

# 平安大华鑫享混合型证券投资基金 2015 年 年度报告

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：平安银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 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。

本报告期自 2015 年 7 月 28 日（合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
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.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	58

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.3 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 .....	60
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	63
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录 .....	65
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华鑫享混合型证券投资基金	
基金简称	平安大华鑫享混合型	
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	2,931,440,625.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鑫享 A	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	84,694,461.81 份	2,846,746,163.96 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	张波
	联系电话	0755-22626828	0755-22168073
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	zhangbo746@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080400-0
注册地址		深圳市福田区福华三路星河	深圳市罗湖区深南东路 5047 号

	发展中心大厦酒店 01: 419	
办公地址	深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	孙建一

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

## § 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 7 月 28 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日		2014 年		2013 年	
	鑫享 A	鑫享 C	鑫享 A	鑫享 C	鑫享 A	鑫享 C
本期已实现收益	1,122,478.89	488,930.93	-	-	-	-
本期利润	2,595,013.28	3,122,503.20	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0271	0.0040	-	-	-	-
本期加权平均净值利润率	2.69%	0.39%	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	2.80%	3.10%	-	-	-	-
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	1,006,320.57	41,212,398.74	-	-	-	-

利润						
期末可供分配基金份额利润	0.0119	0.0145	-	-	-	-
期末基金资产净值	87,053,470.06	2,933,577,537.88	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.028	1.031	-	-	-	-
3.1.3 累计期末指标	2015 年末		2014 年末		2013 年末	
基金份额累计净值增长率	2.80%	3.10%	-	-	-	-

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；

4. 本基金基金合同于 2015 年 7 月 28 日正式生效，截至报告期末未满一年。

### 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

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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.21%	0.19%	6.89%	0.50%	-3.68%	-0.31%
自基金合同生效起至今	2.80%	0.15%	2.94%	0.70%	-0.14%	-0.55%

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	3.10%	0.18%	6.89%	0.50%	-3.79%	-0.32%
自基金合同生效起至今	3.10%	0.16%	2.94%	0.70%	0.16%	-0.54%

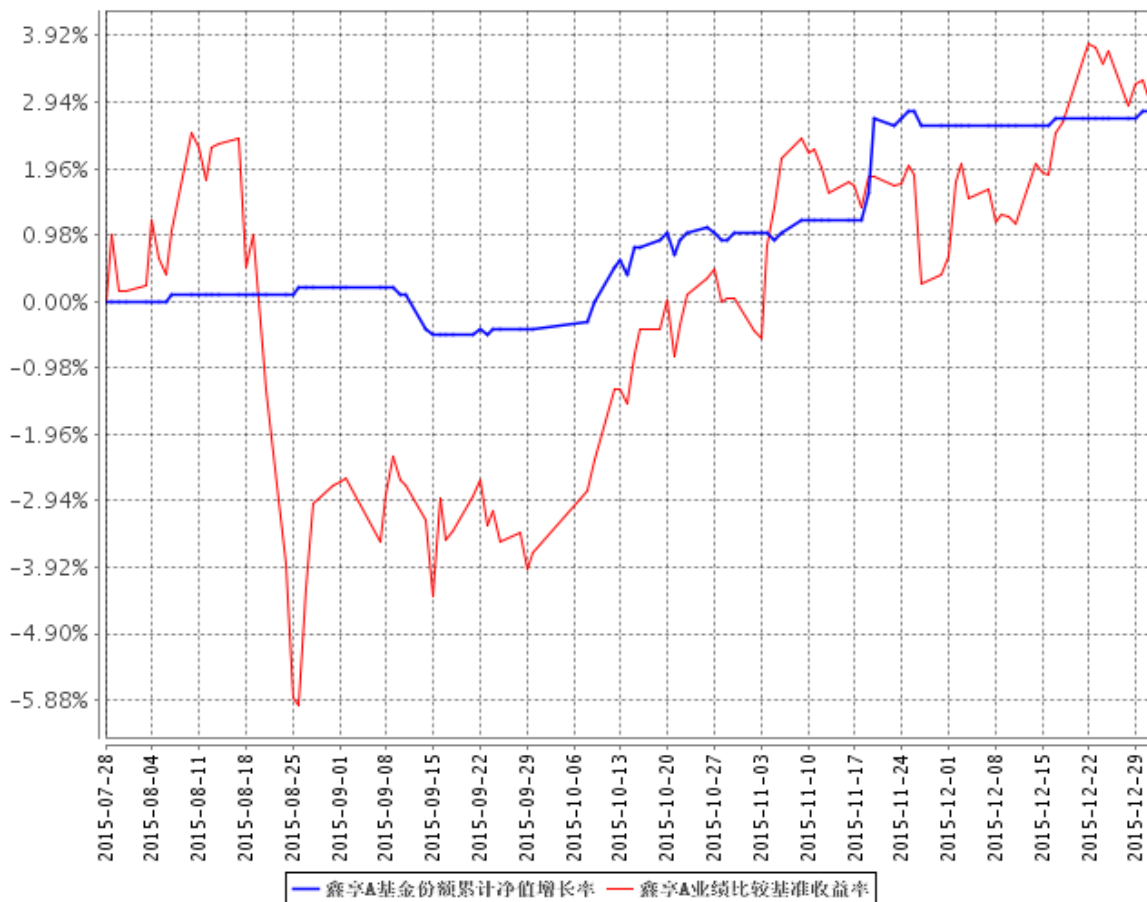
注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证全债指数从沪

