平安大华鑫享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:平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安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	平安大华鑫享混合	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	471,473,739.10份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	平安大华鑫享A	平安大华鑫享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	46,247,985.66份	425,225,753.44份

2.2 基金产品说明

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。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	方琦
	联系电话	0755-22626828	0755-22160168
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fangqi275@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387

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7月28日(基金合同生效日)-2015年12月31日		2014年	
	平安大华鑫享A	平安大华鑫享C	平安大华鑫享A	平安大华鑫享C	平安大华鑫享A	平安大华鑫享C
本期已实现收益	1,731,563.98	29,896,360.30	1,122,478.89	488,930.93	-	-
本期利润	1,726,096.29	22,769,100.62	2,595,013.28	3,122,503.20	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0280	0.0217	0.0271	0.0040		-
本期基金份额净值增长率	2.63%	2.72%	2.80%	3.10%	-	-
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	0.0398	0.0434	0.0119	0.0145	-	-
期末基金资产净值	48,797,463.36	450,228,218.35	87,053,470.06	2,933,577,537.88	-	-
期末基金份额净值	1.055	1.059	1.028	1.031	-	-

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

平安大华鑫享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标准差④	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.09%	0.11%	-0.71%	0.27%	0.80%	-0.16%
过去六个月	1.25%	0.09%	1.79%	0.26%	-0.54%	-0.17%
过去一年	2.63%	0.07%	-1.68%	0.43%	4.31%	-0.36%
自基金合同生效起至今	5.50%	0.10%	1.21%	0.53%	4.29%	-0.43%

平安大华鑫享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	0.19%	0.11%	-0.71%	0.27%	0.90%	-0.16%
过去六个月	1.44%	0.09%	1.79%	0.26%	-0.35%	-0.17%
过去一年	2.72%	0.07%	-1.68%	0.43%	4.40%	-0.36%
自基金合同生效起至今	5.90%	0.11%	1.21%	0.53%	4.69%	-0.42%

注:1.业绩比较基准:沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。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。

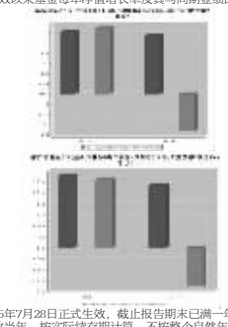
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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7月28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.本基金合同于2015年7月28日正式生效,截止报告期末已满一年.

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

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李黄海	本基金的基金经理	2015年11月4日	2016年12月27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,现担任平安大华鑫享混合型证券投资基金经理。
WANG AO	本基金的基金经理	2016年9月5	-	5	WANG AO先生,CAIA、FRM,澳大利亚莫纳什大学商学(金融学、经济学)学士,曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012年9月加入平安大华基金管理有限公司,担任投资研究部固定收益研究员。华基金鹏有限公司,担任投资研究部固定收益研究员。现任平安大华鑫信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫金定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫利定期开放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,曾任职于西摩证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券,于2015年加入平安大华基金,任权益品投资中心量化研究员,现任平安大华保证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、平安大华鑫安裕合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金经理。
孙健	本基金的基金经理	2015年7月28日	2016年9月5日	16	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"、平安大华智慧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细则、《平安大华鑫享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

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,为基金持有人取得了较好的绝对正收益,2016年全年,以鑫享A为例,份额净值上涨+2.63%,而同期上证综指下跌-12.3%。

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1.055元,份额累计净值为1.055元。报告期内,本基金份额净值增长率为2.63%,同期业绩基准增长率为-1.68%。本基金C份额净值为1.059元,份额累计净值为1.059元。报告期内,本基金份额净值增长率为2.72%,期业绩基准增长率为-1.68%。

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,平安银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对平安大华鑫享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。该基金本报告期内未进行利润分配。

