

平安大华策略先锋混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 3 月 28 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。

普华永道中天会计师事务所为基金财务出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者仔细阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华策略先锋混合
基金主代码	700003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 29 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
报告期末基金份额总额	83,497,160.72 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析，结合经济周期理论，形成对不同市场周期的预测和判断，进行积极、灵活的资产配置，确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。股票投资方面，采用积极主动的投资管理策略，在构建股票投资组合时，灵活运用多种投资策略，积极挖掘和利用市场中可行的投资机会，以实现基金的投资目标。债券投资方面，以利率预期策略、类属资产配置和久期策略为主，以品种选择策略、收益率利差策略和债券置换策略为辅，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上，构建能获得长期、稳定收益的固定收益类投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	基金为混合型基金，其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金和债券型基金，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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	王永民
	联系电话	0755-22626828	010-66594896

	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-70,850,812.00	45,823,535.33	5,977,176.76
本期利润	-75,978,660.05	45,467,212.22	11,153,160.48
加权平均基金份额本期利润	-0.8128	0.7528	0.4107
本期基金份额净值增长率	-30.13%	71.36%	33.88%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.4061	1.0883	0.3026
期末基金资产净值	137,815,310.10	270,502,150.69	80,506,416.81
期末基金份额净值	1.651	2.363	1.379

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上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 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	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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

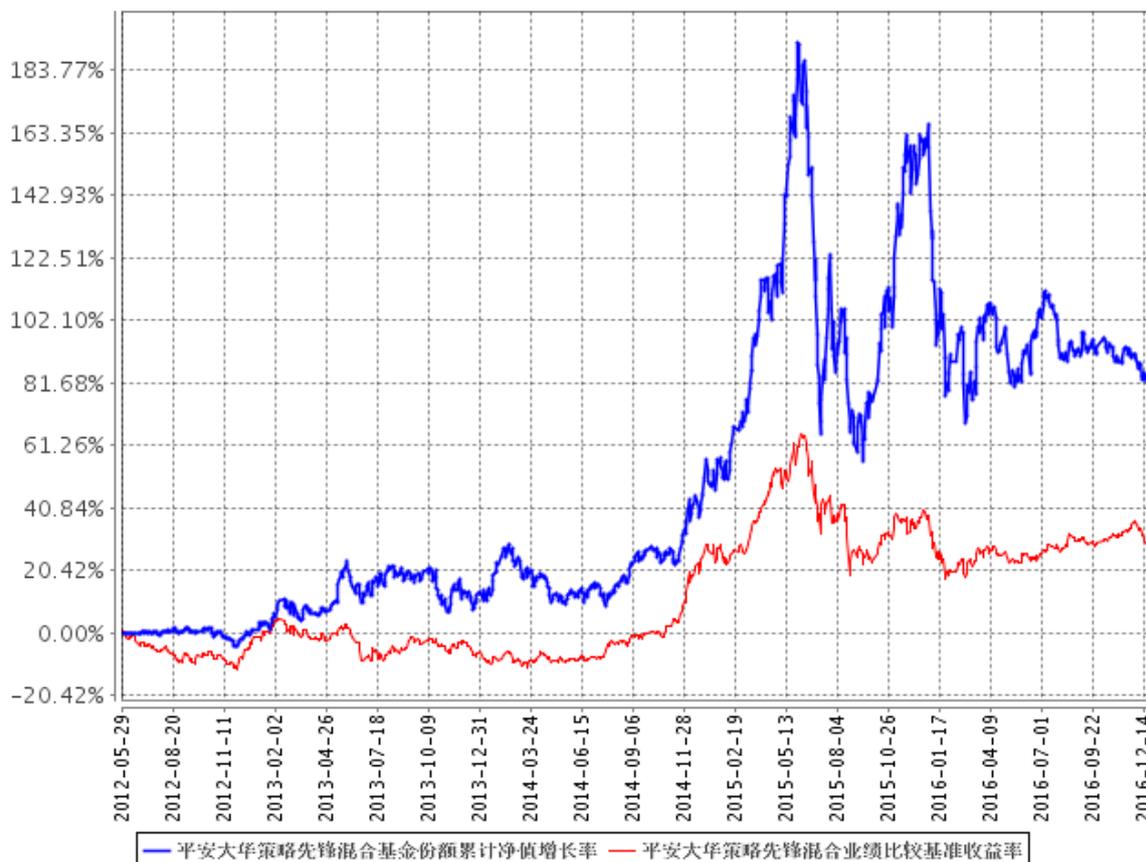
过去三个月	-6.56%	0.76%	0.35%	0.45%	-6.91%	0.31%
过去六个月	-11.14%	0.93%	3.18%	0.47%	-14.32%	0.46%
过去一年	-30.13%	1.95%	-5.64%	0.84%	-24.49%	1.11%
过去三年	60.29%	2.06%	37.96%	1.07%	22.33%	0.99%
自基金合同生效起至今	80.52%	1.77%	29.68%	0.99%	50.84%	0.78%

注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。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，最大限度地涵盖了中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，通常状况下基金在运作过程中股票资产将在 30%-80%范围内调整，中长期可能的股票仓位平均在 60%左右。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准的权重分别是 60%和 40%。因此，该基准是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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

