

平安大华保本混合型证券投资基金 2014 年 半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 26 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 2014 年 8 月 21 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 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	8
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合规守信情况的说明.....	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.....	11
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39

§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息	44
§12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	44
12.3 查阅方式.....	44

§ 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	383,100,133.81 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
注册地址		深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦酒店 01: 419	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区福华三路星河	北京市西城区闹市口大街 1 号

	发展中心大厦 5 楼	院 1 号楼
邮政编码	518048	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	http://www.fund.pingan.com
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
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼
基金保证人	中国投融资担保有限公司	北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦写字楼 9 层

§ 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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	18,540,793.43
本期利润	29,657,020.51
加权平均基金份额本期利润	0.0678
本期加权平均净值利润率	6.22%
本期基金份额净值增长率	4.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	37,525,275.43
期末可供分配基金份额利润	0.0980
期末基金资产净值	420,625,409.24
期末基金份额净值	1.098
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	9.80%

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。

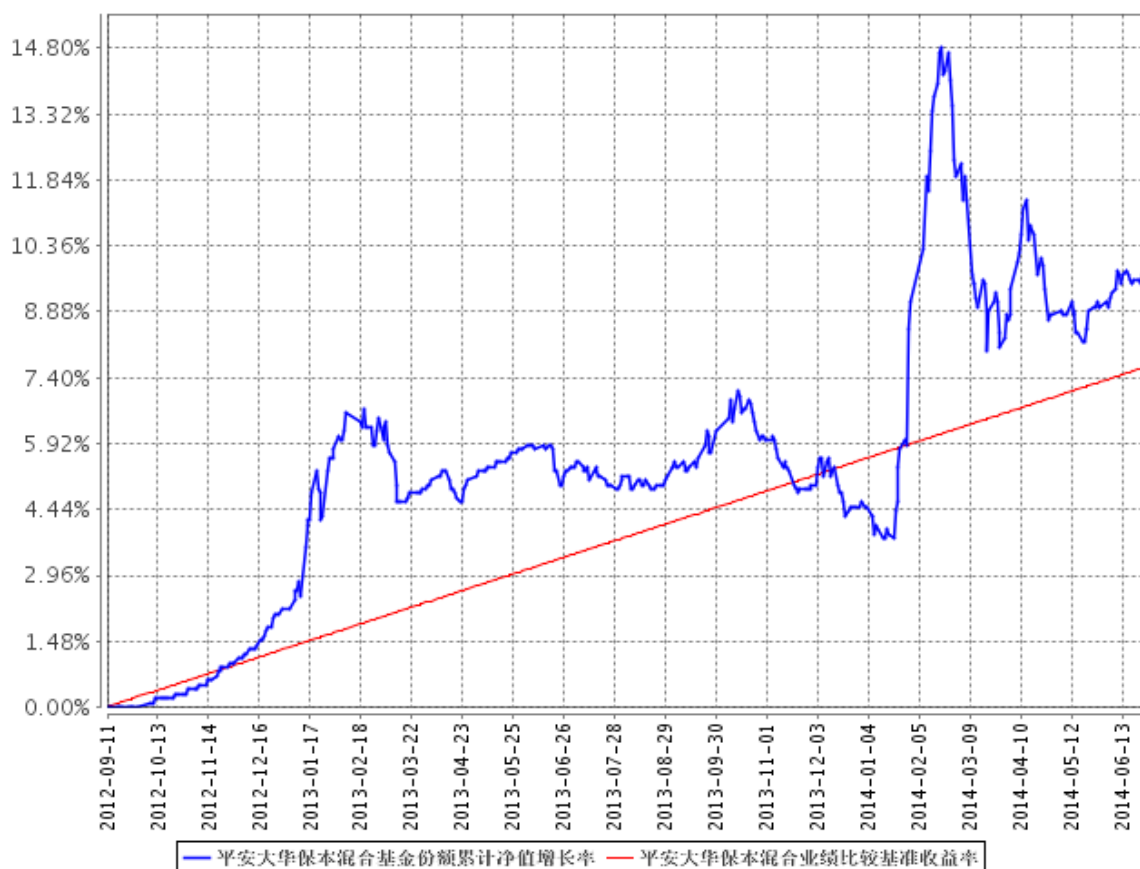
3.2 基金净值表现

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	0.73%	0.13%	0.34%	0.01%	0.39%	0.12%
过去三个月	1.39%	0.27%	0.99%	0.01%	0.40%	0.26%
过去六个月	4.97%	0.46%	2.00%	0.01%	2.97%	0.45%
过去一年	4.17%	0.34%	4.11%	0.01%	0.06%	0.33%
自基金合同生效起至今	9.80%	0.28%	7.66%	0.01%	2.14%	0.27%