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。

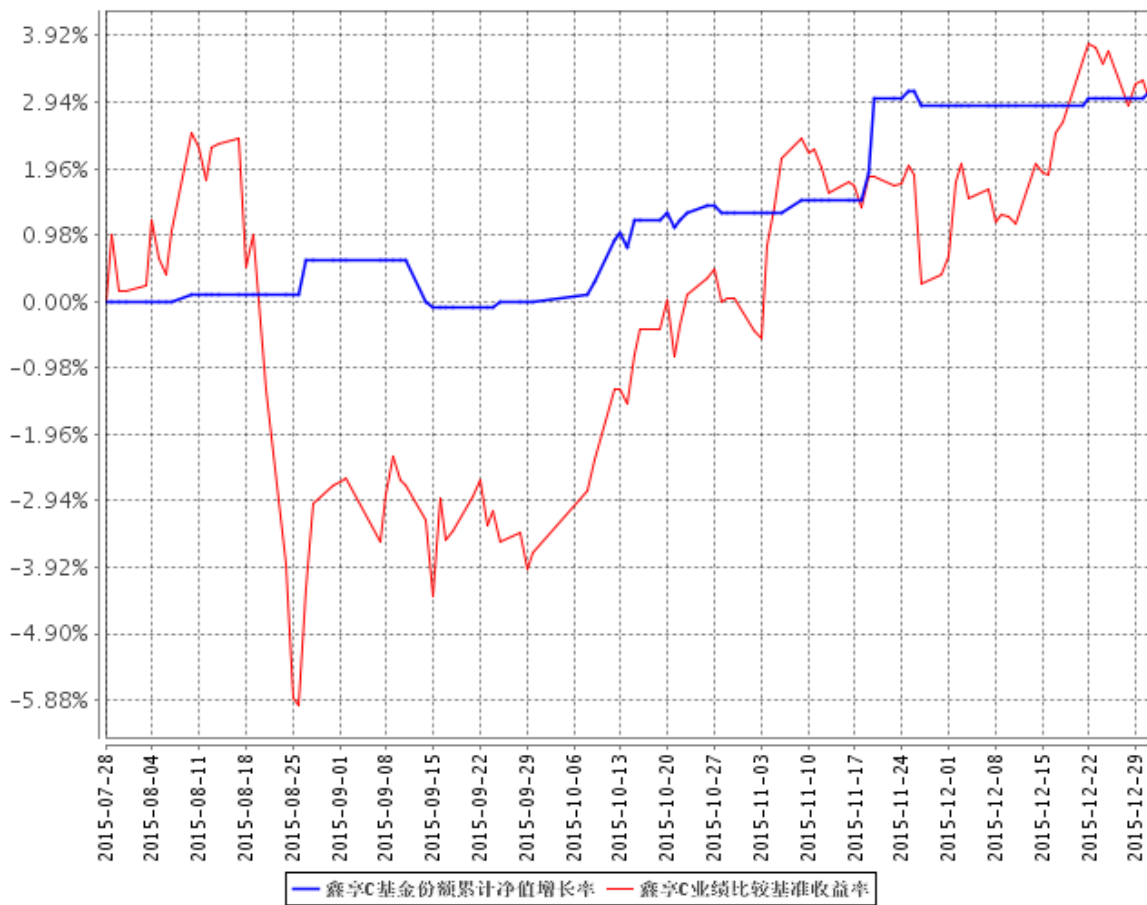
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鑫享A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





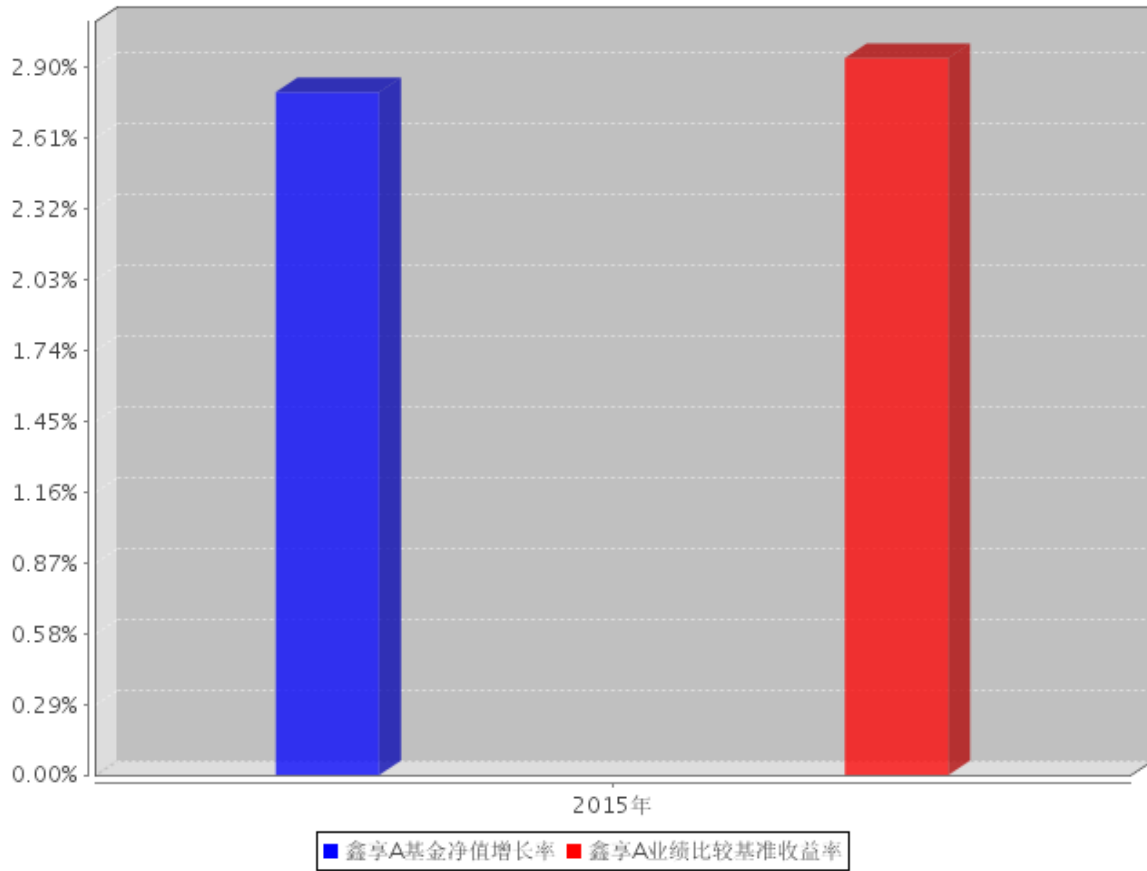
鑫享C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



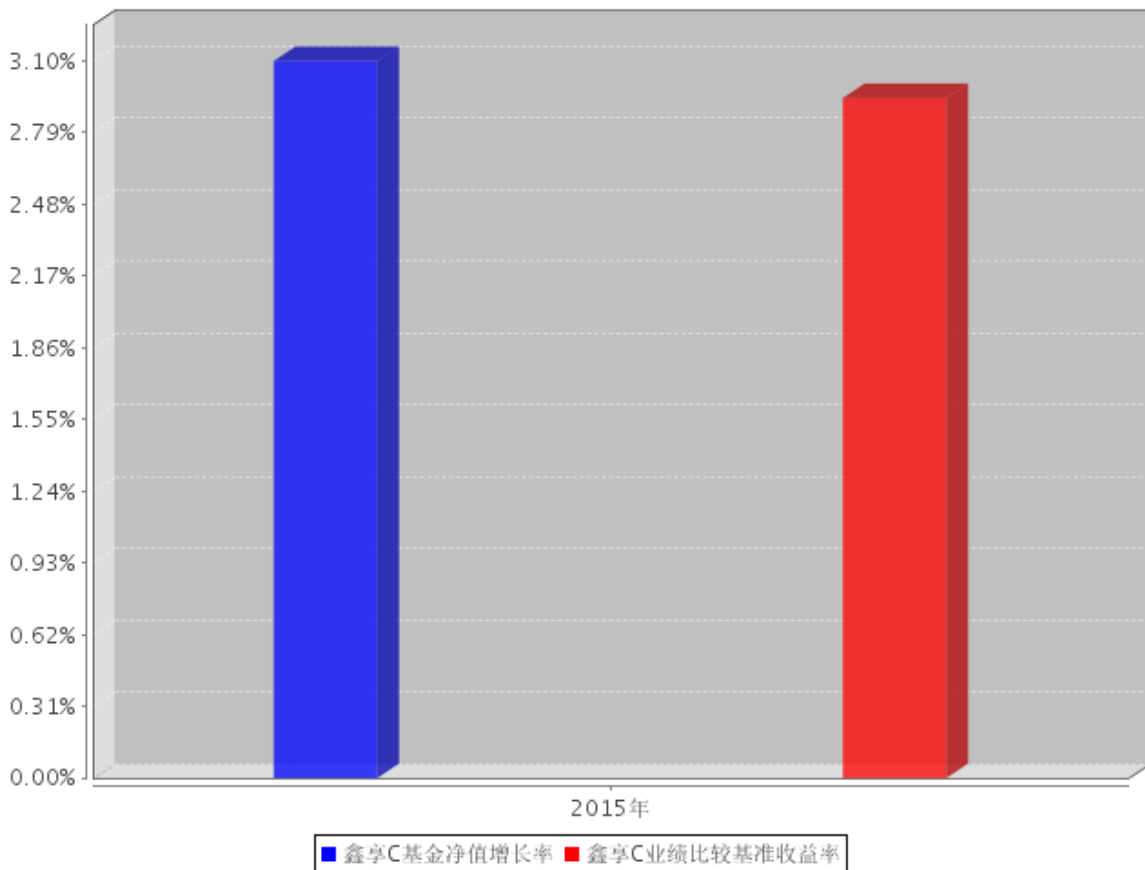
- 1、本基金基金合同于 2015 年 7 月 28 日正式生效，截至报告期末未满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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