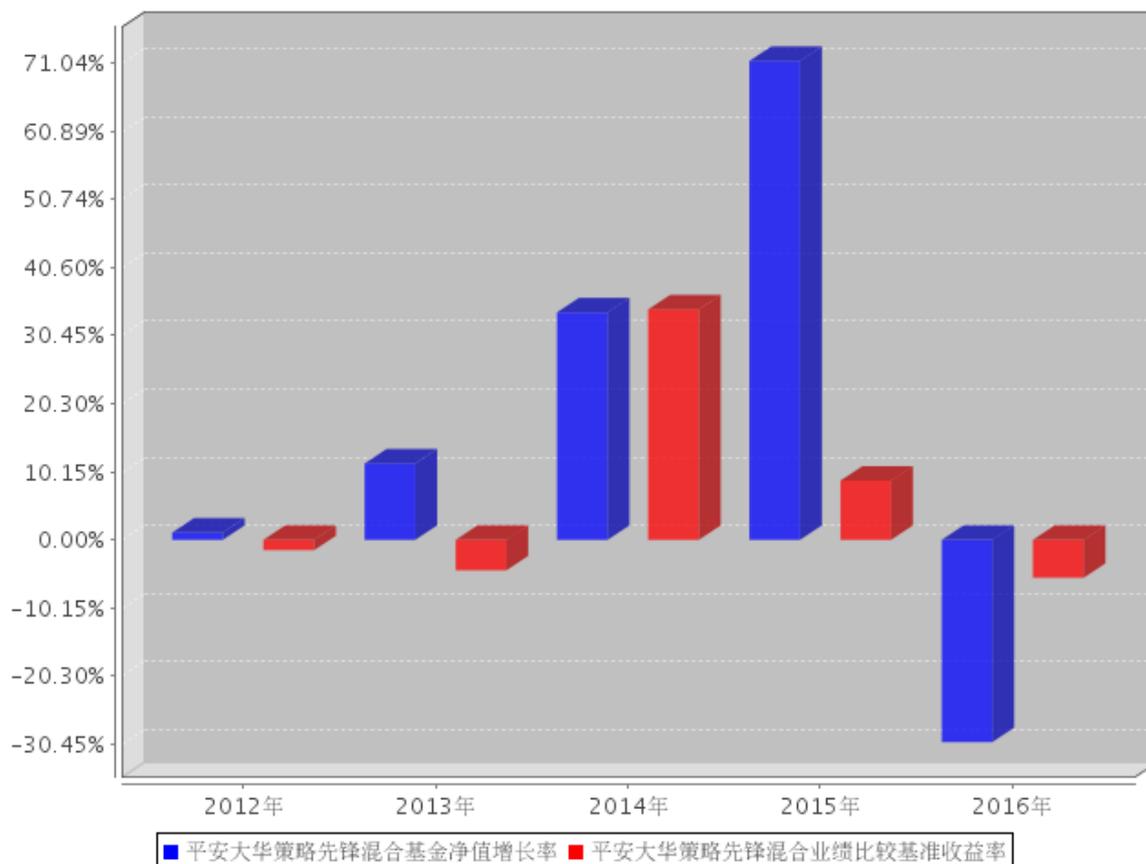
平安大华策略先锋混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2012 年 5 月 29 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，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安大华策略先锋混合自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



1. 本基金合同于 2012 年 5 月 29 日正式生效，截止报告期末已满四年。
2. 2012 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

§ 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 12 月 31 日，平安基金共管理 29 只开放式基金，资产管理总规模超 836 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		
乔海英	本基金的基金经理	2015 年 8 月 4 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、平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金经理。
神爱前	本基金的基金经理	2016 年 7 月 19 日	-	8	厦门大学财政学硕士，8 年证券从业经验，曾任第一创业证券研究所行业研究员、民生证券研究所高级研究员、第一创业证券资产管理部高级研究员，2014 年 12 月加入平安大华基金管理公司，任投资研究部高级研究员，现任平安大华策略先锋混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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、《平安大华策略先锋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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安大华基金管理有限责任公司公平交易管理制度》、《平安大华基金管理有限责任公司异常交易监控及报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 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

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。

4.3.3 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

2016 年 A 股市场大幅波动，上半年在人民币贬值和熔断的影响下出现了大幅下跌，下半年市场逐渐平稳，但出现比较大的结构分化，低估值的蓝筹股获得市场的认可，不断上涨。但在 IPO 加速的压力下，高估值的中小创成长股出现了较大的下跌。

本基金在一季度“熔断”暴跌行情中，未能及时彻底减仓，净值下跌严重。虽然本基金竭力想挽回损失，但下半年创业板市场明显“转熊”，参与一些高弹性品种反而适得其反。本基金 2016 年业绩明显跑输基准，业绩表现不理想。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.651 元，份额累计净值为 1.751 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-30.13%，同期业绩基准增长率为-5.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，本基金认为经过了 2016 年的调整后，A 股下跌空间有限，市场正处于箱体震荡中。目前左右市场走势的几个关键问题在于流动性是否继续收紧、传统行业盈利能否继续改善。这些问题在一季度都很难得以证实或证伪，3-4 月可能是比较关键的时间窗口。因此一季度基本是信息空白期，同时政策催化较多（如年初规划、两会等），一季度往往面临较好的市场环境。本基金积极参与一季度的反弹行情，仍然回避中小创等高弹性品种，偏向于一些真正中期基本趋势向好的行业与个股，同时或阶段性参与一些国企改革、供给侧改革、一带一路等主题性机会。中期来看，中小创仍存在一跌的可能性较大，相应之后会迎来中小创的超跌反弹的机会，随着中小创的不断调整，真正的成长股的投资价值在逐渐凸显，本基金会密切关注参与时机。本基金产品着眼于深挖上述投资机会，并尽力规避风险，目标是实现产品净值的稳步上升，避免再出现较