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。建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 3 亿元人民币，是目前中国内地基金业注册资本金最高的基金公司之一。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 60.7%；新加坡

大华资产管理有限公司，持有股权 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。

平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2014 年 6 月 30 日，平安基金共管理 6 只开放式基金，资产管理总规模逾 66 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙健	基金经理	2012 年 9 月 11 日	-	13	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。

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。

4.3.2 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

2014 年新股开闸之后，本基金管理人在精选个股的基础上增加了新股申购资金，并及时锁定收益，推动 1 季度本基金收益出现了较大幅度的上涨。整体债券配置上，本基金度逐步减仓了利率债，并考虑到债券市场信用风险的逐渐暴露的判断，逐步减仓了信用债，同时提高了利率债在整个债券中的占比，整体债券仓位较年初降低。考虑到二季度政策稳增长带来的宽松预期与市场风险偏好的回升，本基金管理人在精选个券的基础上逐步增加了股票和可转债的仓位，导致期初基金收益出现一定波动。为了配合 2014 年二季度新股开闸，本基金管理人降低了整体债券仓位，增加了新股申购的可用资金，并积极参与了二季度的新股与可转债的申购。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.098 元，份额累计净值为 1.098 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 4.97%，同期业绩基准增长率为 2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年开年经济全面回落，一季度 GDP 增速仅 7.4%、低于政府 7.5% 目标。在此宏观背景下，决策当局重提稳增长，实施定向宽松措施，推动降低社会融资成本，二季度经济有所反弹，政策力保实现全年经济增长目标。在房地产处于下降周期的趋势下，政策在基建以及保障房等领域发力对冲整体投资增速下行，并取得一定效果。在此背景下本基金管理人预计稳增长措施对经济增长的效果将在下半年逐步释放。逆周期调控、全球经济回暖等因素下 GDP 环比有望保持稳健增长，全年预计将实现 7.5% 的增长。预计今年通胀将保持相对温和，货币政策将继续围绕定向宽松的方向，并且配合积极的财政政策与信贷政策。下半年风险点可能来自美债利率上升以及未来加息预期引导的资金回流。

基于上述判断，本基金管理人在资产配置上不再增加债券配置仓位，适度降低组合久期，同时继续保持低评级信用债仓位。在精选行业的基础上对于权益与可转债投资保持更积极的态度，大盘指数将在稳增长措施、货币维持相对宽松、调整结构、IPO 冲击较为温和的背景下有望获取正回报。

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：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	1,132,396.53	63,937,987.50
结算备付金		1,194,017.93	797,946.28
存出保证金		494,900.21	276,875.92
交易性金融资产	6.4.7.2	136,265,403.94	486,440,378.00
其中: 股票投资		21,900,582.16	46,378.00
基金投资		-	-
债券投资		114,364,821.78	486,394,000.00
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	87,650,413.78	14,000,000.00
应收证券清算款		197,043,709.52	5,028,650.01
应收利息	6.4.7.5	3,152,138.25	5,710,784.00
应收股利		-	-
应收申购款		3,075.01	6,438.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		426,936,055.17	576,199,060.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:			
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		-	-
应付赎回款		1,299,566.70	5,976,970.75
应付管理人报酬		419,472.14	600,103.95
应付托管费		69,912.01	100,017.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,337,405.79	3,556,463.01
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	184,289.29	249,332.70
负债合计		6,310,645.93	10,482,887.72
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	383,100,133.81	540,596,503.42
未分配利润	6.4.7.10	37,525,275.43	25,119,669.02
所有者权益合计		420,625,409.24	565,716,172.44

