

平安大华鑫享混合型证券投资基金 2016 年 半年度报告

2016 年 6 月 30 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 8 月 29 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
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.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 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.....	48
7.7 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.....	49
7.8 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.....	49
7.9 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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49

7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.4 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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	错误!未定义书签。
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 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	
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	1,057,820,536.92 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	62,775,991.12 份	995,044,545.80 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	证券时报、上海证券报、中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	鑫享 A	鑫享 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	857,493.51	20,120,398.96
本期利润	926,084.32	15,627,128.58
加权平均基金份额本期利润	0.0131	0.0099
本期加权平均净值利润率	1.27%	0.96%
本期基金份额净值增长率	1.36%	1.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,489,239.60	26,270,205.75
期末可供分配基金份额利润	0.0237	0.0264
期末基金资产净值	65,384,388.89	1,039,111,909.29
期末基金份额净值	1.042	1.044
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	4.20%	4.40%

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未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，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

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
过去一个月	0.39%	0.05%	0.37%	0.30%	0.02%	-0.25%
过去三个月	0.77%	0.06%	-0.29%	0.31%	1.06%	-0.25%
过去六个月	1.36%	0.06%	-3.42%	0.56%	4.78%	-0.50%
自基金合同生效起至今	4.20%	0.11%	-0.58%	0.63%	4.78%	-0.52%

鑫享 C

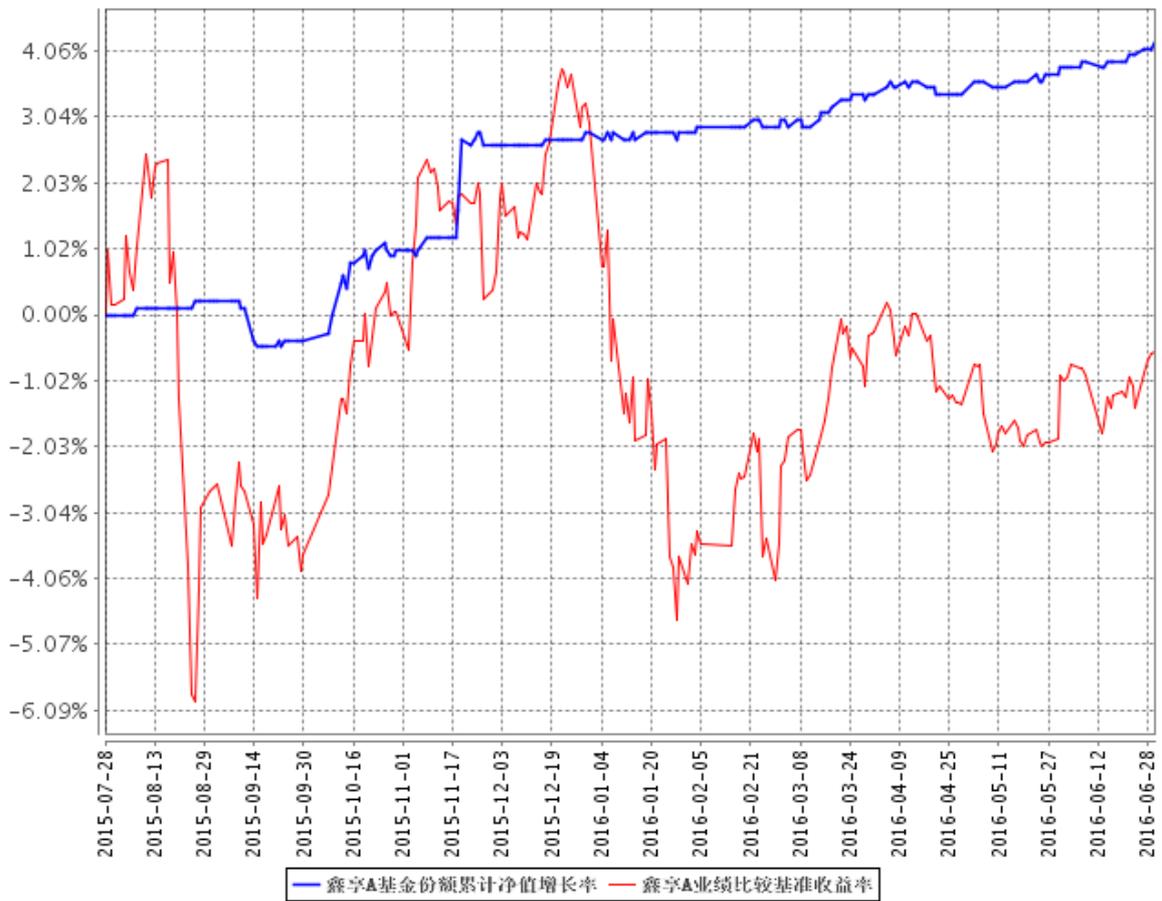
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.38%	0.05%	0.37%	0.30%	0.01%	-0.25%
过去三个月	0.68%	0.06%	-0.29%	0.31%	0.97%	-0.25%
过去六个月	1.26%	0.06%	-3.42%	0.56%	4.68%	-0.50%
自基金合同生效起至今	4.40%	0.12%	-0.58%	0.63%	4.98%	-0.51%

注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证全债指数从沪深交易所和银行间市场挑选国债、金融债及企业债组成样本券，最大限度地涵盖了我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。

