

平安大华保本混合型证券投资基金 2013 年 年度报告摘要

2013 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

送出日期：2014 年 3 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 27 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 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	540,596,503.42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，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	本基金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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-800-4800	010-67595096
传真		0755-23997878	010-66275853

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、基金托管人处

§ 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	2013 年	2012 年 9 月 11 日 (基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	45,847,251.08	12,778,120.43
本期利润	26,895,982.35	21,383,413.60
加权平均基金份额本期利润	0.0363	0.0214
本期基金份额净值增长率	2.35%	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0465	0.0129
期末基金资产净值	565,716,172.44	981,031,878.16
期末基金份额净值	1.046	1.022

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

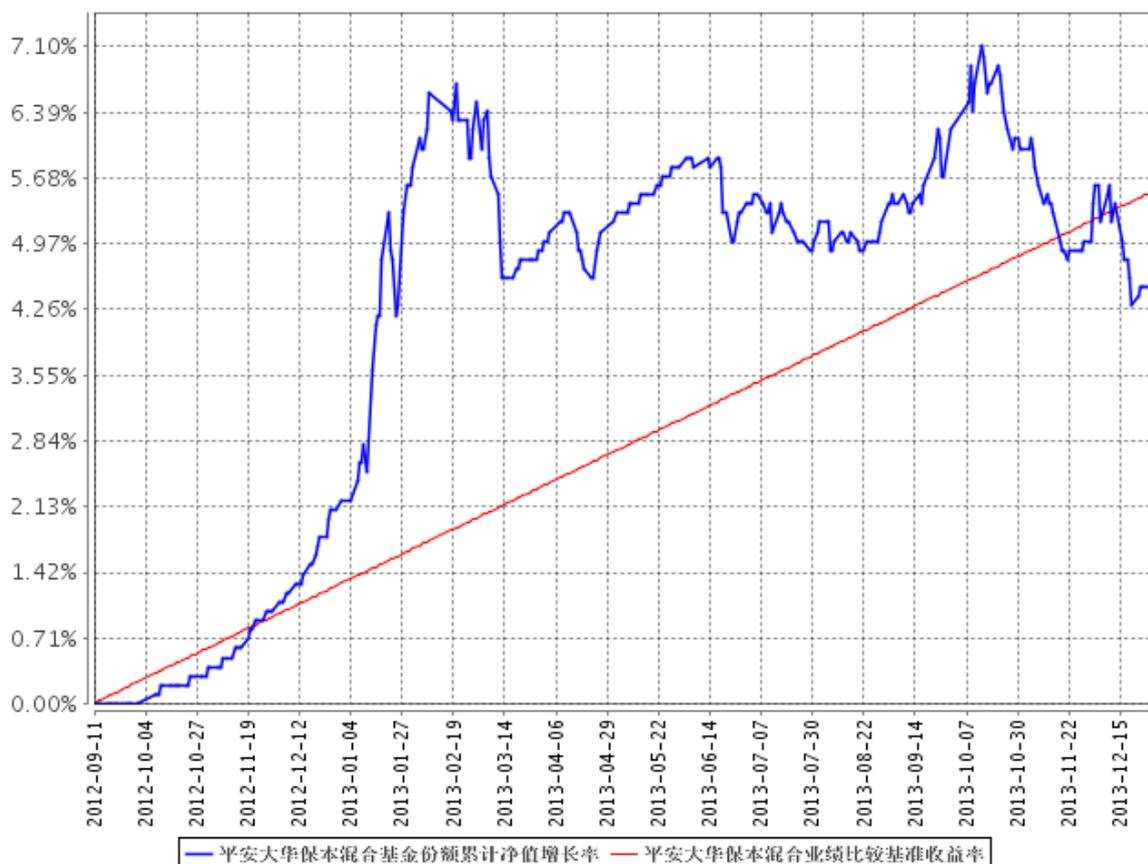
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.51%	0.19%	1.03%	0.01%	-2.54%	0.18%
过去六个月	-0.76%	0.16%	2.07%	0.01%	-2.83%	0.15%
过去一年	2.35%	0.20%	4.20%	0.01%	-1.85%	0.19%