大幅度的回撤。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部门按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网络、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华策略先锋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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 22052 号
--------	-------------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	平安大华策略先锋混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的平安大华策略先锋混合型证券投资基金(以下简称“平安大华策略先锋混合基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是平安大华策略先锋混合基金的基金管理人平安大华基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为,上述平安大华策略先锋混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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,公允反映了平安大华策略先锋混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	曹翠丽	边晓红
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号普华永道中心 11 楼	

审计报告日期	2017 年 3 月 29 日
--------	-----------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安大华策略先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		25,082,686.99	72,599,170.04
结算备付金		2,548,621.81	2,525,335.98
存出保证金		150,850.01	199,546.75
交易性金融资产		100,102,696.18	215,822,497.14
其中：股票投资		100,102,696.18	215,822,497.14
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收证券清算款		11,209,491.41	-
应收利息		5,932.81	16,535.28
应收股利		-	-
应收申购款		66,723.43	1,193,741.39
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		139,167,002.64	292,356,826.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	9,845,429.98
应付赎回款		138,427.07	8,291,681.62
应付管理人报酬		180,433.64	403,641.93

应付托管费		30,072.24	67,273.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		940,247.20	3,068,252.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		62,512.39	178,395.93
负债合计		1,351,692.54	21,854,675.89
所有者权益：			
实收基金		83,497,160.72	114,457,336.08
未分配利润		54,318,149.38	156,044,814.61
所有者权益合计		137,815,310.10	270,502,150.69
负债和所有者权益总计		139,167,002.64	292,356,826.58

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.651 元，基金份额总额 83,497,160.72 份。

7.2 利润表

会计主体：平安大华策略先锋混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-62,102,819.84	53,541,974.52
1. 利息收入		316,189.18	267,891.39
其中：存款利息收入		275,393.48	234,842.21
债券利息收入		31,711.81	30,089.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,083.89	2,959.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-57,485,353.15	52,999,336.85
其中：股票投资收益		-57,698,098.40	53,250,130.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-389,853.27	-394,487.55
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		602,598.52	143,693.60

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-5,127,848.05	-356,323.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		194,192.18	631,069.39
减：二、费用		13,875,840.21	8,074,762.30
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	2,498,584.38	1,750,657.06
2. 托管费	7.4.8.2.2	416,430.68	291,776.20
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		10,693,841.62	5,853,769.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		266,983.53	178,559.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-75,978,660.05	45,467,212.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-75,978,660.05	45,467,212.22

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华策略先锋混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	114,457,336.08	156,044,814.61	270,502,150.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-75,978,660.05	-75,978,660.05
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）	-30,960,175.36	-25,748,005.18	-56,708,180.54
其中：1. 基金申购款	56,912,887.07	46,545,085.10	103,457,972.17
2. 基金赎回款	-87,873,062.43	-72,293,090.28	-160,166,152.71

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）	83,497,160.72	54,318,149.38	137,815,310.10
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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）	58,393,544.90	22,112,871.91	80,506,416.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	45,467,212.22	45,467,212.22
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）	56,063,791.18	88,464,730.48	144,528,521.66
其中：1. 基金申购款	308,949,189.48	359,788,081.55	668,737,271.03
2. 基金赎回款	-252,885,398.30	-271,323,351.07	-524,208,749.37
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）	114,457,336.08	156,044,814.61	270,502,150.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>陈星</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安大华策略先锋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[2012]248号《关于核准平安大华策略先锋混合型证券投资基金募集的批复》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《平安大华策略先锋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 459,395,438.15 元，业经安永华明会计师事务所有限公司(2012)验字第 60937497_A02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 459,456,398.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 60,960.18 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，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华策略先锋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，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 30%-80%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 20%-70%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×60% + 中证全债指数收益率×40%。

7.4.2 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》、《平安大华策略先锋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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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，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。

7.4.7 关联方关系

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
平安证券股份有限公司	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
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
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
上海陆金所资产管理有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
平安证券	1,505,216,107.92	20.51%	131,554,012.85	3.20%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	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 成交总额的比 例
平安证券	30,514,992.64	20.99%	15,396,679.86	4.08%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
-------	-----------------------------	----------------------------------

	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
--	--------	----------------------------	--------	----------------------------

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例	成交金额	占当期权证 成交总额的比 例

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
平安证券	1,401,810.02	22.10%	21,984.97	2.34%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)
平安证券	122,516.40	3.56%	122,516.40	3.99%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	2,498,584.38	1,750,657.06
其中：支付销售机构的客户维护费	1,026,152.54	652,563.14

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 1.50% 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 × 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	416,430.68	291,776.20

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期内无支付给关联方的销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2012 年 5 月 29 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	-	-
-----------------------	---	---

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末均未投资本基金。

7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国银行	25,082,686.99	214,452.13	72,599,170.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.10.1.1 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
002840	华统 股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股未 上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩 股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股未 上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正 新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股未 上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
300591	万里 马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股未 上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-

300588	熙菱 信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股未 上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-
--------	----------	------------------------	----------------------	-----------	------	------	-------	----------	----------	---

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。

7.4.9.2 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
300323	华灿 光电	2016 年 4 月 18 日	重大 事项	8.77	2017 年 1 月 9 日	8.65	441,900	3,792,777.88	3,875,463.00	-
300223	北京 君正	2016 年 12 月 19 日	重大 事项	48.40	-	-	61,500	2,007,596.00	2,976,600.00	-
000711	京蓝 科技	2016 年 10 月 20 日	重大 事项	32.54	2017 年 3 月 13 日	29.29	2,686	73,888.32	87,402.44	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 93,116,707.06 元，属于第二层次的余额为 6,985,989.12 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 203,704,786.14 元，第二层次 10,226,161.00 元，第三层次 1,891,550.00 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 权益工具投资
2016 年 1 月 1 日	1,891,550.00
购买	-
出售	1,891,550.00
转入第三层次	-