鑫享A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



### 鑫享C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 2015 年 7 月 28 日正式生效，截止报告期末未满一年。
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 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2015 年 7 月 28 日正式生效，基金合同生效日至报告期期末，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	2015 年 7 月 28 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、平安大华鑫享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。
李黄海	本基金的基金经理	2015年11月4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合规守信情况的说明

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

对于权益市场，我们在 2015 年度一直秉承审慎投资、以防范风险为首要目标的原则，因此本基金权益投资仓位一直处于相当低的水平，非常好地回避了 2015 年 8 月份本基金成立伊始便遇到的股市大盘暴跌。

固定收益投资方面，三年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 A 份额净值为 1.028 元，份额累计净值为 1.028 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 2.80%，同期业绩基准增长率为 2.94%。本基金 C 份额净值为 1.031 元，份额累计净值为 1.031 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 3.10 期业绩基准增长率为 2.94%。

#### 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 2016 年度，虽然大盘在 2016 年 1 月到 2 月期间又出现了很大幅度的下跌，但我们依然维持谨慎悲观的投资态度，如果 2016 年权益市场存在较大投资机会的话，那也将是下跌之后出现的。

目前的股市存在以下几个特征：

(1) 股票投资者的风险偏好大幅降低，或者说市场投资者的风险厌恶程度极高，从 2015 年 11 月到 2016 年 2 月份，新成立的保本基金规模达到 1012 亿元，保本基金投资者的风险厌恶程度非常高，宁愿放弃较高的权益投资收益，去换取本金的安全。保本基金规模的集中增加，在 2011 年第 2 和第 3 季度也曾经出现过，当时新发行成立了 173 亿元的保本基金。随后在 2011 年下半年出现了股债双跌的情形。虽然股市在 2016 年初已经出了较大幅度的下跌，但展望 2016 年度，我们还需要继续观察市场投资者风险偏好的变化。

(2) 场内资金不足，流动性不足，结构化行情特征明显。截止 2015 年 12 月 31 日，沪深 300 所有成分股静态 ttm 市盈率中位数为 21 倍，而创业板所有个股静态 ttm 市盈率中位数为 112；成长与价值的静态估值比（创业板估值/沪深 300 估值）高达 5.3，创下历史最高！

(3) 而另一方面，资产收益率持续下行，货币市场基金的收益率已经下滑至 2 时代，中国的银行和保险机构在利差持续缩窄的大环境下，面临着越来越严重的“资产荒”。股市处于窘迫的“新常态”：场外巨量资金密切关注着任何盈利机会，随时准备进入股市进行博弈，因此股市表现越发极端，急涨急跌，流动性问题越发严重。股市投资短期化、操作难度加大。

从宏观上看，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。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。公司监察稽核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”）在对平安大华日增利货币市场基金（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

本报告期内，由平安大华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、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）、投资组合报告等内容真实、准确、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（2016）22653 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 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 7 月 28 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日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	2016 年 3 月 24 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：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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,160,219,099.59	-
结算备付金		14,028,821.77	-
存出保证金		117,492.68	-
交易性金融资产	7.4.7.2	72,589,693.27	-
其中：股票投资		31,867,729.00	-
基金投资		-	-
债券投资		40,721,964.27	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,777,893,746.84	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,381,043.51	-
应收股利		-	-
应收申购款		16,504.12	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,026,246,401.78	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
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		2,053,489.29	-
应付托管费		513,372.31	-
应付销售服务费		996,311.64	-
应付交易费用	7.4.7.7	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	7.4.7.8	182,693.53	-
负债合计		5,615,393.84	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,931,440,625.77	-

未分配利润	7.4.7.10	89,190,382.17	-
所有者权益合计		3,020,631,007.94	-
负债和所有者权益总计		3,026,246,401.78	-

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,931,440,625.77 份，其中下属 A 类基金份额 84,694,461.81 份，C 类基金份额 2,846,746,163.96 份。下属 A 类基金份额净值 1.028 元，C 类基金份额净值 1.031 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 28 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：平安大华鑫享混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 7 月 28 日(基金 合同生效日)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
<b>一、收入</b>		11,236,668.74	-
1.利息收入		7,892,200.94	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,290,226.36	-
债券利息收入		2,986,716.75	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,609,821.30	-
其他利息收入		5,436.53	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-988,438.57	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,023,009.76	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,012,924.33	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,476.00	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	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）	7.4.7.18	226,799.71	-
<b>减：二、费用</b>		5,519,152.26	-

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,883,416.47	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	720,854.08	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,276,504.92	-
4. 交易费用	7.4.7.19	436,927.31	-
5. 利息支出		19,549.48	-
其中：卖出回购金融资产支出		19,549.48	-
6. 其他费用	7.4.7.20	181,900.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,717,516.48	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		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：2015 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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	84,050,268.07	2,903,593,719.98
2. 基金赎回款	-180,245,117.80	-577,402.38	-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
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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-

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  
基金管理人负责人

林婉文  
主管会计工作负责人

张南南  
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。

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 $\times$ 30%+中证全债指数收益率 $\times$ 70%。

#### 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 2015 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的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 7 月 28 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。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

##### 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**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### **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。

#### 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[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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	1,160,219,099.59	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,160,219,099.59	-

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	27,841,590.48	31,867,729.00	4,026,138.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	651,964.27	651,964.27
	银行间市场	39,990,031.86	40,070,000.00
	合计	40,641,996.13	40,721,964.27
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	68,483,586.61	72,589,693.27	4,106,106.66
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债余额。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间买入返售证券	977,893,746.84	-
交易所买入返售证券	800,000,000.00	-
合计	1,777,893,746.84	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	296,086.29	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	6,313.00	-
应收债券利息	443,188.56	-
应收买入返售证券利息	635,402.76	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	52.90	-
合计	1,381,043.51	-

