

# 平安大华保本混合型证券投资基金 2013 年 半年度报告

2013 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 27 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2013 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	34
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	34
7.10 投资组合报告附注.....	35
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>35</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36

<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>36</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>36</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件.....	38
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>39</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>39</b>
12.1 备查文件目录.....	39
12.2 存放地点.....	39
12.3 查阅方式.....	39

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华保本混合型证券投资基金
基金简称	平安大华保本混合
基金主代码	700004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 9 月 11 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
报告期末基金份额总额	735,994,429.70 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用投资组合保险技术，以保本期到期时本金安全为目标，通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增长和保本期收益的最大化。
投资策略	采用恒定比例组合保险策略（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）动态调整基金资产在稳健资产和风险资产的投资比例，以保证在保本期到期时基金资产净值不低于事先设定的目标，并在此基础上实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	肖宇鹏	田青
	联系电话	0755-22623179	010-67595096
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-800-4800	010-67595096
传真		0755-23997878	010-66275853
注册地址		深圳市福田区金田路大中华国际交易广场第八层	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场第八层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	杨秀丽	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
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、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
基金保证人	中国投资担保有限公司	北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9层
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场第八层

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	33,005,000.19
本期利润	30,633,660.46
加权平均基金份额本期利润	0.0362
本期加权平均净值利润率	3.44%
本期基金份额净值增长率	3.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	35,967,481.38
期末可供分配基金份额利润	0.0489
期末基金资产净值	775,466,210.27
期末基金份额净值	1.054
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.40%

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。

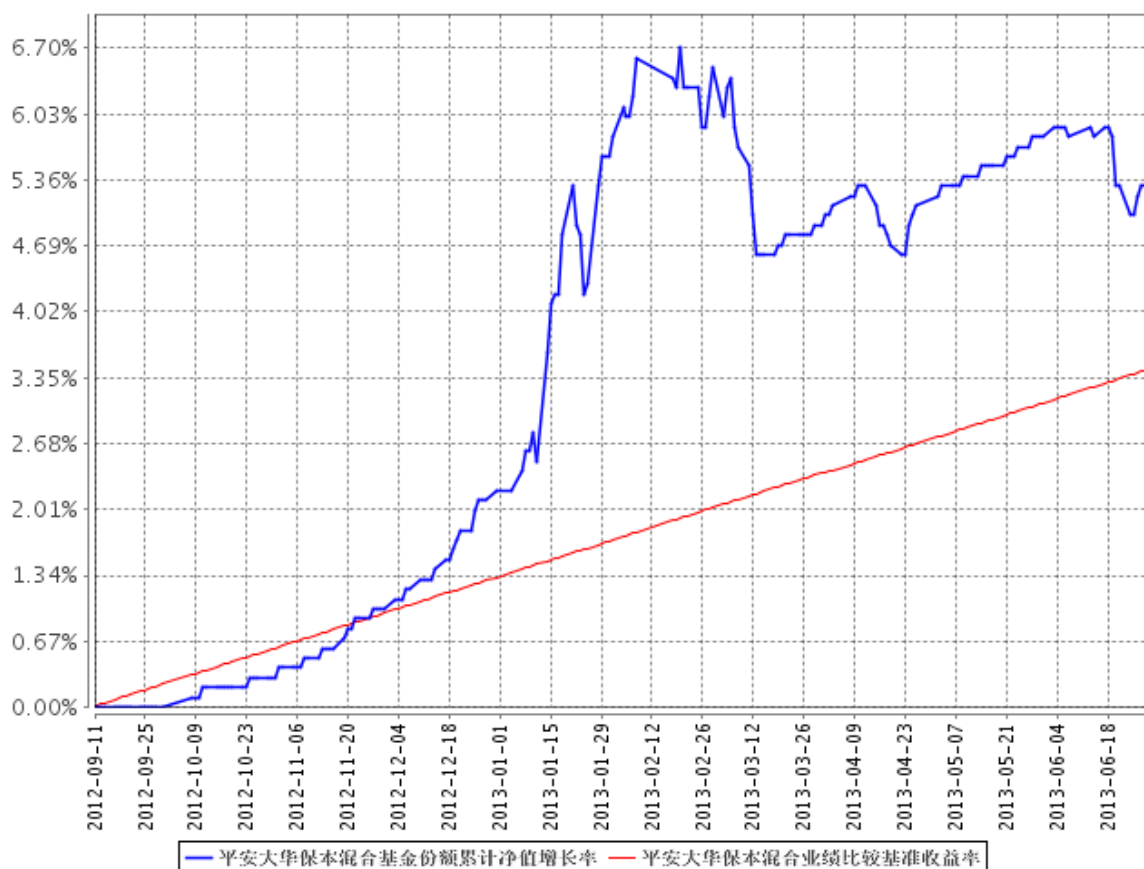
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	-0.38%	0.15%	0.34%	0.02%	-0.72%	0.13%
过去三个月	0.48%	0.11%	1.04%	0.01%	-0.56%	0.10%
过去六个月	3.13%	0.23%	2.08%	0.02%	1.05%	0.21%
自基金合同生效起至今	5.40%	0.18%	3.41%	0.01%	1.99%	0.17%

