

# 平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2017 年 8 月 25 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	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.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	23
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	58
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>60</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
8.3 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.....	60
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>62</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	67
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>69</b>

11.1 备查文件目录 .....	69
11.2 存放地点 .....	69
11.3 查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金	
基金简称	平安大华新鑫先锋混合	
场内简称	-	
基金主代码	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	
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	63,179,459.52 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
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	62,186,031.09 份	993,428.43 份

### 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	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、产业成长周期等来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。	
	新鑫先锋 A	新鑫先锋 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 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	方琦
	联系电话	0755-22626828	0755-22160168
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fangqi275@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		518048	518001
法定代表人		罗春风	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层



### § 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	新鑫先锋 A	新鑫先锋 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,691,890.68	25,802.91
本期利润	4,830,855.80	73,878.28
加权平均基金份额本期利润	0.0713	0.0670
本期加权平均净值利润率	6.58%	6.27%
本期基金份额净值增长率	6.86%	6.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	8,548,835.02	120,567.56
期末可供分配基金份额利润	0.1375	0.1214
期末基金资产净值	70,734,866.11	1,113,995.99
期末基金份额净值	1.137	1.121
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	13.70%	-36.45%

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

新鑫先锋 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	6.86%	0.76%	3.09%	0.34%	3.77%	0.42%
过去三个月	6.16%	0.84%	3.10%	0.32%	3.06%	0.52%
过去六个月	6.86%	0.73%	5.20%	0.29%	1.66%	0.44%
过去一年	-11.59%	0.86%	8.06%	0.35%	-19.65%	0.51%
自基金合同生效起至今	13.70%	1.87%	9.27%	0.90%	4.43%	0.97%

新鑫先锋 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	6.86%	0.75%	3.09%	0.34%	3.77%	0.41%
过去三个月	6.05%	0.83%	3.10%	0.32%	2.95%	0.51%
过去六个月	6.66%	0.73%	5.20%	0.29%	1.46%	0.44%
过去一年	-11.94%	0.86%	8.06%	0.35%	-20.00%	0.51%
自基金合同生效起至今	-36.45%	1.80%	-8.76%	0.90%	-27.69%	0.90%

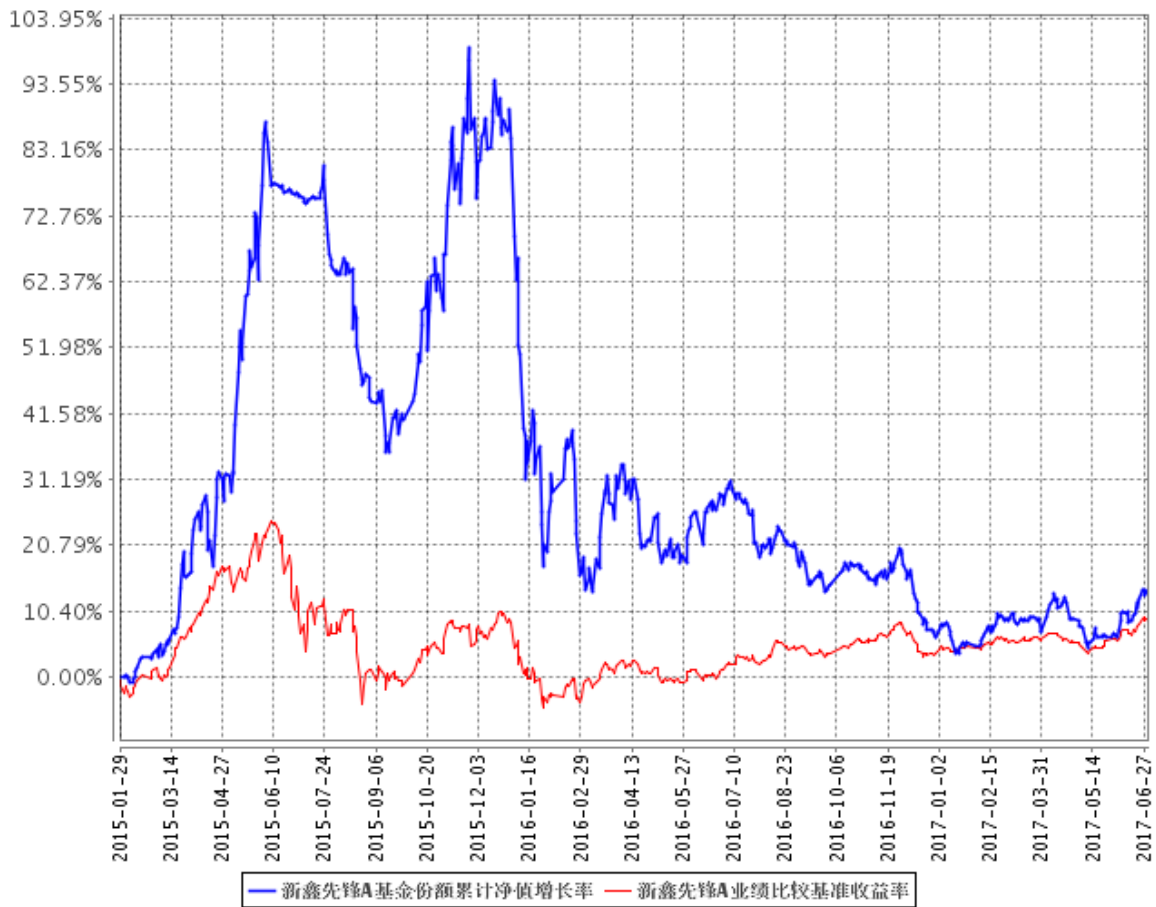
注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证全债指数从沪深交易所和银行间市场挑选国债、金融债及企业债组成样本券，最大限度地涵盖了我国固定收益市场可供投资的产品，已成为广受投资者认可的投资中国固定收益市场的基准指标。本基金为混合型基金，通常状况下在运作过程中股票资产将在 0%-90%范围内调整，中长期可能的股票仓位平