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	244,251.33	-
银行间市场应付交易费用	11,684.29	-
合计	255,935.62	-

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,693.53	-
预提费用	180,000.00	-
合计	182,693.53	-

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鑫享 A		
项目	本期 2015 年 7 月 28 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	103,827,057.49	103,827,057.49
本期申购	1,763,785.28	1,763,785.28
本期赎回(以“-”号填列)	-20,896,380.96	-20,896,380.96
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	84,694,461.81	84,694,461.81

金额单位：人民币元

鑫享 C
------

项目	本期 2015年7月28日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	188,315,234.17	188,315,234.17
本期申购	2,817,779,666.63	2,817,779,666.63
本期赎回(以“-”号填列)	-159,348,736.84	-159,348,736.84
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,846,746,163.96	2,846,746,163.96

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2015 年 7 月 6 日至 2015 年 7 月 24 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 292,126,072.70 元，其中 A 类基金净有效认购资金为人民币 103,815,544.55 元，C 类基金净有效认购资金为人民币 188,310,528.15 元。根据《平安大华鑫享混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 16,218.96 元在本基金成立后，折算为 16,218.96 份基金份额(其中 A 类基金募集期内认购资金产生的利息收入为 11,512.94 元，折算为 11,512.94 份基金份额；C 类基金募集期内认购资金产生的利息收入为 4,706.02 元，折算为 4,706.02 份基金份额)，划入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鑫享 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,122,478.89	1,472,534.39	2,595,013.28
本期基金份额交易产生的变动数	-116,158.32	-119,846.71	-236,005.03
其中：基金申购款	7,587.86	15,720.82	23,308.68
基金赎回款	-123,746.18	-135,567.53	-259,313.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,006,320.57	1,352,687.68	2,359,008.25

单位：人民币元

鑫享 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	488,930.93	2,633,572.27	3,122,503.20



本期基金份额交易产生的变动数	40,723,467.81	42,985,402.91	83,708,870.72
其中：基金申购款	40,969,014.30	43,057,945.09	84,026,959.39
基金赎回款	-245,546.49	-72,542.18	-318,088.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,212,398.74	45,618,975.18	86,831,373.92

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月28日(基金合同生效日)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
活期存款利息收入	1,334,976.39	-
定期存款利息收入	936,418.88	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	18,616.39	-
其他	214.70	-
合计	2,290,226.36	-

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月28日(基金合同生效日)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
卖出股票成交总额	159,172,402.76	-
减：卖出股票成本总额	158,149,393.00	-
买卖股票差价收入	1,023,009.76	-

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月28日(基金合同生效日)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
----	---------------------------------------	----------------------------------

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,012,924.33	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-2,012,924.33	-

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月28日(基金 合同生效日)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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	421,005,712.86	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	414,038,393.99	-
减：应收利息总额	8,980,243.20	-
买卖债券差价收入	-2,012,924.33	-

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内未发生由于债券投资收益产生的赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末及上年度末均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月28日(基金合同生效日)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
股票投资产生的股利收益	1,476.00	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,476.00	-

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年7月28日(基金合同生效日)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
1. 交易性金融资产	4,106,106.66	-
——股票投资	4,026,138.52	-
——债券投资	79,968.14	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	4,106,106.66	-

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期	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	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	224,892.35	-
转换费收入 C 类 001610	782.44	-
转换费收入 A 类 001609	1,124.92	-
合计	226,799.71	-

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 28 日(基金合同生效日)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
交易所市场交易费用	433,852.31	-
银行间市场交易费用	3,075.00	-
合计	436,927.31	-

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 28 日(基金合同生效日)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
审计费用	60,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
银行间账户维护费	1,500.00	-
其他	400.00	-
合计	181,900.00	-

#### 7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 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
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人股东
大华资产管理有限公司	基金管理人股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人股东
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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同于 2015 年 7 月 29 日生效，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本期未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金于本期未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本期未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本期无应支付关联方的佣金

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 28 日(基金合同生	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31

	效日)至 2015 年 12 月 31 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	2,883,416.47	-
其中:支付销售机构的客户维护费	196,602.91	-

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 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 X0.80%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 7 月 28 日(基金合同生效日)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	720,854.08	-

注:支付基金托管人平安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 X0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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		
	2015 年 7 月 28 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		
	鑫享 A	鑫享 C	合计
平安大华基金管理有限公司	-	1,215,918.54	1,215,918.54
平安银行	-	58,479.26	58,479.26
平安证券	-	608.27	608.27
合计	-	1,275,006.07	1,275,006.07

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 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基金管理有限公司,再由平安大华基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=C 类基金前一日基金资产净值 X0.40%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年7月28日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	鑫享 A	鑫享 C
基金合同生效日（2015年7月28日）持有的基金份额	9,999,000.00	-
期初持有的基金份额	9,999,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3400%	-

注：基金管理人平安大华基金管理有限公司在本年度申购/赎回本基金的交易委托平安大华基金管理有限公司直销柜台办理，适用费率为0%。

##### 7.4.10.4.2 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

本基金于本期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 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7月28日(基金合同生效日)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
平安银行	1,160,219,099.59	1,334,976.39	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期末未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

#### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金于本期末未进行利润分配

### 7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002778	高科石化	2015年12月28日	2016年1月6日	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

7.4.12.1.2 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
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	6,520	651,964.27	651,964.27	-

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

#### 7.4.12.2 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
600572	康恩贝	2015年12月29日	重大事项	13.36	2016年1月4日	13.18	12,990	170,114.37	173,546.40	-
600986	科达股份	2015年12月14日	重大事项	21.00	-	-	7,970	169,383.18	167,370.00	-
000002	万科A	2015年12月21日	重大事项	24.43	-	-	4,400	63,291.21	107,492.00	-
300104	乐视网	2015年12月7日	重大事项	58.80	-	-	1,700	90,191.41	99,960.00	-



300336	新文化	2015年12月24日	重大事项	42.00	-	-	2,000	65,660.29	84,000.00	-
002231	奥维通信	2015年12月3日	重大事项	16.36	2016年3月17日	16.00	4,900	81,984.50	80,164.00	-
300349	金卡股份	2015年11月23日	重大事项	37.75	-	-	2,100	70,154.00	79,275.00	-
600749	西藏旅游	2015年11月30日	重大事项	23.62	-	-	3,100	67,244.00	73,222.00	-
002678	珠江钢琴	2015年12月21日	重大事项	17.21	2016年1月19日	15.49	4,000	64,557.44	68,840.00	-
002020	京新药业	2015年12月29日	重大事项	33.55	2016年1月20日	30.20	2,000	59,996.91	67,100.00	-
300011	鼎汉技术	2015年12月31日	重大事项	29.80	2016年1月22日	26.82	2,200	65,765.78	65,560.00	-
300281	金明精机	2015年12月7日	重大事项	18.95	2016年1月6日	17.06	3,400	60,692.50	64,430.00	-
002383	合众思壮	2015年12月15日	重大事项	40.35	2016年3月17日	36.32	1,500	55,703.60	60,525.00	-
002465	海格通信	2015年12月30日	重大事项	16.69	2016年2月4日	15.02	3,600	63,619.05	60,084.00	-
600654	中安消	2015年12月14日	重大事项	29.29	-	-	5,000	168,276.09	146,450.00	-
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	1,400	43,503.31	40,768.00	-