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22065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	平安大华鑫享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享混合型证券投资基金(以下简称"平安大华鑫享混合基金")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鑫享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,上述平安大华鑫享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享混合基金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:平安大华鑫享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		39,716,351.99	1,160,219,099.59
结算备付金		4,199,583.95	14,028,821.77
存出保证金		3,173,032.86	117,492.68
交易性金融资产		450,588,692.38	72,589,693.27
其中:股票投资		102,019,792.38	31,867,729.00
基金投资		-	-
债券投资		348,568,900.00	40,721,964.27
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		-	1,777,893,746.84
应收证券清算款		-	-
应收利息		2,209,797.43	1,381,043.51
应收股利		-	-
应收申购款		597.13	16,504.12
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		499,888,055.74	3,026,246,401.78
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		-	1,613,591.45
应付管理人报酬		440,009.49	2,053,489.29
应付托管费		110,002.40	513,372.31
应付销售服务费		10,160.21	996,311.64
应付交易费用		142,201.93	255,935.62
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		160,000.00	182,693.53
负债合计		862,374.03	5,615,393.84
所有者权益:			
实收基金		471,473,739.10	2,931,440,625.77
未分配利润		27,551,942.61	89,190,382.17
所有者权益合计		499,025,681.71	3,020,631,007.94
负债和所有者权益总计		499,888,055.74	3,026,246,401.78

注:

1. 报告截止日2016年12月31日,基金份额总额471,473,739.10;其中下属A基金份额46,247,985.66份,C类基金份额425,225,75.44。下基A类金份额净值1.055元,C类基金份额净值1.059元。

7.2 利润表

会计主体:平安大华鑫享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7月28日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入		39,496,111.61	11,236,668.74
1.利息收入		21,817,421.63	7,892,200.94
其中:存款利息收入		3,329,182.20	2,290,226.36
债券利息收入		11,734,978.79	2,986,716.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,753,260.64	2,609,821.30
其他利息收入		-	5,436.53
2.投资收益(损失以"-"填列)		22,192,747.85	-988,438.57
其中:股票投资收益		15,934,124.47	1,023,009.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益		5,975,835.95	-2,012,924.33
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		89,316.73	-
股利收益		193,470.50	1,476.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-7,132,727.37	4,106,106.66
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		2,618,669.70	226,799.71
减:二、费用		15,000,914.70	5,519,152.26
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	9,461,646.57	2,883,416.47
2. 托管费	7.4.8.2.2	2,365,411.68	720,854.08
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	2,371,291.32	1,276,504.92
4. 交易费用		380,569.94	436,927.31
5. 利息支出		24,795.19	19,549.48
其中:卖出回购金融资产支出		24,795.19	19,549.48
6. 其他费用		397,200.00	181,900.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		24,495,196.91	5,717,516.48
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		24,495,196.91	5,717,516.48

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:平安大华鑫享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)	2,931,440,625.77	89,190,382.17	3,020,631,007.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	24,495,196.91	24,495,196.91
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)	-2,459,966,886.67	-86,133,636.47	-2,546,100,523.14
其中:1.基金申购款	240,999,439.63	14,630,687.49	255,630,127.12
2.基金赎回款	-2,700,966,326.30	-100,764,323.96	-2,801,730,650.26
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)	471,473,739.10	27,551,942.61	499,025,681.71
项目	上年度可比期间 2015年7月28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)	292,142,291.66	-	292,142,291.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	5,717,516.48	5,717,516.48
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)	2,639,298,334.11	83,472,865.69	2,722,771,199.80
其中:1.基金申购款	2,819,543,451.91	84,050,269.07	2,903,593,719.98
2.基金赎回款	-180,245,117.80	-577,403.38	-180,822,520.18
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)	2,931,440,625.77	89,190,382.17	3,020,631,007.94

报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

平安大华鑫享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?第1330号《关于准予平安大华鑫享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《平安大华鑫享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292,126,072.70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899号验资报告予以验证。经向经向中国证监会备案,《平安大华鑫享混合型证券投资基金基金合同》于2015年7月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为292,142,291.66份基金份额,其中认购资金利息折合16,218.96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,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称"平安银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鑫享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,包括国内依法公开发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金等固定收益类资产,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。

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2016年3月30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》、《平安大华鑫享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[2003]91号《关于证券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,金融业纳税增值税改为缴纳增值税。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
平安银行股份有限公司("平安银行")	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
平安证券有限责任公司("平安证券")	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股份公司
上海陆金所资产管理有限公司	与基金管理人受同一实际控制的公司

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的交易。

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无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.1.3