平安大华深证300指数增强型证券投资基金

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	35,917,689.91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0.5%，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组合管理。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（2016年1月1日 － 2016年3月31日 ）
1.本期已实现收益	-951,425.75
2.本期利润	-8,983,589.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2621
4.期末基金资产净值	51,600,159.16
5.期末基金份额净值	1.437

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	-16.70%	2.81%	-16.19%	2.82%	-0.51%	-0.01%

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	本基金的基金经理	2014年9月12日	-	5	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，现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理，平安大华策略先锋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

报告期内，A股经历了熔断暴跌、低迷和反弹的大幅波动，也契合了全球资本市场的波动。春节过后，对政策及CPI数据的预期催生了3月的反弹行情，传统周期产业与新兴主题均有较优表现。本基金一季度净值下跌16.7%，报告期内均衡行业配置以跟踪指数为主，降低了主动管理组合的权重。在大幅下跌过程中，基金整体仓位较低，个股贝塔较小，故而相对跌幅较小。反弹过程表现稍弱，整体表现与业绩基准基本持平。当前基于对后市震荡向上的判断，超额配置行业以消费、券商、高端制造为主。

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1.437元，份额累计净值为1.517元。报告期内，本基金份额净值增长率为-16.70%，同期业绩基准增长率为-16.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对后市保持谨慎乐观，判断市场将在3000点附近盘整上行。主要原因如下：1、导致市场大幅下跌的主要因素短期消除，如人民币的大幅贬值导致资本外流的压力，美元加息节奏的放缓，注册制的推迟也减轻市场的供给压力；2、积极因素也在出现，如房地产新开工投资增速由负转正，大宗商品价格出现上涨，预计固定资产投资增速未来仍会上涨，短期的补库存仍将持续。

展望2016，宏观经济增速由快速下降进入到缓慢探底阶段，整体呈现弱平衡状态。与此同时，周期已老，成长亦贵的资本市场仍将以结构性行情为主，个股的投资机会依然需要重点从新兴产业的崛起和传统产业的波动中发掘。新产业，转型仍然是宏观经济的不变方向，本基金将精选产业定位明确，管理层优秀，发展思路和布局完善的优质标的进行投资。我们继续看好创新产业以及转型过程中的健康产业、信息服务，高端制造等行业。本基金力求从上述行业中精选出个股，获取超过业绩基准的收益率。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金从2016年1月7日至2016年2月23日期间基金资产净值出现连续29个工作日低于5000万的情形，截至本报告期末，本基金资产净值已高于5000万。

§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	48,269,700.68	92.87
	其中：股票	48,269,700.68	92.87
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	3,633,314.45	6.99
7	其他资产	74,395.66	0.14
8	合计	51,977,410.79	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

5.2.1 报告期末指数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	592,287.71	1.15
B	采矿业	1,270,740.78	2.46
C	制造业	26,493,003.93	51.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,273,953.92	2.47
E	建筑业	662,876.33	1.28
F	批发和零售业	1,601,501.00	3.10
G	交通运输、仓储和邮政业	61,984.37	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,607,157.51	6.99
J	金融业	3,732,125.65	7.23
K	房地产业	2,074,020.56	4.02
L	租赁和商务服务业	807,462.02	1.56
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	861,911.28	1.67
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	852,650.18	1.65
S	综合	185,464.84	0.36
	合计	44,077,140.08	85.42

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	3,217,345.86	6.24
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	939,854.74	1.82
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	35,360.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	4,192,560.60	8.13

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	002038	双鹭药业	51,242	1,218,022.34	2.36
2	000858	五 粮 液	39,900	1,121,589.00	2.17
3	000333	美的集团	34,700	1,070,495.00	2.07
4	000651	格力电器	51,100	982,142.00	1.90
5	000728	国元证券	51,110	946,557.20	1.83
6	002465	海格通信	72,400	936,132.00	1.81
7	000423	东阿阿胶	17,900	869,045.00	1.68
8	002673	西部证券	29,406	794,550.12	1.54
9	002467	二六三	58,795	761,983.20	1.48
10	002155	湖南黄金	80,501	720,483.95	1.40

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	600079	人福医药	82,800	1,540,080.00	2.98
2	600000	浦发银行	52,418	939,854.74	1.82
3	002551	尚荣医疗	36,000	893,160.00	1.73
4	002160	常铝股份	55,730	538,351.80	1.04
5	600735	新华锦	17,051	245,534.40	0.48

