

平安大华鑫享混合型证券投资基金 2017 年 第 1 季度报告

2017 年 3 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

报告送出日期：2017 年 4 月 24 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安大华鑫享混合型
场内简称	-
交易代码	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
报告期末基金份额总额	320,066,761.26 份
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	鑫享 A	鑫享 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	001609	001610
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	42,941,237.43 份	277,125,523.83 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年1月1日—2017年3月31日）	
	鑫享 A	鑫享 C
1. 本期已实现收益	530,510.62	3,863,954.13
2. 本期利润	1,033,450.68	7,115,732.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0231	0.0256
4. 期末基金资产净值	46,295,022.95	299,950,494.85
5. 期末基金份额净值	1.078	1.082

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. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

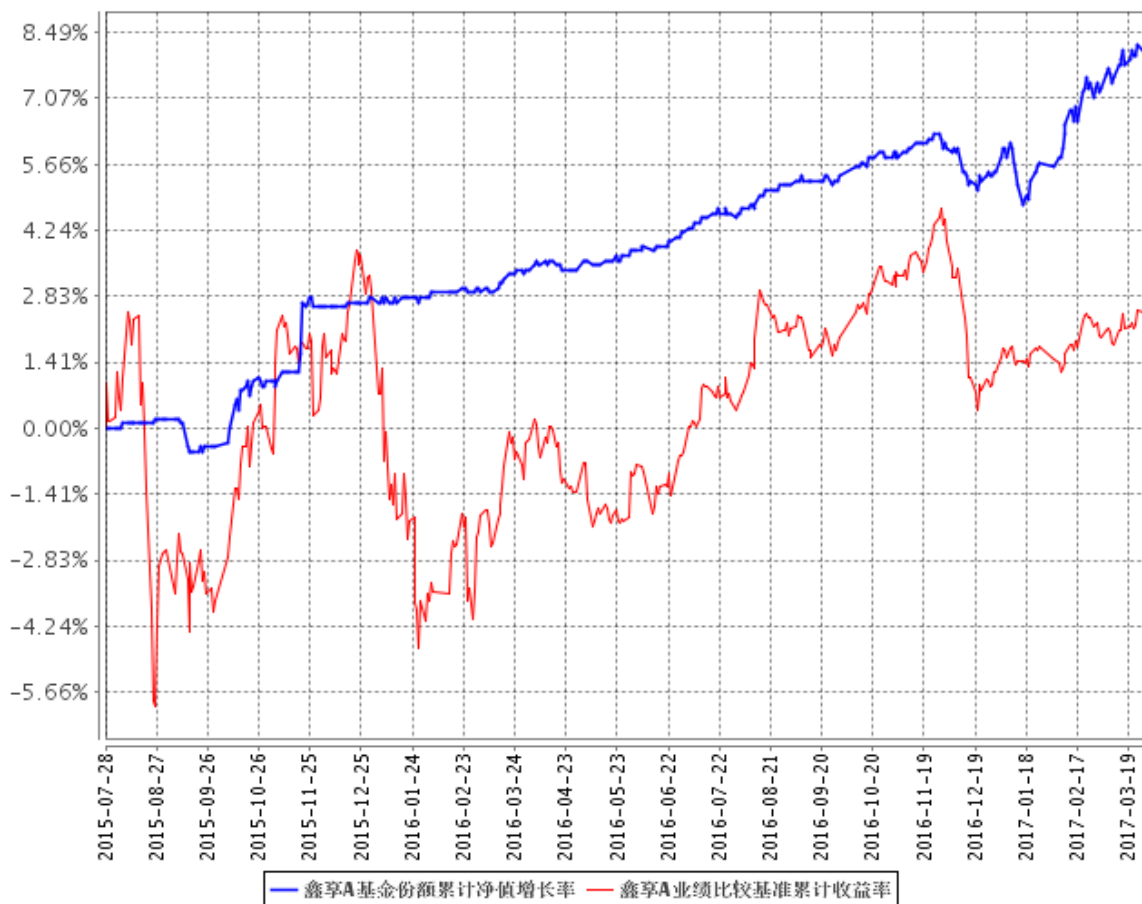
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.18%	0.21%	1.09%	0.17%	1.09%	0.04%