自基金合同生效起至今	4.60%	0.18%	5.55%	0.01%	-0.95%	0.17%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

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。

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

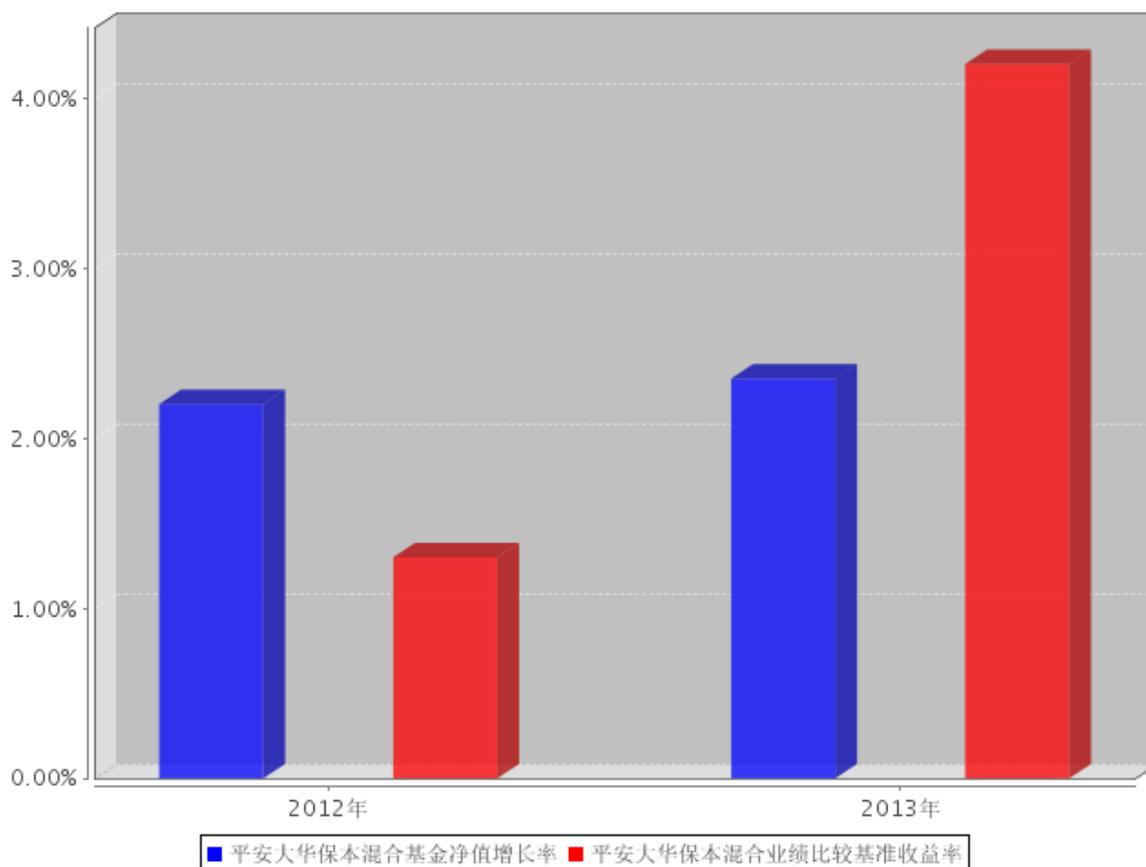
平安大华保本混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2012 年 9 月 11 日正式生效，截至报告期末已满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓。

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

平安大华保本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 9 月 11 日正式生效，截止报告期末已满一年。
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

本基金基金合同于 2012 年 9 月 11 日生效，合同生效日至本报告期末，未进行利润分配。

§ 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 2013 年 12 月 31 日，平安基金共管理六只开放式基金。

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

					券投资基金基金经理、平安大华日增利货币市场基金基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------

- 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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定并下发了《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

