平安大华行业先锋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30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	平安大华行业先锋混合
基金主代码	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
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	292,993,192.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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机遇势性规律,把握不同行业在此变化趋势中可行的投资机会,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、潜条),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,统筹考虑短、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×85%+中证全债指数收益率×15%
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。

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	2014年
本期已实现收益	-126,503,097.78	256,066,180.96	259,943,068.02
本期利润	-179,286,907.85	281,685,588.66	188,713,268.86
加权平均基金份额本期利润	-0.5729	0.6926	0.2538
本期基金份额净值增长率	-33.86%	39.51%	23.05%
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	0.1349	0.7159	0.2302
期末基金资产净值	332,507,999.84	533,584,697.98	723,903,167.09
期末基金份额净值	1.135	1.716	1.230

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。

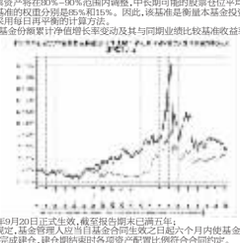
3.2 基金净值表现

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	-11.12%	0.87%	1.23%	0.61%	-12.35%	0.26%
过去六个月	-13.29%	0.89%	4.29%	0.65%	-17.58%	0.24%
过去一年	-33.86%	1.89%	-9.12%	1.19%	-24.74%	0.70%
过去三年	14.10%	2.13%	41.15%	1.52%	-27.05%	0.61%
过去五年	60.91%	1.84%	41.62%	1.38%	19.29%	0.46%
自基金合同生效起至今	45.31%	1.79%	27.59%	1.37%	17.72%	0.42%

注:1.业绩比较基准:2*沪300指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%。2*沪300指数约成分股样本选自沪、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,以成为广发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,通常状况下基金在运作过程中股票资产将在30%-90%范围内调整,中长期可用的股票仓位平均在85%左右。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准的权重分别是85%和15%。因此,该基准是衡量本基金投资业绩的理想基准。

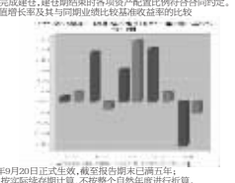
2.3.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1.本基金基金合同于2011年9月20日正式生效,截至报告期末已满五年;

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 过去五年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2011年9月20日正式生效,截至报告期末已满五年;

2.2011年基金合同生效当年,按实际存期计算,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

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
2016	-	-	-	-	-
2015	-	-	-	-	-
2014	1.000	59,567,767.39	10,925,780.23	70,493,547.62	-
合计	1.000	59,567,767.39	10,925,780.23	70,493,547.62	-

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团队

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%;三亚盈润旅业有限公司,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,为投资人量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136亿元。

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		
傅浩	平安大华行业先锋混合证券投资基金的基金经理	2016年8月16日	-	8	中山大学金融学硕士,8年证券从业经验,曾任国都证券有限责任公司行业研究员,广发证券资产管理(广东)有限公司投资经理,2016年5月加入平安大华基金管理公司,任投资研究部投资经理,现任平安大华行业先锋混合型证券投资基金基金经理。
胡昆明	基金经理	2014年9月12日	2016年9月1日	13	北京大学光华管理学院硕士,13年证券基金从业经验,曾先后任职于巨田证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、平安资产管理有限公司担任行业研究员、行业研究经理、高级行业研究经理,2009年加入平安大华基金管理有限公司,担任行业研究员,曾任平安大华行业先锋混合型证券投资基金基金经理。

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,《平安大华行业先锋股票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 管理人对报告期内办公场所的专项说明

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》,本基金管理人严格遵守《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投资交易监控及处理制度》,严格执行法律法规及制度要求,从以下六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督稽核力度,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,四是明确投资制度和路线,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事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将投资决策与交易执行相分离,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日内和当天三个不同的时间窗口,对本基金管理人投资组合作在本报告期连续同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 异常交易行为的专门说明

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

2016年A股市场经历了较大幅度的波动和板块轮换。年初在人民币大幅贬值、熔断等事件的冲击下,市场指数出现系统性下跌。由于年初产品股票仓位保持在高位,上半年组合收益经历了较大的损失,上半年产品组合整体收益率-23.7%,排名市场倒后。