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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	20,006,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,064,000.00	-
合计	40,070,000.00	-

注：以上按短期信用评级的债券投资未评级债券为发行主体评级 AA 级以上的短期/超短期融资券。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	651,964.27	-
未评级	-	-
合计	651,964.27	-

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,160,219,099.59	-	-	-	-	-	1,160,219,099.59
结算备付金	14,028,821.77	-	-	-	-	-	14,028,821.77
存出保证金	117,492.68	-	-	-	-	-	117,492.68
交易性金融资产	-	-40,070,000.00	-	-651,964.27	31,867,729.00	-	72,589,693.27
买入返售金融资产	1,777,893,746.84	-	-	-	-	-	1,777,893,746.84
应收利息	-	-	-	-	-	1,381,043.51	1,381,043.51
应收申购款	-	-	-	-	-	16,504.12	16,504.12
资产总计	2,952,259,160.88	-40,070,000.00	-	-651,964.27	33,265,276.63	3,026,246,401.78	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,613,591.45	1,613,591.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,053,489.29	2,053,489.29
应付托管费	-	-	-	-	-	513,372.31	513,372.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	996,311.64	996,311.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	255,935.62	255,935.62
其他负债	-	-	-	-	-	182,693.53	182,693.53
负债总计	-	-	-	-	-	5,615,393.84	5,615,393.84
利率敏感度缺口	2,952,259,160.88	-40,070,000.00	-	-651,964.27	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

## 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.35%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

## 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票等权益类资产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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	31,867,729.00	1.06	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,867,729.00	1.06	-	-

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 7.4.14 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 30,381,342.60 元，属于第二层次的余额为 42,208,350.67 元，无属于第三层次的余额。

##### (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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (b) 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。

##### (c) 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	31,867,729.00	1.05
	其中：股票	31,867,729.00	1.05
2	固定收益投资	40,721,964.27	1.35
	其中：债券	40,721,964.27	1.35
	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	1,777,893,746.84	58.75
	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	1,174,247,921.36	38.80
7	其他各项资产	1,515,040.31	0.05
8	合计	3,026,246,401.78	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	-	-
C	制造业	16,154,140.21	0.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	613,147.00	0.02
E	建筑业	2,391,368.11	0.08
F	批发和零售业	972,815.44	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	505,489.00	0.02
H	住宿和餐饮业	129,528.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,626,124.46	0.22
J	金融业	1,989,789.00	0.07
K	房地产业	1,076,192.36	0.04
L	租赁和商务服务业	176,508.00	0.01

M	科学研究和技术服务业	93,390.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	468,952.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,431.42	0.00
R	文化、体育和娱乐业	502,790.00	0.02
S	综合	61,064.00	0.00
	合计	31,867,729.00	1.06

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.04
2	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.03
3	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.03
4	300495	美尚生态	6,375	569,223.75	0.02
5	601009	南京银行	20,100	355,770.00	0.01
6	002782	可立克	13,312	283,146.24	0.01
7	300370	安控科技	14,300	279,708.00	0.01
8	300182	捷成股份	11,200	268,800.00	0.01
9	002786	银宝山新	9,630	263,476.80	0.01
10	300497	富祥股份	5,523	237,654.69	0.01
11	600518	康美药业	13,800	233,910.00	0.01
12	002780	三夫户外	3,566	222,304.44	0.01
13	600816	安信信托	9,200	209,484.00	0.01
14	600436	片仔癀	3,000	206,370.00	0.01
15	600351	亚宝药业	12,900	201,498.00	0.01
16	600422	昆药集团	5,000	199,100.00	0.01
17	600513	联环药业	7,500	195,450.00	0.01
18	603778	乾景园林	7,140	195,136.20	0.01
19	600410	华胜天成	7,350	194,848.50	0.01
20	600340	华夏幸福	6,273	192,706.56	0.01
21	601599	鹿港科技	7,600	188,176.00	0.01
22	600366	宁波韵升	8,499	185,618.16	0.01
23	600261	阳光照明	21,100	185,469.00	0.01



24	600176	中国巨石	7,193	182,774.13	0.01
25	603766	隆鑫通用	7,700	182,721.00	0.01
26	600637	东方明珠	4,790	181,493.10	0.01
27	600198	大唐电信	7,300	180,091.00	0.01
28	600867	通化东宝	6,600	179,322.00	0.01
29	600826	兰生股份	5,200	179,088.00	0.01
30	600987	航民股份	13,600	178,432.00	0.01
31	600066	宇通客车	7,909	177,873.41	0.01
32	600797	浙大网新	12,300	176,874.00	0.01
33	600660	福耀玻璃	11,634	176,720.46	0.01
34	600312	平高电气	9,000	175,500.00	0.01
35	600004	白云机场	12,300	175,029.00	0.01
36	600337	美克家居	11,200	174,944.00	0.01
37	600030	中信证券	9,000	174,150.00	0.01
38	600572	康恩贝	12,990	173,546.40	0.01
39	601601	中国太保	6,000	173,160.00	0.01
40	600426	华鲁恒升	11,901	171,731.43	0.01
41	600355	精伦电子	21,199	171,287.92	0.01
42	603085	天成自控	3,500	170,765.00	0.01
43	600563	法拉电子	4,100	170,601.00	0.01
44	601199	江南水务	8,940	170,307.00	0.01
45	600846	同济科技	14,171	169,485.16	0.01
46	600109	国金证券	10,500	169,260.00	0.01
47	600804	鹏博士	7,100	168,412.00	0.01
48	600009	上海机场	5,700	168,264.00	0.01
49	600276	恒瑞医药	3,420	167,990.40	0.01
50	600703	三安光电	6,900	167,532.00	0.01
51	600986	科达股份	7,970	167,370.00	0.01
52	600999	招商证券	7,700	167,090.00	0.01
53	600323	瀚蓝环境	10,400	166,920.00	0.01
54	603023	威帝股份	3,250	166,692.50	0.01
55	600006	东风汽车	18,800	166,568.00	0.01
56	601901	方正证券	17,200	165,120.00	0.01
57	600872	中炬高新	10,500	164,325.00	0.01
58	002787	华源包装	10,011	163,880.07	0.01
59	002335	科华恒盛	3,400	163,200.00	0.01
59	600027	华电国际	24,000	163,200.00	0.01
60	600525	长园集团	8,654	162,954.82	0.01
61	300494	盛天网络	6,251	162,901.06	0.01