负债和所有者权益总计		426,936,055.17	576,199,060.16
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.098 元，累计份额净值 1.098，基金份额总额 383,100,133.81 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		35,995,837.83	40,769,959.13
1.利息收入		7,422,862.96	17,209,439.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	424,241.76	388,513.99
债券利息收入		6,634,572.15	16,020,812.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		364,049.05	800,112.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,773,566.57	24,687,631.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	34,240,187.96	-2,786,233.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-18,013,685.05	27,457,237.97
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	547,063.66	16,627.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,116,227.08	-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）	6.4.7.18	683,181.22	1,244,228.22
减：二、费用		6,338,817.32	10,136,298.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,851,598.90	5,308,732.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	475,266.51	884,788.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,645,564.13	3,308,927.83
5. 利息支出		164,597.66	411,531.31
其中：卖出回购金融资产支出		164,597.66	411,531.31
6. 其他费用	6.4.7.20	201,790.12	222,317.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,657,020.51	30,633,660.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填		29,657,020.51	30,633,660.46

列)			
----	--	--	--

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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	540,596,503.42	25,119,669.02	565,716,172.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,657,020.51	29,657,020.51
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）	-157,496,369.61	-17,251,414.10	-174,747,783.71
其中：1.基金申购款	5,638,916.26	625,785.88	6,264,702.14
2.基金赎回款	-163,135,285.87	-17,877,199.98	-181,012,485.85
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）	383,100,133.81	37,525,275.43	420,625,409.24
项目	上年度可比期间 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

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 2014 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2014 年 1 月 1 日至 2014 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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	1,132,396.53
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,132,396.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,565,331.43	21,900,582.16	335,250.73
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	88,974,560.99	89,362,321.78
	银行间市场	24,955,260.00	25,002,500.00
	合计	113,929,820.99	114,364,821.78
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	135,495,152.42	136,265,403.94	770,251.52

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 2014 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	87,650,413.78	-
合计	87,650,413.78	-

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 2014年6月30日
应收活期存款利息	39,501.95
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	483.89
应收债券利息	3,100,235.55
应收买入返售证券利息	11,716.43
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	200.43
合计	3,152,138.25

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 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,332,114.57
银行间市场应付交易费用	5,291.22
合计	4,337,405.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15,605.25

预提费用	168,684.04
合计	184,289.29

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	540,596,503.42	540,596,503.42
本期申购	5,638,916.26	5,638,916.26
本期赎回(以“-”号填列)	-163,135,285.87	-163,135,285.87
- 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	383,100,133.81	383,100,133.81

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	36,095,679.28	-10,976,010.26	25,119,669.02
本期利润	18,540,793.43	11,116,227.08	29,657,020.51
本期基金份额交易产生的变动数	-15,962,564.87	-1,288,849.23	-17,251,414.10
其中：基金申购款	579,980.07	45,805.81	625,785.88
基金赎回款	-16,542,544.94	-1,334,655.04	-17,877,199.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,673,907.84	-1,148,632.41	37,525,275.43

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 2014年1月1日至2014年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	18,720.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	18,860.47
其他	3,128.37
合计	424,241.76

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 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	1,015,247,554.81
减：卖出股票成本总额	981,007,366.85
买卖股票差价收入	34,240,187.96

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	632,150,146.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	639,760,115.72
减：应收利息总额	10,403,715.45
债券投资收益	-18,013,685.05

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

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**

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	547,063.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	547,063.66

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	11,116,227.08
——股票投资	334,320.20
——债券投资	10,781,906.88
——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	11,116,227.08

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	682,407.14
基金转换费收入	774.08
合计	683,181.22

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	2,640,976.63
银行间市场交易费用	4,587.50
合计	2,645,564.13

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	19,918.33
信息披露费	148,765.71
银行间账户维护费	18,400.00
银行费用	14,706.08
合计	201,790.12

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
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
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
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

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

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
平安证券有限	200,215,522.93	10.15%	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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
平安证券有限	10,078,016.44	2.97%	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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 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	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
平安证券有限	595,000,000.00	73.01%	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 2014年1月1日至2014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
平安证券有限 责任公司	182,275.56	13.08%	2,171,974.51	50.14%
关联方名称	上年度可比期间 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
平安证券有限 责任公司	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 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 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	2,851,598.90
其中：支付销售机构的客户维护费	919,524.49	-

