比亚大学金融数学硕士,曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券,于2015年加入平安大华基金,任衍生品投资中心量化研究员,现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安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、《平安大华鑫安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,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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明显的交易价差,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

本基金在2016年年里,充分发挥混合型基金灵活配置的特点,上半年主要进行固定收益投资和新股申购、债券回购等现金类管理,下半年增加一定的权益类二级市场投资,在年初成功回避了股市大盘很大幅度的系统性风险、以及今年第二季度的震荡风险,并且在下半年参与了市场,以优选低波动、高股息的价值蓝筹主线,配合因子选股争取超额收益的方法。

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A份额净值为0.999元,份额累计净值为0.999元。报告期内,本基金份额净值增长率为-0.10%,同期业绩基准增长率为-2.97%。本基金C份额净值为0.995元,份额累计净值为0.995元。报告期内,本基金份额净值增长率为-0.50%,同期业绩基准增长率为-2.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年12月16日结束的中央经济工作会议提出,将坚持推进供给侧改革并防控金融风险。从2017年1月开始,中央银行的一系列政策操作和对外表态来看,货币政策正在逐步收紧,引导回购利率水平逐步上升,体现了管理层坚持稳增长、防泡沫、去杠杆等重要目标的决心,逐步引导资金"脱虚向实"。

2017年将迎来"十九大",这也是2017年最重要的政治事件,政治体制的理顺和改革落地进程的明确有可能带来A股的上升行情。2017年,仍将对国企改革、农业供给侧改革和PPP等主题方向进行深入研究,并对基本面改善正在发生的国防军工和石油石化进行持续关注,挖掘相关投资机会。

综上所述,2017年的股市行情,仍将存在很大的不确定性,相反债券市场在经历了大幅的调整后,前期累积的风险已经得到一定的释放。后续操作将在已经积累的基金收益的安全垫基础上,紧跟政策步伐,积极规避风险,继续进行稳健投资。

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

报告期内本基金未进行利润分配,符合基金合同的约定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

4.10 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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在平安大华鑫安混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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22049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	平安大华鑫安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鑫安混合型证券投资基金(以下简称"平安大华鑫安混合基金")的财务报表,包括2016年12月31日及2015年12月31日的资产负债表、2016年度和2015年12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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鑫安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,上述平安大华鑫安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鑫安混合基金2016年12月31日及2015年12月31日的财务状况以及2016年度和2015年12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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:平安大华鑫安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		26,320,896.95	94,080,417.03
结算备付金		1,012,001.62	-
存出保证金		68,715.22	-
交易性金融资产		175,644,908.02	651,964.27
其中:股票投资		61,725,692.52	-
基金投资		-	-
债券投资		113,919,215.50	651,964.27
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		100,000,000.00	300,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		2,236,626.69	124,949.59
应收股利		-	-
应收申购款		3,196.76	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		305,286,345.26	394,857,330.89
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		-	-
应付赎回款		994.96	-
应付管理人报酬		173,195.44	172,970.87
应付托管费		54,123.59	54,053.40
应付销售服务费		7,560.24	28,442.94
应付交易费用		70,776.65	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		166,000.00	-
负债合计		472,650.88	255,467.21
所有者权益:			
实收基金		305,312,241.31	394,638,660.15
未分配利润		-498,546.93	-36,796.47
所有者权益合计		304,813,694.38	394,601,863.68
负债和所有者权益总计		305,286,345.26	394,857,330.89

注:

1. 报告截止日2016年12月31日,基金份额总额305,312,241.31份,其中下属A类基金份额283,503,287.31份,C类基金份额21,808,954.00份。下属A类基金份额净值0.999元,C类基金份额净值0.995元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年12月31日和2015年12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:平安大华鑫安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12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入		4,092,972.63	219,270.74
1.利息收入		5,074,875.63	219,270.74
其中:存款利息收入		642,454.56	116,764.14
债券利息收入		3,480,897.92	64.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		951,523.15	102,442.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		813,359.43	-
其中:股票投资收益		-913,861.71	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,692,290.63	-
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		34,930.51	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-2,082,174.50	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		286,912.07	-
减:二、费用		3,837,551.66	256,067.21
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	2,059,282.99	172,970.87
2. 托管费	7.4.8.2.2	643,525.97	54,053.40
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	219,012.58	28,442.94
4. 交易费用		506,987.33	-
5. 利息支出		274.42	-
其中:卖出回购金融资产支出		274.42	-
6. 其他费用		408,468.37	600.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		255,420.97	-36,796.47
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		255,420.97	-36,796.47

