平安大华鑫安混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月20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4月19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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华鑫安混合	
交易代码	001664	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月11日	
报告期末基金份额总额	318,383,911.72份	
投资目标	本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会,力求在严格控制风险的基础上,实现基金资产的持续稳定增值。	
投资策略	本基金将在资产配置允许的范围内,采取相对灵活的资产配置策略,使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测,对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整,以规避或分散市场风险,提高基金风险调整后的收益。本基金以自上而下的投资策略,大类资产、动态控制组合风险、力争长期、稳定的回报。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%	
风险收益特征	本基金是混合型基金,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。	
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	
下属分级基金的基金简称	平安大华鑫安A	平安大华鑫安C
下属分级基金的交易代码	001664	001665
报告期末下属分级基金的份额总额	246,841,944.61份	71,541,967.11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(2016年1月1日 — 2016年3月31日)	
	平安大华鑫安A	平安大华鑫安C
1. 本期已实现收益	725,681.49	197,610.18
2. 本期利润	1,267,637.84	364,130.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0049	0.0037
4. 期末基金资产净值	248,057,223.79	71,835,068.46
5. 期末基金份额净值	1.005	1.004

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

平安大华鑫安A

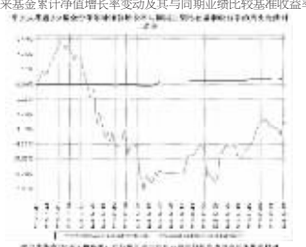
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.56%	0.05%	-4.63%	0.98%	5.13%	-0.93%

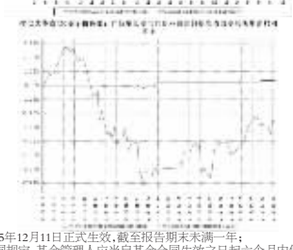
平安大华鑫安C

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	0.46%	0.05%	-4.63%	0.98%	5.03%	-0.93%

业绩比较基准:沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%

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12月11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,建仓期内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	本基金的基金经理	2015年12月11日	-	15	自2001年起,先后在湘财证券资产管理部、中国大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、《平安大华鑫安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

本基金在2016年第一季度里,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并维持权益市场较低仓位,因此成功回避了年初股市大盘很大幅度的系统性风险,为基金持有人取得了较好的绝对正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金A份额净值为1.005元,份额累计净值为1.005元。报告期内,本基金份额净值增长率为0.50%,同期业绩基准增长率为-4.63%。本基金C份额净值为1.004元,份额累计净值为1.004元。报告期内,本基金份额净值增长率为0.40%,同期业绩基准增长率为-4.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济数据有所回暖,从PPI、工业增加值,到进出口数据都较前期有提升,反映在年初高额货币信贷和财政刺激下,经济急剧下滑势头得到遏制。原油和大宗商品价格反弹,也一定程度上缓解了传统采掘、冶炼和加工制造业的压力。人民币汇率趋向稳定,对美元汇率升值,对一揽子货币有所贬和值,央行强调了人民币汇率保持相对稳定的决心,对国内资产价格稳定和外汇资金稳定起到定心丸作用。债券市场信用违约风险爆发的频率和速度增加,国企和央企也加入信用违约的行列,对于中低等级信用债券价格波动加剧。

权益市场方面,展望2016年度,虽然大盘在2016年1月到2月大跌之后出现了持续一个多月、幅度10%以上的反弹,但我们依然维持谨慎的投资态度,认为如果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。目前股市投资者的风险偏好仍然偏低,虽然大盘在3月份持续上行,但成交金额并没有显著放大,处于历史较低水平,而且证券交易结算资金余额也保持稳定,并没有出现资金流入迹象。股票交易仍属于场内资金博弈性质,股市流动性不足,结构化行情特征明显。截止2016年3月31日,沪深300所有成分股静态ttm市盈率中位数为19倍,而创业板所有个股静态ttm市盈率中位数为87;成长与价值的静态估值比(创业板估值/沪深300估值)高达4.5,接近历史最高!