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 419,472.14 元。

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	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	475,266.51		884,788.83	

注：1) 基金托管费按前一日基金资产净值的 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 69,912.01 元。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无销售服务费。

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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013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
深圳建行活期存款	1,132,396.53	383,532.92	8,225,198.73	290,412.45

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。

6.4.10.7 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。

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（2014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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	11,658	142,227.60	142,227.60	-

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 2014 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 2014 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股票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 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	25,002,500.00	128,027,000.00
合计	25,002,500.00	128,027,000.00

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 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	89,012,047.68	321,559,000.00

未评级	-	36,808,000.00
合计	89,012,047.68	358,367,000.00

- 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，有效保障基金份额持有人利益。

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。

本基金所持有的金融负债的合约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 2014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	1,132,396.53	-	-	-	-	-	1,132,396.53
结算备付 金	1,194,017.93	-	-	-	-	-	1,194,017.93
存出保证 金	494,900.21	-	-	-	-	-	494,900.21
交易性金 融资产	25,002,500.00	-	-	89,362,321.78	-	21,900,582.16	136,265,403.94
买入返售 金融资产	87,650,413.78	-	-	-	-	-	87,650,413.78
应收证券 清算款	-	-	-	-	-	197,043,709.52	197,043,709.52
应收利息	-	-	-	-	-	3,152,138.25	3,152,138.25
应收申购 款	298.21	-	-	-	-	2,776.80	3,075.01
资产总计	115,474,526.66	-	-	89,362,321.78	-	222,099,206.73	426,936,055.17
负债							
应付赎回 款	-	-	-	-	-	1,299,566.70	1,299,566.70
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	419,472.14	419,472.14
应付托管 费	-	-	-	-	-	69,912.01	69,912.01
应付交易 费用	-	-	-	-	-	4,337,405.79	4,337,405.79
其他负债	-	-	-	-	-	184,289.29	184,289.29
负债总计	-	-	-	-	-	6,310,645.93	6,310,645.93
利率敏感 度缺口	115,474,526.66	-	-	89,362,321.78	-	-	-
上年度末 2013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	63,937,987.50	-	-	-	-	-	63,937,987.50

结算备付金	797,946.28	-	-	-	-	-	797,946.28
存出保证金	276,875.92	-	-	-	-	-	276,875.92
交易性金融资产	29,727,000.00	137,936,000.00	-252,607,000.00	66,124,000.00	46,378.00	486,440,378.00	
买入返售金融资产	14,000,000.00	-	-	-	-	-	14,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	5,028,650.01	5,028,650.01	
应收利息	-	-	-	-	5,710,784.00	5,710,784.00	
应收申购款	595.01	-	-	-	5,843.44	6,438.45	
其他资产	-	-	-	-	-	-	
资产总计	108,740,404.71	137,936,000.00	-252,607,000.00	66,124,000.00	10,791,655.45	576,199,060.16	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	5,976,970.75	5,976,970.75	
应付管理人报酬	-	-	-	-	600,103.95	600,103.95	
应付托管费	-	-	-	-	100,017.31	100,017.31	
应付交易费用	-	-	-	-	3,556,463.01	3,556,463.01	
其他负债	-	-	-	-	249,332.70	249,332.70	
负债总计	-	-	-	-	10,482,887.72	10,482,887.72	
利率敏感度缺口	108,740,404.71	137,936,000.00	-252,607,000.00	66,124,000.00	-	-	

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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	158,269.84	2,226,863.73
	市场利率上升 25 个基点	-157,442.71	-2,199,321.67

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。

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 2014年6月30日		上年度末 2013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	21,900,582.16	5.21	46,378.00	0.01
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	114,364,821.78	27.19	486,394,000.00	85.98
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	136,265,403.94	32.40	486,440,378.00	85.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5% 其他市场变量保持不变		
	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)	
分析		本期末 (2014年6月30日)	上年度末 (2013年12月31日)
	权益性投资的市场价格上升 5%	1,095,029.11	-
	权益性投资的市场价格下降 5%	-1,095,029.11	-