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:平安大华鑫安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)	394,638,660.15	-36,796.47	394,601,863.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	255,420.97	255,420.97
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)	-89,326,418.84	-717,171.43	-90,043,590.27
其中:1.基金申购款	190,909,871.22	825,703.49	191,735,574.71
2.基金赎回款	-280,236,290.06	-1,542,874.92	-281,779,164.98
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)	305,312,241.31	-498,546.93	304,813,694.38

项目	上年度可比期间 2015年12月11日(基金合同生效日)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)	394,638,660.15	-	394,638,660.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-36,796.47	-36,796.47
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	394,638,660.15	-36,796.47	394,601,863.68

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

平安大华鑫安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[2015]1476号《关于核准平安大华鑫安混合型证券投资基金注册的批复》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《平安大华鑫安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394,571,226.89元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1378号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华鑫安混合型证券投资基金基金合同》于2015年12月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为394,638,660.15份基金份额,其中认购资金利息折合67,433.26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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鑫安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,包括国内依法发行上市股票(包括中小板、创业及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,以及债券等固定收益金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等)以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为0-90%,其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%。

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》、《平安大华鑫安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年度和2015年12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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日及2015年12月31日的财务状况以及2016年度和2015年12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年12月31日和2015年12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

7.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为:(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;若投资者选择红利再投资方式进行收益分配,收益的计算以权益登记日当日收市后计算的基金份额净值为基准转为基金份额进行再投资;(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;(4)由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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("平安大华")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	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("平安证券")	基金管理人的股东的子公司
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("平安银行")	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("陆金所")	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: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12月11日(基金合同生效日)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	50,872,895.04	13.78%	-	-

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

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12月11日(基金合同生效日)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	345,000,000.00	11.33%	350,000,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

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	47,377.93	14.87%	21,580.83	30.85%

关联方名称	上年度可比期间 2015年12月11日(基金合同生效日)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	-	-	-	-

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。权证交易不计佣金。

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12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,059,282.99	172,970.87
其中:支付销售机构的客户维护费	835,099.68	75,757.92

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0.80%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 × 0.80% / 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12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	643,525.97	54,053.40

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 × 0.25% / 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 平安大华鑫安A	平安大华鑫安C	合计
陆金所	-	181.11	181.11
平安证券	-	2,550.07	2,550.07
平安大华	-	4,723.47	4,723.47
平安银行	-	79,752.27	79,752.27
中国银行	-	129,407.68	129,407.68
合计	-	216,614.60	216,614.60

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 平安大华鑫安A	平安大华鑫安C	合计
陆金所	-	19.94	19.94
平安证券	-	327.76	327.76
平安大华	-	3,094.89	3,094.89
平安银行	-	7,030.20	7,030.20
中国银行	-	17,262.37	17,262.37
合计	-	27,735.16	27,735.16

注:支付基金销售机构的销售服务费按C类基金前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给平安大华,再由平安大华计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

C类基金日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值 × 0.40%/ 当年天数。

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

本基金于本期及上年度可比期间均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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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期末及上年度末均未持有本基金份额。

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12月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国银行	26,320,896.95	620,938.03	94,080,417.03	116,764.14

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,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

本基金于本期及上年度可比期间均未发生在承销期内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

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

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
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
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

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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61,628,315.42元,属于第二层次的余额为114,016,592.60元,无属于第三层次的余额(2015 年12月31日:第二层次651,964.27 元,无第一层次和第三层次)。

