平安大华深证300指数增强型证券投资基金

2015 第四季度 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华深证300指数增强
交易代码	700002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
报告期末基金份额总额	31,105,677.43份
投资目标	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过指数复制的方法拟合、跟踪深证300指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过全样本复制的方式拟合、跟踪深证300指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理,以有效降低基金运作成本并提高本基金的投资收益率。 其中指数复制策略采用全样本复制的方式,即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合以拟合标的指数的业绩表现。股票增强策略在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上,辅以有限度的增强操作及一级市场股票投资,以求获取超越标的指数的收益率表现。
业绩比较基准	深证300指数收益率x95%+商业银行活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时,本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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(2015年10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	2,286,679.89
2.本期利润	11,265,203.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.3706
4.期末基金资产净值	53,645,575.90
5.期末基金份额净值	1.725

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。

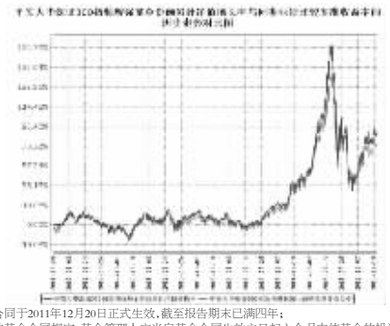
3.2 基金净值表现

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

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	27.59%	1.88%	24.09%	1.92%	3.50%	-0.04%

业绩比较基准:深证300指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%

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



1、本基金基金合同于2011年12月20日正式生效,截至报告期末已满四年;

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。

§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		
乔海英	基金经理	2014年9月12日	-	3	南开大学金融学硕士,曾先后任职于博时基金管理有限公司、民生加银基金管理有限公司担任行业研究员,2013年加入平安大华基金管理有限公司,担任行业研究员。现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理和平安大华策略先锋混合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遵规守信情况的说明

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、《平安大华深证300指数增强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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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3.21%,同期业绩基准增长率为6.89%。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3.1%,同期业绩基准增长率为6.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

供给侧改革的目的是促进产能供需平衡,同时促动产业升级提升效率。短期供给侧改革主要影响过剩产能行业,会出现一些企业的关停并转,对经济增速有下拉影响。中长期随着过剩产能出清或局部改善,供需平衡,产品价格会回升,在清理过剩产能的同时,转型促动各个行业通过互联网、智能制造、技术升级等方式提升产品质量和管理效率,供给侧改革会引起资本市场重新定价,股票市场波动不可避免,对于转型发展又有供给侧改善的行业和公司具备相对的发展优势。债券市场在供给侧改革中享受无风险利率下行的利好,同时也面临过剩行业信用利差扩大的负面影响,随着改革成效凸显,经济增速回升,债券市场中长期面临利率抬升风险。如果经济在底部徘徊时间拉长,债券市场在低利率水平享受稳定的有息收益。

对于权益市场,关注3000点附近政策和市场的承受力,随着市场指数下移,低估值、蓝筹、高分红型价值股优势逐渐显现,小盘成长股取决于指数稳定状态下博弈价值。可转债则需关注由于股票市场恐慌性下跌的可转债博弈价值。

4.6 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

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	750,017.42	1.40
B	采矿业	778,065.72	1.45
C	制造业	28,755,801.90	53.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	916,225.89	1.71
E	建筑业	577,579.39	1.08
F	批发和零售业	2,057,463.69	3.84
G	交通运输、仓储和邮政业	74,106.14	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,642,141.69	6.79
J	金融业	2,873,020.87	5.36
K	房地产业	2,609,544.03	4.94
L	租赁和商务服务业	1,184,253.18	2.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,061,693.06	1.98
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	964,395.54	1.80
S	综合	242,603.68	0.45
	合计	46,526,912.20	86.73

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	1,934,262.34	3.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	62,046.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,165.22	0.00
J	金融业	957,676.86	1.79
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,941.80	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,958,092.22	5.51

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

5.3.1 报告期末指数投资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	002467	二六三	58,795	1,234,107.05	2.30
2	002465	海格通信	72,400	1,208,356.00	2.25
3	000728	国元证券	51,110	1,154,574.90	2.15
4	000651	格力电器	51,100	1,142,085.00	2.13
5	000333	美的集团	34,700	1,138,854.00	2.12
6	000858	五粮液	39,900	1,088,472.00	2.03
7	000623	吉林敦东	31,917	987,831.15	1.84
8	002673	西部证券	29,406	967,751.46	1.80
9	002038	双鹭药业	28,042	939,407.00	1.75
10	000423	东阿阿胶	17,900	936,170.00	1.75