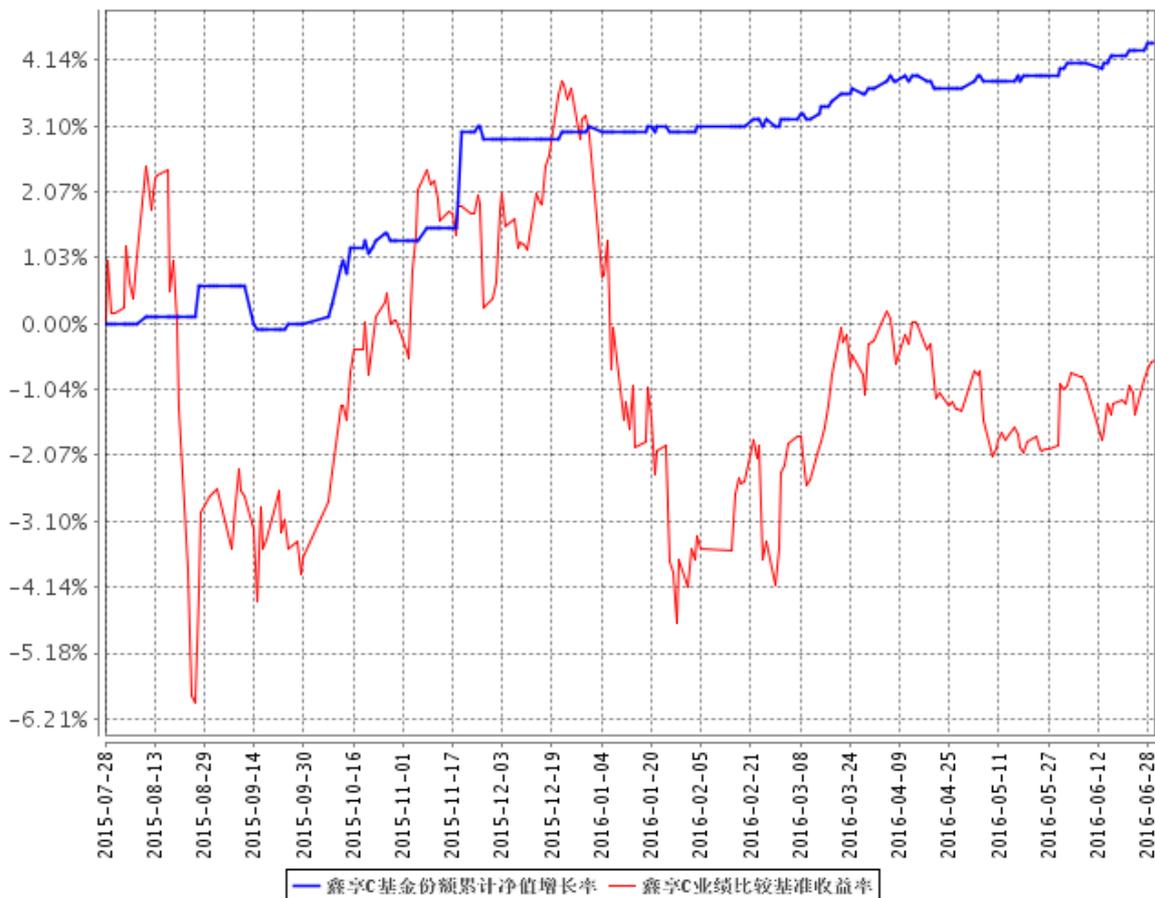
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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。

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

§ 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 2016 年 6 月 30 日，平安基金共管理 17 只开放式基金，资产管理总规模超 459 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、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华日增利货币市场基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
李黄海	本基金的基金经理	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。
--	--	--	--	--	----------------------------------------------------

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在 2016 年上半年里，充分发挥混合型基金灵活配置的特点，主要进行固定收益投资和新股申购、债券回购等现金类管理，权益类二级市场投资几乎可以忽略不计，因此成功回避了年

初股市大盘很大幅度的系统性风险、以及今年第二季度的震荡风险，为基金持有人取得了较好的绝对正收益，今年上半年，以鑫享 A 为例，份额净值上涨+1.4%，而同期上证综指下跌-17.2%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金 A 份额净值为 1.042 元，份额累计净值为 1.042 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 1.36%，同期业绩基准增长率为-3.42%。本基金 C 份额净值为 1.044 元，份额累计净值为 1.044 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 1.26%，同期业绩基准增长率为-3.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，股市可以分成两个阶段：第一阶段，2016 年 1 月份，以熔断为特征的暴跌，上证综指在不到一个月的时间就下跌了 25%；第二阶段，2 月至 6 月，窄幅震荡，上证综指一直围绕着 2900 上下 7% 的幅度波动，波动率接近历史最低。

资本市场在今年第一季度有如下特点：

一方面，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约 1000 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。相同地，今年第一季度，股市和债市的表现都较差。

而另一方面，资产收益率持续下行，银行、保险等金融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”，巨量资金密切关注着任何盈利机会。股票市场方面，相当一部分的自由流通股被证金公司、汇金公司等救市资金所持有。股市博弈行为越发严重，股市投资短期化、操作难度加大。

因此，今年以来到 6 月底，我们一直维持谨慎的投资态度。

但是，从 6 月份开始，我们观察到几个值得重视的新现象，一定程度上反映了股市投资者风险偏好在回升。

首先，中国 A 股市场的日均成交金额在放大，今年 1 月份市场暴跌时，日均成交金额为 5210 亿元；2 到 5 月份日均成交金额为 4988 亿元；而 6 月份以来日均成交金额放大至 5609 亿元，超过了 1 月份暴跌时的日均成交额，与 2 到 5 月份日均成交金额相比放大了 12%。

其次，证券市场交易结算资金日平均余额也保持稳定，今年 2 月初暴跌过后的日均余额为 1.57 万亿，而 7 月初的交易结算金日均余额为 1.65 万亿，证券交易结算资金主要反映的是非机构的股

市资金情况。

另外，限售股解禁统计显示：今年 6 月份是解禁高峰，当月解禁金额高达 2522 亿元，5 月份的解禁金额也达 2114 亿元；而 7 和 8 月属于解禁低谷，解禁金额分别只有 982 亿元和 1413 亿元。在今年第三季度，股市的供给将可能减小。

综上所述，我们对今年第三季度的股市行情，将改变过往的保守投资态度，在已经积累的基金收益的安全垫基础上，在保持绝对收益目标的前提下，积极进行投资。

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

遵照本基金基金合同的规定，本报告期内未进行利润分配。

4.8 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

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华鑫享混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安大华鑫享混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	53,263,831.53	1,160,219,099.59
结算备付金		259,059.52	14,028,821.77
存出保证金		116,485.52	117,492.68
交易性金融资产	6.4.7.2	848,761,733.36	72,589,693.27
其中：股票投资		24,674,199.24	31,867,729.00
基金投资		-	-
债券投资		824,087,534.12	40,721,964.27
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	198,935,538.40	1,777,893,746.84
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,758,674.22	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	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,106,095,322.55	3,026,246,401.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		472,572.25	1,613,591.45
应付管理人报酬		723,329.09	2,053,489.29
应付托管费		180,832.25	513,372.31
应付销售服务费		16,998.50	996,311.64
应付交易费用	6.4.7.7	25,921.36	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	6.4.7.8	179,370.92	182,693.53
负债合计		1,599,024.37	5,615,393.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,057,820,536.92	2,931,440,625.77
未分配利润	6.4.7.10	46,675,761.26	89,190,382.17
所有者权益合计		1,104,496,298.18	3,020,631,007.94
负债和所有者权益总计		1,106,095,322.55	3,026,246,401.78

