

平安大华保本混合型证券投资基金 2015 年 年度报告 摘要

2015 年 12 月 31 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

送出日期：2016 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 2016 年 3 月 29 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。

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。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 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	587,287,637.88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	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、基金托管人处

§ 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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	28,289,090.85	51,262,606.67	45,847,251.08
本期利润	29,650,352.91	61,534,781.83	26,895,982.35
加权平均基金份额本期利润	0.0905	0.1570	0.0363
本期基金份额净值增长率	5.39%	13.58%	2.35%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2017	0.1881	0.0465
期末基金资产净值	589,384,396.34	371,925,595.34	565,716,172.44
期末基金份额净值	1.004	1.188	1.046

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	0.89%	0.05%	0.63%	0.01%	0.26%	0.04%
过去六个月	-10.38%	0.49%	1.35%	0.01%	-11.73%	0.48%
过去一年	5.39%	0.71%	3.07%	0.01%	2.32%	0.70%
过去三年	22.51%	0.47%	11.69%	0.01%	10.82%	0.46%

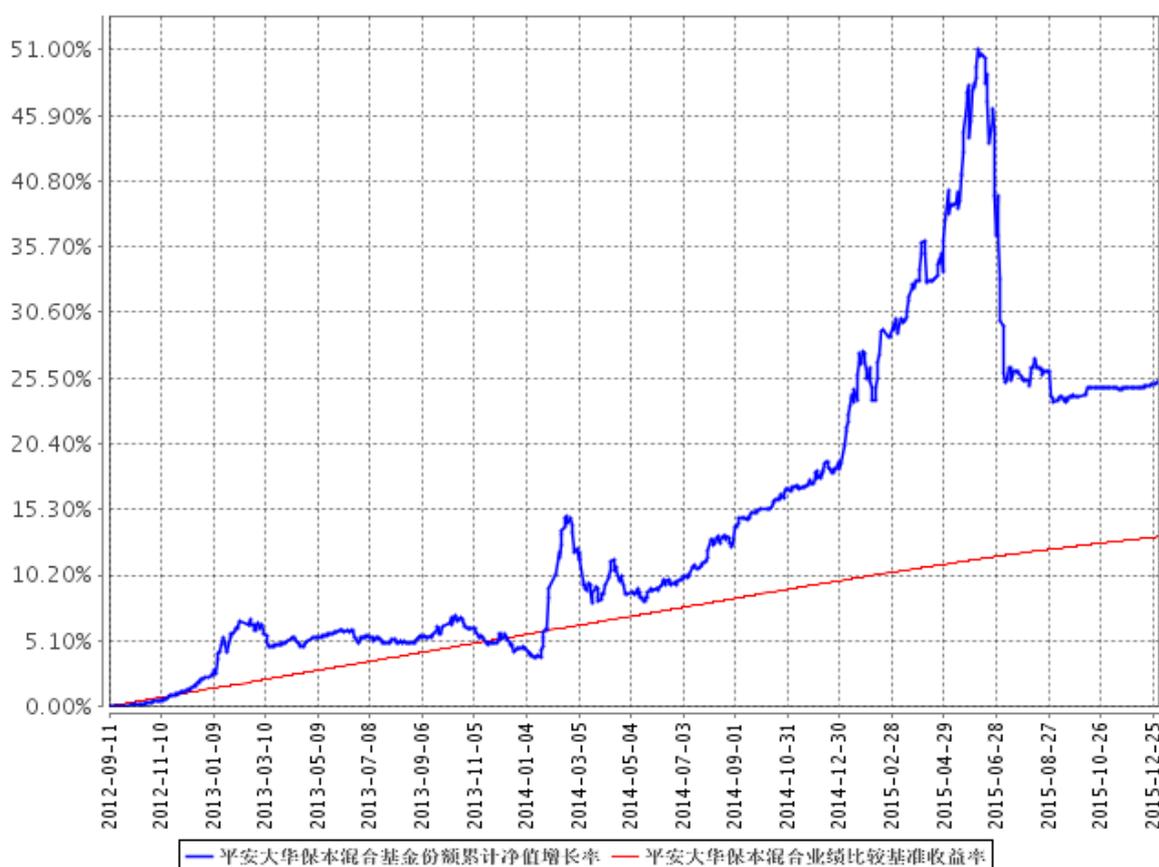
自基金合同生效起至今	25.20%	0.45%	13.14%	0.01%	12.06%	0.44%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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