### 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

平安大华保本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



## § 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。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 2013 年 6 月 30 日，平安大华共管理 5 只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙健	基金经理	2012 年 9 月 11 日	-	12	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，任投资研究部固定收益研究员，现担任平安大华保本混合型证券投资基金基金经理、平安大华添利债券型证券投资基金

					金基金经 理。
--	--	--	--	--	------------

注：1、此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《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、《平安大华保本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。

### 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

2013 年上半年宏观经济基本确立了中长期放缓趋势，在此宏观背景下，本基金退出了权益市场，并未参与股票市场的波段操作，而相应增加了债券资产的配置比例。出于对未来流动性中性偏紧的判断，债券组合在保持原有信用债和短期流动性工具合理仓位的基础之上，加大了浮息债的投资比例，从而使得在此轮债券和权益市场大幅调整的情况下，基金净值仍保在持稳健的上升通道之中。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.054 元，份额累计净值为 1.054 元。报告期内，本基

金份额净值增长率为 3.13%，同期业绩基准增长率为 2.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为经过此番资金一役，管理层宏观调控思路更为清晰，防范金融风险、降低债务杠杆、进行存量调整、强调资金效率，而对经济增速放缓的容忍和对淘汰过剩产能的决心，使得经济未来 3 年的增长中枢将逐渐下移。在此背景下，我们依然看好债券的中长期投资价值，经济增速的下滑将压制债券收益率波动的上限，但与此同时，我们也需关注在流动性中长期外流、机构降低杠杆初期、利率市场化前段和经济结构转型过程中 CPI 的敏感度，可能会增加债券收益率的震荡区间。因此，未来本基金管理人将密切关注债券收益率波动的幅度，逐步择机增加长久期利率债券和高收益信用债券。对于权益投资，随着股指连续下挫，大盘蓝筹的估值越来越有优势，为中期投资提供了较好的机会。但由于下半年 IPO 开闸资金分流，宏观数据低迷，银行去杠杆刚开始，美元升值等不确定因素仍然较多，故对股票市场仍然保持谨慎态度。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部、运营部及监察稽核部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理，特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金基金合同的规定，本报告期内未进行利润分配。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