上半年产品较差的收益率和排名使得后续投资操作处于相对被动的状态。整体上看,下半年在投资操作上有得有失,业绩表现没有达到预期的效果。三季度我们基于对外围政治经济环境的不确定性以及国内经济内在运行的大环境,集中配置了黄金、大消费、农业等避险及内需板块的品种,在三季度获得了较好的效果。三季度产品业绩没有跑赢大盘,在四季度,市场风格出现了较大的变化:特别是当选美国总统后,市场对基建投资和基本金属的需求变得乐观,乐观的预期导致大宗商品的价格出现上涨,上游资源品行业和中游周期行业出现轮换的上涨行情。但事实证明这种行情的启动更多基于逻辑的推理,在当时没有实质性的基本面行情支撑下,行情的波动、轮换、调整是不可避免的。我们在四季度开始进行了快速的调整。我们在四季度并没有把握住板块的轮动节奏,在有色、煤炭等板块行情的判断上出现较大失误,导致四季度产品业绩不达预期。全年来看,行业先锋产品净值全年下跌33.86%,排名市场靠后,没有达到管理人的预期。

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1.135元,份额累计净值为1.415元。报告期内,本基金份额净值增长率为-33.86%,同期业绩基准增长率为-9.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年,我们认为从去年四季度以来,PMI、工业增加值等经济指标已经出现明显的回暖态势,国内经济环境企稳回升的趋势已经较为确定。另一方面,欧洲和日本经济也已经开始企稳回升,特别是上台特朗普的基建投资加速以及减税的政策预期将市场对全球经济复苏的信心增强,这推升了国内商品价格的高涨上行,国内宏观方面,供给侧改革进一步向纵深,建材等中游行业保进,中游行业的盈利水平改善明显,但另一方面,货币政策方面利率上升的趋势已经比较明显,货币政策中性偏紧的格局将会对市场估值造成一定压制。

我们认为,目前的市场是一个基本面向上趋势和估值处于下行的反复博弈过程,所以股数本身可能推持震荡格局,但板块的分化依然会非常明显。一季度我们整体的板块配置思路是沿着经济复苏的主线去配置,目前出现的变量是利率的上行趋势已经明朗,在行业选择上会尽量回避受利率上行压制估值的板块,优选受益利率上行的行业。在2017年我们未来将重点布局和关注的方向包括:

1)大石化板块:欧佩克限产执行的情况比较乐观,油价仍将维持温和上涨趋势,油价上涨带来石化链条的盈利改善的投资机会。

2)"一带一路"板块。"一带一路"政策在十三五会是落地期,在目前的政策和外交环境下,一带一路更可能上升为和美国贸易保护政策进行大国博弈的政策工具,后续的催化剂可能会逐步增多,在一带一路沿线国家有业务积累和竞争力的上市公司将会实质受益。

3)同时受益利率上行和经济复苏的大金融板块。主要关注保险和银行,在经济复苏和利率温和上行的大环境下,以银行为代表的大金融行业有望迎来盈利和估值双升的市场环境。

4)消费电子。虽然开年以来消费电子经历调整,但国统平果8手机的各个创新链条今年依然有投资机会,我们看好其中的龙头公司的表现。

5)军工板块。军工板块叠加着双重逻辑催化:(1)全球范围内政治和外交环境的不确定性带来的机会。(2)国内混改政策在军工集团的落地带来的机会。

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、合规检查等各项合规管理措施以及定时监控、定期检查、专项检查等方式,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、邮件等多种形式为员工了投资者教育工作。