2013 年是政府换届以来经济预期变动最为剧烈的一年,从年初的复苏行情落空到二季度的经济下挫,三季度决策当局托底言论预期下的生产小幅扩张,四季度经济再度逐月下滑。2013 年的债券市场也走出了与传统基本面相悖的独立行情,流动性的持续冲击和创新产品对传统债券的挤压成为不同于以往的分析框架,其背后蕴含的逻辑是决策当局市场之手的结构调整和利率市场化大背景下金融机构的资产配置重分配。以年中钱荒为分界线,下半年利率债券收益率出现大幅度调整,中债国债总财富指数去年下半年跌幅为 4.72%,最高跌幅高达 5.58%,相较而言,信用债由于机构配置需求推动和收益率调整滞后,下半年仅下滑 2%左右。

本报告期基金管理人对权益市场的投资思路为波段操作,及时止盈,上半年出于对宏观经济中长期放缓的判断下退出了权益市场,下半年开始布局权益投资,逐步增加了股票和可转债的投资比例,4 季度适度增加了医药和军工板块的仓位,并从而使得本基金在纯债市场出现大幅调整的情况下净值仍获得稳健增长。

对于纯债投资,上半年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。下半年在利率债上行期间逐步增

持了中长期利率品种，以期在未来获取资本利得。但鉴于 4 季度收益率上行速度过快，并考虑到未来货币政策层面松动可能性不大，而流动性将长期保持中性偏紧的状态，从而使得利率债收益率下行存在一定的时间成本，因此本基金于 4 季度适度降低了利率债券的仓位进行止损操作。对于信用债而言，出于对经济长期偏弱和债务风险逐渐累积的判断，于下半年逐渐减仓，并缩短久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.046 元，份额累计净值为 1.046 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 2.35%，同期业绩基准增长率为 4.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三中全会确立了以市场资源配置为决定性作用的改革思路，金融改革和利率市场化加快势必加大金融机构资产和负债结构的调整，一切资源配置都会围绕市场价格为核心进行，在控制货币增量盘活存量的货币政策指导下，可以预期资金成本会逐步抬升，传统债券市场收益率受到创新产品、资产证券化、非标产品等资金分流的影响而处于不利地位，而标准化债券产品的供给却未能有效压缩下来，债券市场会受到资金波动和供给的双重压力，呈现弱市表现。

虽然利率债前期调整幅度较大，但风险释放后与其他债券投资品种相比风险收益保护较高，不确定的是在利率市场化程度逐步加深和资产多样化选择加剧的市场环境中，收益率高位盘整的持续时间和机会成本。因此我们不仅要关注短期资金成本的变化，还要关注目前高利率对实体经济运行的滞后反应，以及非标资产发行存续可能面临的监管环境、发行利率及规模增长的变化情况。对于信用债券而言，未来行业的信用风险和个券的信用波动将加大，差异化投资明显，我们需密切关注未来信用事件爆发和整体信用风险暴露的可能性，在此之前降低信用仓位，待信用风险释放后精选个券逐步加仓。对于权益投资，本基金管理人对整体市场继续谨慎的同时，对代表经济转型的行业继续保持乐观，重点关注军工、装备、医疗改革和消费升级行业。

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。公司监察稽核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。公司还通过网站、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。

§ 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 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	安永华明(2014)审字第 60937497_H04 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	平安大华保本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保本混合型证券投资基金财务报表,包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表,自 2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益(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基金管理人平安大华基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,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	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

	<p>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基金管理人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，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了平安大华保本混合型证券投资基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	吴翠蓉 周 刚
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2014 年 3 月 19 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		63,937,987.50	8,498,001.66
结算备付金		797,946.28	1,029,387.41
存出保证金		276,875.92	250,000.00
交易性金融资产		486,440,378.00	1,001,257,457.60
其中：股票投资		46,378.00	21,315,000.00
基金投资		-	-
债券投资		486,394,000.00	979,942,457.60
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		14,000,000.00	70,000,000.00