6.4.14 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 2014 年 8 月 22 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	21,900,582.16	5.13
	其中：股票	21,900,582.16	5.13
2	固定收益投资	114,364,821.78	26.79
	其中：债券	114,364,821.78	26.79
	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	87,650,413.78	20.53
	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	2,326,414.46	0.54
7	其他各项资产	200,693,822.99	47.01
8	合计	426,936,055.17	100.00

7.2 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	20,205,569.32	4.80
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	142,227.60	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,549,296.24	0.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,045.00	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	1,444.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	21,900,582.16	5.21

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	600104	上汽集团	500,000	7,650,000.00	1.82
2	000800	一汽轿车	600,000	5,760,000.00	1.37
3	300039	上海凯宝	270,000	3,385,800.00	0.80
4	002701	奥瑞金	100,000	2,017,000.00	0.48
5	600270	外运发展	128,253	1,549,296.24	0.37
6	600741	华域汽车	100,000	978,000.00	0.23
7	300385	雪浪环境	15,852	406,762.32	0.10
8	002727	一心堂	11,658	142,227.60	0.03
9	600271	航天信息	100	2,087.00	0.00
10	002063	远光软件	100	2,045.00	0.00
11	000333	美的集团	100	1,932.00	0.00
12	600835	上海机电	100	1,558.00	0.00
13	601098	中南传媒	100	1,444.00	0.00
14	000063	中兴通讯	100	1,312.00	0.00
15	002185	华天科技	100	1,118.00	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	600372	中航电子	54,484,903.60	9.63
2	000333	美的集团	44,846,563.04	7.93
3	600271	航天信息	41,380,716.41	7.31
4	000625	长安汽车	36,950,638.83	6.53
5	601166	兴业银行	32,991,245.13	5.83
6	600089	特变电工	31,960,502.35	5.65
7	002048	宁波华翔	30,515,944.70	5.39
8	600104	上汽集团	27,210,460.02	4.81
9	300369	绿盟科技	26,819,043.00	4.74
10	600887	伊利股份	25,780,273.79	4.56
11	600583	海油工程	24,875,935.88	4.40
12	601668	中国建筑	23,002,774.45	4.07
13	601098	中南传媒	20,869,624.80	3.69
14	000063	中兴通讯	20,323,265.67	3.59
15	600690	青岛海尔	19,990,665.00	3.53
16	000895	双汇发展	18,644,781.72	3.30
17	002063	远光软件	17,421,041.74	3.08
18	600352	浙江龙盛	16,995,173.24	3.00
19	601808	中海油服	16,722,759.79	2.96
20	600522	中天科技	16,614,403.47	2.94
21	601888	中国国旅	16,047,507.98	2.84
22	002465	海格通信	16,021,061.87	2.83
23	002268	卫士通	15,984,006.02	2.83
24	000651	格力电器	14,994,295.60	2.65
25	000858	五粮液	13,992,689.37	2.47
26	002439	启明星辰	13,934,997.97	2.46
27	601169	北京银行	13,712,664.16	2.42
28	600060	海信电器	13,519,424.31	2.39
29	300360	炬华科技	13,229,706.60	2.34

30	000568	泸州老窖	12,995,161.11	2.30
31	002429	兆驰股份	12,932,065.59	2.29
32	601601	中国太保	12,819,609.86	2.27
33	002642	荣之联	12,116,524.37	2.14
34	600879	航天电子	11,531,474.78	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	300369	绿盟科技	60,207,668.21	10.64
2	000333	美的集团	47,214,973.70	8.35
3	600372	中航电子	44,235,872.65	7.82
4	600271	航天信息	43,679,340.83	7.72
5	000625	长安汽车	39,407,976.23	6.97
6	600089	特变电工	33,046,087.75	5.84
7	601166	兴业银行	32,943,593.58	5.82
8	002048	宁波华翔	32,319,015.70	5.71
9	600887	伊利股份	27,157,414.12	4.80
10	600583	海油工程	23,747,555.84	4.20
11	601668	中国建筑	23,177,923.00	4.10
12	600104	上汽集团	21,071,214.45	3.72
13	601098	中南传媒	20,675,411.70	3.65
14	000063	中兴通讯	20,495,828.93	3.62
15	600690	青岛海尔	20,421,903.36	3.61
16	600522	中天科技	18,204,040.45	3.22
17	002063	远光软件	17,638,243.20	3.12
18	002465	海格通信	17,247,475.59	3.05
19	601808	中海油服	16,996,410.42	3.00
20	600352	浙江龙盛	16,948,449.39	3.00
21	002268	卫士通	16,062,252.69	2.84
22	000895	双汇发展	16,016,969.71	2.83
23	601888	中国国旅	15,783,240.85	2.79
24	000651	格力电器	15,738,089.03	2.78
25	300360	炬华科技	15,619,335.18	2.76
26	002439	启明星辰	14,593,952.25	2.58
27	000858	五粮液	13,650,962.52	2.41