(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	61,725,692.52	20.22
	其中:股票	61,725,692.52	20.22
2	固定收益投资	113,919,215.50	37.32
	其中:债券	113,919,215.50	37.32
	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	100,000,000.00	32.76
	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	27,332,898.57	8.95
7	其他各项资产	2,308,538.67	0.76
8	合计	305,286,345.26	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	251,104.00	0.08
B	采矿业	1,577,771.20	0.52
C	制造业	36,933,940.02	12.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,905,893.00	1.28
E	建筑业	2,152,037.00	0.71
F	批发和零售业	3,249,853.30	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	2,750,275.00	0.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	731,606.00	0.24
J	金融业	4,682,729.00	1.54
K	房地产业	2,294,795.00	0.75
L	租赁和商务服务业	883,351.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,011,592.00	0.33
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	1,300,746.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	61,725,692.52	20.25

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期内无沪港通投资股票。

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	000423	东阿阿胶	49,392	2,660,747.04	0.87
2	002508	老板电器	36,224	1,333,043.20	0.44
3	600519	贵州茅台	3,000	1,002,450.00	0.33
4	000402	金 融 街	80,000	824,000.00	0.27
5	000002	万 科A	39,300	807,615.00	0.26
6	002564	天沃科技	50,000	500,000.00	0.16
7	000090	天健集团	50,000	483,000.00	0.16
8	000018	神州长城	45,000	481,500.00	0.16
9	000045	深纺织A	30,000	420,000.00	0.14
10	600575	皖江物流	72,300	415,725.00	0.14

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	002508	老板电器	10,345,712.12	2.62
2	300392	腾信股份	8,158,767.00	2.07
3	600885	宏发股份	7,838,296.85	1.99
4	000423	东阿阿胶	7,788,191.07	1.97
5	601311	骆驼股份	6,624,773.96	1.68
6	002241	歌尔股份	5,775,137.00	1.46
7	300336	新文化	5,548,182.97	1.41
8	600563	法拉电子	5,546,955.00	1.41
9	002007	华兰生物	4,880,949.40	1.24
10	002675	东诚药业	4,749,848.26	1.20
11	600298	安琪酵母	4,481,934.74	1.14
12	002502	骅威文化	4,391,039.00	1.11
13	002572	索菲亚	4,319,566.00	1.09
14	002032	苏 泊 尔	4,225,442.06	1.07
15	600639	浦东金桥	4,187,603.52	1.06
16	600409	三友化工	3,999,771.00	1.01
17	300015	爱尔眼科	3,996,752.56	1.01
18	600276	恒瑞医药	3,996,333.24	1.01
19	002245	澳洋顺昌	3,918,620.17	0.99
20	000028	国药一致	3,629,815.71	0.92

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	002508	老板电器	8,617,893.44	2.18
2	600885	宏发股份	8,138,675.49	2.06
3	300392	腾信股份	7,333,778.00	1.86
4	601311	骆驼股份	6,803,661.00	1.72
5	600563	法拉电子	5,930,351.67	1.50
6	002241	歌尔股份	5,416,797.00	1.37
7	300336	新文化	5,389,428.08	1.37
8	002675	东诚药业	4,825,670.12	1.22
9	000423	东阿阿胶	4,804,674.00	1.22
10	002007	华兰生物	4,406,967.82	1.12
11	600639	浦东金桥	4,328,065.77	1.10
12	002502	骅威文化	4,310,779.00	1.09
13	002245	澳洋顺昌	4,257,870.00	1.08
14	600276	恒瑞医药	4,213,826.00	1.07
15	002572	索菲亚	4,142,356.00	1.05
16	600409	三友化工	4,017,060.00	1.02
17	300015	爱尔眼科	3,954,091.19	1.00
18	600298	安琪酵母	3,906,225.00	0.99
19	002032	苏 泊 尔	3,837,706.33	0.97
20	300271	华宇软件	3,605,912.06	0.91

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	216,861,993.69
卖出股票收入(成交)总额	152,458,935.29

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	54,858,000.00	18.00
	其中:政策性金融债	54,858,000.00	18.00
4	企业债券	18,825,215.50	6.18
5	企业短期融资券	20,118,000.00	6.60
6	中期票据	20,118,000.00	6.60
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	113,919,215.50	37.37