应收证券清算款		5,028,650.01	19,720.83
应收利息		5,710,784.00	9,620,168.35
应收股利		-	-
应收申购款		6,438.45	155,861.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		576,199,060.16	1,090,830,596.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		-	99,999,650.00
应付证券清算款		-	6,864,309.65
应付赎回款		5,976,970.75	1,165,746.86
应付管理人报酬		600,103.95	1,002,908.36
应付托管费		100,017.31	167,151.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,556,463.01	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		249,332.70	327,843.00
负债合计		10,482,887.72	109,798,718.83
所有者权益:			
实收基金		540,596,503.42	960,194,642.65
未分配利润		25,119,669.02	20,837,235.51
所有者权益合计		565,716,172.44	981,031,878.16
负债和所有者权益总计		576,199,060.16	1,090,830,596.99

注：(1) 报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.046 元，基金份额总额 540,596,503.42 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2012 年 9 月 11 日(基
-----	-----	-----------------------	------------------------------

	2013 年 12 月 31 日	金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
一、收入	45,108,595.13	26,419,182.90
1. 利息收入	32,005,460.03	12,292,122.42
其中：存款利息收入	673,712.60	2,321,862.99
债券利息收入	30,064,152.90	8,007,682.30
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,267,594.53	1,962,577.13
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	29,949,559.18	5,189,720.06
其中：股票投资收益	3,767,217.10	1,895,791.59
基金投资收益	-	-
债券投资收益	26,160,360.00	3,293,928.47
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	21,982.08	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-18,951,268.73	8,605,293.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,104,844.65	332,047.25
减：二、费用	18,212,612.78	5,035,769.30
1. 管理人报酬	9,422,648.22	3,664,146.61
2. 托管费	1,570,441.47	610,691.09
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,818,859.30	260,011.37
5. 利息支出	962,532.09	352,499.89
其中：卖出回购金融资产支出	962,532.09	352,499.89
6. 其他费用	438,131.70	148,420.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	26,895,982.35	21,383,413.60
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	26,895,982.35	21,383,413.60

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	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（本期净利润）	-	26,895,982.35	26,895,982.35
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）	-419,598,139.23	-22,613,548.84	-442,211,688.07
其中：1. 基金申购款	13,572,560.12	741,146.04	14,313,706.16
2. 基金赎回款	-433,170,699.35	-23,354,694.88	-456,525,394.23
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）	540,596,503.42	25,119,669.02	565,716,172.44
项目	上年度可比期间 2012年9月11日(基金合同生效日)至2012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）	1,019,276,286.73	-	1,019,276,286.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	21,383,413.60	21,383,413.60
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）	-59,081,644.08	-546,178.09	-59,627,822.17
其中：1. 基金申购款	1,558,050.69	17,574.73	1,575,625.42
2. 基金赎回款	-60,639,694.77	-563,752.82	-61,203,447.59
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）	960,194,642.65	20,837,235.51	981,031,878.16

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：

李克难
基金管理人负责人

林婉文
主管会计工作负责人

王彦
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（以下简称“中国建设银行”）。

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。

7.4.2 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2号《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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及自 2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错事项。

7.4.6 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；及根据财政部、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。

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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
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
平安证券有限责任公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司

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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年9月11日(基金合同生效日)至2012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	2,079,423,254.74	53.67%	106,102,074.70	61.85%

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12月31日		上年度可比期间 2012年9月11日(基金合同生效日)至2012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	1,074,919,525.37	68.40%	380,921,932.80	81.38%

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12月31日		上年度可比期间 2012年9月11日(基金合同生效日)至2012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
平安证券	1,733,600,000.00	74.26%	2,805,000,000.00	94.67%

7.4.8.1.2 权证交易

本报告期内无通过关联方进行的权证交易。

7.4.8.1.3 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	1,893,104.61	55.71%	1,989,698.95	56.01%
关联方名称	上年度可比期间 2012年9月11日(基金合同生效日)至2012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	96,594.34	62.52%	96,594.34	62.52%

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。

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 2013年1月1日至2013年12 月31日	上年度可比期间 2012年9月11日(基金合同生效日) 至2012年12月31日
	当期发生的基金应支付 的管理费	9,422,648.22
其中：支付销售机构的客 户维护费	3,896,441.34	1,619,371.22

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 为每日应支付的基金管理费

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 600,103.95 元。(2012 年 12 月 31 日：人民币 1,002,908.36)