均在 50% 左右。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准权重分别是 50%和 50% 。因此，沪深 300 指数和中证全债指数是衡量本基金投资业绩的理想基准。

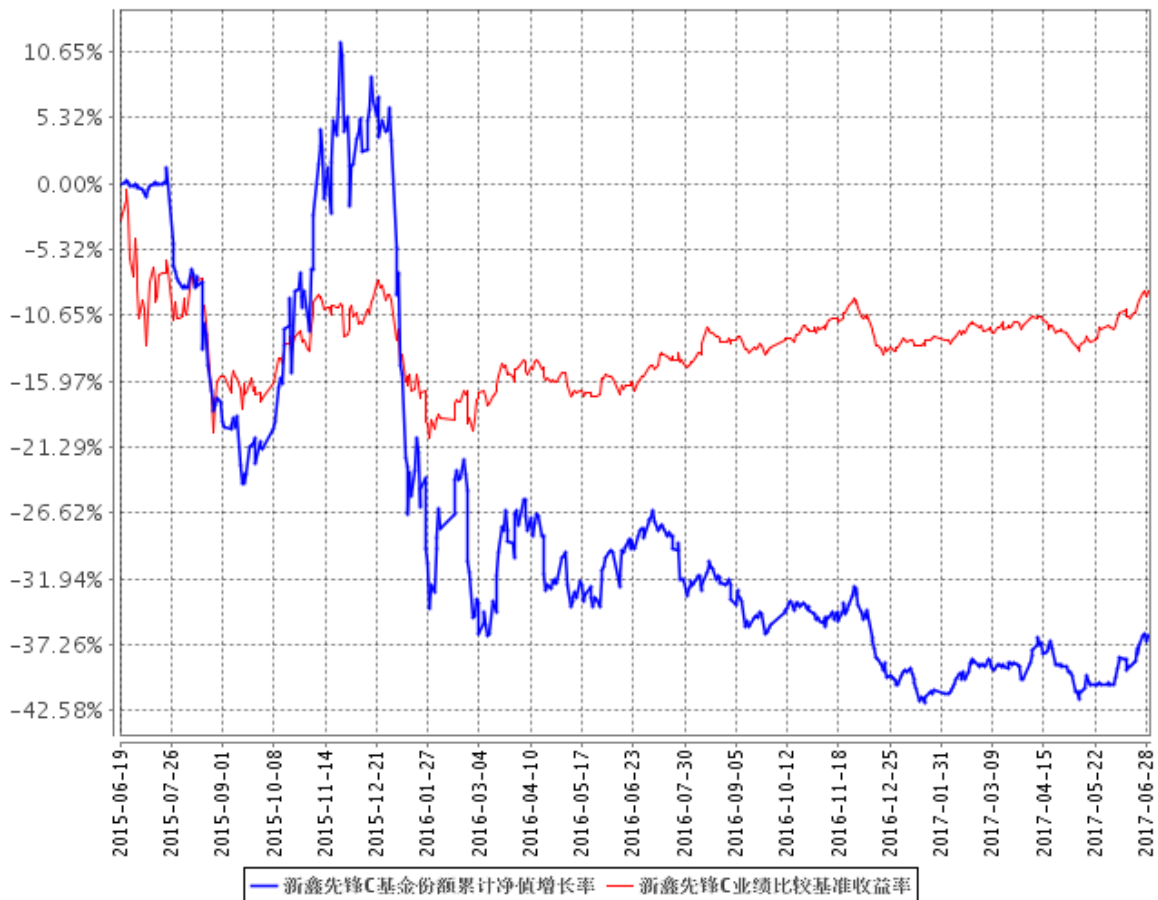
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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

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，截至报告期末已满两年；
- 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“平安大华”）经中国证监会证监许可【2010】1917号文批准设立。平安大华总部位于深圳，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，持有股份60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股份25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份14.3%。

平安大华秉承“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。截至到2017年二季度末，公司旗下共有39只公募基金，公募基金管理规模突破1200亿元人民币。

#### 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		
邓翔	平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理	2016年7月19日	-	8年	中山大学国际贸易硕士，8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基金经理。

1、此处的“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。

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、《平安大华新鑫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

2017 年上半年，经济增长维持在高位，但季度环比回落；金融监管逐渐加强，资金面趋于紧张。年初，受益于供给侧改带来产能收缩以及短期需求向好，周期板块迎来一波上涨，本基金也配置了一部分周期板块和一带一路等主题个股。二季度，市场对于经济逐季走弱的担忧愈发增强，

叠加流动性继续收紧，周期板块和高估值的创业板等大幅回落。市场对确定性的追求愈发强烈，业绩稳定、低估值的个股表现较好。本基金及时调整投资策略，配置了业绩稳定、低估值的个股，取得一定的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末新鑫先锋 A 基金份额净值为 1.137 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.86%；截至本报告期末新鑫先锋 C 基金份额净值为 1.121 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.66%；同期业绩比较基准收益率为 5.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年经济增速仍将保持一定的韧性，不会出现大幅波动的情况，但环比增速回落的可能性较大。在经济失速的可能性不大的情况下，金融强监管仍是主旋律，加之美联储正处于加息周期，国内资金面易紧难松。在企业盈利可能环比下行，利率上行的背景下，市场不具备出现大行情的基础。本基金计划在下半年继续配置低估值，业绩稳定的个股，同时密切关注资金利率的变化，如果利率出现大幅度的提升，持有现金可能是较好的选择。