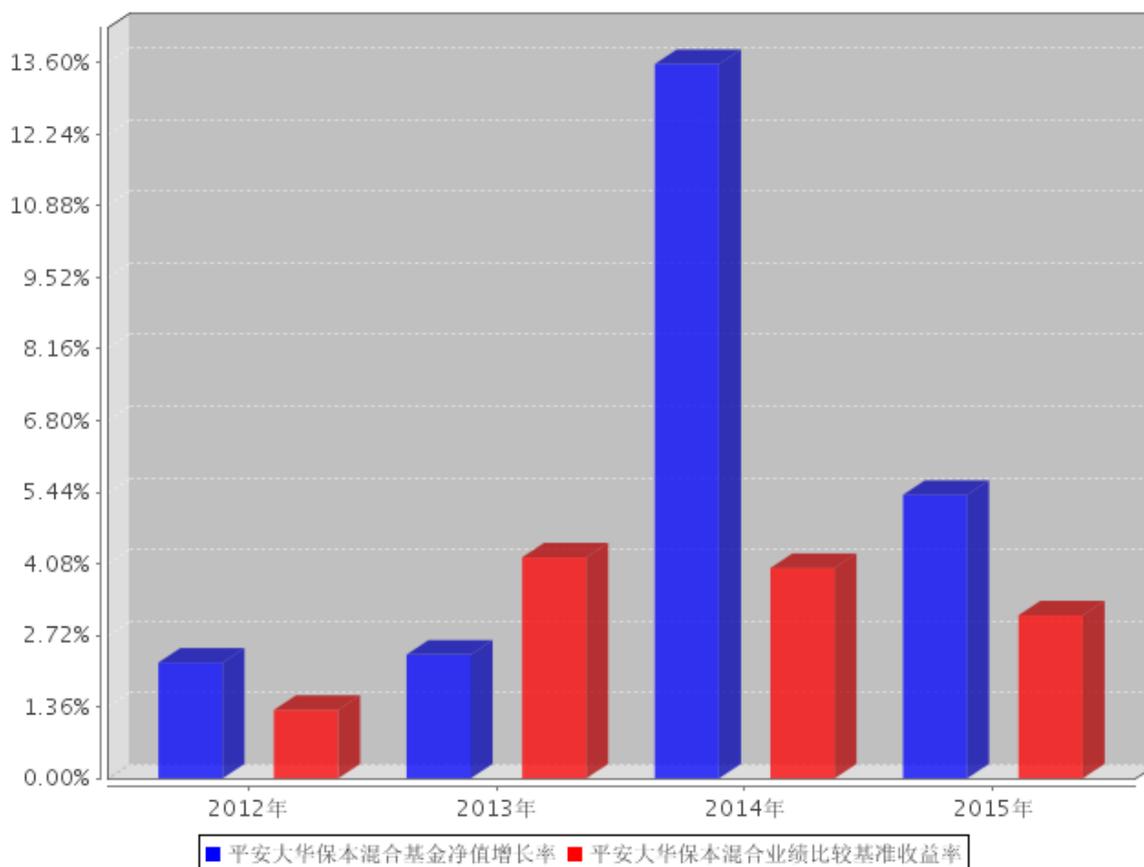
平安大华保本混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 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。

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

平安大华保本混合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对比图



1. 本基金合同于 2012 年 9 月 11 日正式生效，截止报告期末已满三年。
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 2015 年 12 月 31 日，平安基金共管理 11 只开放式基金，资产管理总规模超 384 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		
孙健	本基金的基金经理	2012 年 9 月 11 日	-	15	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 大华新鑫 先锋混合 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 大华鑫亨 混合型证 券投资基 金基金经 理、平安 大华鑫安 混合型证 券投资基 金基金经 理。
--	--	--	--	--	---

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。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

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》、《公开募集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，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