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

本基金本报告期末未持有权证。

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情况。

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情况。

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	9,138.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	710.50
5	应收申购款	64,546.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,395.66

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	000651	格力电器	982,142.00	1.90	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	31,105,677.43
报告期期间基金总申购份额	8,501,044.54
减：报告期期间基金总赎回份额	3,689,032.06
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	35,917,689.91

§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（%）	27.84

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4月20日

平安大华添利债券型证券投资基金

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	平安大华添利债券	
交易代码	700005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月27日	
报告期末基金份额总额	89,198,463.03份	
投资目标	在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上，主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合，以期获得和产品期限匹配的债券收益。	
业绩比较基准	中证全债指数收益率。	
风险收益特征	本基金属于债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种。预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
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	平安大华添利债券A	平安大华添利债券C
下属分级基金的交易代码	700005	700006
报告期末下属分级基金的份额总额	45,922,803.07份	43,275,659.96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（2016年1月1日 － 2016年3月31日 ）	
	平安大华添利债券A	平安大华添利债券C
1.本期已实现收益	398,090.27	210,259.82
2.本期利润	286,290.84	260,972.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0064	0.0091
4.期末基金资产净值	64,064,950.57	59,477,905.73
5.期末基金份额净值	1.395	1.374

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

平安大华添利债券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	0.87%	0.11%	1.26%	0.06%	-0.39%	0.05%

平安大华添利债券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	0.73%	0.11%	1.26%	0.06%	-0.53%	0.05%

业绩比较基准：中证全债指数收益率

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11月27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。

§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11月27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、《平安大华添利债券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

开年以来，债券市场经历了较大幅度的波动，本基金继续保持较低的债券仓位，等待市场调整后加仓，久期以3年以下为主，组合以防风险为主。

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1.395元，份额累计净值为1.395元。报告期内，本基金份额净值增长率为0.87%，同期业绩基准增长率为1.26%。本基金C份额净值为1.374元，份额累计净值为1.374元。报告期内，本基金份额净值增长率为0.73%，同期业绩基准增长率为1.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

第一季度宏观数据显示经济呈现出短期企稳迹象，在基建投资19.25%的同比增速带动下，固定资产投资连续两个月上扬，地产投资今年以来也结束了过往的下滑走势，实现了6.2%的增长，由于今年房屋销售和新开工面积均呈现出大幅的上行，预计3~6个月的地产投资仍有向上势头。不仅如此，2015年普遍担心的"流动性陷阱"问题也伴随着一季度的信用扩张而短期缓解，工业品出厂价格指数跌幅收窄，通缩预期减弱，整体宏观基本面呈现出向好态势。

今年以来货币政策看似风平浪静，但未再主动放水，年初以来不断提示金融机构杠杆风险，并且祭出MPA考核实施逆周期调控，预计今年的政策主题以防系统风险为主。因此短期内债券投资相对谨慎，保持较低的债券仓位，缩短组合久期，并且提高信用风险等级，降低杠杆，待债券收益率调整充分后再主动加仓，可转债作为阶段性博弈的交易品种。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	101,045,912.46	79.90
	其中：债券	101,045,912.46	79.90
	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	-	-
	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	23,089,148.57	18.26
7	其他资产	2,328,289.93	1.84
8	合计	126,463,350.96	100.00

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

本基金本报告期末未持有股票 。

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

本基金本报告期末未持有股票 。

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	5,008,500.00	4.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,566,031.60	49.83
	其中：政策性金融债	61,566,031.60	49.83
4	企业债券	4,208,518.00	3.41
5	企业短期融资券	10,069,000.00	8.15
6	中期票据	5,994,000.00	4.85
7	可转债	14,199,862.86	11.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	101,045,912.46	81.79

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	140201	14国开01	200,000	20,502,000.00	16.60
2	150212	15国开12	150,000	15,256,500.00	12.35
3	018002	国开1302	97,320	10,620,531.60	8.60
4	140216	14国开16	100,000	10,217,000.00	8.27
5	041559064	15三星CP001	100,000	10,069,000.00	8.15

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,175.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,775,424.72
5	应收申购款	540,689.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,328,289.93

5.10.4 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	128009	歌尔转债	8,766,489.60	7.10

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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	平安大华添利债券A	平安大华添利债券C
报告期期初基金份额总额	61,469,501.28	32,194,128.37
报告期期间基金总申购份额	24,113,572.79	28,317,157.35
减：报告期期间基金总赎回份额	39,660,271.00	17,235,625.76
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	45,922,803.07	43,275,659.96