#### 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、运营部及法律合规监察部相关人员组成。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

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### **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”）在对平安大华新鑫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的复核，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。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由平安大华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、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）、投资组合报告等内容真实、准确、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：平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,409,053.01	8,312,125.85
结算备付金		687,808.66	1,549,283.92
存出保证金		345,897.13	255,637.73
交易性金融资产	6.4.7.2	39,963,797.34	35,653,342.14
其中：股票投资		39,963,797.34	35,653,342.14
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	24,000,000.00	-
应收证券清算款		7,232,171.29	33,619,017.76
应收利息	6.4.7.5	-1,824.57	812.30
应收股利		-	-
应收申购款		2,994.03	16,955.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	13,623.22	-
资产总计		76,653,520.11	79,407,175.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,294,963.56	-
应付赎回款		75,530.98	226,536.21
应付管理人报酬		87,246.95	106,010.13
应付托管费		14,541.17	17,668.36
应付销售服务费		359.10	428.31
应付交易费用	6.4.7.7	267,400.02	505,453.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	64,616.23	60,352.08
负债合计		4,804,658.01	916,448.64
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	63,179,459.52	73,784,473.92
未分配利润	6.4.7.10	8,669,402.58	4,706,252.98
所有者权益合计		71,848,862.10	78,490,726.90
负债和所有者权益总计		76,653,520.11	79,407,175.54

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额总额 63,179,459.52 份，其中下属 A 类基金份额 62,186,031.09 份，C 类基金份额 993,428.43 份。下属 A 类基金份额净值 1.137 元，C 类基金份额净值 1.121 元。

## 6.2 利润表

会计主体：平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		6,807,278.83	-40,871,185.61
1.利息收入		144,762.38	273,902.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	115,615.43	273,902.96
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		29,146.95	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,462,775.96	-30,860,217.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,957,299.33	-31,475,022.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	505,476.63	614,804.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,187,040.49	-10,395,209.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	12,700.00	110,338.39
<b>减：二、费用</b>		1,902,544.75	2,555,807.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	554,730.78	782,578.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	92,455.12	130,429.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,338.14	4,017.10

4. 交易费用	6.4.7.19	1,160,955.75	1,545,321.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	92,064.96	93,461.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,904,734.08	-43,426,992.91
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,904,734.08	-43,426,992.91

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	73,784,473.92	4,706,252.98	78,490,726.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,904,734.08	4,904,734.08
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）	-10,605,014.40	-941,584.48	-11,546,598.88

其中：1.基金申购款	2,125,682.24	172,253.95	2,297,936.19
2.基金赎回款	-12,730,696.64	-1,113,838.43	-13,844,535.07
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）	63,179,459.52	8,669,402.58	71,848,862.10
项目	上年度可比期间		
	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）	76,251,880.69	64,782,847.62	141,034,728.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-43,426,992.91	-43,426,992.91
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）	6,739,312.23	2,377,589.33	9,116,901.56
其中：1.基金申购款	22,303,884.00	7,109,694.98	29,413,578.98
2.基金赎回款	-15,564,571.77	-4,732,105.65	-20,296,677.42
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	82,991,192.92	23,733,444.04	106,724,636.96

(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：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>胡明</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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安大华新鑫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[2014]第 668 号《关于核准平安大华新鑫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《平安大华新鑫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人民币 414,125,173.84 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 066 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 414,175,451.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 50,277.87 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《平安大华新鑫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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票,含普通股和优先股)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×50% + 中证全债指数收益率×50%。

## 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》、《平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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 2017 半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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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需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[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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	4,409,053.01
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	4,409,053.01
-----	--------------

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	37,977,012.11	39,963,797.34	1,986,785.23
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	37,977,012.11	39,963,797.34	1,986,785.23

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	24,000,000.00	-
合计	24,000,000.00	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	4,145.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	278.55
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-6,389.05
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	140.04
合计	-1,824.57

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	13,623.22
待摊费用	-
合计	13,623.22

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	267,400.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	267,400.02

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	151.27
预提费用	64,464.96
合计	64,616.23

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

新鑫先锋 A		
项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,641,084.01	72,641,084.01
本期申购	2,051,954.96	2,051,954.96
本期赎回(以“-”号填列)	-12,507,007.88	-12,507,007.88
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

本期末	62,186,031.09	62,186,031.09
-----	---------------	---------------

金额单位：人民币元

新鑫先锋 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,143,389.91	1,143,389.91
本期申购	73,727.28	73,727.28
本期赎回(以“-”号填列)	-223,688.76	-223,688.76
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	993,428.43	993,428.43

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

新鑫先锋 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,533,160.00	-1,885,405.24	4,647,754.76
本期利润	1,691,890.68	3,138,965.12	4,830,855.80
本期基金份额交易产生的变动数	-959,678.85	29,903.31	-929,775.54
其中：基金申购款	181,906.97	-14,840.74	167,066.23
基金赎回款	-1,141,585.82	44,744.05	-1,096,841.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,265,371.83	1,283,463.19	8,548,835.02

单位：人民币元

新鑫先锋 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	162,771.12	-104,272.90	58,498.22
本期利润	25,802.91	48,075.37	73,878.28
本期基金份额交易产生的变动数	-23,083.24	11,274.30	-11,808.94
其中：基金申购款	10,084.88	-4,897.16	5,187.72
基金赎回款	-33,168.12	16,171.46	-16,996.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	165,490.79	-44,923.23	120,567.56