62	600446	金证股份	3,300	162,327.00	0.01
63	601555	东吴证券	10,100	162,307.00	0.01
64	600119	长江投资	8,200	162,196.00	0.01
65	600118	中国卫星	3,800	161,652.00	0.01
66	600850	华东电脑	3,100	160,115.00	0.01
67	601766	中国中车	12,300	158,055.00	0.01
68	600398	海澜之家	11,300	157,748.00	0.01
69	601519	大智慧	12,300	157,686.00	0.01
70	600288	大恒科技	9,000	157,410.00	0.01
71	600373	中文传媒	6,600	155,034.00	0.01
72	600037	歌华有线	7,200	155,016.00	0.01
73	600571	信雅达	2,600	153,608.00	0.01
74	603015	弘讯科技	4,500	153,360.00	0.01
75	600292	中电远达	7,300	150,964.00	0.00
76	603898	好莱客	4,400	149,512.00	0.00
77	601038	一拖股份	10,800	149,364.00	0.00
78	600654	中安消	5,000	146,450.00	0.00
79	601965	中国汽研	15,500	145,545.00	0.00
80	601777	力帆股份	8,300	143,922.00	0.00
81	600686	金龙汽车	7,350	141,046.50	0.00
82	600067	冠城大通	15,900	138,966.00	0.00
83	601002	晋亿实业	12,000	138,360.00	0.00
84	601788	光大证券	6,000	137,640.00	0.00
85	600503	华丽家族	9,800	134,260.00	0.00
86	600517	置信电气	10,600	134,196.00	0.00
87	600570	恒生电子	2,200	134,134.00	0.00
88	600376	首开股份	10,700	133,750.00	0.00
89	601886	江河创建	10,400	131,144.00	0.00
90	601007	金陵饭店	8,400	129,528.00	0.00
91	603299	井神股份	23,499	124,779.69	0.00
92	002439	启明星辰	3,800	121,600.00	0.00
93	002690	美亚光电	3,000	121,050.00	0.00
94	300379	东方通	900	110,421.00	0.00
95	000002	万科A	4,400	107,492.00	0.00
96	002609	捷顺科技	5,100	106,386.00	0.00
97	300275	梅安森	2,800	101,920.00	0.00
98	300104	乐视网	1,700	99,960.00	0.00
99	002766	索菱股份	2,000	99,100.00	0.00
100	300490	华自科技	7,127	93,292.43	0.00

101	300491	通合科技	6,015	90,766.35	0.00
102	002153	石基信息	600	90,600.00	0.00
103	002089	新海宜	3,900	87,789.00	0.00
104	002426	胜利精密	3,300	85,866.00	0.00
105	300336	新文化	2,000	84,000.00	0.00
106	002243	通产丽星	4,900	83,202.00	0.00
107	000718	苏宁环球	6,300	83,097.00	0.00
108	002402	和而泰	2,900	82,331.00	0.00
109	002184	海得控制	1,900	81,719.00	0.00
110	300270	中威电子	3,400	81,056.00	0.00
111	002642	荣之联	1,400	81,046.00	0.00
112	300231	银信科技	3,000	80,640.00	0.00
113	002231	奥维通信	4,900	80,164.00	0.00
114	300250	初灵信息	1,000	79,590.00	0.00
115	600602	仪电电子	6,200	79,298.00	0.00
116	300349	金卡股份	2,100	79,275.00	0.00
117	002149	西部材料	2,800	78,428.00	0.00
118	300130	新国都	2,100	78,267.00	0.00
119	002117	东港股份	1,700	78,234.00	0.00
120	300400	劲拓股份	1,600	77,648.00	0.00
121	300257	开山股份	2,500	77,125.00	0.00
122	002450	康得新	2,000	76,200.00	0.00
123	000555	神州信息	1,800	75,780.00	0.00
124	002104	恒宝股份	3,100	74,369.00	0.00
125	002376	新北洋	4,000	73,920.00	0.00
126	600749	西藏旅游	3,100	73,222.00	0.00
127	000423	东阿阿胶	1,400	73,220.00	0.00
128	300146	汤臣倍健	1,900	73,150.00	0.00
129	002329	皇氏集团	2,600	72,540.00	0.00
130	300070	碧水源	1,400	72,478.00	0.00
131	002380	科远股份	1,800	72,162.00	0.00
132	300300	汉鼎股份	2,200	71,962.00	0.00
133	300271	华宇软件	1,500	71,220.00	0.00
134	300202	聚龙股份	2,200	70,818.00	0.00
135	300165	天瑞仪器	2,700	70,524.00	0.00
136	300027	华谊兄弟	1,700	70,516.00	0.00
137	002777	久远银海	4,264	70,356.00	0.00
138	002236	大华股份	1,900	70,110.00	0.00
139	002785	万里石	12,000	70,080.00	0.00

140	002396	星网锐捷	2,900	70,035.00	0.00
141	000863	三湘股份	5,900	69,325.00	0.00
142	002551	尚荣医疗	2,100	69,237.00	0.00
143	300103	达刚路机	2,600	69,134.00	0.00
144	300171	东富龙	2,300	68,954.00	0.00
145	002428	云南锗业	3,400	68,952.00	0.00
146	000156	华数传媒	2,100	68,880.00	0.00
147	002678	珠江钢琴	4,000	68,840.00	0.00
148	300391	康跃科技	3,100	68,820.00	0.00
149	002588	史丹利	2,100	68,313.00	0.00
150	002046	轴研科技	5,100	67,932.00	0.00
151	000802	北京文化	2,000	67,760.00	0.00
152	002508	老板电器	1,500	67,425.00	0.00
153	002139	拓邦股份	2,700	67,257.00	0.00
154	300267	尔康制药	2,000	67,200.00	0.00
155	002020	京新药业	2,000	67,100.00	0.00
156	002620	瑞和股份	1,700	66,844.00	0.00
157	002308	威创股份	2,700	66,555.00	0.00
158	002519	银河电子	2,800	66,500.00	0.00
159	002294	信立泰	2,200	66,264.00	0.00
160	000566	海南海药	1,700	66,062.00	0.00
161	300017	网宿科技	1,100	65,989.00	0.00
162	002405	四维图新	1,700	65,960.00	0.00
163	300274	阳光电源	2,400	65,808.00	0.00
164	002462	嘉事堂	1,300	65,806.00	0.00
165	000963	华东医药	800	65,568.00	0.00
166	300011	鼎汉技术	2,200	65,560.00	0.00
167	300026	红日药业	3,100	65,410.00	0.00
168	002400	省广股份	2,600	65,390.00	0.00
169	300015	爱尔眼科	2,049	64,707.42	0.00
170	002572	索菲亚	1,500	64,650.00	0.00
171	300207	欣旺达	2,300	64,630.00	0.00
172	002445	中南重工	2,300	64,515.00	0.00
173	300281	金明精机	3,400	64,430.00	0.00
174	002262	恩华药业	2,200	64,394.00	0.00
175	002482	广田股份	2,200	64,350.00	0.00
176	000776	广发证券	3,300	64,185.00	0.00
177	300378	鼎捷软件	1,100	64,042.00	0.00
178	300205	天喻信息	3,100	63,984.00	0.00