## 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

# § 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：平安大华保本混合型证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,225,198.73	8,498,001.66
结算备付金		604,887.15	1,029,387.41
存出保证金		584,607.75	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	707,376,900.00	1,001,257,457.60
其中：股票投资		-	21,315,000.00
基金投资		-	-
债券投资		707,376,900.00	979,942,457.60
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	47,600,162.75	70,000,000.00
应收证券清算款		-	19,720.83
应收利息	6.4.7.5	20,224,351.90	9,620,168.35
应收股利		-	-
应收申购款		19,718.01	155,861.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		784,635,826.29	1,090,830,596.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年6月30日</b>	<b>上年度末 2012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		-	99,999,650.00
应付证券清算款		91,016.79	6,864,309.65
应付赎回款		5,511,442.49	1,165,746.86
应付管理人报酬		790,252.51	1,002,908.36
应付托管费		131,708.76	167,151.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,112,480.65	161,320.51
应交税费		-	-
应付利息		-	109,789.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	532,714.82	327,843.00
负债合计		9,169,616.02	109,798,718.83
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	735,994,429.70	960,194,642.65
未分配利润	6.4.7.10	39,471,780.57	20,837,235.51
所有者权益合计		775,466,210.27	981,031,878.16
负债和所有者权益总计		784,635,826.29	1,090,830,596.99

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.054 元，基金份额总额 735,994,429.70 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安大华保本混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		40,769,959.13
1.利息收入		17,209,439.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	388,513.99
债券利息收入		16,020,812.85
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		800,112.30
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,687,631.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,786,233.67
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	27,457,237.97
资产支持证券投资收益		-

衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	16,627.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,371,339.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,244,228.22
<b>减：二、费用</b>		10,136,298.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,308,732.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	884,788.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,308,927.83
5. 利息支出		411,531.31
其中：卖出回购金融资产支出		411,531.31
6. 其他费用	6.4.7.19	222,317.91
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		30,633,660.46
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		30,633,660.46

注：本基金合同于 2012 年 9 月 11 日生效，因此无需披露比较数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华保本混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	960,194,642.65	20,837,235.51	981,031,878.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,633,660.46	30,633,660.46
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）	-224,200,212.95	-11,999,115.40	-236,199,328.35
其中：1.基金申购款	11,990,672.09	654,926.04	12,645,598.13
2.基金赎回款	-236,190,885.04	-12,654,041.44	-248,844,926.48
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）	735,994,429.70	39,471,780.57	775,466,210.27

注：本基金合同于 2012 年 9 月 11 日生效，因此无需披露比较数据。

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>李克难</u>	<u>林婉文</u>	<u>王彦</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

平安大华保本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]566号《关于核准平安大华保本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《平安大华保本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，首次募集期间为 2012 年 8 月 13 日至 2012 年 9 月 7 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,019,088,309.57 元，业经安永华明会计师事务所有限公司(2012)验字第 60937497\_B02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华保本混合型证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,019,276,286.73 份基金份额，其中认购资金利息折合 187,977.16 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华保本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，包括国内依法发行交易的债券、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）、权证、货币市场工具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。本基金在保本期内投资稳健资产占基金资产的比例不低于 60%；基金保留的现金或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%；投资风险资产占基金资产的比例不高于 40%；基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为每个保本期起始日的三年期银行定期存款税后收益率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体

会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 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

本基金本报告期无重大会计差错事项。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问



题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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 2013年6月30日	
	活期存款	8,225,198.73
定期存款	-	
其中：存款期限 1-3 个月	-	
其他存款	-	
合计：	8,225,198.73	

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
债券	交易所市场	320,032,605.47	322,089,900.00
	银行间市场	381,110,341.09	385,287,000.00
	合计	701,142,946.56	707,376,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	701,142,946.56	707,376,900.00	6,233,953.44

注：本年度本基金所投资的股票中，无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末无衍生金融资产/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 2013年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	28,500,162.75	-
买入返售证券_交易所	19,100,000.00	-
合计	47,600,162.75	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本期末无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 2013年6月30日
应收活期存款利息	6,427.59
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	244.98
应收债券利息	20,170,388.18
应收买入返售证券利息	47,054.36
应收申购款利息	-
其他	236.79
合计	20,224,351.90

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,108,431.84
银行间市场应付交易费用	4,048.81
合计	2,112,480.65

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	84,358.73
预提费用	198,356.09
合计	532,714.82

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	960,194,642.65	960,194,642.65
本期申购	11,990,672.09	11,990,672.09
本期赎回(以“-”号填列)	-236,190,885.04	-236,190,885.04
本期末	735,994,429.70	735,994,429.70