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额为 1,057,820,536.92 份（其中 A 类基金份额为 62,775,991.12 份，C 类基金份额为 995,044,545.80 份），A 类基金份额净值为 1.042 元，C 类基金份额净值为 1.044 元。

6.2 利润表

会计主体：平安大华鑫享混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		27,813,460.01	-
1.利息收入		14,830,847.93	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,005,650.59	-
债券利息收入		5,322,015.70	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,503,181.64	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,351,705.34	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,569,023.79	-

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,625,811.47	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	156,870.08	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,424,679.57	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,055,586.31	-
减：二、费用		11,260,247.11	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,961,747.67	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,740,436.90	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,314,422.87	-
4. 交易费用	6.4.7.19	46,026.29	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	197,613.38	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,553,212.90	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,553,212.90	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华鑫享混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,931,440,625.77	89,190,382.17	3,020,631,007.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,553,212.90	16,553,212.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动	-1,873,620,088.85	-59,067,833.81	-1,932,687,922.66

数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	1,631,074.79	52,440.38	1,683,515.17
2.基金赎回款	-1,875,251,163.64	-59,120,274.19	-1,934,371,437.83
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)	1,057,820,536.92	46,675,761.26	1,104,496,298.18
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安大华鑫享混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 1330 号《关于准予平安大华鑫享混合型证券投资基金注册的批复》核准,由平安大华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华鑫享混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 292,126,072.70 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 899 号验资报告予以验证。经向经向中国证监会备案,《平安大华鑫享混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 292,142,291.66 份基金份额,其中认购资金利息折合 16,218.96 份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

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

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	53,263,831.53
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	53,263,831.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	26,171,361.81	24,674,199.24	-1,497,162.57	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	4,741,744.73	5,072,534.12	330,789.39
	银行间市场	818,167,199.73	819,015,000.00	847,800.27
	合计	822,908,944.46	824,087,534.12	1,178,589.66
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	849,080,306.27	848,761,733.36	-318,572.91	

本年度本基金所投资的股票中，无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

买入返售证券_银行间	198,935,538.40	-
合计	198,935,538.40	-

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	18,707.75
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	104.85
应收债券利息	4,484,963.07
应收买入返售证券利息	254,851.39
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	47.16
合计	4,758,674.22

6.4.7.6 其他资产

本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,686.18
银行间市场应付交易费用	20,235.18
合计	25,921.36

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	357.54
预提费用	179,013.38
合计	179,370.92

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鑫享 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,694,461.81	84,694,461.81
本期申购	709,929.43	709,929.43
本期赎回(以“-”号填列)	-22,628,400.12	-22,628,400.12
- 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	62,775,991.12	62,775,991.12

金额单位：人民币元

鑫享 C		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,846,746,163.96	2,846,746,163.96
本期申购	921,145.36	921,145.36
本期赎回(以“-”号填列)	-1,852,622,763.52	-1,852,622,763.52
- 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	995,044,545.80	995,044,545.80

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	1,006,320.57	1,352,687.68	2,359,008.25
本期利润	857,493.51	68,590.81	926,084.32
本期基金份额交易产生的变动数	-374,574.48	-302,120.32	-676,694.80
其中：基金申购款	12,219.94	9,831.02	22,050.96
基金赎回款	-386,794.42	-311,951.34	-698,745.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,489,239.60	1,119,158.17	2,608,397.77

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
上年度末	41,212,398.74	45,618,975.18	86,831,373.92
本期利润	20,120,398.96	-4,493,270.38	15,627,128.58
本期基金份额交易产生的变动数	-35,062,591.95	-23,328,547.06	-58,391,139.01
其中：基金申购款	18,464.53	11,924.89	30,389.42
基金赎回款	-35,081,056.48	-23,340,471.95	-58,421,528.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,270,205.75	17,797,157.74	44,067,363.49

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	2,545,369.73
定期存款利息收入	435,193.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	23,440.07
其他	1,646.90
合计	3,005,650.59

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	19,636,022.19
减：卖出股票成本总额	9,066,998.40
买卖股票差价收入	10,569,023.79

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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	4,625,811.47
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	4,625,811.47

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	116,478,245.93
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	111,051,668.23
减：应收利息总额	800,766.23
买卖债券差价收入	4,625,811.47

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末未发生贵金属投资。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	156,870.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	156,870.08

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,424,679.57
——股票投资	-5,523,301.09
——债券投资	1,098,621.52
——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	-4,424,679.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	1,927,035.69
转换费收入 A 类 001609	3.35
申购款利息收入	67,036.96
DVP 账户利息收入	61,510.31
合计	2,055,586.31

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25%

归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	40,276.28
银行间市场交易费用	5,750.01
合计	46,026.29

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,178.12
银行间账户维护费	18,600.00
合计	197,613.38

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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	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
上海陆金所资产管理有限公司	与基金管理人受同一实际控制人控制的公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于本期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无关联方债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期内无通过关联方进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,961,747.67	-
其中：支付销售机构的客户维护费	172,470.39	-

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,740,436.90	-

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。

6.4.10.2.3 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		
	2016年1月1日至2016年6月30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	-	2,286,184.16	2,286,184.16
平安银行	-	28,049.64	28,049.64
平安证券	-	113.18	113.18
上海陆金所资产管理有 限公司	-	73.63	73.63
合计	-	2,314,420.61	2,314,420.61

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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	
	2016年1月1日至2016年6月30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	9,999,000.00	-

份额		
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	0.9452%	-

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	-	-
期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

鑫享 A				
关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
平安大华基金管理 有限公司	9,999,000.00	0.9452%	-	-

6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	53,263,831.53	2,545,369.73	-	-

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	8,832	114,639.36	114,639.36	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

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。

6.4.12.2 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
601611	中国	2016年	重大	20.92	2016年	23.01	30,404	105,501.88	636,051.68	-

