

平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 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：2017 年 1 月 19 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 1 月 17 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华新鑫先锋混合型
场内简称	-
交易代码	000739
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 29 日
报告期末基金份额总额	73,784,473.92 份
投资目标	通过积极进行资产配置和灵活运用多种投资策略，在有效控制风险的前提下，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，谋求基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	从大的宏观经济层面来分析大类资产配置方案，股票投资主要集中于经济转型产业，主要通过成长驱动力研究，依据新兴产业细分领域产业政策、产业成长路径、产业成长周期等对新兴产业进行研判，把握大类投资机会。同时根据公司自下而上的盈利模式，发展路径和产业运作诉求，业绩回报，ROE 等指标合并精选优质上市公司，构造能够获取稳健受益的投资组合。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准 = 沪深 300 指数收益率 × 50% + 中证全债指数收益率 × 50%

风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。	
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	新鑫先锋 A	新鑫先锋 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	000739	001515
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	72,641,084.01 份	1,143,389.91 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（2016年10月1日—2016年12月31日）	
	新鑫先锋 A	新鑫先锋 C
1. 本期已实现收益	-3,685,090.50	-59,294.27
2. 本期利润	-5,968,427.61	-93,208.63
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0797	-0.0797
4. 期末基金资产净值	77,288,838.77	1,201,888.13
5. 期末基金份额净值	1.064	1.051

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

新鑫先锋 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	-7.24%	0.88%	0.00%	0.39%	-7.24%	0.49%

新鑫先锋 C

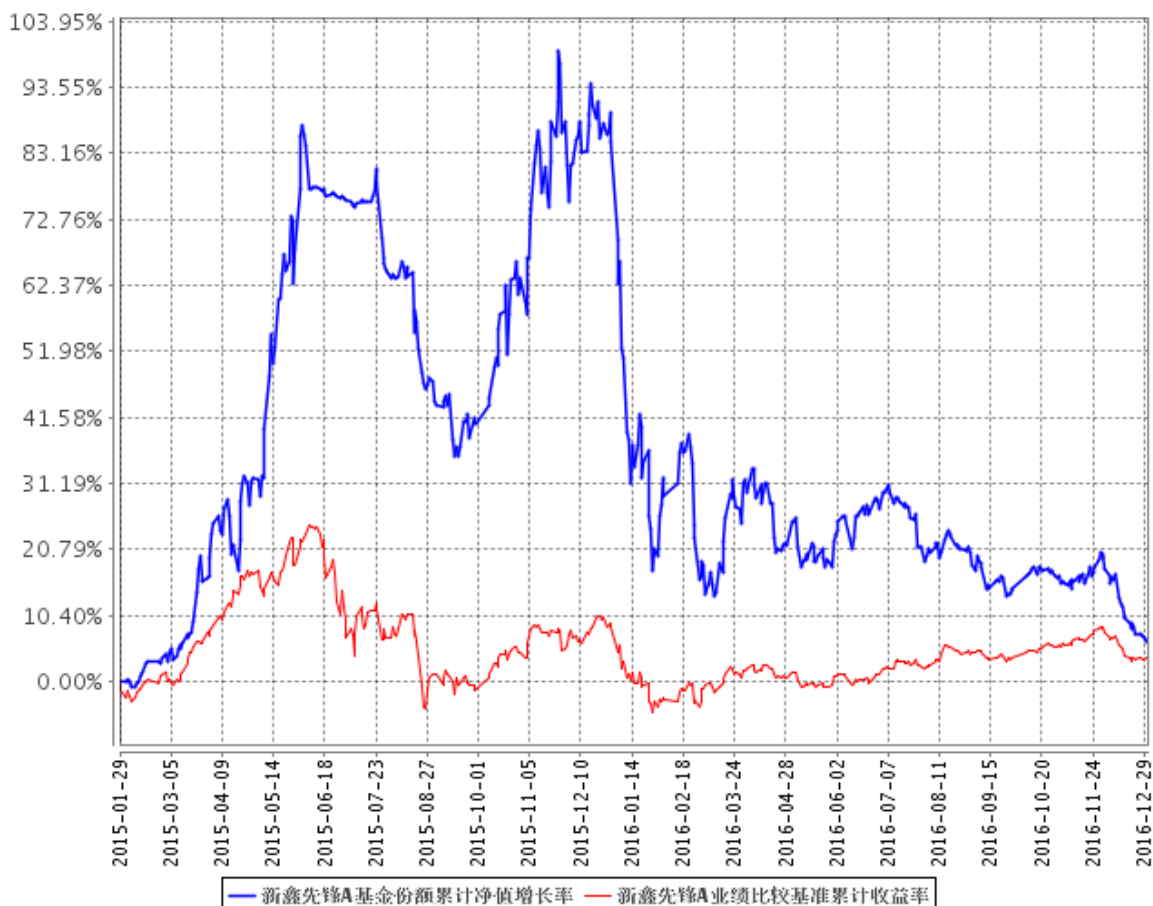
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个	-7.40%	0.88%	0.00%	0.39%	-7.40%	0.49%

