

# 平安大华鑫享混合型证券投资基金 2016 年半年度报告 摘要

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

### 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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
	联系电话	0755-22626828
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn
客户服务电话	400-800-4800	95511-3
传真	0755-23997878	0755-82080400-0

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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

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	0.77%	0.06%	-0.29%	0.31%	1.06%	-0.25%

月						
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

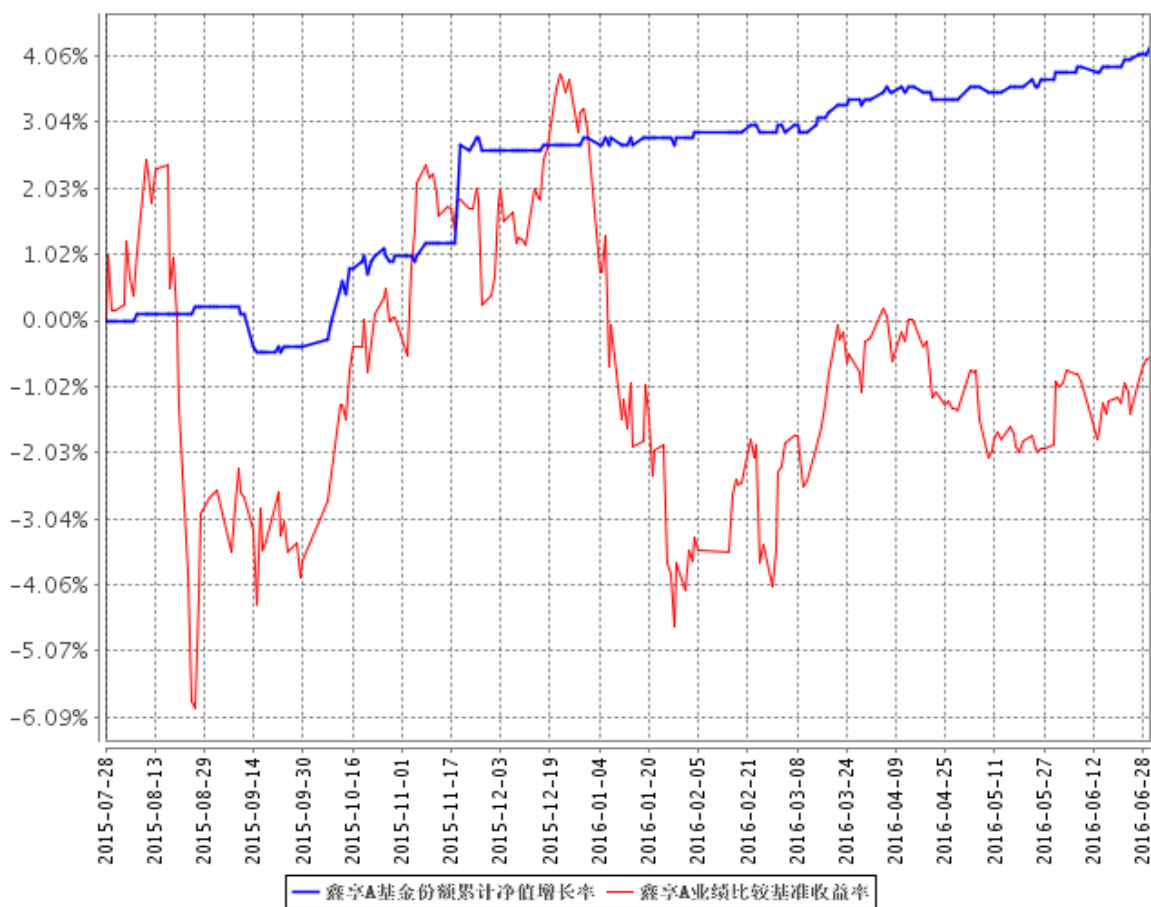
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.38%	0.05%	0.37%	0.30%	0.01%	-0.25%
过去三个月	0.68%	0.06%	-0.29%	0.31%	0.97%	-0.25%
过去六个月	1.26%	0.06%	-3.42%	0.56%	4.68%	-0.50%
自基金合同生效起至今	4.40%	0.12%	-0.58%	0.63%	4.98%	-0.51%