	核建	6月30日	事项		7月1日						
601599	鹿港科技	2016年4月11日	重大事项	11.34	2016年7月6日	10.21	15,200	174,465.94	172,368.00	-	
600986	科达股份	2016年6月27日	重大事项	15.98	2016年7月18日	17.58	7,970	169,383.18	127,360.60	-	
600654	中安消	2016年5月19日	重大事项	21.50	2016年8月8日	20.39	5,000	168,276.09	107,500.00	-	
000718	苏宁环球	2016年1月4日	重大事项	13.09	2016年7月18日	11.78	6,300	66,071.49	82,467.00	-	
000002	万科A	2015年12月21日	重大事项	18.20	2016年7月4日	21.99	4,400	63,291.21	80,080.00	-	
002089	新海宜	2016年1月8日	重大事项	17.71	2016年7月18日	18.55	3,900	64,720.50	69,069.00	-	
300300	汉鼎宇佑	2016年5月10日	重大事项	30.56	-	-	2,200	63,335.07	67,232.00	-	
002766	索菱股份	2016年3月21日	重大事项	31.74	2016年7月5日	34.91	2,000	75,713.94	63,480.00	-	
300391	康跃科技	2016年3月25日	重大事项	17.79	2016年7月18日	19.57	3,100	64,224.48	55,149.00	-	
002445	中南文化	2016年6月14日	重大事项	22.99	-	-	2,300	62,820.43	52,877.00	-	
002046	轴研科技	2016年5月9日	重大事项	10.33	2016年8月22日	11.36	5,100	60,153.55	52,683.00	-	
000802	北京文化	2016年6月1日	重大事项	23.52	2016年8月22日	22.69	2,000	60,713.27	47,040.00	-	
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项	12.44	-	-	3,600	63,619.05	44,784.00	-	
000948	南天信息	2016年6月28日	重大事项	19.31	2016年7月12日	21.00	2,300	61,619.83	44,413.00	-	

002630	华西能源	2016年4月25日	重大事项	11.06	-	-	4,000	51,915.42	44,240.00	-
300166	东方国信	2016年6月8日	重大事项	27.47	-	-	1,600	63,207.01	43,952.00	-
300332	天壕环境	2016年4月11日	重大事项	9.37	2016年7月29日	9.91	4,400	58,419.04	41,228.00	-
300284	苏交科	2016年5月20日	重大事项	19.49	2016年8月10日	21.44	1,800	46,784.55	35,082.00	-
002175	东方网络	2016年5月9日	重大事项	46.09	-	-	400	24,043.50	18,436.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	30,188,000.00	20,006,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	410,357,000.00	20,064,000.00
合计	440,545,000.00	40,070,000.00

注：以上按短期信用评级的债券投资未评级的债券投资为国债及发行主体评级在 AA 级以上的超短期融资券。

6.4.13.2.2 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	19,904,000.00	-
AAA 以下	15,388,534.12	651,964.27
未评级	348,250,000.00	-
合计	383,542,534.12	651,964.27

注：以上按长期信用评级的债券投资未评级债券为政策性银行债。

6.4.13.3 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发行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 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 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	53,263,831.53	-	-	-	-	-	53,263,831.53
结算备付金	259,059.52	-	-	-	-	-	259,059.52
存出保证金	116,485.52	-	-	-	-	-	116,485.52

交易性金融资产	50,070,000.00	30,188,000.00	728,441,000.00	11,272,549.20	4,115,984.92	24,674,199.24	848,761,733.36
买入返售金融资产	198,935,538.40	-	-	-	-	-	198,935,538.40
应收利息	-	-	-	-	-	4,758,674.22	4,758,674.22
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	302,644,914.97	30,188,000.00	728,441,000.00	11,272,549.20	4,115,984.92	29,432,873.46	1,106,095,322.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	472,572.25	472,572.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	723,329.09	723,329.09
应付托管费	-	-	-	-	-	180,832.25	180,832.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	16,998.50	16,998.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,921.36	25,921.36
其他负债	-	-	-	-	-	179,370.92	179,370.92
负债总计	-	-	-	-	-	1,599,024.37	1,599,024.37
利率敏感度缺口	302,644,914.97	30,188,000.00	728,441,000.00	11,272,549.20	4,115,984.92	-	-
上年度末 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
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	1,351,350.98	-
	市场利率上升 25 个基点	-1,347,794.24	-

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的股票投资金额仅占基金净资产的 2.23%（2015 年 12 月 31 日：1.06%），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 8 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	24,674,199.24	2.23
	其中：股票	24,674,199.24	2.23
2	固定收益投资	824,087,534.12	74.50
	其中：债券	824,087,534.12	74.50
	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	198,935,538.40	17.99
	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	53,522,891.05	4.84
7	其他各项资产	4,875,159.74	0.44
8	合计	1,106,095,322.55	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	14,379,679.76	1.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	467,805.40	0.04
E	建筑业	1,309,008.48	0.12
F	批发和零售业	705,409.66	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	423,841.00	0.04
H	住宿和餐饮业	105,252.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,251,875.36	0.29
J	金融业	1,345,147.00	0.12
K	房地产业	846,838.50	0.08
L	租赁和商务服务业	764,991.40	0.07
M	科学研究和技术服务业	216,907.85	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	331,647.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	110,468.37	0.01
R	文化、体育和娱乐业	368,747.46	0.03
S	综合	46,580.00	0.00
	合计	24,674,199.24	2.23

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

7.3 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	000861	海印股份	130,000	642,200.00	0.06
2	601611	中国核建	30,404	636,051.68	0.06
3	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.02
4	002791	坚朗五金	3,973	213,628.21	0.02
5	600518	康美药业	13,800	209,622.00	0.02
6	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
7	600366	宁波韵升	8,499	202,871.13	0.02

8	600436	片仔癀	4,500	202,545.00	0.02
9	603608	天创时尚	7,994	191,616.18	0.02
10	603023	威帝股份	9,750	187,785.00	0.02
11	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.02
12	600563	法拉电子	4,100	186,632.00	0.02
13	601599	鹿港科技	15,200	172,368.00	0.02
14	600006	XD 东风汽	18,800	166,756.00	0.02
15	600987	航民股份	13,600	164,832.00	0.01
16	600276	恒瑞医药	4,104	164,611.44	0.01
17	600867	通化东宝	7,920	163,864.80	0.01
18	600660	福耀玻璃	11,634	162,876.00	0.01
19	601601	中国太保	6,000	162,240.00	0.01
20	600355	精伦电子	21,199	159,628.47	0.01
21	600066	宇通客车	7,909	156,598.20	0.01
22	603766	隆鑫通用	7,700	155,694.00	0.01
23	600816	安信信托	9,200	155,204.00	0.01
24	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
25	600340	华夏幸福	6,273	152,935.74	0.01
26	603339	四方冷链	2,793	151,995.06	0.01
27	600176	中国巨石	15,825	151,445.25	0.01
28	600004	白云机场	12,300	150,798.00	0.01
29	600261	阳光照明	21,100	148,966.00	0.01
30	601965	中国汽研	15,500	148,955.00	0.01
31	600009	上海机场	5,700	148,485.00	0.01
32	600570	恒生电子	2,200	146,894.00	0.01
33	600030	中信证券	9,000	146,070.00	0.01
34	603085	天成自控	3,500	146,055.00	0.01
35	600337	美克家居	11,200	145,712.00	0.01
36	600198	大唐电信	7,300	145,124.00	0.01
37	600513	联环药业	7,500	144,375.00	0.01
38	600525	长园集团	10,385	143,832.25	0.01
39	600571	信雅达	2,600	143,312.00	0.01
40	600109	国金证券	10,500	141,540.00	0.01
41	600312	平高电气	9,000	140,940.00	0.01
42	600846	同济科技	14,171	140,292.90	0.01
43	601199	江南水务	17,880	139,106.40	0.01
44	600797	浙大网新	12,300	138,621.00	0.01
45	600703	三安光电	6,900	137,793.00	0.01
46	600373	中文传媒	6,600	136,950.00	0.01