注：申购含红利再投、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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,430,252.11	8,406,983.40	20,837,235.51
本期利润	33,005,000.19	-2,371,339.73	30,633,660.46
本期基金份额交易产生的变动数	-9,467,770.92	-2,531,344.48	-11,999,115.40
其中：基金申购款	500,731.69	154,194.35	654,926.04
基金赎回款	-9,968,502.61	-2,685,538.83	-12,654,041.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,967,481.38	3,504,299.19	39,471,780.57

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	60,713.33
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	32,486.98
其他	4,901.38
合计	388,513.99

**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 2013年1月1日至2013年6月30日

卖出股票成交总额	1,094,192,506.70
减：卖出股票成本总额	1,096,978,740.37
买卖股票差价收入	-2,786,233.67

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,519,107,655.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,479,842,314.86
减：应收利息总额	11,808,102.22
债券投资收益	27,457,237.97

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,627.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,627.20

##### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,371,339.73
——股票投资	278,976.00
——债券投资	-2,650,315.73
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	-2,371,339.73

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	1,234,540.14
基金转换费收入	9,688.08
合计	1,244,228.22

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	3,300,177.83
银行间市场交易费用	8,750.00
合计	3,308,927.83

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52
银行间账户维护费	9,000.00
银行费用	14,961.82
合计	222,317.91

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 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，本基金无需做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	基金管理人
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券有限责任公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司
三亚盈湾旅业有限公司	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
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司	基金托管人

注：于本期，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

以下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

本基金合同于 2012 年 9 月 11 日生效，无上年度可比期间数据。

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
平安证券	1,301,729,064.18	60.00%

#### 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
平安证券	895,948,747.00	91.07%

#### 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
平安证券	1,024,100,000.00	81.14%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30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	1,185,092.50	60.65%	1,281,686.84	60.79%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

#### 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 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,308,732.79
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2) 本期末本基金未支付的管理费余额 790,252.51 元。



**6.4.10.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费	884,788.83	

注：1) 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2) 本期末本基金未支付的托管费余额 131,708.76 元。

**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**

本基金本报告期末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固有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**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。

**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 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	8,225,198.73	290,412.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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**

本报告期内无参与关联方承销证券的情况。

## 6.4.11 利润分配情况

### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2013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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 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 2013 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无债券作为质押。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 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

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金管理人制定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、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### 6.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，

以控制相应的信用风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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，不得超过该证券市值的 10%。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
A-1	29,994,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	189,988,000.00	100,035,000.00
合计	219,982,000.00	100,035,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

2、未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债和央票。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
AAA	-	102,168,890.35
AAA 以下	487,394,900.00	738,138,567.25
未评级	-	39,600,000.00
合计	487,394,900.00	879,907,457.60

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

2、未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金持有的交易性金融资产在证券交易商或银行间交易，本基金未持有具有重大流动性风险的投资品种。

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资金的处理模式，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每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员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。本基金所持部分证券在交易所上市，其余也可在银行间市场交易，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可回购交易的债券资产的公允价值。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、债券投资；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款等。

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，并通过对利率水平进行预测、分析收益率曲线及调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013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	8,225,198.73	-	-	-	-	-	8,225,198.73
结算备付金	604,887.15	-	-	-	-	-	604,887.15
存出保证金	584,607.75	-	-	-	-	-	584,607.75
交易性金	29,994,000.00	140,168,000.00	49,820,000.00	363,129.9	124,265.00	-	707,376,900.00