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300014	亿纬锂能	33,300	1,092,906.00	2.04
2	600000	浦发银行	52,418	957,676.86	1.79
3	000756	新华制药	31,800	426,438.00	0.79
4	600735	新华锦	17,051	409,565.02	0.76
5	300350	华鹏飞	1,800	62,046.00	0.12

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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	17,895.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	829.37
5	应收申购款	23,698.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,423.67

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002465	海格通信	1,208,356.00	2.25	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	30,168,765.03
报告期期间基金总申购份额	4,309,589.16
减:报告期期间基金总赎回份额	3,372,676.76
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	31,105,677.43

§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

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(%)	32.15

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§8 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二十三次会议审议通过,由罗春凤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。该事项已于2015年10月29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深证300指数增强型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金合同

(3)平安大华深证300指数增强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)报告期内平安大华深证300指数增强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、基金托管人处

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
2016年1月21日

平安大华鑫享混合型证券投资基金

2015 第四季度 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
报告送出日期:2016年1月21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2016年1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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华鑫享混合型	
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	2,931,440,625.77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断,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

§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(2015年10月1日 — 2015年12月31日)	
	鑫享A	鑫享C
1. 本期已实现收益	1,526,892.67	342,351.60
2. 本期利润	2,981,045.39	2,968,681.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0326	0.0023
4. 期末基金资产净值	87,053,470.06	2,933,577,537.88
5. 期末基金份额净值	1.028	1.031

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	3.21%	0.19%	6.89%	0.50%	-3.68%	-0.31%

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	3.10%	0.18%	6.89%	0.50%	-3.79%	-0.32%

业绩比较基准:沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%

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

1、本基金基金合同于2015年7月28日正式生效,截至报告期未未满一年;

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。

§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		
孙健	基金经理	2015年7月28日	-	14	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,任投资研究部固定收益研究员,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,平安大华添利货币市场基金基金经理,平安大华鑫安混合型证券投资基金基金经理、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,平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理。
李黄海	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、东方法基金投资发展部总监助理,摩根士丹利华鑫基金数量投资部投资经理,2015年9月加入平安大华基金管理有限公司,2015年11月起担任平安大华鑫享混合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遵规守信情况的说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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3.21%,同期业绩基准增长率为6.89%。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3.1%,同期业绩基准增长率为6.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

供给侧改革的目的是促进产能供需平衡,同时促动产业升级提升效率。短期供给侧改革主要影响过剩产能行业,会出现一些企业的关停并转,对经济增速有下拉影响。中长期随着过剩产能出清或局部改善,供需平衡,产品价格会回升,在清理过剩产能的同时,转型促动各个行业通过互联网、智能制造、技术升级等方式提升产品质量和管理效率,供给侧改革会引起资本市场重新定价,股票市场波动不可避免,对于转型发展又有供给侧改善的行业和公司具备相对的发展优势。债券市场在供给侧改革中享受无风险利率下行的利好,同时也面临过剩行业信用利差扩大的负面影响,随着改革成效凸显,经济增速回升,债券市场中长期面临利率抬升风险。如果经济在底部徘徊时间拉长,债券市场在低利率水平享受稳定的有息收益。

对于权益市场,关注3000点附近政策和市场的承受力,随着市场指数下移,低估值、蓝筹、高分红型价值股优势逐渐显现,小盘成长股取决于指数稳定状态下博弈价值。可转债则需关注由于股票市场恐慌性下跌的可转债博弈价值。

4.6 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	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	其他资产	1,515,040.31	0.05
8	合计	3,026,246,401.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
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

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	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

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	-	-
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

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	011599613	15广田SCP002	100,000	10,036,000.00	0.33
2	011599691	15杉杉SCP003	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邯郸CP004	100,000	9,984,000.00	0.33
5	123001	蓝标转债	6,520	651,964.27	0.02

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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	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

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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	96,624,321.79	36,199,896.67
报告期期间基金总申购份额	1,573,082.37	2,817,435,332.27
减:报告期期间基金总赎回份额	13,502,942.35	6,889,064.98
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	84,694,461.81	2,846,746,163.96

§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

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(%)	0.34

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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二十三次会议审议通过,由罗春凤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。该事项已于2015年10月29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、基金托管人处

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
2016年1月21日

平安大华行业先锋混合型证券投资基金

2015 第四季度 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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1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2015年10月1日起至12月31日止。