资产收益率持续下行,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。

因此,本基金在今年第二季度里,仍将主要进行固定收益类投资,以谋取绝对收益为主要目标,同时密切关注市场投资者风险偏好的变化带来的投资机会。

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	2,789,459.00	0.86
	其中:股票	2,789,459.00	0.86
2	固定收益投资	165,657,360.51	51.07
	其中:债券	165,657,360.51	51.07
	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	98,000,347.00	30.21
	其中:买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	54,868,602.93	16.92
7	其他资产	3,029,875.65	0.93
8	合计	324,345,645.09	100.00

注:本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

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	1,452.00	0.00
B	采矿业	1,371.00	0.00
C	制造业	1,331,161.00	0.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,608.00	0.00
E	建筑业	1,140.00	0.00
F	批发和零售业	1,713.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	12,800.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,879.00	0.00
J	金融业	2,194.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,430,231.00	0.45
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	3,830.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,789,459.00	0.87

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	000861	海印股份	248,100	1,411,689.00	0.44
2	000488	晨鸣纸业	82,300	697,081.00	0.22
3	601126	四方股份	52,700	516,460.00	0.16
4	000651	格力电器	1,000	19,220.00	0.01
5	600004	白云机场	1,000	12,400.00	0.00
6	300071	华谊嘉信	1,000	9,000.00	0.00
7	002304	洋河股份	100	6,680.00	0.00
8	601888	中国国旅	100	4,565.00	0.00
9	000513	丽珠集团	100	4,495.00	0.00
10	300100	双林股份	100	3,879.00	0.00

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	19,900,000.00	6.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	54,895,500.00	17.16
	其中:政策性金融债	54,895,500.00	17.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	58,249,000.00	18.21
6	中期票据	30,400,000.00	9.50
7	可转债	2,212,860.51	0.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	165,657,360.51	51.79

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	120223	12进开23	500,000	49,810,000.00	15.57
2	1082085	10铁道MTN1	200,000	19,980,000.00	6.25
3	160912	16铁路债12	200,000	19,900,000.00	6.22
4	041658008	16恒林浆CP001	160,000	16,091,200.00	5.03
5	011598133	15鸡街电子SCP001	160,000	16,062,400.00	5.02

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情况。

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

本基金本报告期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的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

基金投资的前十名股票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	5,315.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,024,060.95
5	应收申购款	499.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,029,875.65

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

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	000651	格力电器	19,220.00	0.01	重大事项
2	300071	华谊嘉信	9,000.00	0.00	重大事项

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	平安大华鑫安A	平安大华鑫安C
报告期期初基金份额总额	264,842,656.60	129,796,003.55
报告期期间基金总申购份额	1,142,434.35	132,856.28
减:报告期期间基金总赎回份额	19,143,146.34	58,386,892.72
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	246,841,944.61	71,541,967.11

§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

本报告期内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。

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。

§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安混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华鑫安混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华鑫安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安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4月20日

平安大华保本混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月20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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月19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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华保本混合
交易代码	700004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月11日
报告期末基金份额总额	565,775,709.54份
投资目标	采用投资组合保险技术,以保本期到期时本金安全为目标,通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,力争实现基金资产的稳定增长和保本期收益的最大化。
投资策略	采用恒定比例组合保险策略,动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例,以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标,并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金、低于股票基金和一般混合基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金保证人	中国投融资担保有限公司(原名“中国投资担保有限公司”)

§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(2016年1月1日 — 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	2,957,951.54
2.本期利润	5,380,869.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0093
4.期末基金资产净值	573,134,092.02
5.期末基金份额净值	1.013

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。

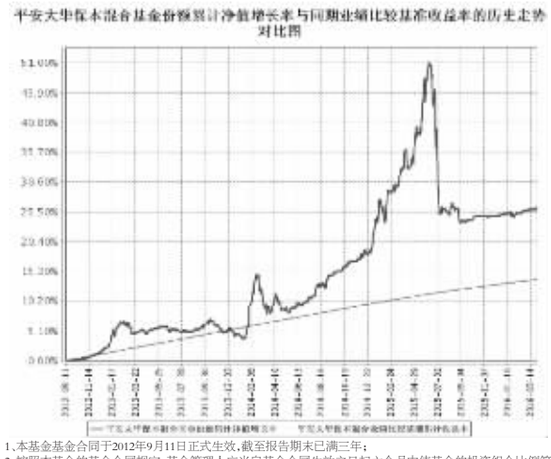
3.2 基金净值表现

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

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	0.90%	0.12%	0.66%	0.01%	0.24%	0.11%

业绩比较基准:三年期银行定期存款收益率(税后)

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2012年9月11日正式生效,截至报告期末已满三年;