鑫享 C

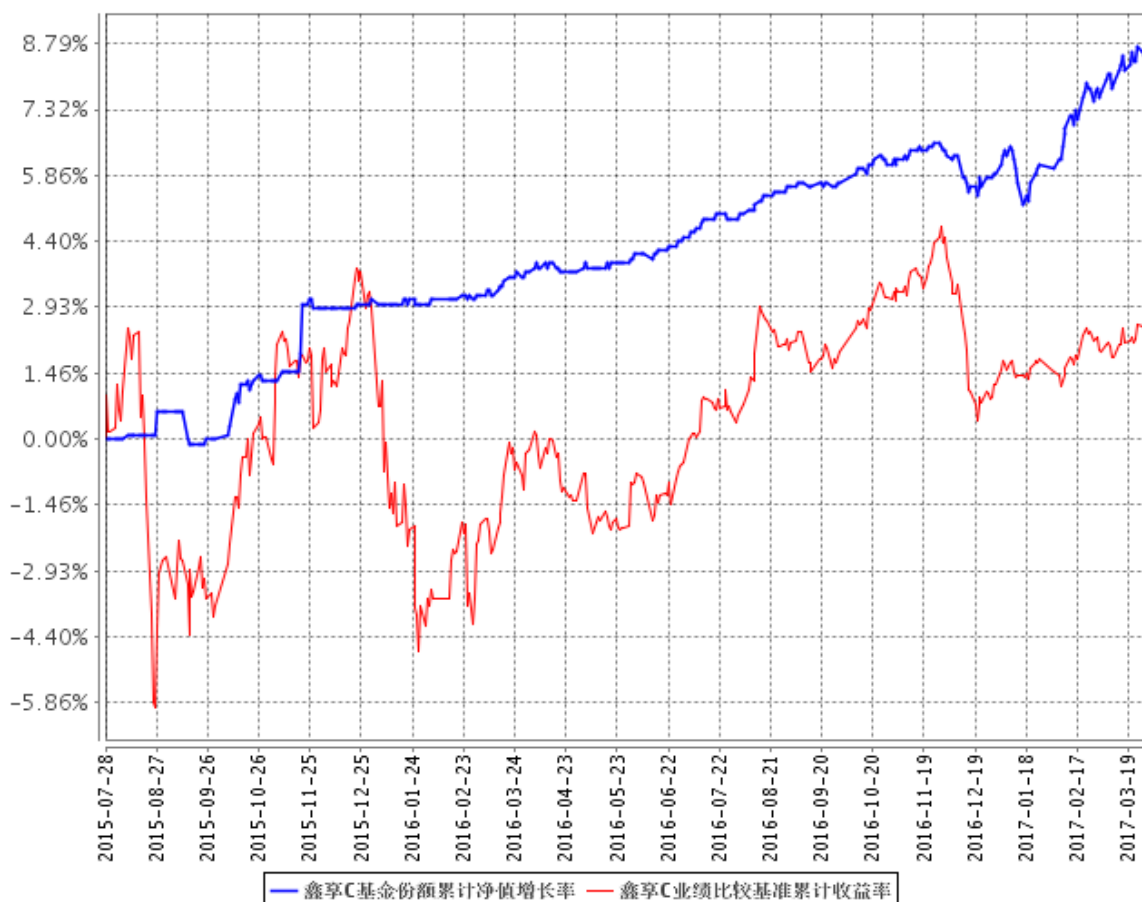
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.17%	0.20%	1.09%	0.17%	1.08%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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，截至报告期末已满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
WANG AO	本基金的基金经理	2016年9月5日	-	5	WANG AO 先生，CAIA、FRM，澳大利亚莫纳什大学商学（金融学、经济学）学士，曾任职原深发展银行国际业务部外汇政策管理室。2012年9月加入平安大华基金管

					理有限公司，担任投资研究部固定收益研究员。现任平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠裕债券型证券投资基金基金经理。
施旭	本基金的基金经理	2016 年 12 月 27 日	-	7	施旭先生，哥伦比亚大学金融数学硕士，曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券，于 2015 年加入平安大华基金，任衍生品投资中心量化研究员，现任平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金经理。

1、此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2、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

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华鑫享混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公