转出第三层次	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2016 年 12 月 31 日	-
2016 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2016 年度损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	-
	<hr/>
	交易性金融资产
	权益工具投资
2015 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层次	1,891,550.00
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2015 年 12 月 31 日	1,891,550.00
2015 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2015 年度损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	-4,820,420.02
	<hr/>

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

第三层次资产公允价值参考市场同期可比价格确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	100,102,696.18	71.93
	其中：股票	100,102,696.18	71.93
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	27,631,308.80	19.85
7	其他各项资产	11,432,997.66	8.22
8	合计	139,167,002.64	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	8,428,833.88	6.12
B	采矿业	732,412.00	0.53
C	制造业	75,715,934.66	54.94
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	1,357,620.00	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	5,836,737.00	4.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,550,351.20	2.58

J	金融业	-	-
K	房地产业	2,978,311.44	2.16
L	租赁和商务服务业	1,502,496.00	1.09
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	100,102,696.18	72.64

8.2.2 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。

8.3 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	600166	福田汽车	2,135,040	6,597,273.60	4.79
2	000488	晨鸣纸业	595,200	6,166,272.00	4.47
3	600796	钱江生化	391,200	4,862,616.00	3.53
4	000333	美的集团	162,800	4,586,076.00	3.33
5	600125	铁龙物流	555,000	4,484,400.00	3.25
6	300323	华灿光电	441,900	3,875,463.00	2.81
7	600809	山西汾酒	149,600	3,742,992.00	2.72
8	000998	隆平高科	155,716	3,336,993.88	2.42
9	600877	中国嘉陵	343,000	3,210,480.00	2.33
10	000823	超声电子	241,589	3,002,951.27	2.18

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300322	硕贝德	54,281,719.58	20.07
2	000060	中金岭南	50,960,340.23	18.84
3	000810	创维数字	45,923,529.17	16.98
4	002284	亚太股份	45,263,845.81	16.73
5	002464	金利科技	43,135,866.39	15.95
6	600547	山东黄金	36,015,132.67	13.31
7	000971	高升控股	30,072,913.18	11.12
8	300027	华谊兄弟	29,777,103.53	11.01
9	002308	威创股份	28,621,037.96	10.58
10	002618	丹邦科技	27,719,447.29	10.25
11	002624	完美世界	25,481,412.98	9.42
12	600652	游久游戏	25,229,935.87	9.33
13	600489	中金黄金	25,036,351.78	9.26
14	002273	水晶光电	23,764,751.58	8.79
15	600568	中珠医疗	23,577,914.00	8.72
16	002191	劲嘉股份	23,120,054.96	8.55
17	600259	广晟有色	22,961,025.08	8.49
18	002175	东方网络	22,641,415.14	8.37
19	300073	当升科技	21,872,997.74	8.09
20	600497	驰宏锌锗	20,604,386.71	7.62
21	002655	共达电声	20,353,222.87	7.52
22	300493	润欣科技	19,327,701.80	7.15
23	300383	光环新网	19,285,392.36	7.13
24	002235	安妮股份	18,121,949.90	6.70
25	601799	星宇股份	18,031,883.53	6.67
26	600988	赤峰黄金	18,003,813.65	6.66
27	600699	均胜电子	17,762,157.15	6.57
28	300467	迅游科技	17,606,052.00	6.51
29	002247	帝龙文化	17,522,389.46	6.48
30	000606	*ST 易桥	17,168,923.50	6.35

31	000078	海王生物	16,989,343.41	6.28
32	300093	金刚玻璃	16,975,734.23	6.28
33	002368	太极股份	16,960,934.49	6.27
34	300299	富春通信	15,595,286.53	5.77
35	601069	西部黄金	15,436,682.57	5.71
36	002237	恒邦股份	15,413,610.16	5.70
37	002089	新海宜	15,371,727.48	5.68
38	002371	七星电子	15,036,869.16	5.56
39	002113	天润数娱	14,606,954.49	5.40
40	002340	格林美	14,583,172.67	5.39
41	002664	信质电机	14,200,978.96	5.25
42	002510	天汽模	14,048,991.08	5.19
43	002079	苏州固锴	13,920,766.66	5.15
44	000603	盛达矿业	13,860,087.90	5.12
45	300316	晶盛机电	13,688,696.02	5.06
46	300353	东土科技	13,655,652.86	5.05
47	600961	株冶集团	13,597,859.12	5.03
48	002281	光迅科技	13,475,317.25	4.98
49	603788	宁波高发	13,346,007.81	4.93
50	002168	深圳惠程	13,301,215.97	4.92
51	002450	康得新	13,216,175.12	4.89
52	600589	广东榕泰	13,083,630.68	4.84
53	002537	海立美达	13,048,593.06	4.82
54	600392	盛和资源	12,990,340.67	4.80
55	000878	云南铜业	12,863,818.00	4.76
56	600640	号百控股	12,765,608.46	4.72
57	000034	神州数码	12,654,954.76	4.68
58	000758	中色股份	12,407,127.21	4.59
59	002502	骅威文化	12,397,332.28	4.58
60	000881	大连国际	12,368,368.44	4.57
61	601211	国泰君安	12,269,778.46	4.54
62	002488	金固股份	12,256,968.81	4.53
63	603993	洛阳钼业	12,064,990.16	4.46
64	300148	天舟文化	12,019,630.80	4.44
65	000657	中钨高新	12,000,109.22	4.44
66	002066	瑞泰科技	11,984,774.05	4.43