28	601169	北京银行	13,125,365.87	2.32
29	002642	荣之联	13,096,943.29	2.32
30	601601	中国太保	12,771,461.73	2.26
31	000568	泸州老窖	12,324,011.99	2.18
32	600060	海信电器	11,946,090.40	2.11
33	600879	航天电子	11,598,530.87	2.05

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	1,002,527,250.81
卖出股票收入（成交）总额	1,015,247,554.81

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	25,002,500.00	5.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	57,451,960.00	13.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	31,910,361.78	7.59
8	其他	-	-
9	合计	114,364,821.78	27.19

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

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	128005	齐翔转债	299,994	31,910,361.78	7.59
2	130014	13 付息国债 14	250,000	25,002,500.00	5.94
3	124043	12 深立业	230,340	22,803,660.00	5.42
4	112098	11 新野 02	200,000	19,700,000.00	4.68

5	112100	12 盾安债	100,000	9,950,000.00	2.37
---	--------	--------	---------	--------------	------

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。

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

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

7.12.2

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	494,900.21
2	应收证券清算款	197,043,709.52
3	应收股利	-
4	应收利息	3,152,138.25
5	应收申购款	3,075.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	200,693,822.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002727	一心堂	142,227.60	0.03	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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
4,835	79,234.77	1,988,711.58	0.52%	381,111,422.23	99.48%

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	0.00	0.0000%

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 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	540,596,503.42
本报告期基金总申购份额	5,638,916.26
减：本报告期基金总赎回份额	163,135,285.87
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	383,100,133.81

§ 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

2014年2月28日，经平安大华基金管理有限公司股东会审议通过，罗春风先生、聂丹女士出任董事，李克难先生、高鹏先生不再担任董事，张云平先生出任监事，叶素兰女士不再担任监事。

2014年3月4日，经平安大华基金管理有限公司职工代表大会选举，毛晴峰先生出任职工监

事，支琼女士不再担任职工监事。

2014 年 3 月 19 日，经平安大华基金管理有限公司董事会审议通过，李克难先生不再担任总经理，罗春风先生任代理总经理。

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

截止本报告期末，聘用安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。根据平安集团审计的统一安排，平安大华基金管理有限公司第二届董事会第八次会议决议，2014 年 7 月 22 日改聘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，本次变更符合法律法规的要求，并履行了必要的程序。

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	
方正证券	2	1,117,087,009.98	56.65%	762,708.17	54.74%	-
华创证券	1	505,822,672.75	25.65%	346,438.46	24.86%	-
平安证券	1	200,215,522.93	10.15%	182,275.56	13.08%	-
长城证券	1	148,866,344.21	7.55%	101,959.06	7.32%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

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 1 个交易单元：长城证券（深圳 1 个）。

2、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

3、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

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
方正证券	262,526,316.33	77.39%	220,000,000.00	26.99%	-	-
华创证券	35,037,323.17	10.33%	-	-	-	-
平安证券	10,078,016.44	2.97%	595,000,000.00	73.01%	-	-
长城证券	31,573,764.12	9.31%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

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	平安大华基金管理有限公司 2013 年 12 月 31 日基金净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 1 月 1 日
2	平安大华保本混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及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	2014 年 1 月 28 日
3	平安大华保本混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及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	2014 年 2 月 10 日

4	平安大华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年3月21日
5	平安大华基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票荣之联(002642)估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年3月29日
6	平安大华基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年4月18日

§ 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

深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

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
2014 年 8 月 26 日