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	105,710.02
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,178.57
其他	2,726.84
合计	115,615.43

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	443,475,833.17
减：卖出股票成本总额	440,518,533.84
买卖股票差价收入	2,957,299.33

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末无衍生工具收益/损失。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期末无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	505,476.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	505,476.63

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	3,187,040.49
——股票投资	3,187,040.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,187,040.49



**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,582.18
转换费收入 A 类 000739	117.82
合计	12,700.00

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对持续持有期少于 30 天的 A 类基金份额投资人收取的赎回费，100%归入基金资产；对持续持有期超过 30 天(含 30 天)但少于 90 天的 A 类基金份额投资人收取的赎回费，75%归入基金资产；对持续持有期超过 90 天(含 90 天)但少于 180 天的 A 类基金份额投资人收取的赎回费，50%归入基金资产；对持续持有期超过 180 天(含 180 天)的 A 类基金份额投资人收取的赎回费，25%归入基金资产；对 C 类基金份额投资人收取的赎回费 100%计入基金财产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,160,955.75
银行间市场交易费用	-
合计	1,160,955.75

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	34,712.18

银行间账户维护费	27,000.00
其他	600.00
合计	92,064.96

#### 6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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（“平安大华”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“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
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	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
上海陆金所资产管理有限公司（“陆金”	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基

所”)	金销售机构
-----	-------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	554,730.78	782,578.16
其中：支付销售机构的客户维护费	214,160.41	275,311.70

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人管理费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：

日管理人管理费 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	92,455.12	130,429.65

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 0.25% 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 X 0.25% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 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		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新鑫先锋 A	新鑫先锋 C	合计
平安大华基金管理有限 公司	-	1,788.75	1,788.75
上海陆金所资产管理有 限公司	-	426.90	426.90
合计	-	2,215.65	2,215.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	新鑫先锋 A	新鑫先锋 C	合计
平安大华基金管理有限 公司	-	2,387.01	2,387.01

上海陆金所资产管理有 限公司	-	1,585.81	1,585.81
合计	-	3,972.82	3,972.82

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 X 0.40%/ 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无运用自有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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-活期 存款	4,409,053.01	105,710.02	15,522,508.64	129,995.67

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，活期存款按银行同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 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
600795	国电电力	2017年6月5日	重大事项	3.60	-	-	98,500	347,705.00	354,600.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制订了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### 6.4.13.1 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行平安银行，因而与银行存款相关的信用风险较小。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.1.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末本基金未持有债券投资。

#### 6.4.13.1.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末本基金未持有债券投资。

### 6.4.13.2 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券

在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.3 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.3.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 6.4.13.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,409,053.01	-	-	-	-	-	4,409,053.01
结算备付金	687,808.66	-	-	-	-	-	687,808.66
存出保证金	345,897.13	-	-	-	-	-	345,897.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	39,963,797.34	39,963,797.34
买入返售金融资产	24,000,000.00	-	-	-	-	-	24,000,000.00



应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,232,171.29	7,232,171.29
应收利息	-	-	-	-	-	-1,824.57	-1,824.57
应收申购款	-	-	-	-	-	2,994.03	2,994.03
其他资产	-	-	-	-	-	13,623.22	13,623.22
资产总计	29,442,758.80	-	-	-	-	47,210,761.31	76,653,520.11
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,294,963.56	4,294,963.56
应付赎回款	-	-	-	-	-	75,530.98	75,530.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	87,246.95	87,246.95
应付托管费	-	-	-	-	-	14,541.17	14,541.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-	359.10	359.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	267,400.02	267,400.02
其他负债	-	-	-	-	-	64,616.23	64,616.23
负债总计	-	-	-	-	-	4,804,658.01	4,804,658.01
利率敏感度缺口	29,442,758.80	-	-	-	-	42,406,103.30	71,848,862.10
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	8,312,125.85	-	-	-	-	-	8,312,125.85
结算备付金	1,549,283.92	-	-	-	-	-	1,549,283.92
存出保证金	255,637.73	-	-	-	-	-	255,637.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	35,653,342.14	35,653,342.14
应收证券清算款	-	-	-	-	-	33,619,017.76	33,619,017.76
应收利息	-	-	-	-	-	812.30	812.30
应收申购款	-	-	-	-	-	16,955.84	16,955.84
资产总计	10,117,047.50	-	-	-	-	69,290,128.04	79,407,175.54
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	226,536.21	226,536.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	106,010.13	106,010.13

应付托管费	-	-	-	-	-	17,668.36	17,668.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	428.31	428.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	505,453.55	505,453.55
其他负债	-	-	-	-	-	60,352.08	60,352.08
负债总计	-	-	-	-	-	916,448.64	916,448.64
利率敏感度缺口	10,117,047.50	-	-	-	-	-68,373,679.40	78,490,726.90

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.3.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2016 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.3.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.3.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk)

指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

### 6.4.13.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	39,963,797.34	55.62	35,653,342.14	45.42
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	39,963,797.34	55.62	35,653,342.14	45.42

### 6.4.13.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	基金业绩比较基准增加 5%	6,364,989.19	5,216,450.01
	基金业绩比较基准减少 5%	-6,364,989.19	-5,216,450.01

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%

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### 6.4.13.1 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。

##### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 8 月 25 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	39,963,797.34	52.14
	其中：股票	39,963,797.34	52.14
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	24,000,000.00	31.31
	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	5,096,861.67	6.65
7	其他各项资产	7,592,861.10	9.91
8	合计	76,653,520.11	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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,150,647.34	36.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供	354,600.00	0.49