67	300098	高新兴	11,694,741.54	4.32
68	603398	邦宝益智	11,534,945.60	4.26
69	002590	万安科技	11,458,429.40	4.24
70	300327	中颖电子	11,332,361.72	4.19
71	000625	长安汽车	11,118,751.00	4.11
72	600760	*ST 黑豹	11,069,547.13	4.09
73	300507	苏奥传感	10,843,236.90	4.01
74	600597	光明乳业	10,823,107.00	4.00
75	300303	聚飞光电	10,818,209.22	4.00
76	002048	宁波华翔	10,648,995.82	3.94
77	000831	*ST 五稀	10,569,337.03	3.91
78	600166	福田汽车	10,488,571.00	3.88
79	601168	西部矿业	10,253,083.00	3.79
80	002165	红宝丽	10,072,982.87	3.72
81	600645	中源协和	10,024,448.90	3.71
82	002635	安洁科技	9,868,496.31	3.65
83	600071	凤凰光学	9,826,751.87	3.63
84	000937	冀中能源	9,807,611.11	3.63
85	300209	天泽信息	9,804,410.95	3.62
86	600172	黄河旋风	9,712,679.17	3.59
87	601699	潞安环能	9,691,401.70	3.58
88	300313	天山生物	9,619,209.00	3.56
89	601088	中国神华	9,577,878.00	3.54
90	300033	同花顺	9,544,135.00	3.53
91	300410	正业科技	9,461,582.00	3.50
92	002249	大洋电机	9,454,437.00	3.50
93	600123	兰花科创	9,426,464.29	3.48
94	000711	京蓝科技	9,377,179.20	3.47
95	000960	锡业股份	9,374,480.81	3.47
96	600498	烽火通信	9,364,017.99	3.46
97	002341	新纶科技	9,145,131.48	3.38
98	300221	银禧科技	9,132,587.68	3.38
99	002006	精功科技	9,131,002.56	3.38
100	002684	猛狮科技	9,046,334.00	3.34
101	000823	超声电子	9,033,505.48	3.34
102	002145	中核钛白	8,956,653.19	3.31

103	002030	达安基因	8,893,790.79	3.29
104	300014	亿纬锂能	8,848,106.80	3.27
105	000426	兴业矿业	8,808,622.18	3.26
106	600898	三联商社	8,792,828.73	3.25
107	002699	美盛文化	8,774,352.50	3.24
108	000636	风华高科	8,637,495.34	3.19
109	002601	佰利联	8,558,232.52	3.16
110	000673	当代东方	8,553,617.21	3.16
111	002456	欧菲光	8,539,054.95	3.16
112	300088	长信科技	8,370,274.00	3.09
113	600026	中远海能	8,227,613.66	3.04
114	000796	凯撒旅游	8,177,509.96	3.02
115	000050	深天马A	8,127,695.00	3.00
116	300310	宜通世纪	8,080,314.07	2.99
117	300346	南大光电	8,058,461.00	2.98
118	002138	顺络电子	8,039,516.40	2.97
119	002766	索菱股份	8,007,711.00	2.96
120	000975	银泰资源	7,971,310.60	2.95
121	000970	中科三环	7,903,502.50	2.92
122	300304	云意电气	7,879,177.00	2.91
123	601766	中国中车	7,870,992.00	2.91
124	002329	皇氏集团	7,854,174.00	2.90
125	300431	暴风集团	7,841,087.03	2.90
126	002534	杭锅股份	7,812,508.00	2.89
127	002232	启明信息	7,802,803.52	2.88
128	600195	中牧股份	7,801,946.00	2.88
129	600745	中茵股份	7,749,091.85	2.86
130	300319	麦捷科技	7,729,132.00	2.86
131	600395	盘江股份	7,692,824.80	2.84
132	300275	梅安森	7,678,542.00	2.84
133	300037	新宙邦	7,626,014.00	2.82
134	000889	茂业通信	7,605,611.20	2.81
135	000655	金岭矿业	7,505,071.68	2.77
136	300306	远方光电	7,419,748.76	2.74
137	600028	中国石化	7,278,601.50	2.69
138	603023	威帝股份	7,208,898.00	2.67

139	002123	梦网荣信	7,154,733.42	2.64
140	600576	万家文化	7,111,938.40	2.63
141	000969	安泰科技	7,100,937.24	2.63
142	600843	上工申贝	6,980,256.00	2.58
143	002632	道明光学	6,956,953.00	2.57
144	002501	利源精制	6,928,231.15	2.56
145	000688	建新矿业	6,858,665.00	2.54
146	600677	航天通信	6,858,606.85	2.54
147	300081	恒信移动	6,845,213.00	2.53
148	002158	汉钟精机	6,822,005.24	2.52
149	300025	华星创业	6,814,742.10	2.52
150	601599	鹿港文化	6,800,802.62	2.51
151	000333	美的集团	6,733,012.00	2.49
152	000933	*ST 神火	6,731,230.80	2.49
153	600880	博瑞传播	6,720,579.40	2.48
154	002243	通产丽星	6,681,224.53	2.47
155	002659	中泰桥梁	6,650,298.00	2.46
156	000488	晨鸣纸业	6,567,596.00	2.43
157	300228	富瑞特装	6,518,866.40	2.41
158	300256	星星科技	6,495,544.00	2.40
159	300007	汉威电子	6,368,759.00	2.35
160	300518	盛讯达	6,255,155.00	2.31
161	002521	齐峰新材	6,241,164.00	2.31
162	000629	*ST 钒钛	6,208,747.00	2.30
163	002402	和而泰	6,201,124.45	2.29
164	002577	雷柏科技	6,077,601.04	2.25
165	000423	东阿阿胶	6,077,097.62	2.25
166	300350	华鹏飞	6,062,278.75	2.24
167	002036	联创电子	6,021,463.00	2.23
168	603989	艾华集团	5,943,998.36	2.20
169	600886	国投电力	5,927,265.91	2.19
170	600438	通威股份	5,907,240.00	2.18
171	600232	金鹰股份	5,877,637.00	2.17
172	002453	天马精化	5,865,469.00	2.17
173	600705	中航资本	5,855,976.00	2.16
174	000567	海德股份	5,785,545.83	2.14