179	300237	美晨科技	5,100	63,444.00	0.00
180	000977	浪潮信息	2,000	63,420.00	0.00
180	002063	远光软件	3,000	63,420.00	0.00
181	000997	新大陆	2,500	63,300.00	0.00
182	300177	中海达	3,300	63,294.00	0.00
183	000895	双汇发展	3,100	63,271.00	0.00
184	300369	绿盟科技	1,300	63,232.00	0.00
185	300248	新开普	1,700	63,155.00	0.00
186	002556	辉隆股份	3,400	62,866.00	0.00
187	300075	数字政通	2,000	62,700.00	0.00
188	002487	大金重工	4,400	62,480.00	0.00
189	300339	润和软件	1,300	62,426.00	0.00
190	002701	奥瑞金	2,200	62,172.00	0.00
191	300219	鸿利光电	3,900	62,127.00	0.00
192	300233	金城医药	1,900	62,054.00	0.00
193	000815	*ST美利	2,300	61,916.00	0.00
194	002268	卫士通	1,100	61,831.00	0.00
195	300289	利德曼	3,100	61,690.00	0.00
196	002170	芭田股份	4,700	61,664.00	0.00
197	002122	天马股份	7,400	61,642.00	0.00
198	002378	章源钨业	5,100	61,404.00	0.00
199	002595	豪迈科技	2,700	61,263.00	0.00
200	000009	中国宝安	3,400	61,064.00	0.00
201	002279	久其软件	900	60,930.00	0.00
202	002520	日发精机	2,300	60,835.00	0.00
203	002372	伟星新材	3,400	60,792.00	0.00
204	000069	华侨城A	6,900	60,720.00	0.00
205	002383	合众思壮	1,500	60,525.00	0.00
206	002437	誉衡药业	2,000	60,500.00	0.00
207	002142	宁波银行	3,900	60,489.00	0.00
208	002501	利源精制	4,800	60,384.00	0.00
209	300022	吉峰农机	5,500	60,335.00	0.00
210	002465	海格通信	3,600	60,084.00	0.00
211	002410	广联达	3,300	59,994.00	0.00
212	002183	怡亚通	1,300	59,878.00	0.00
213	000783	长江证券	4,800	59,616.00	0.00
214	300199	翰宇药业	2,400	59,112.00	0.00
215	002630	华西能源	4,000	59,080.00	0.00
216	000939	凯迪生态	4,100	59,040.00	0.00

217	000413	东旭光电	6,500	59,020.00	0.00
218	002424	贵州百灵	2,300	59,018.00	0.00
219	002010	传化股份	2,500	58,875.00	0.00
220	002177	御银股份	5,400	58,590.00	0.00
221	002317	众生药业	4,400	58,256.00	0.00
222	300056	三维丝	2,700	58,239.00	0.00
223	000948	南天信息	2,300	58,213.00	0.00
224	300159	新研股份	3,500	58,100.00	0.00
225	000797	中国武夷	2,600	58,084.00	0.00
226	000046	泛海控股	4,616	57,930.80	0.00
227	002223	鱼跃医疗	1,500	57,675.00	0.00
228	300262	巴安水务	3,100	57,567.00	0.00
229	002589	瑞康医药	1,600	57,456.00	0.00
230	000961	中南建设	3,700	57,202.00	0.00
231	002658	雪迪龙	2,100	57,099.00	0.00
232	002179	中航光电	1,500	56,940.00	0.00
233	000821	京山轻机	3,500	56,910.00	0.00
234	300033	同花顺	800	56,840.00	0.00
235	002285	世联行	3,500	56,805.00	0.00
236	300144	宋城演艺	2,000	56,600.00	0.00
237	002364	中恒电气	2,000	56,420.00	0.00
238	002649	博彦科技	1,000	56,280.00	0.00
239	300090	盛运环保	4,800	56,208.00	0.00
240	002565	上海绿新	4,700	56,165.00	0.00
241	002573	清新环境	2,500	56,100.00	0.00
242	002563	森马服饰	4,500	55,800.00	0.00
243	002312	三泰控股	2,000	55,600.00	0.00
244	000826	启迪桑德	1,400	55,468.00	0.00
245	002367	康力电梯	3,300	55,341.00	0.00
246	002415	海康威视	1,600	55,024.00	0.00
247	000733	振华科技	2,200	55,000.00	0.00
248	300024	机器人	800	54,800.00	0.00
249	002111	威海广泰	1,800	54,630.00	0.00
250	002025	航天电器	2,100	54,579.00	0.00
251	300253	卫宁软件	1,300	54,444.00	0.00
252	002178	延华智能	4,100	54,366.00	0.00
253	300055	万邦达	2,500	54,275.00	0.00
254	000026	飞亚达 A	3,300	54,054.00	0.00
255	300332	天壕环境	2,200	53,680.00	0.00

256	002361	神剑股份	3,300	53,658.00	0.00
257	300348	长亮科技	700	53,053.00	0.00
258	002108	沧州明珠	3,000	53,010.00	0.00
259	300126	锐奇股份	3,000	52,950.00	0.00
260	002470	金正大	2,600	52,884.00	0.00
261	300195	长荣股份	2,200	52,558.00	0.00
262	002559	亚威股份	3,300	52,503.00	0.00
263	300296	利亚德	2,100	52,500.00	0.00
264	002017	东信和平	2,700	52,380.00	0.00
265	002325	洪涛股份	3,300	51,579.00	0.00
266	300166	东方国信	1,600	51,248.00	0.00
267	000062	深圳华强	1,400	51,240.00	0.00
268	000686	东北证券	2,900	50,750.00	0.00
269	300113	顺网科技	500	50,685.00	0.00
270	300294	博雅生物	1,300	50,609.00	0.00
271	300380	安硕信息	700	48,293.00	0.00
272	002085	万丰奥威	1,500	48,270.00	0.00
273	002547	春兴精工	3,600	47,808.00	0.00
274	002778	高科石化	5,600	47,600.00	0.00
275	300455	康拓红外	1,000	47,200.00	0.00
276	000777	中核科技	1,500	47,085.00	0.00
277	000801	四川九洲	1,517	46,920.81	0.00
278	300114	中航电测	900	45,099.00	0.00
279	000550	江铃汽车	1,500	44,970.00	0.00
280	002518	科士达	1,260	44,478.00	0.00
281	002121	科陆电子	1,500	44,400.00	0.00
282	300072	三聚环保	1,300	44,161.00	0.00
283	002625	龙生股份	900	43,785.00	0.00
284	000540	中天城投	4,800	43,776.00	0.00
285	000418	小天鹅 A	1,820	43,680.00	0.00
286	300124	汇川技术	900	42,480.00	0.00
287	300244	迪安诊断	600	41,724.00	0.00
288	002138	顺络电子	2,900	41,615.00	0.00
289	300377	赢时胜	500	41,085.00	0.00
290	000712	锦龙股份	1,400	40,768.00	0.00
291	300085	银之杰	700	39,130.00	0.00
292	300284	苏交科	1,800	39,024.00	0.00
293	000523	广州浪奇	2,500	37,700.00	0.00
294	002221	东华能源	1,300	30,394.00	0.00