保本 3 年周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，本基金份额净值为 1.004 元，份额累计净值为 1.252 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 5.39%，同期业绩基准增长率为 3.10%。

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 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。

4.7 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。

4.8 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关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

经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		217,491,244.83	21,433,136.51
结算备付金		2,857,142.86	525,405.28
存出保证金		233,148.48	192,074.46
交易性金融资产		390,138,810.89	360,159,205.85
其中：股票投资		20,139.94	42,088,307.10
基金投资		-	-
债券投资		390,118,670.95	318,070,898.75
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		-	-
应收利息		5,005,190.21	2,330,501.18
应收股利		-	-
应收申购款		26,123.47	25,051.75
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		615,751,660.74	384,665,375.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 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		20,670,197.70	7,292,674.96
应付赎回款		985,187.56	313,430.99
应付管理人报酬		608,683.55	384,752.32
应付托管费		101,447.28	64,125.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,387,000.30	4,409,751.73

应交税费		235,200.00	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		379,548.01	275,044.26
负债合计		26,367,264.40	12,739,779.69
所有者权益：			
实收基金		470,937,173.23	313,036,070.53
未分配利润		118,447,223.11	58,889,524.81
所有者权益合计		589,384,396.34	371,925,595.34
负债和所有者权益总计		615,751,660.74	384,665,375.03

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.004 元，基金份额总额 587,287,637.88 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		41,482,909.44	72,021,617.28
1. 利息收入		8,586,497.94	11,519,254.98
其中：存款利息收入		1,235,490.78	1,060,293.22
债券利息收入		6,648,269.33	9,492,729.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		702,737.83	966,232.37
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		30,861,677.75	49,279,920.90
其中：股票投资收益		14,665,847.15	53,054,343.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益		15,860,022.69	-4,393,670.69
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		335,807.91	619,248.38
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,361,262.06	10,272,175.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		673,471.69	950,266.24
减：二、费用		11,832,556.53	10,486,835.45
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	4,257,178.47	5,274,394.72

2. 托管费	7.4.8.2.2	709,529.83	879,065.80
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		6,160,702.99	3,695,928.72
5. 利息支出		288,530.93	212,606.95
其中：卖出回购金融资产支出		288,530.93	212,606.95
6. 其他费用		416,614.31	424,839.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,650,352.91	61,534,781.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,650,352.91	61,534,781.83

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	540,596,503.42	25,119,669.02	565,716,172.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	61,534,781.83	61,534,781.83
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）	-227,560,432.89	-27,764,926.04	-255,325,358.93
其中：1. 基金申购款	12,466,060.20	1,728,898.33	14,194,958.53
2. 基金赎回款	-240,026,493.09	-29,493,824.37	-269,520,317.46
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）	313,036,070.53	58,889,524.81	371,925,595.34

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 张南南
 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。

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 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述事项外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。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 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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
建设银行股份有限公司	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
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

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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

平安证券有限	2,086,581,357.24	48.06%	612,753,614.55	22.78%
--------	------------------	--------	----------------	--------

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
平安证券有限	10,959,211.83	4.89%	353,100,888.03	38.83%

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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
平安证券有限	31,000,000.00	2.98%	1,550,800,000.00	87.58%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金于本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 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
平安证券有限 责任公司	1,899,618.23	54.64%	1,899,618.23	56.27%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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 (%)
平安证券有限 责任公司	557,849.34	28.04%	2,547,548.29	58.00%

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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,257,178.47	5,274,394.72
其中：支付销售机构的客户维护费	1,556,689.60	1,695,645.47

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司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×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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	709,529.83	879,065.80

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×0.20% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

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

本基金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

本基金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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	217,491,244.83	956,297.81	21,433,136.51	999,160.74

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

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

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无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015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

7.4.10.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
112303	15京威债	2015年12月11日	2016年1月5日	新债未上市	99.99	99.99	200,000	19,998,027.40	19,998,027.40	-
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	新债未上市	99.99	99.99	5,240	523,965.55	523,965.55	-

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
600988	赤峰	2015年	重大	11.57	2016年	12.73	1,000	15,574.98	11,570.00	-