175	600139	西部资源	5,779,136.03	2.14
176	002446	盛路通信	5,714,543.29	2.11
177	601918	*ST 新集	5,714,195.00	2.11
178	002359	齐星铁塔	5,699,086.80	2.11
179	002529	海源机械	5,673,436.00	2.10
180	002639	雪人股份	5,672,553.00	2.10
181	002172	澳洋科技	5,623,952.54	2.08
182	002384	东山精密	5,618,385.03	2.08
183	601012	隆基股份	5,598,752.47	2.07
184	002425	凯撒文化	5,579,017.90	2.06
185	601689	拓普集团	5,563,714.59	2.06
186	300318	博晖创新	5,459,037.00	2.02
187	000762	西藏矿业	5,421,250.00	2.00
188	300459	金科娱乐	5,416,341.40	2.00
189	001979	招商蛇口	5,412,872.00	2.00

8.4.2 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	300322	硕贝德	59,221,545.54	21.89
2	000810	创维数字	50,821,443.87	18.79
3	002464	金利科技	49,438,994.72	18.28
4	000060	中金岭南	48,173,500.73	17.81
5	002284	亚太股份	44,998,421.28	16.64
6	600547	山东黄金	35,052,845.27	12.96
7	002273	水晶光电	30,402,122.21	11.24
8	300027	华谊兄弟	29,748,751.36	11.00
9	002618	丹邦科技	28,650,264.02	10.59
10	002175	东方网络	28,612,563.69	10.58
11	000971	高升控股	28,024,895.94	10.36
12	002308	威创股份	27,636,713.64	10.22
13	000078	海王生物	27,269,257.75	10.08
14	600652	游久游戏	25,886,601.25	9.57
15	002624	完美世界	25,216,248.11	9.32
16	600489	中金黄金	23,686,205.82	8.76

17	002191	劲嘉股份	23,339,194.82	8.63
18	600568	中珠医疗	23,058,133.10	8.52
19	600259	广晟有色	22,751,662.98	8.41
20	300299	富春通信	22,719,357.75	8.40
21	300073	当升科技	21,360,381.68	7.90
22	601799	星宇股份	20,238,711.68	7.48
23	300327	中颖电子	20,227,586.60	7.48
24	002655	共达电声	20,215,079.80	7.47
25	600497	驰宏锌锗	19,579,473.11	7.24
26	600988	赤峰黄金	19,377,536.00	7.16
27	300383	光环新网	18,585,592.53	6.87
28	002113	天润数娱	18,173,049.39	6.72
29	300493	润欣科技	17,908,459.32	6.62
30	002235	安妮股份	17,817,349.63	6.59
31	600699	均胜电子	17,249,220.89	6.38
32	300467	迅游科技	17,100,686.00	6.32
33	300098	高新兴	16,954,738.20	6.27
34	300093	金刚玻璃	16,941,461.00	6.26
35	002368	太极股份	16,908,380.00	6.25
36	300310	宜通世纪	16,129,848.75	5.96
37	002237	恒邦股份	15,822,253.00	5.85
38	002371	七星电子	15,743,282.86	5.82
39	002247	帝龙文化	15,326,656.28	5.67
40	601069	西部黄金	15,221,377.60	5.63
41	002340	格林美	15,211,039.55	5.62
42	600589	广东榕泰	15,168,515.25	5.61
43	000603	盛达矿业	14,960,412.48	5.53
44	002089	新海宜	14,303,002.20	5.29
45	300316	晶盛机电	14,249,080.45	5.27
46	300353	东土科技	14,033,140.40	5.19
47	600576	万家文化	13,965,772.55	5.16
48	002510	天汽模	13,833,360.53	5.11
49	002664	信质电机	13,773,262.32	5.09
50	002079	苏州固锝	13,687,830.83	5.06
51	600961	株冶集团	13,675,526.10	5.06
52	002450	康得新	13,641,419.92	5.04
53	002281	光迅科技	13,435,578.35	4.97
54	603788	宁波高发	13,317,365.53	4.92