司制定的公平交易相关制度。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾一季度，打新策略获得了不错的收益，新股上市基本都能获得一个不错的涨幅；并且一季度市场上行，底仓也获得了可喜的收益，整体来看一季度成绩喜人。展望二季度，在雄安新区改革的提振下，有望点燃整体市场情绪，市场下行可能不大，底仓应仍能保持一个良好的状态，新股依然可以获得一个较为可观的收益。本基金的运作，主要运用量化多因子模型，精选低估值具有安全边际和成长价值的蓝筹和白马个股，将上市公司的现金分红比例、波动特性、行业发展的空间纳入研究范畴，在货币政策不断收紧的预期下，力争把握市场的结构性的行情，构建具备稳健增长潜力的投资组合。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 3 月 31 日，本基金 A 份额净值为 1.078 元，份额累计净值为 1.078 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 2.18%，同期业绩基准增长率为 1.09%。本基金 C 份额净值为 1.082 元，份额累计净值为 1.082 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 2.17%，同期业绩基准增长率为 1.09%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	120,666,584.10	33.86
	其中：股票	120,666,584.10	33.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	218,346,935.60	61.28
	其中：债券	218,346,935.60	61.28
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,880,356.34	3.90
8	其他资产	3,435,032.36	0.96
9	合计	356,328,908.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,273,207.00	0.37
C	制造业	53,914,757.12	15.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,852,450.00	0.54
E	建筑业	3,383,160.00	0.98
F	批发和零售业	6,274,960.16	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	7,506,555.34	2.17
H	住宿和餐饮业	1,949,428.88	0.56
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,294,373.00	1.82
J	金融业	29,344,840.60	8.48
K	房地产业	4,636,146.00	1.34
L	租赁和商务服务业	995,131.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	599,984.08	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,594,866.00	0.75
S	综合	-	-
	合计	120,666,584.10	34.85

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601336	新华保险	81,100	3,421,609.00	0.99
2	601628	中国人寿	135,100	3,418,030.00	0.99
3	600030	中信证券	208,200	3,354,102.00	0.97
4	601009	南京银行	251,300	3,020,626.00	0.87
5	601668	中国建筑	311,800	2,868,560.00	0.83
6	000429	粤高速A	295,600	2,225,868.00	0.64
7	002009	天奇股份	129,500	1,790,985.00	0.52
8	002466	天齐锂业	40,900	1,766,880.00	0.51
9	002589	瑞康医药	42,700	1,751,554.00	0.51
10	000698	沈阳化工	221,800	1,741,130.00	0.50

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	15,447,635.60	4.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,035,500.00	0.30
	其中：政策性金融债	1,035,500.00	0.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	195,582,800.00	56.49
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,281,000.00	1.81
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	218,346,935.60	63.06

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	011698575	16 广晟 SCP006	300,000	29,940,000.00	8.65
2	011698567	16 津航空 SCP002	300,000	29,898,000.00	8.63
3	011698984	16 宏泰国资 SCP002	200,000	19,988,000.00	5.77
4	011698580	16 昆山国创 SCP008	200,000	19,966,000.00	5.77
5	011698655	16 盾安	200,000	19,926,000.00	5.75

		SCP004			
--	--	--------	--	--	--

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末无贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末无权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1706	IF1706	-5	-5,111,100.00	-134,368.42	-
公允价值变动总额合计(元)					-134,368.42
股指期货投资本期收益(元)					-768,748.31
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-151,731.69

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,292,314.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,142,051.83
5	应收申购款	666.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,435,032.36

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113010	江南转债	1,094,800.00	0.32
2	132002	15天集EB	2,068,800.00	0.60

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫享 A	鑫享 C
报告期期初基金份额总额	46,247,985.66	425,225,753.44
报告期期间基金总申购份额	206,452.04	48,750,806.85
减：报告期期间基金总赎回份额	3,513,200.27	196,851,036.46
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	42,941,237.43	277,125,523.83

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

鑫享 A

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	3.12

鑫享 C

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

-

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101~20170331	170,873,786.41	0	0	170,873,786.41	53.39%

	2	20170101~20170105	188,323,917.14	0	188,323,917.14	0	0%
个人							
产品特有风险							
流动性风险							

注：

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第三十八次会议审议通过，付强先生新任公司副总经理职务，任职日期为 2017 年 1 月 20 日，该事项已于 2017 年 1 月 23 日公告。

§ 9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安大华基金管理有限公司

2017 年 4 月 24 日