融资产	0			00.00	0.00		
买入返售 金融资产	47,600,162.75	-	-	-	-	-	47,600,162.75
应收利息	-	-	-	-	-	20,224,351.90	20,224,351.90
应收申购 款	-	-	-	-	-	19,718.01	19,718.01
资产总计	87,008,856.38	140,168,000.00	49,820,000.00	363,129,900.00	124,265,000.00	20,244,069.91	784,635,826.29
负债							
应付证券 清算款	-	-	-	-	-	91,016.79	91,016.79
应付赎回 款	-	-	-	-	-	5,511,442.49	5,511,442.49
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	790,252.51	790,252.51
应付托管 费	-	-	-	-	-	131,708.76	131,708.76
应付交易 费用	-	-	-	-	-	2,112,480.65	2,112,480.65
其他负债	-	-	-	-	-	532,714.82	532,714.82
负债总计	-	-	-	-	-	9,169,616.02	9,169,616.02
利率敏感 度缺口	87,008,856.38	140,168,000.00	49,820,000.00	363,129,900.00	124,265,000.00	-	-
上年度末 2012 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	8,498,001.66	-	-	-	-	-	8,498,001.66
结算备付 金	1,029,387.41	-	-	-	-	-	1,029,387.41
存出保证 金	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金 融资产	48,796,000.00	55,469,755.20	103,407,890.35	631,457,812.05	140,811,000.00	21,315,000.00	1,001,257,457.60
买入返售 金融资产	70,000,000.00	-	-	-	-	-	70,000,000.00
应收证券 清算款	-	-	-	-	-	19,720.83	19,720.83
应收利息	-	-	-	-	-	9,620,168.35	9,620,168.35
应收申购	99.40	-	-	-	-	155,761.74	155,861.14

款							
资产总计	128,323,488.47	55,469,755.20	103,407,890.35	631,457,812.05	140,811,000.00	31,360,650.92	1,090,830,596.99
负债							
卖出回购金融资产款	99,999,650.00	-	-	-	-	-	99,999,650.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6,864,309.65	6,864,309.65
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,165,746.86	1,165,746.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,002,908.36	1,002,908.36
应付托管费	-	-	-	-	-	167,151.41	167,151.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	161,320.51	161,320.51
应付利息	-	-	-	-	-	109,789.04	109,789.04
其他负债	-	-	-	-	-	327,843.00	327,843.00
负债总计	99,999,650.00	-	-	-	-	9,799,068.83	109,798,718.83
利率敏感度缺口	28,323,838.47	55,469,755.20	103,407,890.35	631,457,812.05	140,811,000.00	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2013年6月30日）	上年度末（2012年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-4,880,900.61	-6,271,631.73
市场利率下降 25 个基点	4,880,900.61	6,271,631.73	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

由于本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，截至 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的股票投资金额仅占基金净资产的 2.17%，因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	-	-	21,315,000.00	2.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	707,376,900.00	91.22	979,942,457.60	99.89
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	707,376,900.00	91.22	1,001,257,457.60	102.06

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	707,376,900.00	90.15
	其中：债券	707,376,900.00	90.15
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-

4	买入返售金融资产	47,600,162.75	6.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	8,830,085.88	1.13
6	其他各项资产	20,828,677.66	2.65
7	合计	784,635,826.29	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	600585	海螺水泥	39,581,392.57	4.03
2	600837	海通证券	35,661,840.67	3.64
3	000630	铜陵有色	32,771,125.22	3.34
4	600362	江西铜业	32,687,737.35	3.33
5	600166	福田汽车	31,010,567.29	3.16
6	002155	辰州矿业	29,039,153.62	2.96
7	600489	中金黄金	28,893,391.70	2.95
8	600547	山东黄金	28,836,684.68	2.94
9	000060	中金岭南	28,171,808.23	2.87
10	600497	驰宏锌锗	27,853,230.96	2.84
11	600030	中信证券	27,315,154.18	2.78
12	000401	冀东水泥	23,665,005.38	2.41
13	600739	辽宁成大	22,833,681.33	2.33
14	601088	中国神华	22,284,597.82	2.27
15	300039	上海凯宝	21,961,182.40	2.24
16	600801	华新水泥	20,486,896.74	2.09
17	600703	三安光电	19,809,118.23	2.02
18	600104	上汽集团	18,679,101.40	1.90
19	000960	锡业股份	16,746,024.89	1.71