月						
---	--	--	--	--	--	--

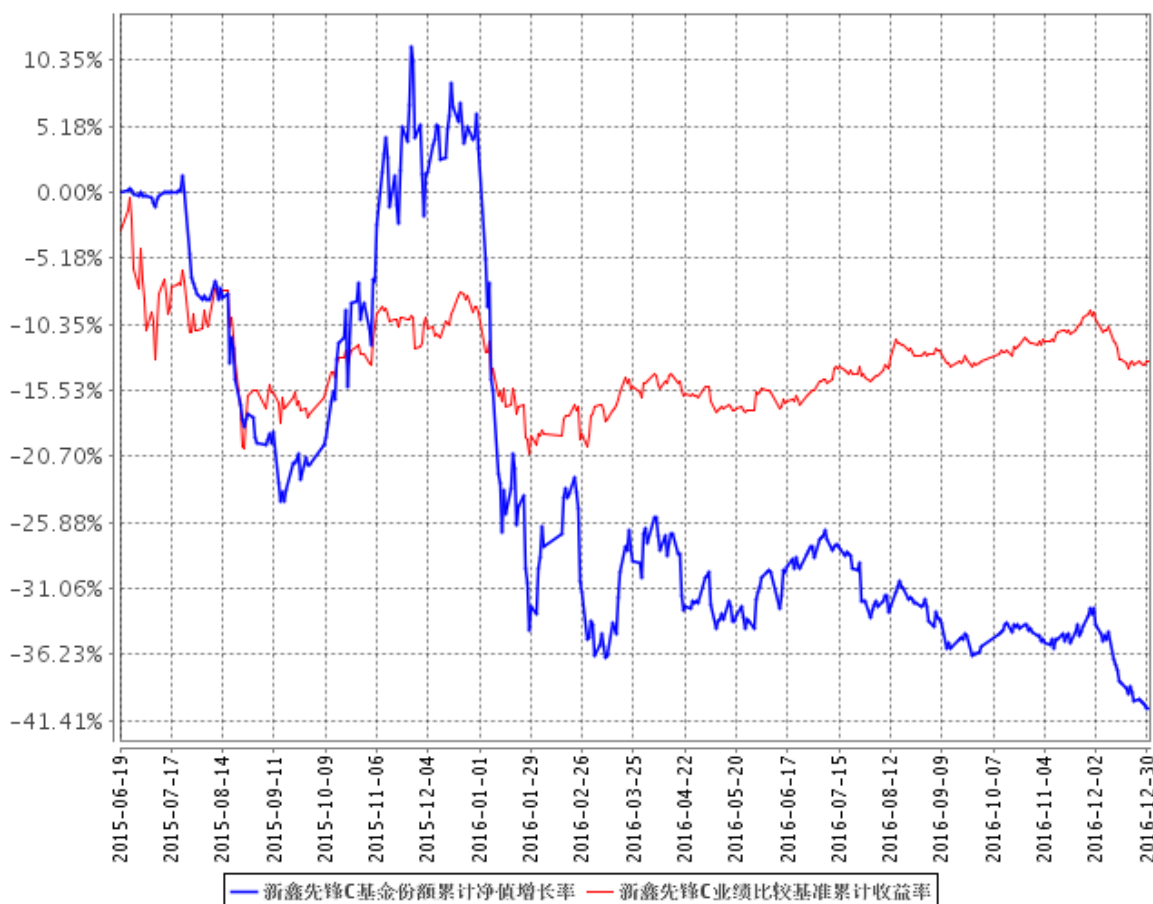
业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