元)

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 9 月 11 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,570,441.47	610,691.09

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 为每日应支付的基金托管费

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 100,017.31 元。(2012 年 12 月 31 日: 人民币 167,151.41 元)。

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无销售服务费。

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

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

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 9 月 11 日 (基金合同生效日) 至 2012 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
中国建设银行	3,937,987.50	541,615.17	8,498,001.66	253,607.64

注：1、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。

2. 本基金 2013 年由中国建设银行保管的定期存款按银行约定利率计息，利息收入为人民币 60,713.33 元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内无参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2013 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

本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
000625	长安汽车	2013 年 12 月 31 日	重大事项	11.45	2014 年 1 月 3 日	11.72	100	1,192.68	1,145.00	-

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

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2012 年 3 月 16 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	46,378.00	0.01
	其中：股票	46,378.00	0.01
2	固定收益投资	486,394,000.00	84.41
	其中：债券	486,394,000.00	84.41
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	14,000,000.00	2.43
	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	64,735,933.78	11.23
6	其他各项资产	11,022,748.38	1.91
7	合计	576,199,060.16	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,232.00	0.00
C	制造业	34,884.00	0.01
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	-	-

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	8,165.00	0.00
J	金融业	-	-
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	1,097.00	0.00
	合计	46,378.00	0.01

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	000333	美的集团	100	5,000.00	0.00
2	002230	科大讯飞	100	4,785.00	0.00
3	000895	双汇发展	100	4,708.00	0.00
4	002065	东华软件	100	3,380.00	0.00
5	300119	瑞普生物	100	2,542.00	0.00
6	002532	新界泵业	100	2,296.00	0.00
7	601808	中海油服	100	2,232.00	0.00
8	002250	联化科技	100	2,099.00	0.00
9	600271	航天信息	100	2,017.00	0.00
10	002152	广电运通	100	1,919.00	0.00

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	600056	中国医药	57,456,439.33	5.86
2	300183	东软载波	47,997,666.02	4.89
3	600585	海螺水泥	39,581,392.57	4.03
4	002369	卓翼科技	38,456,595.84	3.92
5	600309	万华化学	38,246,911.99	3.90
6	601808	中海油服	37,964,666.20	3.87
7	600837	海通证券	36,661,075.82	3.74
8	002532	新界泵业	33,644,368.12	3.43
9	000800	一汽轿车	32,885,499.83	3.35
10	600489	中金黄金	32,869,719.28	3.35
11	600547	山东黄金	32,815,177.73	3.34
12	000630	铜陵有色	32,771,125.22	3.34
13	600362	江西铜业	32,687,737.35	3.33
14	600166	福田汽车	31,310,157.29	3.19
15	002155	辰州矿业	29,039,153.62	2.96
16	600060	海信电器	28,415,795.45	2.90
17	600030	中信证券	28,313,908.55	2.89
18	000060	中金岭南	28,171,808.23	2.87
19	600497	驰宏锌锗	27,853,230.96	2.84
20	600739	辽宁成大	26,730,898.33	2.72
21	002065	东华软件	25,263,041.62	2.58
22	600406	国电南瑞	25,125,567.70	2.56
23	600820	隧道股份	24,459,445.86	2.49
24	600271	航天信息	23,687,763.23	2.41
25	000401	冀东水泥	23,665,005.38	2.41
26	601088	中国神华	23,283,369.15	2.37
27	300039	上海凯宝	21,961,182.40	2.24
28	002581	万昌科技	20,882,116.04	2.13
29	600801	华新水泥	20,486,896.74	2.09
30	601601	中国太保	20,126,606.37	2.05