	黄金	8月31日	事项		1月5日					
000712	锦龙股份	2015年12月25日	重大事项	29.12	2016年1月4日	28.00	52	2,349.44	1,514.24	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因重大事项可能产生重大影响被暂时停牌的股票，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

本基金于本期末未持有银行间市场债券正回购。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本期末未持有交易所市场债券正回购。

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 2015 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 7,055.70 元，属于第二层次的余额为 390,131,755.19 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 135,299,005.85 元，第二层次 224,860,200.00 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。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)，本基金于 2015 年 3 月 31 日起改为采用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》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 2015 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资产(2014 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	20,139.94	0.00
	其中：股票	20,139.94	0.00
2	固定收益投资	390,118,670.95	63.36
	其中：债券	390,118,670.95	63.36
	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	220,348,387.69	35.79
7	其他各项资产	5,264,462.16	0.85
8	合计	615,751,660.74	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	11,570.00	0.00
C	制造业	7,055.70	0.00
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,514.24	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,139.94	0.00

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	600988	赤峰黄金	1,000	11,570.00	0.00

2	601877	正泰电器	130	3,352.70	0.00
3	600312	平高电气	100	1,950.00	0.00
4	002348	高乐股份	100	1,753.00	0.00
5	000712	锦龙股份	52	1,514.24	0.00

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于平安大华基金管理有限公司网站（<http://www.fund.pingan.com>）的年度报告正文。

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	600352	浙江龙盛	103,565,452.42	27.85
2	300210	森远股份	71,370,757.38	19.19
3	600703	三安光电	70,095,016.85	18.85
4	002236	大华股份	51,415,937.61	13.82
5	600397	安源煤业	39,630,877.72	10.66
6	002450	康得新	39,091,954.44	10.51
7	600711	盛屯矿业	33,445,849.24	8.99
8	600820	隧道股份	33,412,048.19	8.98
9	600835	上海机电	32,770,029.58	8.81
10	000039	中集集团	31,976,183.66	8.60
11	300147	香雪制药	31,479,142.55	8.46
12	601877	正泰电器	28,963,591.95	7.79
13	600118	中国卫星	28,851,057.38	7.76
14	002653	海思科	27,902,960.69	7.50
15	600170	上海建工	24,472,090.21	6.58
16	600787	中储股份	23,369,071.93	6.28
17	601179	中国西电	23,353,586.90	6.28
18	002353	杰瑞股份	22,588,825.34	6.07
19	600340	华夏幸福	21,907,905.14	5.89
20	600089	特变电工	21,877,608.10	5.88
21	601992	金隅股份	21,490,759.33	5.78
22	000783	长江证券	21,482,887.96	5.78
23	600171	上海贝岭	21,343,591.82	5.74

24	002037	久联发展	21,259,090.80	5.72
25	601088	中国神华	21,100,413.66	5.67
26	601015	陕西黑猫	20,686,455.93	5.56
27	600395	盘江股份	20,439,216.87	5.50
28	600583	海油工程	19,463,309.61	5.23
29	600332	白云山	19,172,609.50	5.15
30	000712	锦龙股份	19,141,256.18	5.15
31	002261	拓维信息	19,024,333.99	5.12
32	600376	首开股份	18,852,467.38	5.07
33	002230	科大讯飞	18,840,069.36	5.07
34	002216	三全食品	18,550,790.97	4.99
35	601808	中海油服	18,112,776.57	4.87
36	600406	国电南瑞	16,414,097.01	4.41
37	300159	新研股份	15,983,508.03	4.30
38	002454	松芝股份	15,931,442.26	4.28
39	601601	中国太保	15,545,889.36	4.18
40	002339	积成电子	15,449,232.00	4.15
41	600436	片仔癀	15,181,218.32	4.08
42	600485	信威集团	15,109,313.34	4.06
43	601628	中国人寿	15,049,803.41	4.05
44	601233	桐昆股份	14,795,466.19	3.98
45	600674	川投能源	14,465,977.03	3.89
46	600270	外运发展	13,193,470.24	3.55
47	600066	宇通客车	13,169,214.73	3.54
48	000063	中兴通讯	13,027,207.89	3.50
49	002074	国轩高科	12,983,482.57	3.49
50	002008	大族激光	12,959,614.59	3.48
51	600826	兰生股份	12,625,568.06	3.39
52	000060	中金岭南	12,598,961.58	3.39
53	002155	湖南黄金	12,578,551.00	3.38
54	600850	华东电脑	12,505,451.00	3.36
55	002294	信立泰	11,988,261.79	3.22
56	000333	美的集团	11,785,891.50	3.17
57	300370	安控科技	11,731,963.00	3.15
58	300124	汇川技术	11,688,317.63	3.14
59	600557	康缘药业	11,669,394.54	3.14