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

新鑫先锋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



新鑫先锋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 1 月 29 日正式生效，截止报告期末已满一年；
- 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，截止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		
邓翔	本基金的基金经理	2016 年 7 月 19 日	-	7	中山大学国际贸易硕士，7 年证券从业经验，曾任毕马威华振会计师事务所审计员、广州长金投资管理有限公司研究员、东莞证券股份有限公司投资经理，

					2016 年 4 月加入平安大华基金管理公司，任投资研究部投资经理，现任平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金。
--	--	--	--	--	--

- 1、此处的“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、《平安大华新鑫先锋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

四季度以来，上证指数和创业板指数走出完全分化的行情。在供给侧改革，国企改革，险资举牌等多重因素的作用下，上证指数自 9 月末开始持续上涨，一度突破 3100 点；12 月在监管层加强对险资举牌行为的监管，资金面持续紧张，债券市场大幅下跌等多重因素的影响下，上证指数出现较大幅度的回调。创业板指表现持续低迷，并在 12 月跌破了近一年的震荡平台。四季度，本产品陆续减持了中小板，创业板股票，加大对低估值蓝筹板块的配置，10 月，11 月均取得了一定的效果；在 12 月的回调中持仓的蓝筹个股遭遇较大幅度回调，导致净值有较大回撤。

展望一季度，企业盈利改善的趋势有望延续，但资金面边际收紧的趋势也将延续，分子，分

母端同时向上，对市场的影响偏中性。考虑到 12 月指数有较大幅度的回调，预计一季度市场震荡反弹的可能性较大。2016 年年末的中央经济工作会议重点强调了国企改革，供给侧改革，农业供给侧改革等方面，一季度，本产品计划以上述方向作为板块配置的主要方向，精选其中基本面较好的个股，力争净值有好的表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 份额净值为 1.064 元，份额累计净值为 1.064 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-7.24%，同期业绩基准增长率为 0.00%。本基金 C 份额净值为 1.051 元，份额累计净值为 1.051 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-7.40%，同期业绩基准增长率为 0.00%。

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	35,653,342.14	44.90
	其中：股票	35,653,342.14	44.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	9,861,409.77	12.42
8	其他资产	33,892,423.63	42.68
9	合计	79,407,175.54	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	6,268,500.00	7.99
C	制造业	15,117,788.47	19.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,759,400.00	3.52
E	建筑业	15,592.23	0.02
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	11,492,061.44	14.64
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	35,653,342.14	45.42

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	601898	中煤能源	600,000	3,486,000.00	4.44
2	601211	国泰君安	180,000	3,346,200.00	4.26
3	002064	华峰氨纶	600,000	3,294,000.00	4.20
4	002217	合力泰	160,000	2,864,000.00	3.65
5	601857	中国石油	350,000	2,782,500.00	3.55
6	000875	吉电股份	420,000	2,759,400.00	3.52
7	600038	中直股份	55,000	2,663,100.00	3.39
8	000778	新兴铸管	500,000	2,585,000.00	3.29
9	000636	风华高科	200,000	1,952,000.00	2.49
10	600030	中信证券	120,000	1,927,200.00	2.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期无债券投资情况。

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

本基金本报告期无债券投资。

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	255,637.73
2	应收证券清算款	33,619,017.76
3	应收股利	-
4	应收利息	812.30
5	应收申购款	16,955.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,892,423.63

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

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限。

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	新鑫先锋 A	新鑫先锋 C
报告期期初基金份额总额	78,218,195.04	1,200,454.21
报告期期间基金总申购份额	1,871,452.80	59,275.15
减：报告期期间基金总赎回份额	7,448,563.83	116,339.45
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	72,641,084.01	1,143,389.91

§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

新鑫先锋 A

本基金管理人未运用固有资金投资本基金

新鑫先锋 C

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

-

§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新鑫先锋混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华新鑫先锋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) 报告期内平安大华新鑫先锋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
2017 年 1 月 19 日