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

§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	本基金的基金经理	2012年9月11日	-	15	自2001年起,先后在湘财证券资产管理部、中国大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、《平安大华保本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

2016年一季度里,本基金主要采用了以可转债正股和可转债为主要的投资策略,有一定的效果。债券收益率处于历史较低位置,长期高等级债券收益率和短融,回购差别不大,债券配置速度低于预期,一方面等待市场收益率回升,另一方面需要把握债券的信用质量,对债券信用评级提高门槛,跟随负面信息及时调整持仓。收益资产方面,由于基金的实际安全垫还比较弱,将按照实际安全垫进行配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金份额净值为1.013元,份额累计净值为1.263元。报告期内,本基金份额净值增长率为0.90%,同期业绩基准增长率为0.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济数据有所回暖,从PPI、工业增加值,到进出口数据都较前期有提升,反映在年初高额货币信贷和财政刺激下,经济急剧下滑势头得到遏制。原油和大宗商品价格反弹,也一定程度上缓解了传统采掘、冶炼和加工制造业的压力。人民币汇率趋向稳定,对美元汇率升值,对一揽子货币有所贬和值,央行强调了人民币汇率保持相对稳定的决心,对国内资产价格稳定和外汇资金稳定起到定心丸作用。债券市场信用违约风险爆发的频率和速度增加,国企和央企也加入信用违约的行列,对于中低等级信用债券价格波动加剧。

目前的债券市场收益水平,反映了银行资金委托投资的杠杆化率、在短期利率水平无法进一步下行的情况下,未来将面临债券供给压力和利率波动的负面影响,特别是银行MPA季度管理对于6月末的利率水平将造成很大影响。债券调整已经开始,根据历史收益率均值,未来经济数据预判,在合适的位置开始增加债券投资。同时少量参与可转债正股的投资,投资比例严格按照实际安全垫原则,并做好及时止损准备。随着宏观经济数据回暖,密切关注3000点的支撑作用。

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	25,773,780.40	4.48
	其中:股票	25,773,780.40	4.48
2	固定收益投资	386,361,382.16	67.19
	其中:债券	386,361,382.16	67.19
	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	95,040,342.56	16.53
	其中:买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	59,954,442.05	10.43
7	其他资产	7,891,013.82	1.37
8	合计	575,020,960.99	100.00

注:本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

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	559,001.00	0.10
C	制造业	2,107,537.00	0.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,792.00	0.00
E	建筑业	9,894,750.00	1.73
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,330.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,669,308.00	0.81
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,534,072.40	1.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	25,773,780.40	4.50

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	600496	精工钢构	1,975,000	9,894,750.00	1.73
2	000861	海印股份	1,299,960	7,396,772.40	1.29
3	600050	中国联通	637,200	2,797,308.00	0.49
4	600406	国电南瑞	130,000	1,872,000.00	0.33
5	600037	歌华有线	111,500	1,137,300.00	0.20
6	600703	三安光电	50,000	983,000.00	0.17
7	600583	海油工程	77,300	554,241.00	0.10
8	002701	奥瑞金	20,000	488,000.00	0.09
9	000488	晨鸣纸业	30,000	254,100.00	0.04
10	002595	豪迈科技	10,000	193,500.00	0.03

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	25,042,500.00	4.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	98,646,000.00	17.21
5	企业短期融资券	70,351,000.00	12.27
6	中期票据	166,337,800.00	29.02
7	可转债	25,984,082.16	4.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	386,361,382.16	67.41

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	1180165	11佛山公控债	300,000	33,552,000.00	5.85
2	101551025	15浙电电子MTN001	300,000	31,227,000.00	5.45
3	1182146	11凯迪MTN1	300,000	30,432,000.00	5.31
4	1362188	13吉利MTN1	300,000	30,288,000.00	5.28
5	011599978	15三钢SCP003	300,000	30,165,000.00	5.26

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	101,495.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,739,812.78
5	应收申购款	49,705.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,891,013.82

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	128039	数字转债	11,575,872.00	2.02

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

报告期期初基金份额总额	587,287,637.88
报告期期间基金总申购份额	4,805,423.34
减:报告期期间基金总赎回份额	26,317,351.68
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	565,775,709.54

§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

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。

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。

§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保本混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华保本混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华保本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)报告期内平安大华保本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4月20日

平安大华财富宝货币市场基金

2016 第一季度 报告

2016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:2016年4月20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4月19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2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华财富宝货币
交易代码	000759
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效