295	002175	东方网络	400	24,104.00	0.00
-----	--------	------	-----	-----------	------

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601009	南京银行	2,384,930.00	0.08
2	600426	华鲁恒升	1,952,946.38	0.06
3	600835	上海机电	1,865,431.15	0.06
4	002450	康得新	1,723,367.68	0.06
5	600703	三安光电	1,564,973.85	0.05
6	600517	置信电气	1,370,962.00	0.05
7	002595	豪迈科技	1,351,251.25	0.04
8	603898	好莱客	1,333,280.00	0.04
9	603766	隆鑫通用	1,208,757.00	0.04
10	601599	鹿港科技	1,188,715.00	0.04
11	600351	亚宝药业	1,185,718.00	0.04
12	600660	福耀玻璃	1,183,698.00	0.04
13	600872	中炬高新	1,181,089.00	0.04
14	600513	联环药业	1,175,920.93	0.04
15	600261	阳光照明	1,171,119.00	0.04
16	600337	美克家居	1,163,683.75	0.04
17	600009	上海机场	1,162,227.00	0.04
18	600006	东风汽车	1,157,965.00	0.04
19	600312	平高电气	1,156,681.00	0.04
20	600066	宇通客车	1,155,987.50	0.04

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601009	南京银行	2,010,270.11	0.07
2	600835	上海机电	1,963,794.70	0.07



3	600426	华鲁恒升	1,824,262.01	0.06
4	002450	康得新	1,793,329.00	0.06
5	600703	三安光电	1,462,803.68	0.05
6	002595	豪迈科技	1,294,078.87	0.04
7	600517	置信电气	1,278,506.00	0.04
8	603898	好莱客	1,277,246.44	0.04
9	601233	桐昆股份	1,103,335.00	0.04
10	002035	华帝股份	1,065,225.34	0.04
11	600872	中炬高新	1,059,822.00	0.04
12	601599	鹿港科技	1,045,850.00	0.03
13	603766	隆鑫通用	1,040,707.00	0.03
14	600563	法拉电子	1,039,824.40	0.03
15	600351	亚宝药业	1,031,148.00	0.03
16	600660	福耀玻璃	1,018,118.38	0.03
17	600513	联环药业	1,011,928.00	0.03
18	600337	美克家居	1,006,104.00	0.03
19	600009	上海机场	999,892.35	0.03
20	601199	江南水务	998,307.83	0.03

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	185,990,983.48
卖出股票收入（成交）总额	159,172,402.76

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,070,000.00	1.33
6	中期票据	-	-
7	可转债	651,964.27	0.02

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,721,964.27	1.35

### 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	011599613	15 广田 SCP002	100,000	10,036,000.00	0.33
2	011599691	15 杉杉 SCP0003	100,000	10,028,000.00	0.33
3	041560077	15 鲁金茂 CP001	100,000	10,022,000.00	0.33
4	041556035	15 峰峰 CP004	100,000	9,984,000.00	0.33
5	123001	蓝标转债	6,520	651,964.27	0.02

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

本报告期末本基金无贵金属投资。

### 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

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

本基金本报告期内无股指期货投资。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 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情况。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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	117,492.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,381,043.51
5	应收申购款	16,504.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,515,040.31

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有转股期的可转债。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金持有的前十名股票中未存在流通受限股票。

### 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

份额级别	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
鑫享 A	775	109,283.18	9,999,000.00	11.81%	74,695,461.81	88.19%
鑫享 C	236	12,062,483.75	2,816,005,736.55	98.92%	30,740,427.41	1.08%
合计	1,011	2,899,545.62	2,826,004,736.55	96.40%	105,435,889.22	3.60%

### 9.2 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	鑫享 A	0.00	0.0000%
	鑫享 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

### 9.3 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	鑫享 A	0
	鑫享 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫享 A	0
	鑫享 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫享 A	鑫享 C
基金合同生效日(2015年7月28日)基金份	103,827,057.49	188,315,234.17

额总额		
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,763,785.28	2,817,779,666.63
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	20,896,380.96	159,348,736.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	84,694,461.81	2,846,746,163.96

## § 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、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。

### 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

报告期内本基金合同生效, 初次聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内应支付给该事务所的报酬为 60,000.00 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	
国联证券	2	12,027,152.75	3.51%	8,555.00	-	-
兴业证券	1	13,027,642.15	3.80%	9,266.63	-	-
国信证券	2	151,369,173.58	44.13%	107,668.96	-	-
银河证券	2	153,073,903.62	44.63%	108,881.59	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	13,509,009.02	3.94%	9,879.15	-	-

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。

3、本基金报告期合同生效, 上述租用交易单元均为本期新增所用。

#### 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

国联证券	-	-	2,155,000,000.00	48.92%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	50,000,000.00	1.14%	-	-
银河证券	-	-	600,000,000.00	13.62%	-	-
华创证券	2,025,469.66	100.00%	1,600,000,000.00	36.32%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安大华基金管理有限公司关于平安大华鑫享混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2016年7月29日
2	平安大华基金管理有限公司关于平安大华鑫享混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年8月24日
3	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增开源证券为销售机构及开通转换和定投业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年8月28日
4	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行为销售机构及开通转换和定投业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年9月1日
5	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆金所资产管理有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年9月1日
6	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中金公司为销售机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年9月8日
7	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申万宏源西部证券为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年9月10日
8	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年9月18日

	市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告		
9	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京乐融多源投资咨询有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年9月23日
10	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年9月23日
11	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天风证券为销售机构及开通转换和定投业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年9月24日
12	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中泰证券为销售机构及开通转换和定投业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年10月22日
13	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增珠海盈米财富管理有限公司为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年10月26日
14	平安大华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年10月29日
15	关于平安大华鑫享混合型证券投资基金因直销系统升级暂停直销渠道申购、定投、赎回、转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年11月3日
16	平安大华鑫享混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年11月6日
17	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大泰金石投资管理有限公司为销售机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年11月6日
18	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息科技有限公司为销售机	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015年11月10日



	构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告		
19	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015 年 11 月 23 日
20	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金估值调整的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015 年 11 月 26 日
21	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增第一创业证券为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015 年 11 月 26 日
22	关于平安大华鑫享混合型证券投资基金暂停大额申购的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015 年 11 月 30 日
23	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金估值调整的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015 年 12 月 18 日
24	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015 年 12 月 18 日
25	关于增加平安大华鑫享混合型证券投资基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015 年 12 月 25 日
26	平安大华基金管理有限公司关于指数熔断机制对旗下公募基金业务规则影响的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015 年 12 月 31 日
27	平安大华基金管理有限公司 2015 年 12 月 31 日基金净值公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2015 年 12 月 31 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安大华鑫享混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华鑫享混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华鑫享混合型证券投资基金托管协议

- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 报告期内平安大华鑫享混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

## 12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>。

平安大华基金管理有限公司  
2016 年 3 月 30 日