§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

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添利债券型证券投资基金设立的文件

（2）平安大华添利债券型证券投资基金基金合同

（3）平安大华添利债券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）报告期内平安大华添利债券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

平安大华鑫享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：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3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华鑫享混合	
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	1,064,999,673.90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
下属分级基金的交易代码	001609	001610
报告期末下属分级基金的份额总额	68,053,020.20份	996,946,653.70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 ）	
	鑫享A	鑫享C
1.本期已实现收益	491,505.55	14,659,219.66
2.本期利润	465,550.71	8,560,326.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0061	0.0039
4.期末基金资产净值	70,393,132.79	1,034,022,411.21
5.期末基金份额净值	1.034	1.037

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

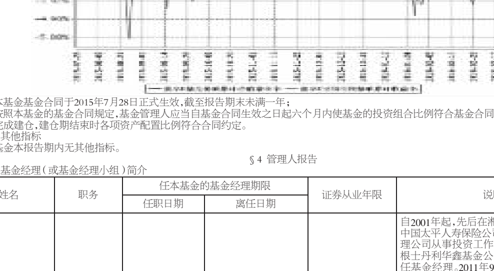
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.58%	0.06%	-3.14%	0.73%	3.72%	-0.67%

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	0.58%	0.06%	-3.14%	0.73%	3.72%	-0.67%

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%

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

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1.034元，份额累计净值为1.034元。报告期内，本基金份额净值增长率为0.58%，同期业绩基准增长率为-3.14%。本基金C份额净值为1.037元，份额累计净值为1.037元。报告期内，本基金份额净值增长率为0.58%，同期业绩基准增长率为-3.14%。

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值，央行强调了人民币汇率保持相对稳定的决心，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，并没有出现资金入市迹象。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"。股市处于赛道的"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	23,976,369.22	2.17
	其中：股票	23,976,369.22	2.17
2	固定收益投资	473,355,085.91	42.79
	其中：债券	473,355,085.91	42.79
	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	581,177,331.76	52.53
	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	16,752,922.54	1.51
7	其他资产	11,078,822.87	1.00
8	合计	1,106,340,532.30	100.00

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	-	-
C	制造业	13,184,941.12	1.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	829,384.80	0.08
E	建筑业	1,485,224.14	0.13
F	批发和零售业	601,279.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	460,891.00	0.04
H	住宿和餐饮业	104,580.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,300,506.60	0.30
J	金融业	1,699,811.00	0.15
K	房地产业	856,721.40	0.08
L	租赁和商务服务业	454,600.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	77,313.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	384,792.00	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	94,892.16	0.01
R	文化、体育和娱乐业	394,751.00	0.04
S	综合	46,682.00	0.00
	合计	23,976,369.22	2.17

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	601199	江南水务	27,340	487,198.80	0.04
2	002496	辉丰股份	15,800	462,150.00	0.04
3	002325	洪涛股份	35,300	437,014.00	0.04
4	000861	海印股份	57,900	329,451.00	0.03
5	601009	南京银行	20,100	323,610.00	0.03
6	600496	精工钢构	63,800	319,638.00	0.03
7	600518	康美药业	13,800	215,142.00	0.02
8	300182	捷成股份	11,200	202,720.00	0.02
9	600987	航民股份	13,600	195,704.00	0.02
10	603608	天创时尚	7,994	183,542.24	0.02

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	49,750,000.00	4.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	348,060,000.00	31.52
	其中：政策性金融债	348,060,000.00	31.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,188,000.00	3.64
6	中期票据	30,400,000.00	2.75
7	可转债	4,957,085.91	0.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	473,355,085.91	42.86

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国开23	1,500,000	149,430,000.00	13.53
2	070208	07国开08	1,000,000	99,400,000.00	9.00
3	120225	12国开25	1,000,000	99,230,000.00	8.98
4	169912	16贴现国债12	500,000	49,750,000.00	4.50
5	1082085	10铁道MTN1	200,000	19,980,000.00	1.81

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	237,522.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,841,300.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,078,822.87

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

项目	鑫享A	鑫享C
报告期期初基金份额总额	84,694,461.81	2,846,746,163.96
报告期期间基金总申购份额	516,550.09	835,426.99
减：报告期期间基金总赎回份额	17,157,991.70	1,850,634,937.25
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	68,053,020.20	996,946,653.70

§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（%）	0.94

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4月20日