60	300115	长盈精密	11,587,948.62	3.12
61	600288	大恒科技	11,586,881.44	3.12
62	600309	万华化学	11,539,147.70	3.10
63	600392	盛和资源	11,438,815.01	3.08
64	002205	国统股份	11,406,565.00	3.07
65	002415	海康威视	11,286,716.21	3.03
66	000961	中南建设	11,249,774.47	3.02
67	002051	中工国际	11,194,162.97	3.01
68	002650	加加食品	11,150,655.88	3.00
69	002148	北纬通信	11,116,701.00	2.99
70	002376	新北洋	11,000,828.07	2.96
71	600563	法拉电子	10,984,095.17	2.95
72	002402	和而泰	10,970,494.25	2.95
73	600135	乐凯胶片	10,888,618.85	2.93
74	300186	大华农	10,872,714.00	2.92
75	601688	华泰证券	10,736,297.25	2.89
76	601398	工商银行	10,692,550.00	2.87
77	600546	山煤国际	10,690,906.00	2.87
78	002594	比亚迪	10,480,973.40	2.82
79	002025	航天电器	10,442,109.32	2.81
80	000726	鲁泰A	10,391,225.00	2.79
81	600879	航天电子	10,387,010.00	2.79
82	002190	成飞集成	10,349,968.74	2.78
83	000976	*ST春晖	10,340,207.00	2.78
84	600895	张江高科	10,294,458.80	2.77
85	600312	平高电气	9,987,530.15	2.69
86	600036	招商银行	9,888,174.00	2.66
87	300207	欣旺达	9,491,463.00	2.55
88	300037	新宙邦	9,183,775.61	2.47
89	002399	海普瑞	9,112,674.81	2.45
90	002091	江苏国泰	8,993,088.10	2.42
91	000969	安泰科技	8,949,977.55	2.41
92	601918	国投新集	8,914,927.00	2.40
93	002465	海格通信	8,634,986.00	2.32
94	002108	沧州明珠	8,520,976.88	2.29
95	300193	佳士科技	8,360,623.00	2.25

96	002595	豪迈科技	7,967,957.58	2.14
97	000568	泸州老窖	7,870,657.04	2.12
98	300236	上海新阳	7,705,337.85	2.07
99	002123	荣信股份	7,692,810.98	2.07
100	600872	中炬高新	7,685,490.99	2.07
101	600517	置信电气	7,680,553.20	2.07
102	000625	长安汽车	7,670,602.34	2.06
103	600551	时代出版	7,653,298.75	2.06
104	002460	赣锋锂业	7,639,395.33	2.05
105	002348	高乐股份	7,631,575.99	2.05
106	600143	金发科技	7,597,725.85	2.04
107	600987	航民股份	7,597,024.20	2.04
108	002064	华峰氨纶	7,575,283.99	2.04

注：“买入金额”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。

8.4.2 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	600352	浙江龙盛	123,936,021.84	33.32
2	300210	森远股份	73,744,748.44	19.83
3	600703	三安光电	67,731,353.97	18.21
4	002236	大华股份	52,557,915.24	14.13
5	600397	安源煤业	44,478,501.56	11.96
6	002450	康得新	39,793,016.78	10.70
7	002241	歌尔声学	37,532,393.15	10.09
8	600820	隧道股份	37,053,065.93	9.96
9	300147	香雪制药	33,454,272.97	8.99
10	600118	中国卫星	31,805,226.38	8.55
11	002653	海思科	31,333,797.64	8.42
12	600835	上海机电	30,483,761.90	8.20
13	601877	正泰电器	30,136,480.95	8.10
14	600711	盛屯矿业	28,755,191.29	7.73
15	600170	上海建工	23,580,386.47	6.34
16	002037	久联发展	23,160,829.90	6.23
17	600787	中储股份	22,738,559.60	6.11
18	601179	中国西电	22,650,054.43	6.09