47	603898	好莱客	4,400	136,796.00	0.01
48	600422	昆药集团	10,000	136,400.00	0.01
49	600426	华鲁恒升	15,471	136,299.51	0.01
50	600826	兰生股份	5,200	136,136.00	0.01
51	601555	东吴证券	10,100	135,340.00	0.01
52	600323	瀚蓝环境	10,400	131,976.00	0.01
53	601901	方正证券	17,200	131,752.00	0.01
54	600872	中炬高新	10,500	129,570.00	0.01
55	600804	鹏博士	7,100	129,433.00	0.01
56	600351	亚宝药业	12,900	129,387.00	0.01
57	600398	海澜之家	11,300	127,690.00	0.01
58	600118	中国卫星	3,800	127,680.00	0.01
59	600986	科达股份	7,970	127,360.60	0.01
60	600999	招商证券	7,700	127,050.00	0.01
61	600572	康恩贝	19,485	126,262.80	0.01
62	603015	弘讯科技	9,000	125,010.00	0.01
63	600119	长江投资	8,200	124,558.00	0.01
64	600376	首开股份	10,700	118,984.00	0.01
65	600027	华电国际	24,000	118,800.00	0.01
66	600446	金证股份	3,300	118,635.00	0.01
67	603779	威龙股份	2,808	117,823.68	0.01
68	603959	百利科技	2,815	116,681.75	0.01
69	600288	大恒科技	9,000	116,460.00	0.01
70	600637	东方明珠	4,790	116,253.30	0.01
71	600850	华东电脑	4,030	115,620.70	0.01
72	600410	华胜天成	10,290	115,453.80	0.01
73	601966	玲珑轮胎	8,832	114,639.36	0.01
74	600067	冠城大通	15,900	114,639.00	0.01
75	300505	川金诺	1,893	114,450.78	0.01
76	601519	大智慧	12,300	113,037.00	0.01
77	601766	中国中车	12,300	112,791.00	0.01
78	600037	歌华有线	7,200	109,512.00	0.01
79	600686	金龙汽车	7,350	108,265.50	0.01
80	600654	中安消	5,000	107,500.00	0.01
81	601886	江河集团	10,400	106,808.00	0.01
82	603101	汇嘉时代	3,563	106,248.66	0.01
83	601007	金陵饭店	8,400	105,252.00	0.01
84	601002	晋亿实业	12,000	104,400.00	0.01
85	601038	一拖股份	10,800	102,276.00	0.01

86	601788	光大证券	6,000	101,640.00	0.01
87	600517	置信电气	10,600	100,806.00	0.01
88	002795	永和智控	1,450	98,716.00	0.01
89	002439	启明星辰	3,800	98,154.00	0.01
90	601777	力帆股份	8,300	97,691.00	0.01
91	600292	远达环保	7,300	92,491.00	0.01
92	300510	金冠电气	1,365	92,219.40	0.01
93	002793	东音股份	1,413	91,859.13	0.01
94	300349	金卡股份	2,100	90,300.00	0.01
95	300104	乐视网	1,700	89,947.00	0.01
96	600503	华丽家族	9,800	89,866.00	0.01
97	002609	捷顺科技	5,100	89,709.00	0.01
98	002149	西部材料	2,800	89,264.00	0.01
99	002572	索菲亚	1,500	84,030.00	0.01
100	002508	老板电器	2,250	82,732.50	0.01
101	000718	苏宁环球	6,300	82,467.00	0.01
102	300294	博雅生物	1,300	81,718.00	0.01
103	002426	胜利精密	8,250	81,262.50	0.01
104	000002	万 科 A	4,400	80,080.00	0.01
105	002402	和而泰	2,900	78,445.00	0.01
106	002108	沧州明珠	3,000	77,700.00	0.01
107	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
108	002231	奥维通信	4,900	75,754.00	0.01
109	300015	爱尔眼科	2,049	74,849.97	0.01
110	000423	东阿阿胶	1,400	73,962.00	0.01
111	300017	网宿科技	1,100	73,920.00	0.01
112	603029	天鹅股份	1,618	72,211.34	0.01
113	300379	东方通	900	71,532.00	0.01
114	002690	美亚光电	3,000	69,120.00	0.01
115	002089	新 海 宜	3,900	69,069.00	0.01
116	002450	康得新	3,997	68,348.70	0.01
117	300300	汉鼎宇佑	2,200	67,232.00	0.01
118	300296	利亚德	2,100	66,486.00	0.01
119	002620	瑞和股份	1,700	65,552.00	0.01
120	600602	云赛智联	6,200	65,472.00	0.01
121	300033	同花顺	800	65,160.00	0.01
122	002179	中航光电	1,500	64,980.00	0.01
123	300130	新国都	2,100	64,890.00	0.01
124	000895	双汇发展	3,100	64,728.00	0.01

