

# 平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	平安大华智能生活混合
场内简称	-
交易代码	002598
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 7 日
报告期末基金份额总额	57,394,674.00 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，重点投资与智能生活主题相关的优质证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	投资策略 本基金采取“灵活资产配置、主动投管理”的投资策略，一方面通过大类资产配置，降低系统性风险，把握市场波动中的投资机会；另一方面利用平安大华研究平台优势，重点研究、投资与智能生活主题相关的证券资产，构建在中长期能够从经济转型、产业升级中受益的投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低

	于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。	
基金管理人	平安大华基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安大华智能生活混合 A	平安大华智能生活混合 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	002598	002599
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	56,829,878.04 份	574,795.96 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）	
	平安大华智能生活混合 A	平安大华智能生活混合 C
1. 本期已实现收益	-418,841.76	-4,828.93
2. 本期利润	-2,865,886.81	-28,778.11
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0465	-0.0419
4. 期末基金资产净值	53,745,792.15	538,019.02
5. 期末基金份额净值	0.946	0.936

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安大华智能生活混合 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	-5.31%	0.77%	0.51%	0.44%	-5.82%	0.33%

平安大华智能生活混合 C

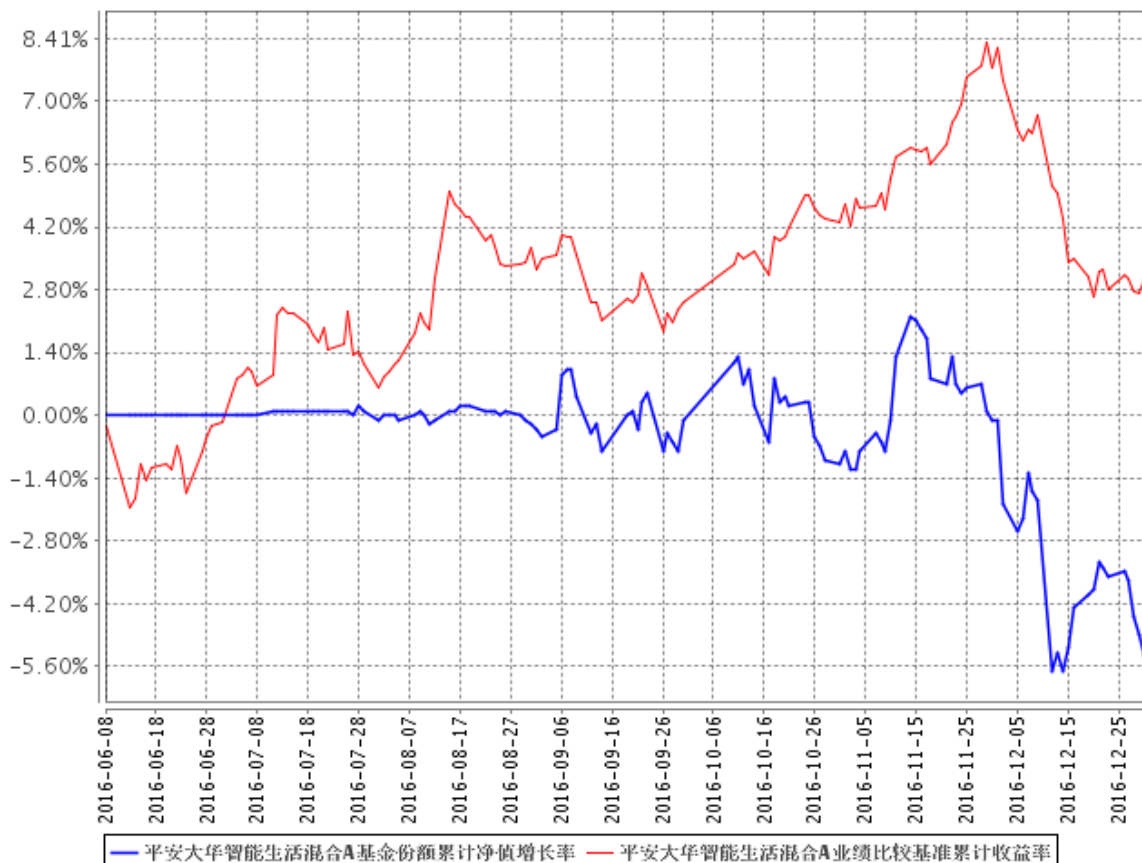
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个	-5.55%	0.77%	0.51%	0.44%	-6.06%	0.33%