55	002168	深圳惠程	13,015,228.95	4.81
56	000606	*ST 易桥	12,964,131.92	4.79
57	002488	金固股份	12,918,457.30	4.78
58	000878	云南铜业	12,835,018.41	4.74
59	000758	中色股份	12,756,341.79	4.72
60	600392	盛和资源	12,519,883.16	4.63
61	603993	洛阳钼业	12,463,980.82	4.61
62	000657	中钨高新	12,333,500.49	4.56
63	601211	国泰君安	12,144,021.63	4.49
64	000050	深天马 A	12,083,533.20	4.47
65	002537	海立美达	12,072,720.79	4.46
66	002502	骅威文化	12,034,651.00	4.45
67	000881	大连国际	11,935,699.00	4.41
68	300113	顺网科技	11,856,655.00	4.38
69	002590	万安科技	11,837,615.12	4.38
70	000034	神州数码	11,761,067.02	4.35
71	002632	道明光学	11,567,349.60	4.28
72	000835	长城动漫	11,404,031.50	4.22
73	002048	宁波华翔	11,154,206.00	4.12
74	300148	天舟文化	11,130,527.22	4.11
75	000831	*ST 五稀	11,077,494.98	4.10
76	600597	光明乳业	11,074,792.80	4.09
77	300507	苏奥传感	11,057,763.00	4.09
78	603398	邦宝益智	11,056,279.00	4.09
79	600640	号百控股	10,809,608.64	4.00
80	000625	长安汽车	10,756,905.62	3.98
81	000426	兴业矿业	10,710,062.58	3.96
82	002635	安洁科技	10,637,734.56	3.93
83	300275	梅安森	10,523,158.00	3.89
84	300303	聚飞光电	10,435,141.76	3.86
85	600760	*ST 黑豹	10,261,564.17	3.79
86	600306	*ST 商城	10,258,039.95	3.79
87	600071	凤凰光学	10,179,483.00	3.76
88	002425	凯撒文化	10,072,514.30	3.72
89	601168	西部矿业	9,946,882.16	3.68
90	002165	红宝丽	9,902,661.55	3.66
91	000937	冀中能源	9,885,771.33	3.65
92	600645	中源协和	9,712,059.39	3.59

93	300209	天泽信息	9,642,815.84	3.56
94	600172	黄河旋风	9,627,500.46	3.56
95	601088	中国神华	9,626,316.58	3.56
96	300033	同花顺	9,556,261.50	3.53
97	601699	潞安环能	9,548,717.55	3.53
98	000960	锡业股份	9,540,559.00	3.53
99	002066	瑞泰科技	9,524,958.42	3.52
100	600123	兰花科创	9,466,375.80	3.50
101	002456	欧菲光	9,361,340.19	3.46
102	000711	京蓝科技	9,337,909.30	3.45
103	002006	精功科技	9,213,504.49	3.41
104	002249	大洋电机	9,136,885.73	3.38
105	002684	猛狮科技	8,992,857.60	3.32
106	002341	新纶科技	8,974,103.00	3.32
107	000975	银泰资源	8,879,670.15	3.28
108	600498	烽火通信	8,840,768.22	3.27
109	300313	天山生物	8,798,654.00	3.25
110	000636	风华高科	8,753,710.06	3.24
111	002601	佰利联	8,747,450.03	3.23
112	300346	南大光电	8,740,273.80	3.23
113	000673	当代东方	8,662,059.95	3.20
114	300088	长信科技	8,651,063.26	3.20
115	300014	亿纬锂能	8,619,152.56	3.19
116	300221	银禧科技	8,594,712.17	3.18
117	002030	达安基因	8,527,336.84	3.15
118	300410	正业科技	8,466,960.00	3.13
119	002138	顺络电子	8,360,048.76	3.09
120	600026	中远海能	8,345,358.00	3.09
121	002699	美盛文化	8,271,433.40	3.06
122	002145	中核钛白	8,244,919.00	3.05
123	600898	三联商社	8,076,892.31	2.99
124	300304	云意电气	8,026,187.00	2.97
125	601766	中国中车	7,993,464.69	2.96
126	000688	建新矿业	7,917,510.00	2.93
127	603003	龙宇燃油	7,893,935.12	2.92
128	000655	金岭矿业	7,786,855.37	2.88
129	300431	暴风集团	7,680,348.10	2.84
130	600195	中牧股份	7,677,207.36	2.84

131	002335	科华恒盛	7,659,765.00	2.83
132	002329	皇氏集团	7,658,685.90	2.83
133	600745	中茵股份	7,596,977.34	2.81
134	002104	恒宝股份	7,595,510.36	2.81
135	600395	盘江股份	7,590,660.62	2.81
136	300103	达刚路机	7,589,896.03	2.81
137	000970	中科三环	7,546,022.96	2.79
138	000796	凯撒旅游	7,515,046.16	2.78
139	600028	中国石化	7,458,951.00	2.76
140	002232	启明信息	7,444,508.74	2.75
141	300037	新宙邦	7,441,966.29	2.75
142	002766	索菱股份	7,346,732.00	2.72
143	002534	杭锅股份	7,109,876.64	2.63
144	300007	汉威电子	7,100,562.09	2.62
145	300081	恒信移动	7,071,705.00	2.61
146	603023	威帝股份	6,938,318.73	2.56
147	600677	航天通信	6,859,142.41	2.54
148	002123	梦网荣信	6,803,164.41	2.52
149	300306	远方光电	6,700,755.81	2.48
150	002256	兆新股份	6,641,261.80	2.46
151	600880	博瑞传播	6,640,317.00	2.45
152	000969	安泰科技	6,623,326.71	2.45
153	603989	艾华集团	6,610,761.59	2.44
154	000889	茂业通信	6,537,862.61	2.42
155	000933	*ST 神火	6,514,286.10	2.41
156	002158	汉钟精机	6,495,395.52	2.40
157	300319	麦捷科技	6,478,856.21	2.40
158	002501	利源精制	6,407,886.25	2.37
159	002402	和而泰	6,399,897.39	2.37
160	601599	鹿港文化	6,356,842.00	2.35
161	002243	通产丽星	6,341,110.00	2.34
162	000823	超声电子	6,270,650.52	2.32
163	300219	鸿利智汇	6,265,643.76	2.32
164	002446	盛路通信	6,244,994.00	2.31
165	300025	华星创业	6,154,375.08	2.28
166	002659	中泰桥梁	6,130,219.28	2.27
167	002529	海源机械	6,124,392.22	2.26
168	300256	星星科技	6,102,730.00	2.26