125	300275	梅安森	2,800	63,532.00	0.01
126	002766	索菱股份	2,000	63,480.00	0.01
127	002372	伟星新材	4,420	63,471.20	0.01
128	300159	新研股份	3,500	63,175.00	0.01
129	002519	银河电子	2,800	62,776.00	0.01
130	002405	四维图新	2,550	62,730.00	0.01
131	002243	通产丽星	4,900	62,475.00	0.01
132	002236	大华股份	4,750	62,225.00	0.01
133	002380	科远股份	1,800	61,794.00	0.01
134	000821	京山轻机	3,500	61,670.00	0.01
135	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
136	300219	鸿利光电	3,900	60,762.00	0.01
137	002294	信立泰	2,200	59,840.00	0.01
138	000418	小天鹅 A	1,820	59,368.40	0.01
139	300207	欣旺达	2,300	59,041.00	0.01
140	300250	初灵信息	1,992	58,943.28	0.01
141	600749	西藏旅游	3,100	58,590.00	0.01
142	002139	拓邦股份	4,050	58,563.00	0.01
143	300274	阳光电源	2,400	58,560.00	0.01
144	300165	天瑞仪器	5,400	58,482.00	0.01
145	002428	云南锗业	3,400	58,412.00	0.01
146	000555	神州信息	1,800	58,302.00	0.01
147	300270	中威电子	3,400	57,902.00	0.01
148	300400	劲拓股份	1,600	57,872.00	0.01
149	002595	豪迈科技	2,700	57,699.00	0.01
150	002142	宁波银行	3,900	57,642.00	0.01
151	002262	恩华药业	2,860	57,629.00	0.01
152	300267	尔康制药	4,000	57,280.00	0.01
153	002396	星网锐捷	2,900	57,130.00	0.01
154	300271	华宇软件	2,996	56,684.32	0.01
155	000413	东旭光电	6,500	55,835.00	0.01
156	000783	长江证券	4,800	55,680.00	0.01
157	300231	银信科技	3,000	55,320.00	0.01
158	000776	广发证券	3,300	55,308.00	0.01
159	002642	荣之联	2,100	55,251.00	0.01
160	300391	康跃科技	3,100	55,149.00	0.00
161	300369	绿盟科技	1,300	55,003.00	0.00
162	002364	中恒电气	2,000	54,860.00	0.00
163	000863	三湘股份	5,900	54,280.00	0.00

164	000963	华东医药	800	53,920.00	0.00
165	300026	红日药业	3,100	53,909.00	0.00
166	002383	合众思壮	1,500	53,745.00	0.00
167	300072	三聚环保	1,935	53,483.40	0.00
168	002117	东港股份	1,700	53,482.00	0.00
169	002376	新北洋	4,000	53,440.00	0.00
170	002378	章源钨业	5,100	53,295.00	0.00
171	300202	聚龙股份	2,200	53,262.00	0.00
172	002177	御银股份	5,400	53,190.00	0.00
173	002445	中南文化	2,300	52,877.00	0.00
174	002317	众生药业	4,400	52,756.00	0.00
175	002046	轴研科技	5,100	52,683.00	0.00
176	002138	顺络电子	2,900	52,577.00	0.00
177	002437	誉衡药业	6,000	52,200.00	0.00
178	000961	中南建设	9,250	51,892.50	0.00
179	002588	史丹利	4,200	51,870.00	0.00
180	002025	航天电器	2,100	51,849.00	0.00
181	002501	利源精制	4,800	51,840.00	0.00
182	300348	长亮科技	1,400	51,744.00	0.00
183	300011	鼎汉技术	2,200	51,634.00	0.00
184	002085	万丰奥威	3,000	51,570.00	0.00
185	002415	海康威视	2,400	51,504.00	0.00
186	300146	汤臣倍健	3,800	51,452.00	0.00
187	002556	辉隆股份	3,400	51,374.00	0.00
188	300070	碧水源	3,450	51,336.00	0.00
189	300075	数字政通	2,000	51,300.00	0.00
190	002361	神剑股份	6,600	51,216.00	0.00
191	002104	恒宝股份	3,100	50,964.00	0.00
192	002520	日发精机	3,450	50,922.00	0.00
193	002367	康力电梯	3,300	50,820.00	0.00
194	300281	金明精机	3,400	50,456.00	0.00
195	000997	新大陆	2,500	50,100.00	0.00
196	300177	中海达	3,300	50,028.00	0.00
197	002184	海得控制	1,900	49,989.00	0.00
198	300336	新文化	2,000	49,960.00	0.00
199	002279	久其软件	2,250	49,905.00	0.00
200	300144	宋城演艺	2,000	49,820.00	0.00
201	000733	振华科技	2,200	49,500.00	0.00
202	300377	赢时胜	1,000	49,490.00	0.00

203	002020	京新药业	4,000	49,480.00	0.00
204	002010	传化股份	2,500	49,475.00	0.00
205	300233	金城医药	1,900	49,191.00	0.00
206	002589	瑞康医药	1,600	49,136.00	0.00
207	002551	尚荣医疗	2,100	49,098.00	0.00
208	002678	珠江钢琴	4,000	49,080.00	0.00
209	300199	翰宇药业	2,400	48,840.00	0.00
210	002563	森马服饰	4,500	48,735.00	0.00
210	300056	三维丝	2,700	48,735.00	0.00
211	002559	亚威股份	3,300	48,675.00	0.00
212	300103	达刚路机	2,600	48,620.00	0.00
213	002462	嘉事堂	1,300	48,425.00	0.00
214	300237	美晨科技	5,100	48,042.00	0.00
215	000815	美利纸业	2,300	47,794.00	0.00
216	002400	省广股份	3,380	47,759.40	0.00
217	002223	鱼跃医疗	1,500	47,580.00	0.00
218	300262	巴安水务	3,100	47,492.00	0.00
219	002153	石基信息	1,800	47,484.00	0.00
220	002111	威海广泰	1,800	47,322.00	0.00
221	002410	广联达	3,300	47,190.00	0.00
222	000802	北京文化	2,000	47,040.00	0.00
223	002518	科士达	1,890	47,023.20	0.00
224	000977	浪潮信息	2,000	46,900.00	0.00
225	000046	泛海控股	4,616	46,667.76	0.00
226	002701	奥瑞金	5,280	46,622.40	0.00
227	300339	润和软件	1,300	46,592.00	0.00
228	000009	中国宝安	3,400	46,580.00	0.00
229	300289	利德曼	3,100	46,376.00	0.00
230	002063	远光软件	3,000	46,350.00	0.00
231	002122	天马股份	7,400	46,028.00	0.00
232	300027	华谊兄弟	3,399	46,022.46	0.00
233	300205	天喻信息	3,100	45,849.00	0.00
234	300248	新开普	1,700	45,747.00	0.00
235	300055	万邦达	2,500	45,525.00	0.00
236	300022	吉峰农机	5,500	45,045.00	0.00
237	002178	延华智能	4,100	45,018.00	0.00
238	300253	卫宁健康	1,820	44,954.00	0.00
239	000686	东北证券	3,480	44,926.80	0.00
240	300455	康拓红外	2,000	44,880.00	0.00