	应业		
E	建筑业	3,194,400.00	4.45
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	2,429,150.00	3.38
J	金融业	7,835,000.00	10.90
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	39,963,797.34	55.62

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内无港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601668	中国建筑	330,000	3,194,400.00	4.45
2	600566	济川药业	79,500	3,023,385.00	4.21
3	000333	美的集团	70,000	3,012,800.00	4.19

4	600000	浦发银行	230,000	2,909,500.00	4.05
5	000423	东阿阿胶	39,941	2,871,358.49	4.00
6	601628	中国人寿	100,000	2,698,000.00	3.76
7	600487	亨通光电	86,700	2,431,935.00	3.38
8	002555	三七互娱	95,000	2,429,150.00	3.38
9	603355	莱克电气	40,000	2,350,800.00	3.27
10	600837	海通证券	150,000	2,227,500.00	3.10
11	002466	天齐锂业	40,000	2,174,000.00	3.03
12	002456	欧菲光	105,000	1,907,850.00	2.66
13	002008	大族激光	50,000	1,732,000.00	2.41
14	603868	飞科电器	25,500	1,576,920.00	2.19
15	600887	伊利股份	70,000	1,511,300.00	2.10
16	002271	东方雨虹	35,000	1,298,500.00	1.81
17	600522	中天科技	100,000	1,205,000.00	1.68
18	600104	上汽集团	12,000	372,600.00	0.52
19	600795	国电电力	98,500	354,600.00	0.49
20	600079	人福医药	17,900	351,198.00	0.49
21	600519	贵州茅台	700	330,295.00	0.46
22	002206	海利得	95	705.85	0.00

## 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	000709	河钢股份	8,483,530.50	10.81
2	600066	宇通客车	7,991,776.70	10.18
3	002573	清新环境	7,847,302.00	10.00
4	603799	华友钴业	7,435,000.00	9.47

5	000400	许继电气	6,506,935.42	8.29
6	601628	中国人寿	6,155,481.00	7.84
7	600085	同仁堂	6,026,977.50	7.68
8	601117	中国化学	5,836,880.00	7.44
9	000768	中航飞机	5,759,946.28	7.34
10	000725	京东方 A	5,381,000.00	6.86
11	601933	永辉超市	5,251,883.00	6.69
12	000997	新大陆	5,195,396.27	6.62
13	002311	海大集团	5,144,271.62	6.55
14	002271	东方雨虹	5,076,735.99	6.47
15	600872	中炬高新	5,053,896.00	6.44
16	000636	风华高科	4,489,228.48	5.72
17	000333	美的集团	4,452,620.19	5.67
18	600566	济川药业	4,312,129.61	5.49
19	601618	中国中冶	4,294,786.00	5.47
20	601607	上海医药	4,269,381.00	5.44
21	002456	欧菲光	4,199,984.00	5.35
22	300275	梅安森	4,180,403.00	5.33
23	600887	伊利股份	3,993,647.00	5.09
24	002511	中顺洁柔	3,896,652.14	4.96
25	600585	海螺水泥	3,819,505.68	4.87
26	000928	中钢国际	3,743,429.12	4.77
27	300353	东土科技	3,722,459.00	4.74
28	300003	乐普医疗	3,702,990.00	4.72
29	600054	黄山旅游	3,682,584.99	4.69
30	601668	中国建筑	3,659,344.01	4.66
31	300232	洲明科技	3,626,025.63	4.62
32	300152	科融环境	3,624,377.92	4.62



33	002677	浙江美大	3,554,414.00	4.53
34	600522	中天科技	3,509,258.00	4.47
35	600038	中直股份	3,389,964.00	4.32
36	601233	桐昆股份	3,306,695.34	4.21
37	000797	中国武夷	3,276,761.50	4.17
38	600477	杭萧钢构	3,275,762.54	4.17
39	600518	康美药业	3,271,712.00	4.17
40	600787	中储股份	3,263,327.00	4.16
41	600297	广汇汽车	3,255,358.00	4.15
42	300136	信维通信	3,247,778.03	4.14
43	603868	飞科电器	3,224,255.00	4.11
44	600718	东软集团	3,210,287.01	4.09
45	600995	文山电力	3,125,000.00	3.98
46	300322	硕贝德	3,117,956.00	3.97
47	603686	龙马环卫	3,110,848.00	3.96
48	002303	美盈森	3,102,091.00	3.95
49	600742	一汽富维	3,063,931.95	3.90
50	601328	交通银行	3,050,000.00	3.89
51	601901	方正证券	3,045,366.00	3.88
52	002396	星网锐捷	3,044,880.00	3.88
53	002705	新宝股份	3,035,185.00	3.87
54	600688	上海石化	2,988,000.00	3.81
55	300015	爱尔眼科	2,980,987.92	3.80
56	600000	浦发银行	2,938,911.92	3.74
57	000066	中国长城	2,934,894.00	3.74
58	600019	宝钢股份	2,916,000.00	3.72
59	000878	云南铜业	2,906,955.70	3.70
60	300342	天银机电	2,882,808.30	3.67