169	000670	*ST 盈方	6,046,402.08	2.24
170	002189	利达光电	6,022,459.00	2.23
171	300518	盛讯达	5,997,284.28	2.22
172	002577	雷柏科技	5,991,875.04	2.22
173	600705	中航资本	5,990,359.10	2.21
174	300350	华鹏飞	5,957,254.62	2.20
175	300228	富瑞特装	5,956,570.60	2.20
176	600139	西部资源	5,881,410.88	2.17
177	000629	*ST 钒钛	5,867,937.00	2.17
178	600438	通威股份	5,859,351.47	2.17
179	601689	拓普集团	5,830,624.96	2.16
180	002453	天马精化	5,820,077.75	2.15
181	002036	联创电子	5,791,916.59	2.14
182	002521	齐峰新材	5,774,674.01	2.13
183	600886	国投电力	5,768,728.30	2.13
184	000567	海德股份	5,763,932.60	2.13
185	600249	两面针	5,747,342.67	2.12
186	601012	隆基股份	5,739,812.00	2.12
187	601918	*ST 新集	5,738,592.18	2.12
188	000423	东阿阿胶	5,736,726.40	2.12
189	000622	*ST 恒立	5,734,401.85	2.12
190	002292	奥飞娱乐	5,684,584.85	2.10
191	002172	澳洋科技	5,650,404.43	2.09
192	600711	盛屯矿业	5,608,413.14	2.07
193	300318	博晖创新	5,576,938.36	2.06
194	002359	齐星铁塔	5,574,703.13	2.06
195	600232	金鹰股份	5,568,111.00	2.06
196	300207	欣旺达	5,510,397.00	2.04
197	002643	万润股份	5,506,020.96	2.04
198	000409	山东地矿	5,503,384.02	2.03
199	002639	雪人股份	5,443,353.62	2.01
200	300340	科恒股份	5,435,044.00	2.01
201	300076	GQY 视讯	5,426,890.00	2.01
202	000792	盐湖股份	5,418,857.23	2.00

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。

8.4.3 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	3,643,830,028.20
卖出股票收入（成交）总额	3,696,723,882.71

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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资产。

8.6 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

基金本报告期末未持有债券资产。

8.7 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。

8.8 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

本基金本报告期无贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内无股指期货投资。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	150,850.01
2	应收证券清算款	11,209,491.41
3	应收股利	-
4	应收利息	5,932.81
5	应收申购款	66,723.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,432,997.66

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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	300323	华灿光电	3,875,463.00	2.81	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
7,994	10,444.98	0.00	0.00%	83,497,160.72	100.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	129,869.76	0.1555%

9.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年5月29日）基金份额总额	459,456,398.33
本报告期期初基金份额总额	114,457,336.08
本报告期基金总申购份额	56,912,887.07
减：本报告期基金总赎回份额	87,873,062.43
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	83,497,160.72

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

3、经平安大华基金管理有限公司2016年第三次股东大会审议通过《关于更换第二届董事会会议的议案》，同意由叶杨诗明女士代替王世荣先生出任董事。

4、2016年12月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 3 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 60,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

- 1、本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。
- 2、本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
平安证券	2	1,505,216,107.92	20.51%	1,401,810.02	22.10%	-
民生证券	2	888,047,136.17	12.10%	649,429.09	10.24%	-
招商证券	2	685,583,764.61	9.34%	638,485.41	10.07%	-
广发证券	1	536,978,595.57	7.32%	500,088.19	7.88%	-
西南证券	1	517,501,298.30	7.05%	368,098.79	5.80%	-
方正证券	2	480,237,216.74	6.54%	447,243.91	7.05%	-
中金公司	2	445,707,809.12	6.07%	415,087.44	6.54%	-
国金证券	1	418,185,899.31	5.70%	389,455.46	6.14%	-
中信证券	2	413,280,260.36	5.63%	384,888.78	6.07%	-
申万证券	2	298,535,305.16	4.07%	278,026.88	4.38%	-
安信证券	2	248,867,414.26	3.39%	181,996.56	2.87%	-
华泰证券	1	243,226,840.64	3.31%	173,008.05	2.73%	-

长江证券	1	187,974,458.91	2.56%	175,059.65	2.76%	-
中银证券	1	168,908,148.58	2.30%	120,143.55	1.89%	-
中信建投	1	100,182,474.50	1.36%	73,263.32	1.16%	-
国信证券	2	89,190,436.30	1.22%	65,225.03	1.03%	-
长城证券	2	56,097,729.62	0.76%	39,902.44	0.63%	-
中投证券	1	31,860,151.49	0.43%	22,661.85	0.36%	-
兴业证券	2	20,129,851.40	0.27%	14,651.89	0.23%	-
银河证券	2	4,268,449.22	0.06%	3,975.24	0.06%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
东方证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-

1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元变更情况

报告期内停止租用交易单元：民生证券（深圳 1 个）

2、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

3、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。

11.7.2 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
平安证券	30,514,992.64	20.99%	-	-	-	-
民生证券	13,818,283.20	9.51%	16,600,000.00	100.00%	-	-
招商证券	29,886,798.25	20.56%	-	-	-	-
广发证券	19,692,860.13	13.55%	-	-	-	-
西南证券	5,687,744.04	3.91%	-	-	-	-
方正证券	35,343.80	0.02%	-	-	-	-

中金公司	1,417,319.00	0.98%	-	-	-	-
国金证券	4,164,580.20	2.87%	-	-	-	-
中信证券	14,198,002.90	9.77%	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	23,151,327.01	15.93%	-	-	-	-
华泰证券	2,780,124.01	1.91%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

平安大华基金管理有限公司
2017年3月30日