月						
---	--	--	--	--	--	--

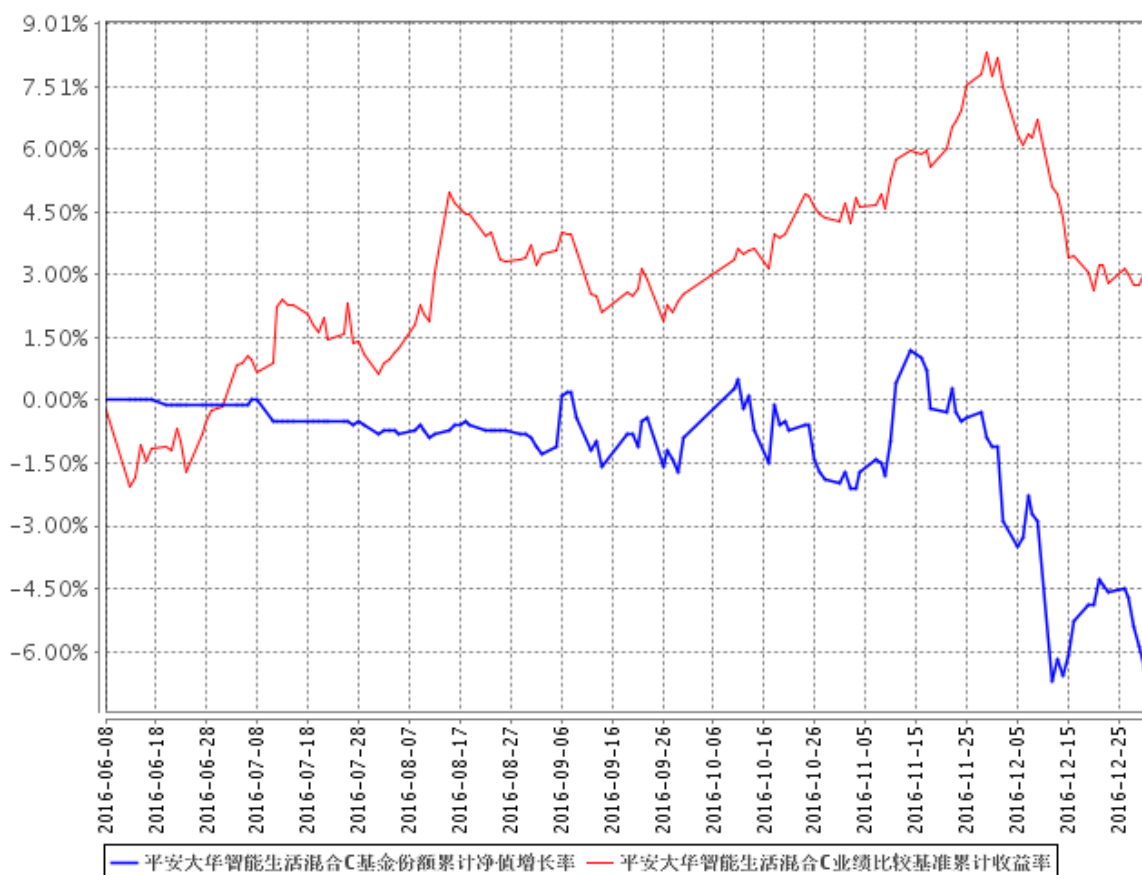
业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*60%+中证综合债指数收益率\*40%

### 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

平安大华智能生活混合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



平安大华智能生活混合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 2016 年 6 月 8 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。