61	000630	铜陵有色	2,862,000.00	3.65
62	002296	辉煌科技	2,861,996.00	3.65
63	600036	招商银行	2,858,400.00	3.64
64	600079	人福医药	2,844,891.00	3.62
65	600703	三安光电	2,838,943.00	3.62
66	002310	东方园林	2,835,428.54	3.61
67	600837	海通证券	2,811,894.04	3.58
68	002672	东江环保	2,801,492.98	3.57
69	000910	大亚圣象	2,765,672.08	3.52
70	300145	中金环境	2,760,228.00	3.52
71	000423	东阿阿胶	2,750,604.85	3.50
72	002450	康得新	2,741,270.06	3.49
73	002008	大族激光	2,740,268.00	3.49
74	002215	诺普信	2,715,986.00	3.46
75	002081	金螳螂	2,685,026.00	3.42
76	300383	光环新网	2,681,234.00	3.42
77	601333	广深铁路	2,678,400.00	3.41
78	002378	章源钨业	2,673,299.00	3.41
79	600160	巨化股份	2,643,835.00	3.37
80	002624	完美世界	2,641,554.00	3.37
81	002043	兔宝宝	2,590,742.00	3.30
82	000719	大地传媒	2,587,630.68	3.30
83	600587	新华医疗	2,564,954.00	3.27
84	300182	捷成股份	2,547,265.80	3.25
85	300347	泰格医药	2,545,133.00	3.24
86	000778	新兴铸管	2,539,575.19	3.24
87	600660	福耀玻璃	2,509,955.07	3.20
88	600565	迪马股份	2,484,219.00	3.16

89	002555	三七互娱	2,449,597.00	3.12
90	002127	南极电商	2,410,000.00	3.07
91	000712	锦龙股份	2,385,000.00	3.04
92	000546	金圆股份	2,370,697.00	3.02
93	601919	中远海控	2,351,000.00	3.00
94	002460	赣锋锂业	2,350,223.00	2.99
95	002739	万达电影	2,339,361.68	2.98
96	600885	宏发股份	2,330,911.00	2.97
97	603355	莱克电气	2,326,565.00	2.96
98	601718	际华集团	2,324,000.00	2.96
99	600879	航天电子	2,321,198.00	2.96
100	300144	宋城演艺	2,303,777.10	2.94
101	000811	烟台冰轮	2,297,265.00	2.93
102	002543	万和电气	2,249,597.00	2.87
103	600487	亨通光电	2,237,130.60	2.85
104	000063	中兴通讯	2,216,660.02	2.82
105	002466	天齐锂业	2,198,676.85	2.80
106	300316	晶盛机电	2,197,500.00	2.80
107	600428	中远海特	2,166,000.00	2.76
108	600185	格力地产	2,162,018.60	2.75
109	600871	石化油服	2,150,000.00	2.74
110	000402	金融街	2,138,186.20	2.72
111	000540	中天金融	2,136,789.00	2.72
112	600271	航天信息	2,130,000.00	2.71
113	000022	深赤湾A	2,112,000.00	2.69
114	300091	金通灵	2,104,759.50	2.68
115	002805	丰元股份	2,080,000.00	2.65
116	300583	赛托生物	2,018,483.59	2.57

117	601965	中国汽研	2,002,237.32	2.55
118	600516	方大炭素	1,926,000.00	2.45
119	300073	当升科技	1,914,843.70	2.44
120	300017	网宿科技	1,889,826.00	2.41
121	300525	博思软件	1,821,895.00	2.32
122	002611	东方精工	1,815,430.76	2.31
123	002745	木林森	1,707,688.00	2.18
124	600398	海澜之家	1,603,261.00	2.04

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	000709	河钢股份	10,703,124.27	13.64
2	603799	华友钴业	8,566,051.00	10.91
3	600066	宇通客车	8,160,411.50	10.40
4	002573	清新环境	7,904,893.63	10.07
5	000636	风华高科	6,478,069.75	8.25
6	000400	许继电气	6,321,631.28	8.05
7	600085	同仁堂	6,305,274.87	8.03
8	600038	中直股份	6,256,550.00	7.97
9	000725	京东方 A	5,765,300.00	7.35
10	000768	中航飞机	5,677,396.48	7.23
11	601117	中国化学	5,666,336.00	7.22
12	601933	永辉超市	5,588,000.00	7.12
13	000778	新兴铸管	5,452,556.00	6.95
14	002311	海大集团	5,293,655.29	6.74

15	000997	新大陆	5,281,461.48	6.73
16	600872	中炬高新	5,225,882.78	6.66
17	002064	华峰氨纶	4,825,082.00	6.15
18	601628	中国人寿	4,729,524.00	6.03
19	601607	上海医药	4,589,712.00	5.85
20	300275	梅安森	4,589,519.40	5.85
21	002271	东方雨虹	4,314,300.00	5.50
22	601618	中国中冶	4,202,000.00	5.35
23	600585	海螺水泥	4,039,330.00	5.15
24	002511	中顺洁柔	4,032,100.78	5.14
25	600477	杭萧钢构	3,948,791.01	5.03
26	300353	东土科技	3,937,557.00	5.02
27	300003	乐普医疗	3,796,722.65	4.84
28	300232	洲明科技	3,711,593.00	4.73
29	600054	黄山旅游	3,709,769.15	4.73
30	601857	中国石油	3,680,827.00	4.69
31	002677	浙江美大	3,614,923.28	4.61
32	600518	康美药业	3,575,619.00	4.56
33	300136	信维通信	3,531,038.44	4.50
34	601898	中煤能源	3,502,409.04	4.46
35	000797	中国武夷	3,434,700.00	4.38
36	601211	国泰君安	3,392,310.00	4.32
37	601233	桐昆股份	3,369,765.99	4.29
38	300152	科融环境	3,322,235.45	4.23
39	600787	中储股份	3,239,741.00	4.13
40	600995	文山电力	3,231,751.00	4.12
41	000928	中钢国际	3,210,993.64	4.09
42	600297	广汇汽车	3,178,705.70	4.05