19	601015	陕西黑猫	21,643,978.16	5.82
20	601088	中国神华	21,518,301.91	5.79
21	600089	特变电工	21,503,037.33	5.78
22	600395	盘江股份	21,409,812.03	5.76
23	002353	杰瑞股份	21,028,677.76	5.65
24	000039	中集集团	20,737,063.39	5.58
25	000783	长江证券	20,413,610.44	5.49
26	600376	首开股份	20,340,424.95	5.47
27	600340	华夏幸福	19,713,189.40	5.30
28	002261	拓维信息	19,541,231.60	5.25
29	600332	白云山	19,379,277.55	5.21
30	002216	三全食品	19,328,675.22	5.20
31	600583	海油工程	19,066,047.54	5.13
32	002230	科大讯飞	18,913,572.00	5.09
33	601992	金隅股份	18,458,726.63	4.96
34	600406	国电南瑞	18,438,763.90	4.96
35	601808	中海油服	17,739,897.92	4.77
36	000712	锦龙股份	17,712,293.00	4.76
37	300159	新研股份	16,604,084.89	4.46
38	600171	上海贝岭	16,574,648.93	4.46
39	600436	片仔癀	16,548,782.42	4.45
40	002454	松芝股份	16,525,024.67	4.44
41	002339	积成电子	15,494,799.37	4.17
42	600485	信威集团	15,216,601.97	4.09
43	601601	中国太保	14,868,386.53	4.00
44	601233	桐昆股份	14,685,161.06	3.95
45	600826	兰生股份	14,566,927.46	3.92
46	600674	川投能源	14,473,758.73	3.89
47	601628	中国人寿	13,778,375.04	3.70
48	002008	大族激光	13,385,464.92	3.60
49	002594	比亚迪	13,297,637.06	3.58
50	002074	国轩高科	13,236,219.09	3.56
51	000063	中兴通讯	12,991,547.92	3.49
52	300115	长盈精密	12,829,225.74	3.45
53	600066	宇通客车	12,811,224.64	3.44
54	002402	和而泰	12,508,237.67	3.36
55	002155	湖南黄金	12,458,878.74	3.35
56	002415	海康威视	12,376,311.75	3.33

57	600500	中化国际	12,136,987.00	3.26
58	600288	大恒科技	11,990,520.19	3.22
59	002376	新北洋	11,915,227.64	3.20
60	000060	中金岭南	11,900,634.73	3.20
61	002294	信立泰	11,713,489.41	3.15
62	002051	中工国际	11,710,122.00	3.15
63	600557	康缘药业	11,675,950.04	3.14
64	300124	汇川技术	11,662,696.88	3.14
65	000976	*ST 春晖	11,606,145.28	3.12
66	000961	中南建设	11,596,274.70	3.12
67	000333	美的集团	11,585,748.53	3.12
68	600563	法拉电子	11,498,552.17	3.09
69	600546	山煤国际	11,438,730.70	3.08
70	600309	万华化学	11,391,351.00	3.06
71	300186	大华农	11,140,528.00	3.00
72	000726	鲁泰A	11,107,732.62	2.99
73	600135	乐凯胶片	11,060,912.00	2.97
74	002025	航天电器	10,975,477.01	2.95
75	002650	加加食品	10,897,073.81	2.93
76	300370	安控科技	10,814,863.75	2.91
77	600392	盛和资源	10,766,991.52	2.89
78	600312	平高电气	10,633,198.83	2.86
79	002205	国统股份	10,584,278.87	2.85
80	300236	上海新阳	10,579,625.96	2.84
81	600879	航天电子	10,503,858.68	2.82
82	601398	工商银行	10,461,391.34	2.81
83	600270	外运发展	10,080,456.00	2.71
84	300207	欣旺达	9,991,475.00	2.69
85	002190	成飞集成	9,962,501.60	2.68
86	600036	招商银行	9,807,814.00	2.64
87	002348	高乐股份	9,563,397.61	2.57
88	002148	北纬通信	9,497,061.07	2.55
89	601688	华泰证券	9,430,611.09	2.54
90	002091	江苏国泰	9,417,182.13	2.53
91	601918	国投新集	9,327,164.68	2.51
92	002108	沧州明珠	8,907,229.65	2.39
93	002399	海普瑞	8,905,623.32	2.39
94	000969	安泰科技	8,827,055.84	2.37