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。

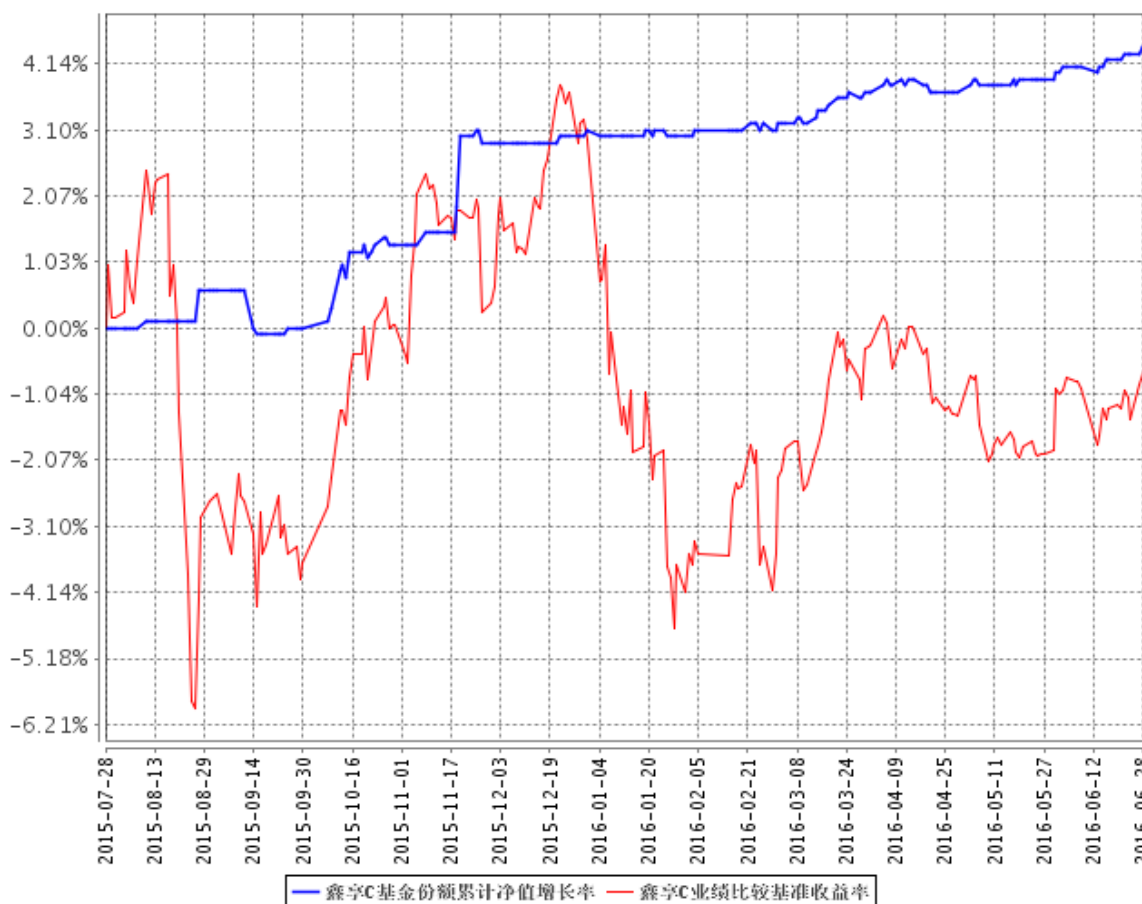
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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。

## § 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，

不断丰富的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、程序及方法的科学合理性，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
<b>资产：</b>			
银行存款		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		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		-	-
买入返售金融资产		198,935,538.40	1,777,893,746.84
应收证券清算款		-	-
应收利息		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		-	-
资产总计		1,106,095,322.55	3,026,246,401.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
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		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		179,370.92	182,693.53
负债合计		1,599,024.37	5,615,393.84
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		1,057,820,536.92	2,931,440,625.77
未分配利润		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
<b>一、收入</b>		27,813,460.01	-
1.利息收入		14,830,847.93	-
其中：存款利息收入		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		10,569,023.79	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		4,625,811.47	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		156,870.08	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-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）		2,055,586.31	-
<b>减：二、费用</b>		11,260,247.11	-
1. 管理人报酬		6,961,747.67	-
2. 托管费		1,740,436.90	-
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	2,314,422.87	-
4. 交易费用		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		197,613.38	-
<b>三、利润总额（亏损总额以</b>		16,553,212.90	-

“-”号填列)			
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（本期净利润）	-	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数（净值减少以“-”号填列）	-1,873,620,088.85	-59,067,833.81	-1,932,687,922.66
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（本期净利润）	-	-	-

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 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相一致的说明

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 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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

#### 6.4.8 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。

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 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。

###### 6.4.8.1.2 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。

###### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无关联方债券回购交易。

###### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本报告期内无通过关联方进行的权证交易。

###### 6.4.8.1.5 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。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	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
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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值  $\times$  0.80% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 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  $\times$  0.20% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.3 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  $\times$  0.40% / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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 基金份额	9,999,000.00	-
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	-	-

##### 6.4.8.4.2 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

关联方名称	鑫享 A	
	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%	-	-

#### 6.4.8.5 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。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期末未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.8.7 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。

### 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 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

6.4.10.1.1 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	2016 年7月	新股流 通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

		29 日	7 日						
--	--	------	-----	--	--	--	--	--	--

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。

#### 6.4.9.2 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	中国核建	2016年6月30日	重大事项	20.92	2016年7月1日	23.01	30,404	105,501.88	636,051.68	-
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	2016	重大	30.56	-	-	2,200	63,335.07	67,232.00	-

	宇佑	年 5月 10日	事项							
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	2016	重大	19.49	2016	21.44	1,800	46,784.55	35,082.00	-



	科	年 5月 20日	事项		年 8月 10日					
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。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 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。

#### 6.4.9.3.2 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。

### 6.4.10 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	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前十名股票投资明细

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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于平安大华基金管理有限公司网站（<http://www.fund.pingan.com>）的半年度报告正文。

## 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。

## 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%

### 8.3 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%

### 8.4 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

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%	-	-	-	-

平安大华基金管理有限公司  
2016 年 8 月 29 日