43	600703	三安光电	3,177,345.35	4.05
44	601901	方正证券	3,172,573.00	4.04
45	300322	硕贝德	3,108,161.98	3.96
46	601328	交通银行	3,090,500.00	3.94
47	002450	康得新	3,055,460.98	3.89
48	300015	爱尔眼科	3,044,901.62	3.88
49	600036	招商银行	2,998,139.00	3.82
50	603686	龙马环卫	2,995,011.40	3.82
51	600019	宝钢股份	2,979,000.00	3.80
52	600688	上海石化	2,929,000.00	3.73
53	002303	美盈森	2,925,000.00	3.73
54	002396	星网锐捷	2,915,521.56	3.71
55	000878	云南铜业	2,884,273.75	3.67
56	600160	巨化股份	2,854,000.00	3.64
57	000630	铜陵有色	2,853,000.00	3.63
58	600887	伊利股份	2,851,721.00	3.63
59	002217	合力泰	2,844,583.49	3.62
60	000910	大亚圣象	2,816,046.66	3.59
61	300342	天银机电	2,814,707.00	3.59
62	002296	辉煌科技	2,802,791.00	3.57
63	002672	东江环保	2,773,568.00	3.53
64	002705	新宝股份	2,760,020.66	3.52
65	600718	东软集团	2,739,701.32	3.49
66	002378	章源钨业	2,730,726.22	3.48
67	000063	中兴通讯	2,712,878.34	3.46
68	600660	福耀玻璃	2,708,146.00	3.45
69	000875	吉电股份	2,698,482.00	3.44
70	600742	一汽富维	2,687,950.55	3.42

71	601009	南京银行	2,642,600.40	3.37
72	002215	诺普信	2,640,585.15	3.36
73	002081	金螳螂	2,632,823.80	3.35
74	300347	泰格医药	2,623,109.92	3.34
75	002456	欧菲光	2,613,718.50	3.33
76	002624	完美世界	2,592,510.00	3.30
77	300145	中金环境	2,591,954.40	3.30
78	002310	东方园林	2,561,100.00	3.26
79	000719	大地传媒	2,540,468.00	3.24
80	601333	广深铁路	2,523,000.00	3.21
81	300182	捷成股份	2,495,811.00	3.18
82	601919	中远海控	2,495,000.00	3.18
83	002460	赣锋锂业	2,468,077.00	3.14
84	300383	光环新网	2,456,551.08	3.13
85	000066	中国长城	2,425,838.93	3.09
86	600587	新华医疗	2,406,901.00	3.07
87	600565	迪马股份	2,399,951.00	3.06
88	000546	金圆股份	2,346,322.00	2.99
89	300144	宋城演艺	2,344,546.93	2.99
90	000712	锦龙股份	2,340,621.00	2.98
91	000333	美的集团	2,328,888.00	2.97
92	002543	万和电气	2,317,763.95	2.95
93	600079	人福医药	2,309,552.00	2.94
94	002127	南极电商	2,290,060.00	2.92
95	600879	航天电子	2,288,846.00	2.92
96	600428	中远海特	2,288,600.00	2.92
97	600522	中天科技	2,239,673.00	2.85
98	002739	万达电影	2,211,899.60	2.82

99	002043	兔 宝 宝	2,201,601.92	2.80
100	300316	晶盛机电	2,179,300.40	2.78
101	601718	际华集团	2,175,000.00	2.77
102	600885	宏发股份	2,106,000.00	2.68
103	601965	中国汽研	2,089,144.30	2.66
104	603868	飞科电器	2,066,030.00	2.63
105	000540	中天金融	2,046,000.00	2.61
106	000402	金 融 街	2,001,727.00	2.55
107	002805	丰元股份	1,997,211.00	2.54
108	000811	烟台冰轮	1,987,333.00	2.53
109	600516	方大炭素	1,970,303.00	2.51
110	300583	赛托生物	1,965,208.59	2.50
111	300073	当升科技	1,940,070.00	2.47
112	600871	石化油服	1,937,500.00	2.47
113	600030	中信证券	1,928,400.00	2.46
114	300091	金通灵	1,853,215.75	2.36
115	000022	深赤湾A	1,841,055.00	2.35
116	600185	格力地产	1,838,798.00	2.34
117	600271	航天信息	1,827,168.94	2.33
118	300525	博思软件	1,797,231.00	2.29
119	002142	宁波银行	1,767,515.61	2.25
120	600362	XD 江西铜	1,728,120.00	2.20
121	002611	东方精工	1,703,434.00	2.17
122	600566	济川药业	1,684,046.00	2.15
123	300017	网宿科技	1,666,735.00	2.12
124	601336	新华保险	1,609,249.00	2.05



**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	441,641,948.55
卖出股票收入（成交）总额	443,475,833.17

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买入或卖出金额（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**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**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**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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**

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**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投资。

**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**

本基金本报告期内无股指期货投资。

**7.10.2 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。

**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

海通证券股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 11 月 28 日收到中国证监会《行政处罚决定书》（编号：【2016】127 号）。因公司未按规定审查、了解客户真实身份，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，中国证监会决定：对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项对公司的盈利情况不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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	345,897.13
2	应收证券清算款	7,232,171.29
3	应收股利	-
4	应收利息	-1,824.57
5	应收申购款	2,994.03
6	其他应收款	13,623.22
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	7,592,861.10

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 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。

## § 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
新 鑫 先锋 A	3,017	20,611.88	0.00	0.00%	62,186,031.09	100.00%
新 鑫 先锋 C	41	24,229.96	0.00	0.00%	993,428.43	100.00%
合计	3,050	20,714.58	0.00	0.00%	63,179,459.52	100.00%