31	600703	三安光电	19,809,118.23	2.02
----	--------	------	---------------	------

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。

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	600056	中国医药	55,389,873.32	5.65
2	300183	东软载波	49,735,789.26	5.07
3	600585	海螺水泥	41,259,153.15	4.21
4	600309	万华化学	39,153,235.69	3.99
5	002369	卓翼科技	38,925,973.74	3.97
6	601808	中海油服	37,563,946.90	3.83
7	600837	海通证券	35,506,443.64	3.62
8	002532	新界泵业	35,184,516.30	3.59
9	600362	江西铜业	34,026,067.74	3.47
10	000630	铜陵有色	33,673,402.02	3.43
11	600489	中金黄金	32,236,684.57	3.29
12	000800	一汽轿车	31,827,482.86	3.24
13	600547	山东黄金	31,201,255.08	3.18
14	600166	福田汽车	31,010,149.98	3.16
15	000060	中金岭南	29,858,235.48	3.04
16	600060	海信电器	28,808,133.10	2.94
17	600497	驰宏锌锗	28,375,905.93	2.89
18	600030	中信证券	27,909,200.84	2.84
19	000100	TCL 集团	27,697,696.23	2.82
20	002065	东华软件	26,333,248.98	2.68
21	002155	辰州矿业	26,059,530.47	2.66
22	600271	航天信息	25,691,971.84	2.62
23	600739	辽宁成大	25,542,992.94	2.60
24	600406	国电南瑞	25,429,089.64	2.59
25	000401	冀东水泥	24,783,811.77	2.53
26	600820	隧道股份	24,574,152.15	2.50
27	300039	上海凯宝	23,420,040.90	2.39
28	601088	中国神华	23,295,083.54	2.37
29	002581	万昌科技	21,274,854.39	2.17
30	600801	华新水泥	20,699,530.56	2.11
31	601601	中国太保	20,146,288.17	2.05

32	600703	三安光电	20,049,085.89	2.04
33	600525	长园集团	19,791,559.48	2.02

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	1,924,633,034.81
卖出股票收入（成交）总额	1,949,948,780.44

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

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	29,727,000.00	5.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	135,108,000.00	23.88
	其中：政策性金融债	135,108,000.00	23.88
4	企业债券	282,179,000.00	49.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	39,380,000.00	6.96
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	486,394,000.00	85.98

8.6 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	1,000,000	98,300,000.00	17.38
2	1280077	12 芜湖建投债	400,000	39,636,000.00	7.01
3	1282357	12 红豆 MTN2	400,000	39,380,000.00	6.96
4	122513	12 伟星集	400,000	39,200,000.00	6.93
5	130240	13 国开 40	400,000	36,808,000.00	6.51

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 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。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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情况。

8.10.2 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投资情况。

8.10.3 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情况。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 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	276,875.92
2	应收证券清算款	5,028,650.01
3	应收股利	-
4	应收利息	5,710,784.00
5	应收申购款	6,438.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,022,748.38

8.11.4 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转换债券。

8.11.5 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中未存在流通受限情况。

8.11.6 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
6,043	89,458.30	1,988,711.58	0.37%	538,607,791.84	99.63%

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	0.00	0.0000%

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。

§ 10 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	13,572,560.12
减：本报告期基金总赎回份额	433,170,699.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	540,596,503.42

§ 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) 基金管理人的重大人事变动情况

报告期内,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

基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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

本报告期内本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

本报告期内未有改聘为其审计的会计事务所的情况。报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所—安永华明会计师事务所有限公司 2013 年度审计的报酬为 80,000.00 元。目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 年。

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

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。

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		12,079,423,254.74	53.67%	1,893,104.61	55.71%	-
中投证券		11,315,486,039.18	33.95%	1,176,356.01	34.62%	-
华创证券	1	339,325,419.69	8.76%	232,405.62	6.84%	-
方正证券	2	140,347,101.64	3.62%	96,078.64	2.83%	-

注：1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元变更情况

报告期内新增 3 个交易单元：华创证券（上海 1 个）、方正证券（深圳 1 个）（上海 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	1,074,919,525.37	68.40%	1,733,600,000.00	74.26%	-	-
中投证券	474,135,276.84	30.17%	488,000,000.00	20.90%	-	-
华创证券	22,543,976.57	1.43%	30,000,000.00	1.29%	-	-
方正证券	-	-	83,000,000.00	3.56%	-	-

注：本基金租用的证券公司交易单元本期无权证交易。

平安大华基金管理有限公司
2014年3月28日