241	002465	海格通信	3,600	44,784.00	0.00
242	300024	机器人	1,760	44,686.40	0.00
243	000948	南天信息	2,300	44,413.00	0.00
244	002308	威创股份	2,700	44,361.00	0.00
245	002630	华西能源	4,000	44,240.00	0.00
246	000069	华侨城 A	6,900	44,160.00	0.00
247	002121	科陆电子	3,750	44,062.50	0.00
248	300166	东方国信	1,600	43,952.00	0.00
249	300171	东富龙	2,300	43,424.00	0.00
250	300113	顺网科技	1,131	42,932.76	0.00
251	000826	启迪桑德	1,400	42,770.00	0.00
252	600496	精工钢构	10,000	42,600.00	0.00
253	002573	清新环境	2,500	42,300.00	0.00
254	002470	金正大	5,200	41,860.00	0.00
255	002482	广田集团	5,500	41,690.00	0.00
256	300257	开山股份	2,500	41,300.00	0.00
257	300332	天壕环境	4,400	41,228.00	0.00
258	300378	鼎捷软件	1,430	41,069.60	0.00
259	300195	长荣股份	2,200	40,810.00	0.00
260	300114	中航电测	1,350	40,230.00	0.00
261	002547	春兴精工	3,600	39,816.00	0.00
262	002170	芭田股份	4,700	39,668.00	0.00
263	002625	龙生股份	900	39,582.00	0.00
264	002649	博彦科技	1,000	39,570.00	0.00
265	002424	贵州百灵	2,300	39,560.00	0.00
266	002268	卫士通	1,100	39,314.00	0.00
267	002329	皇氏集团	2,600	38,974.00	0.00
268	000156	华数传媒	2,100	38,955.00	0.00
269	002487	大金重工	4,400	38,940.00	0.00
270	002017	东信和平	2,700	38,880.00	0.00
271	000797	中国武夷	2,600	38,844.00	0.00
272	300090	盛运环保	4,800	38,832.00	0.00
273	002285	世联行	4,900	38,171.00	0.00
274	002312	三泰控股	2,000	37,900.00	0.00
275	000062	深圳华强	1,400	37,800.00	0.00
276	000026	飞亚达 A	3,300	37,719.00	0.00
277	000801	四川九洲	3,034	37,378.88	0.00
278	002183	怡亚通	2,600	37,232.00	0.00
279	300126	锐奇股份	3,000	37,230.00	0.00

280	000566	海南海药	3,400	37,094.00	0.00
281	000939	凯迪生态	4,100	36,695.00	0.00
282	000550	江铃汽车	1,500	36,540.00	0.00
283	002658	雪迪龙	2,100	36,519.00	0.00
284	300380	安硕信息	700	36,050.00	0.00
285	300244	迪安诊断	1,080	35,618.40	0.00
286	000777	中核科技	1,500	35,340.00	0.00
287	300284	苏交科	1,800	35,082.00	0.00
288	300124	汇川技术	1,800	34,920.00	0.00
289	002565	上海绿新	4,700	34,827.00	0.00
290	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
291	002221	东华能源	2,600	31,694.00	0.00
292	000540	中天城投	4,800	29,904.00	0.00
293	000712	锦龙股份	1,400	29,064.00	0.00
294	300085	银之杰	910	27,209.00	0.00
295	000523	广州浪奇	2,500	27,175.00	0.00
296	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
297	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
298	002175	东方网络	400	18,436.00	0.00
299	300496	中科创达	234	15,846.48	0.00
300	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
301	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
302	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
303	002335	科华恒盛	100	4,852.00	0.00
304	300182	捷成股份	200	3,422.00	0.00
305	002789	建艺集团	28	2,007.04	0.00
306	603861	白云电器	56	1,856.96	0.00
307	601009	南京银行	180	1,690.20	0.00
308	002325	洪涛股份	120	1,102.80	0.00
309	300506	名家汇	12	633.96	0.00
310	603027	千禾味业	4	141.08	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000861	海印股份	2,500,469.00	0.08

2	002510	天汽模	1,299,146.00	0.04
3	600004	白云机场	499,111.00	0.02
4	600703	三安光电	335,530.00	0.01
5	600496	精工钢构	299,860.00	0.01
6	002325	洪涛股份	299,483.00	0.01
7	002496	辉丰股份	298,525.00	0.01
8	601199	江南水务	298,393.00	0.01
9	601611	中国核建	211,003.76	0.01
10	002797	第一创业	135,968.56	0.00
11	601966	玲珑轮胎	114,639.36	0.00
12	601900	南方传媒	112,559.06	0.00
13	002791	坚朗五金	85,697.61	0.00
14	603608	天创时尚	78,341.20	0.00
15	002792	通宇通讯	70,678.14	0.00
16	603868	飞科电器	59,372.79	0.00
17	601127	小康股份	50,326.22	0.00
18	002790	瑞尔特	50,104.76	0.00
19	300511	雪榕生物	48,307.04	0.00
20	300512	中亚股份	39,164.43	0.00

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。

7.4.2 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	603508	思维列控	1,823,284.50	0.06
2	000861	海印股份	1,747,118.00	0.06
3	300496	中科创达	1,410,806.50	0.05
4	002510	天汽模	1,292,110.00	0.04
5	002781	奇信股份	1,275,858.00	0.04
6	300495	美尚生态	917,702.50	0.03
7	300494	盛天网络	612,598.00	0.02
8	002782	可立克	592,831.00	0.02
9	600004	白云机场	528,174.00	0.02
10	002496	辉丰股份	513,628.00	0.02
11	603778	乾景园林	492,802.80	0.02
12	002786	银宝山新	483,703.70	0.02

13	002787	华源包装	437,978.50	0.01
14	300497	富祥股份	436,268.77	0.01
15	002325	洪涛股份	424,746.00	0.01
16	603299	井神股份	389,064.45	0.01
17	002780	三夫户外	385,128.00	0.01
18	601900	南方传媒	381,941.60	0.01
19	601199	江南水务	355,175.00	0.01
20	300491	通合科技	349,256.00	0.01

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。

7.4.3 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	7,391,503.33
卖出股票收入（成交）总额	19,636,022.19