### 3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙健	本基金的基金经理	2016 年 6 月 9 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。
神爱前	本基金的基金经理	2016 年 7 月 25 日	-	6	厦门大学财政学硕士，6 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、《平安大华智能生活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 A 股市场出现结构性的分化，银行等权重股出现了较大的上扬，带动沪深 300 指数出现一定的上扬，但代表成长方向的中小创却出现了较大的调整。本基金在上半季度逐渐加仓，使得前半季度的净值虽然没有跟上指数的涨幅，但也稳步上升。但下半季度在积累一定“安全垫”后，由于错误认为中小创会补涨，所以加仓布局了一些中小创股票，出现了一定幅度的回调，净值跌到 1 以下。

展望后市，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的下沿，2017 年一季度存在一定的反弹空间。2017 年的机会主要来自三个方面：首先是国企改革的机会。深改组再度讨论国企改革，随着央企第一批改革试点的推动，未来国企改革必将会稳步推进。2017 年的重点关注第二批央企改革试点以及地方的国企改革的推动；其次就是养老金入市的投资机会。预计养老金 17 年入市应该是大概率的事件，对市场风险偏好的提升无疑具有较大的意义，养老金配置的重点估计还是稳健蓝筹类，这类股票在 16 年曾有很好的表现，17 年应该也还会有很好的机会；第三个投资机会来自于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开始凸显，春节之后可以重点考虑中小创的超跌反弹的机会。2017 年的主要风险还是外围的汇率风险。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。

## 4.5 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 0.946 元，份额累计净值为 0.946 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-5.31%，同期业绩基准增长率为 0.51%。本基金 C 份额净值为 0.936 元，份额累计净值为 0.936 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-5.55%，同期业绩基

准增长率为 0.51%。

#### 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	49,276,240.80	89.83
	其中：股票	49,276,240.80	89.83
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	5,514,455.17	10.05
8	其他资产	62,918.73	0.11
9	合计	54,853,614.70	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	1,344,308.00	2.48
B	采矿业	2,201,093.00	4.05
C	制造业	29,841,608.80	54.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,313,340.00	4.26
F	批发和零售业	4,619,302.00	8.51
G	交通运输、仓储和邮政业	2,246,639.00	4.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,281,082.00	4.20
J	金融业	-	-

K	房地产业	2,210,143.00	4.07
L	租赁和商务服务业	2,218,725.00	4.09
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	49,276,240.80	90.78

### 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	601718	际华集团	277,100	2,552,091.00	4.70
2	002345	潮宏基	211,100	2,550,088.00	4.70
3	002622	融钰集团	165,600	2,414,448.00	4.45
4	600814	杭州解百	209,000	2,376,330.00	4.38
5	000018	神州长城	216,200	2,313,340.00	4.26
6	000400	许继电气	127,000	2,305,050.00	4.25
7	000997	新大陆	117,400	2,281,082.00	4.20
8	002519	银河电子	100,300	2,246,720.00	4.14
9	600787	中储股份	247,700	2,246,639.00	4.14
10	600826	兰生股份	82,100	2,242,972.00	4.13

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末无贵金属投资。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末无权证投资。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无股指期货投资。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末无股指期货投资。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末无国债期货投资。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无国债期货持仓。

**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	60,887.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,831.59
5	应收申购款	200.00

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,918.73

#### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600814	杭州解百	2,376,330.00	4.38	重大事项

#### 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	平安大华智能生活混合 A	平安大华智能生活混合 C
报告期期初基金份额总额	74,115,125.35	834,409.95
报告期期间基金总申购份额	1,199,568.24	56,351.92
减：报告期期间基金总赎回份额	18,484,815.55	315,965.91
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	56,829,878.04	574,795.96

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

平安大华智能生活混合 A

本基金管理人未运用固有资金投资本基金

平安大华智能生活混合 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智能生活混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 平安大华智能生活混合型证券投资基金基金合同
- (3) 平安大华智能生活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) 报告期内平安大华智能生活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、基金托管人住所

### 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