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,由投研岗、运营岗及监察稽核岗相关人员组成。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,负责定期评议公司估值政策、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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对平安大华行业先锋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,完全履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22043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	平安大华行业先锋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行业先锋混合型证券投资基金(以下简称"平安大华行业先锋混合基金")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行业先锋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")及有关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。审计工作还包括评估基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评估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,上述平安大华行业先锋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行业先锋混合基金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	曹荣丽　　迟晓红
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28日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:平安大华行业先锋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		63,667,328.12	37,857,990.59
结算备付金		7,689,165.58	5,954,155.68
存出保证金		349,882.09	592,586.36
交易性金融资产		254,004,613.94	504,925,146.21
其中:股票投资		254,004,613.94	504,925,146.21
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收证券清算款		12,840,990.26	5,614,259.60
应收利息		11,280.19	10,553.85
应收股利		-	-
应收申购款		200,718.33	57,836.67
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		338,763,978.51	555,012,528.96
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		1,065,496.98	4,889,463.25
应付赎回款		123,303.26	754,038.28
应付管理人报酬		431,331.33	676,270.11
应付托管费		71,888.56	112,711.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,217,876.45	13,208,865.49
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,346,083.10	1,796,482.18
负债合计		6,255,978.67	21,427,830.98
所有者权益:			
实收基金		292,993,192.19	310,965,843.57
未分配利润		39,514,807.65	222,618,854.41
所有者权益合计		332,507,999.84	533,584,697.98
负债和所有者权益总计		338,763,978.51	555,012,528.96

注:
1.报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.135元,基金份额总额 292,993,192.19份。

7.2 利润表

会计主体:平安大华行业先锋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		-159,567,350.92	310,786,131.56
1.利息收入		510,821.28	1,500,370.03
其中:存款利息收入		487,212.05	684,744.08
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,609.23	815,625.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-107,360,710.77	283,265,198.36
其中:股票投资收益		-108,921,951.79	282,148,428.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		1,561,241.02	1,106,769.87
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-52,783,810.07	25,619,407.70
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		66,348.64	411,155.46
减:二.费用		19,719,556.93	29,100,542.89
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	5,916,286.35	10,007,112.11
2. 托管费	7.4.8.2.2	986,047.70	1,667,851.99
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		12,382,011.56	17,006,690.19
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		435,211.32	418,888.60
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-179,286,907.85	281,685,588.66
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		-179,286,907.85	281,685,588.66

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:平安大华行业先锋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)	310,965,843.57	222,618,854.41	533,584,697.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	-179,286,907.85	-179,286,907.85
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)	-17,972,651.38	-3,817,138.91	-21,789,790.29
其中:1.基金申购款	63,115,263.94	16,947,776.18	80,063,040.12
2.基金赎回款	-81,087,915.32	-20,764,915.09	-101,852,830.41
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)	292,993,192.19	39,514,807.65	332,507,999.84

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)	588,446,441.27	135,456,725.82	723,903,167.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动 (本期净利润)	-	281,685,588.66	281,685,588.66
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)	-277,480,597.70	-194,523,460.07	-472,004,057.77
其中:1.基金申购款	166,844,349.74	140,525,851.99	307,370,201.73
2.基金赎回款	-444,324,947.44	-335,049,312.06	-779,374,259.50
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)	310,965,843.57	222,618,854.41	533,584,697.98

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　　林展文　　陈果

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

平安大华行业先锋混合型证券投资基金(原名为平安大华行业先锋股票型证券投资基金,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[2011]第1111号《关于核准平安大华行业先锋股票型证券投资基金募集的批复》的核准,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《平安大华行业先锋股票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了人民币3,197,219,239.94元,经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2011)验字第60937497_H01号验资报告。经向中国证监会备案,《平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金合同》于2011年9月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,198,116,247.37份基金份额。其中认购资金利息折合9306,007.43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2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,平安大华行业先锋股票型证券投资基金于2015年8月5日公告后更名为平安大华行业先锋混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华行业先锋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的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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。本基金投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-40%,其中权证投资比例不高于基金资产净值的3%,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留现金以及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%。本基金的业绩比较基准为:2*沪300指数收益率×85%+中证全债指数收益率×15%。

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》、《平安大华行业先锋混合型证券投资基金合同》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的说明

7.4.5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《关于金融机构开展个人住房抵押贷款试点的通知》,财税[2016]46号《关于进一步明确金融机构开展个人住房抵押贷款试点金融业有关税收政策的通知》,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、债券的收入,免征营业税。自2016年5月1日起,金融业出现纳税义务的,按现行营业税及附加税率3%计缴。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,暂免按50%计入应纳税所得额。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
三亚盈润旅业有限公司	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
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
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

注:上述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

单位:人民币元

关联交易方名称	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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
平安证券	767,175,235.38	9.00%	567,768,624.42	4.75%

7.4.8.1.2 债券交易

单位:人民币元

关联交易方名称	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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

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