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。

7.5 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	49,970,000.00	4.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	348,250,000.00	31.53
	其中：政策性金融债	348,250,000.00	31.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	390,575,000.00	35.36
6	中期票据	30,220,000.00	2.74
7	可转债（可交换债）	5,072,534.12	0.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	824,087,534.12	74.61

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120223	12 国开 23	1,500,000	149,490,000.00	13.53
2	070208	07 国开 08	1,000,000	99,450,000.00	9.00

3	120225	12 国开 25	1,000,000	99,310,000.00	8.99
4	011699613	16 深航空 SCP004	500,000	50,090,000.00	4.54
4	011699066	16TCL 集 SCP001	500,000	50,090,000.00	4.54
5	011699589	16 厦国贸控 SCP003	500,000	50,070,000.00	4.53

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	116,485.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,758,674.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,875,159.74

7.12.4 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。

7.12.5 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	601611	中国核建	636,051.68	0.06	临时停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	597	105,152.41	9,999,000.00	15.93%	52,776,991.12	84.07%
鑫享 C	177	5,621,720.60	970,873,786.41	97.57%	24,170,759.39	2.43%
合计	774	1,366,693.20	980,872,786.41	92.73%	76,947,750.51	7.27%

8.2 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	95.93	0.0002%
	鑫享 C	9,280.95	0.0009%
	合计	9,376.88	0.0009%

8.3 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

§ 9 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）基金份额总额	103,827,057.49	188,315,234.17
本报告期初基金份额总额	84,694,461.81	2,846,746,163.96
本报告期基金总申购份额	709,929.43	921,145.36
减：本报告期基金总赎回份额	22,628,400.12	1,852,622,763.52
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	62,775,991.12	995,044,545.80

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十三次会议审议通过，由陈特正先生接替肖宇鹏先生任职公司督察长职务，任职日期为 2016 年 1 月 21 日，该事项已于 2016 年 1 月 22 日公告。

2、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十六次会议审议通过，由肖宇鹏先生接替罗春风先生任职公司总经理职务，任职日期为 2016 年 1 月 22 日，该事项已于 2016 年 1 月 23 日公告。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	1,233,309.25	4.84%	877.19	4.84%	-
东方证券	1	-	-	-	-	新增
海通证券	2	3,304,250.56	12.97%	2,350.21	12.97%	新增
国信证券	2	5,556,141.99	21.82%	3,952.09	21.81%	-
开源证券	2	3,340,002.75	13.12%	2,375.64	13.11%	新增
银河证券	2	1,180,153.92	4.63%	839.43	4.63%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	新增
恒泰证券	2	437,978.50	1.72%	320.31	1.77%	-
申万宏源	2	1,384,594.00	5.44%	984.85	5.43%	新增
中银国际	1	4,688.00	0.02%	3.33	0.02%	新增
华创证券	2	1,117,617.39	4.39%	795.02	4.39%	-
东兴证券	1	-	-	100.39	0.55%	新增
长江证券	1	-	-	-	-	新增
英大证券	1	-	-	-	-	新增
西南证券	1	-	-	-	-	新增
联讯证券	2	-	-	-	-	新增
民生证券	1	-	-	-	-	新增
华泰证券	2	-	-	-	-	新增
光大证券	2	-	-	-	-	新增
广发证券	2	-	-	-	-	新增
华林证券	2	-	-	-	-	新增
安信证券	2	-	-	-	-	新增
天风证券	2	-	-	-	-	新增
兴业证券	1	7,799,971.47	30.50%	5,524.45	30.48%	-

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。

10.7.2 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	3,866,595.30	10.76%	100,000,000.00	7.14%	-	-

东方证券	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	200,000,000.00	14.29%	-
国信证券	20,012,771.62	55.68%	500,000,000.00	35.71%	-
开源证券	-	-	-	-	-
银河证券	8,432,785.30	23.46%	-	-	-
中泰证券	212,298.07	0.59%	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	600,000,000.00	42.86%	-
东兴证券	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-
兴业证券	3,417,641.76	9.51%	-	-	-

10.8 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旗下基金在指数熔断期间调整开放时间的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月4日
2	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行申购与定期定额申购费率优惠活动的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月5日
3	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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月5日
4	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金在指数熔断期	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月7日

	间调整开放时间的公告		
5	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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月8日
6	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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月14日
7	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安证券费率优惠调整的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月20日
8	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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月20日
9	平安大华鑫享混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月21日
10	平安大华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月22日
11	平安大华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年1月23日
12	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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年2月5日
13	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信期货为销售机构及开通转换和定投业务的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年2月26日
14	关于旗下部分基金新增奕丰金融为销售机构及开通转换和定投业务并参与其费率优惠的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年3月11日
15	平安大华鑫享混合型证券投资基金招募说明书（更新） 2016年第1期	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年3月12日
16	平安大华鑫享混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要 2016年第1期	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年3月12日
17	关于旗下部分基金新增中经北证（北京）资产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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年3月25日
18	关于平安大华鑫享混合型证券投资基金 C 类份额销售服务费优惠的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016年3月28日

19	平安大华鑫享混合型证券投资基金 2015 年年度报告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 3 月 30 日
20	平安大华鑫享混合型证券投资基金 2015 年年度报告 摘要	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 3 月 30 日
21	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大证券为销售机构的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 3 月 31 日
22	关于旗下部分基金新增北京钱景财富投资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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 4 月 15 日
23	平安大华鑫享混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 4 月 20 日
24	关于旗下部分基金新增深圳市华融金融服务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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 4 月 22 日
25	关于旗下部分基金新增华融湘江银行为销售机构及开通定投业务的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 4 月 27 日
26	关于旗下部分基金新增上海中正达广投资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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 4 月 28 日
27	关于旗下部分基金新增北京微动利投资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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 5 月 27 日
28	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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 6 月 1 日
29	关于旗下部分基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为销售机构的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 6 月 6 日
30	关于旗下部分基金新增浙江同花顺基金销售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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 6 月 15 日

31	关于旗下部分基金新增东北证券为销售机构及开通定投与转换业务的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 6 月 17 日
32	关于旗下部分基金新增深圳市金斧子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	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 6 月 22 日
33	平安大华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务的公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 6 月 24 日
34	平安大华基金管理有限公司 2016 年 6 月 30 日基金净值公告	证券时报、上海证券报、中国证券报	2016 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华鑫享混合型证券投资基金的文件；
- 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、平安大华鑫享混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安大华基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内平安大华鑫享混合型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

11.3 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 8 月 29 日