20	600637	百视通	16,720,398.82	1.70
----	--------	-----	---------------	------

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	600585	海螺水泥	41,259,153.15	4.21
2	600837	海通证券	34,514,365.20	3.52
3	600362	江西铜业	34,026,067.74	3.47
4	000630	铜陵有色	33,673,402.02	3.43
5	600166	福田汽车	30,704,720.25	3.13
6	000060	中金岭南	29,858,235.48	3.04
7	600497	驰宏锌锗	28,375,905.93	2.89
8	600489	中金黄金	28,261,794.29	2.88
9	600547	山东黄金	27,213,145.96	2.77
10	600030	中信证券	26,914,294.88	2.74
11	002155	辰州矿业	26,059,530.47	2.66
12	000401	冀东水泥	24,783,811.77	2.53
13	300039	上海凯宝	23,420,040.90	2.39
14	000100	TCL 集团	22,877,906.23	2.33
15	601088	中国神华	22,294,075.54	2.27
16	600739	辽宁成大	21,607,123.94	2.20
17	600801	华新水泥	20,699,530.56	2.11
18	600703	三安光电	20,049,085.89	2.04
19	600104	上汽集团	18,600,955.15	1.90
20	000960	锡业股份	17,259,781.34	1.76

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,075,384,764.37
卖出股票收入（成交）总额	1,094,192,506.70

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	49,820,000.00	6.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,168,000.00	18.08
	其中：政策性金融债	140,168,000.00	18.08
4	企业债券	446,354,900.00	57.56
5	企业短期融资券	29,994,000.00	3.87
6	中期票据	41,040,000.00	5.29
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	707,376,900.00	91.22

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	130212	13 国开 12	1,400,000	140,168,000.00	18.08
2	112119	12 恒邦债	500,000	50,300,000.00	6.49
3	112121	12 景兴债	500,000	49,927,500.00	6.44
4	120019	12 付息国债 19	500,000	49,820,000.00	6.42
5	1282357	12 红豆 MTN2	400,000	41,040,000.00	5.29

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金未持有股指期货。

### 7.9.2 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。

## 7.10 投资组合报告附注

### 7.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.10.2

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。

### 7.10.3 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	584,607.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,224,351.90
5	应收申购款	19,718.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,828,677.66

### 7.10.4 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。

### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.10.6 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。

## § 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

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
7,647	96,246.17	5,981,207.54	0.81%	730,013,222.16	99.19%

## 8.2 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	47,601.70	0.0060%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年9月11日）基金份额总额	1,019,276,286.73
本报告期期初基金份额总额	960,194,642.65
本报告期基金总申购份额	11,990,672.09
减：本报告期基金总赎回份额	236,190,885.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	735,994,429.70

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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) 基金管理人的重大人事变动情况

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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

报告期内本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

### 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	
平安证券	1	1,301,729,064.18	60.00%	1,185,092.50	60.65%	-
中投证券	1	867,848,206.89	40.00%	768,825.73	39.35%	-

注：1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况；

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。

#### 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
平安证券	895,948,747.00	91.07%	1,024,100,000.00	81.14%	-	-
中投证券	87,839,334.70	8.93%	238,000,000.00	18.86%	-	-

注：本基金租用的证券公司交易单元本期无权证交易。

## 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	平安大华策略先锋混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年5月31日
2	平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年5月30日
3	平安大华策略先锋混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年3月29日
4	平安大华基金管理有限公司关于赎回平安大华行业先锋基金份额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年3月26日
5	平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年3月20日
6	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年1月12日
7	平安大华添利债券型证券投资基金参加代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年1月7日
8	平安大华添利债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华保本混合型证券投资基金的文件；
- 2、平安大华保本混合型证券投资基金基金合同；
- 3、平安大华保本混合型证券投资基金托管协议；
- 4、平安大华保本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、报告期内平安大华保本混合型证券投资基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区金田路大中华国际交易广场第八层

### 12.3 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  
2013 年 8 月 27 日