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	120223	12国开23	500,000	49,855,000.00	16.36
2	041660010	16三安CP001	200,000	20,118,000.00	6.60
3	1282537	12美凯龙MTN2	100,000	10,141,000.00	3.33
4	122289	13日照港	100,000	10,030,000.00	3.29
5	1082085	10铁道MTN1	100,000	9,977,000.00	3.27

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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

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

本基金本报告期无贵金属投资。

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

金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

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

本报告期末本基金未持有股指期货。

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未持仓投资股指期货。

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。

8.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					-
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

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

-

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	68,715.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,236,626.69
5	应收申购款	3,196.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,308,538.67

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	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
平安大华鑫安A	656	432,169.65	189,175,587.21	66.73%	94,327,700.10	33.27%
平安大华鑫安C	168	129,815.20	0.00	0.00%	21,808,954.00	100.00%
合计	809	377,394.61	189,175,587.21	61.96%	116,136,654.10	38.04%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	平安大华鑫安A	0.00	0.0000%
	平安大华鑫安C	0.00	0.0000%
	合计	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	份额级别	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	平安大华鑫安A	0
	平安大华鑫安C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安大华鑫安A	0
	平安大华鑫安C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	平安大华鑫安A	平安大华鑫安C
基金合同生效日(2015年12月11日)基金份额总额	264,842,656.60	129,796,003.55
本报告期期初基金份额总额	264,842,656.60	129,796,003.55
本报告期基金总申购份额	190,662,148.49	247,722.73
减:本报告期基金总赎回份额	172,001,517.78	108,234,772.28
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	283,503,287.31	21,808,954.00

§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。

4、2016年12月,郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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2年。报告期内应支付给该事务所的报酬为66,000.00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

1、本报告期内,基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

2、本报告期内,本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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
国金证券	1	66,767,887.27	18.09%	62,181.03	19.52%	-
平安证券	2	50,872,895.04	13.78%	47,377.93	14.87%	-
民生证券	2	47,958,899.84	13.00%	35,072.34	11.01%	-
中信证券	2	35,873,802.38	9.72%	33,409.45	10.49%	-
广发证券	1	30,159,032.68	8.17%	28,087.27	8.82%	-
华泰证券	1	27,743,939.75	7.52%	19,734.24	6.20%	-
方正证券	2	26,414,418.82	7.16%	24,599.66	7.72%	-
安信证券	2	20,643,777.00	5.59%	14,683.96	4.61%	-
西南证券	1	18,535,219.26	5.02%	13,184.09	4.14%	-
招商证券	2	16,157,321.20	4.38%	15,047.27	4.72%	-
长江证券	1	11,882,578.22	3.22%	11,066.25	3.47%	-
中金公司	2	7,578,493.59	2.05%	7,057.80	2.22%	-
申万证券	2	4,213,826.00	1.14%	3,924.35	1.23%	-
中信建投	1	2,849,443.99	0.77%	2,083.79	0.65%	-
中银证券	1	1,403,011.00	0.38%	998.00	0.31%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	新增1个
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元变更情况

报告期内停止租用交易单元:民生证券(深圳1个)

2、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

3、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
国金证券	1,698,301.90	5.81%	472,000,000.00	15.51%	-	-
平安证券	-	-	345,000,000.00	11.33%	-	-
民生证券	698,413.24	2.39%	50,000,000.00	1.64%	-	-
中信证券	714,124.50	2.44%	200,000,000.00	6.57%	-	-
广发证券	775,721.91	2.65%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	897,831.60	3.07%	370,000,000.00	12.16%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	1,128,914.76	3.86%	361,000,000.00	11.86%	-	-
长江证券	-	-	363,000,000.00	11.93%	-	-
中金公司	-	-	268,000,000.00	8.80%	-	-
申万证券	-	-	130,000,000.00	4.27%	-	-
中信建投	10,131,095.89	34.63%	295,000,000.00	9.69%	-	-
中银证券	4,401,152.70	15.04%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	150,000,000.00	4.93%	-	-
中投证券	-	-	40,000,000.00	1.31%	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	8,808,988.97	30.11%	-	-	-	-

平安大华基金管理有限公司

2017年3月30日