### 8.2 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	新鑫先锋 A	55,766.72	0.0897%
	新鑫先锋 C	119,074.49	11.9862%
	合计	174,841.21	0.2767%

### 8.3 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	新鑫先锋 A	0
	新鑫先锋 C	0

有本开放式基金	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	新鑫先锋 A	0
	新鑫先锋 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新鑫先锋 A	新鑫先锋 C
基金合同生效日（2015 年 1 月 29 日）基金份额总额	414,175,451.71	-
本报告期期初基金份额总额	72,641,084.01	1,143,389.91
本报告期基金总申购份额	2,051,954.96	73,727.28
减：本报告期基金总赎回份额	12,507,007.88	223,688.76
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	62,186,031.09	993,428.43

## § 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三十八次会议审议通过，由付强先生任职公司副总经理，任职日期为 2017 年 1 月 20 日。

2、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由李兆良先生、李娟娟女士、刘雪生先生、潘汉腾先生接替曹勇先生、刘茂山先生、郑学定先生、黄士林先生任职公司第三届董事会董事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

3、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由巢傲文先生、李峥女士接替张云平、毛晴峰先生为第三届监事会监事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

### 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	
天风证券	2	116,011,179.42	13.11%	82,518.17	12.91%	-
恒泰证券	2	94,619,195.77	10.69%	69,194.79	10.83%	-
中信建投	2	90,854,281.20	10.27%	64,624.72	10.11%	-
英大证券	1	60,333,146.74	6.82%	42,914.95	6.72%	-
方正证券	2	57,486,231.37	6.50%	40,889.99	6.40%	-
渤海证券	1	53,358,553.74	6.03%	37,954.07	5.94%	-
海通证券	2	47,513,778.72	5.37%	33,796.40	5.29%	-
长江证券	1	44,677,273.56	5.05%	31,779.11	4.97%	-
广发证券	2	38,123,529.27	4.31%	34,741.95	5.44%	-
中泰证券	1	31,617,194.29	3.57%	22,489.22	3.52%	-
安信证券	2	30,087,065.56	3.40%	21,400.97	3.35%	-
西南证券	1	29,867,389.08	3.38%	21,244.71	3.32%	-
东兴证券	2	29,164,805.81	3.30%	20,744.84	3.25%	-
华林证券	2	23,613,688.55	2.67%	16,796.07	2.63%	-
川财证券	1	19,759,808.88	2.23%	14,055.34	2.20%	新增
光大证券	2	19,440,032.26	2.20%	13,827.74	2.16%	-
华泰证券	2	18,079,405.92	2.04%	12,859.79	2.01%	-
国联证券	2	15,693,427.40	1.77%	11,163.15	1.75%	-
华创证券	2	12,444,010.00	1.41%	8,851.34	1.39%	-
银河证券	2	9,499,294.17	1.07%	6,756.70	1.06%	-
联讯证券	2	9,091,627.32	1.03%	6,466.81	1.01%	-



东北证券	5	9,075,796.50	1.03%	6,455.56	1.01%	新增
民生证券	1	6,297,562.84	0.71%	4,479.55	0.70%	-
财富证券	1	5,543,538.00	0.63%	3,943.07	0.62%	新增
万联证券	2	3,624,697.00	0.41%	2,578.25	0.40%	-
东方证券	1	3,427,850.00	0.39%	2,438.23	0.38%	-
兴业证券	1	2,661,185.00	0.30%	1,892.87	0.30%	-
申万宏源	2	1,852,051.00	0.21%	1,317.36	0.21%	-
国信证券	2	1,126,000.00	0.13%	800.94	0.13%	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	新增

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
天风证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-85,000,000.00	54.49%	-	-
英大证券	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-
海通证券	-	-24,000,000.00	15.38%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-
安信证券	-	-16,000,000.00	10.26%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-
华林证券	-	-25,000,000.00	16.03%	-	-
川财证券	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-
银河证券	-	-6,000,000.00	3.85%	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-

大通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	证券日报、公司网站	2017 年 1 月 19 日
2	关于旗下部分基金新增凤凰金信（银川）投资管理有限公司为销售机构及费率优惠的公告	证券日报、公司网站	2017 年 1 月 19 日
3	平安大华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、公司网站	2017 年 1 月 23 日
4	平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金招募说明书更新及摘要（2017 年第 1 期）	证券日报、公司网站	2017 年 3 月 14 日
5	平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金 2016 年年度报告及摘要	证券日报、公司网站	2017 年 3 月 30 日
6	关于旗下部分基金新增扬州国信嘉利投资理财有限公司为销售机构同时开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	证券日报、公司网站	2017 年 3 月 31 日
7	关于旗下部分基金新增深圳盈信基金销售有限公司为销售机构同时开通定投和转换	证券日报、公司网站	2017 年 4 月 17 日

	业务并参与其费率优惠的公告		
8	关于旗下部分基金新增苏州财路基金销售有限公司为销售机构的公告	证券日报、公司网站	2017 年 4 月 18 日
9	关于旗下部分基金新增上海好买基金销售有限责任公司为销售机构并开通定投转换业务并参与其费率优惠的公告	证券日报、公司网站	2017 年 4 月 24 日
10	平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	证券日报、公司网站	2017 年 4 月 24 日
11	关于旗下部分基金参加首创证券申购、定投申购费率优惠活动的公告	证券日报、公司网站	2017 年 4 月 26 日
12	关于旗下部分基金参与银河证券费率调整的公告	证券日报、公司网站	2017 年 5 月 25 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金的文件；
- 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、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安大华基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金公告的各项原稿。

### 11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>。

平安大华基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日