95	002465	海格通信	8,742,599.00	2.35
96	002460	赣锋锂业	8,573,100.03	2.31
97	600872	中炬高新	8,309,070.89	2.23
98	300193	佳士科技	8,272,813.00	2.22
99	600143	金发科技	8,117,205.07	2.18
100	300037	新宙邦	8,116,943.85	2.18
101	000831	五矿稀土	8,011,299.57	2.15
102	600517	置信电气	7,940,382.82	2.13
103	002123	荣信股份	7,898,302.16	2.12
104	002595	豪迈科技	7,826,778.72	2.10
105	600551	时代出版	7,805,781.81	2.10
106	000568	泸州老窖	7,792,193.34	2.10
107	000503	海虹控股	7,711,670.00	2.07
108	600987	航民股份	7,656,786.99	2.06
109	002064	华峰氨纶	7,571,577.00	2.04

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	2,142,210,321.75
卖出股票收入（成交）总额	2,199,744,538.80

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	25,020,000.00	4.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	93,634,027.40	15.89
5	企业短期融资券	120,387,000.00	20.43
6	中期票据	149,434,000.00	25.35
7	可转债	1,643,643.55	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	390,118,670.95	66.19

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	33,528,000.00	5.69
2	101551025	15 均胜电子 MTN001	300,000	30,879,000.00	5.24
3	1182146	11 凯迪 MTN1	300,000	30,465,000.00	5.17
4	1382188	13 吉利 MTN1	300,000	30,282,000.00	5.14
5	136006	15 鲁星 01	300,000	30,165,000.00	5.12

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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	233,148.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,005,190.21
5	应收申购款	26,123.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,264,462.16

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

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	600988	赤峰黄金	11,570.00	0.00	重大事项
2	000712	锦龙股份	1,514.24	0.00	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		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,876	120,444.60	9,541,929.03	1.62%	577,745,708.85	98.38%

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	9,231.59	0.0016%

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	313, 036, 070. 53
本报告期基金总申购份额	414, 289, 181. 91
减:本报告期基金总赎回份额	265, 765, 556. 63
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	125, 727, 942. 07
本报告期期末基金份额总额	587, 287, 637. 88

§ 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

基金管理人的重大人事变动：

1、2015 年 5 月 20 日，经基金管理人 2015 年第二次股东会议审议通过，同意由冯方女士担任第二届监事会监事，林卸伟先生不再担任基金管理人监事。

2、2015 年 6 月 17 日，基金管理人发布公告，经第二届董事会第十五次会议审议通过，聘任汪涛先生出任公司副总经理职务，任职日期为 2015 年 6 月 16 日。

3、2015 年 10 月 16 日，经基金管理人 2015 年第四次股东会议审议通过，同意由杨玉萍女士担任第二届董事会董事，郑强先生不再担任基金管理人董事。

4、2015 年 10 月 29 日，基金管理人发布公告，经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。

5、2015 年 11 月 3 日，经基金管理人 2015 年第五次股东会议审议通过，同意由肖宇鹏先生担任第二届董事会董事，杨秀丽女士不再担任基金管理人董事。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

1、2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2、2012 年 11 月 15 日，根据工作需要，中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

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 72,000.00 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	22	155,456,842.77	49.64%	1,486,165.42	42.75%	新增 1 个
平安证券	12	86,581,357.24	48.06%	1,899,618.23	54.64%	-
中投证券	1	99,916,137.54	2.30%	90,963.80	2.62%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	152,195,873.46	67.92%	1,009,733,000.00	97.02%	-	-
平安证券	10,959,211.83	4.89%	31,000,000.00	2.98%	-	-
中投证券	60,931,801.29	27.19%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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
2016年3月30日