平安大华深证300指数增强型证券投资基金

【2012】第一季度报告

基金管理人:平安大华基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年4月25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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月20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2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华深证300指数增强
交易代码	700002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
报告期末基金份额总额	120,084,127.37份
投资目标	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过指数复制的方法拟合、跟踪深证300指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过全样本复制的方式拟合、跟踪深证300指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理。以有效降低基金运作成本并提高本基金的投资收益率。 其中指数复制策略采用全样本复制的方式,即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合以拟合标的指数的业绩表现。股票增强策略在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上,捕以有限度的增强操作及一级市场股票投资,以求获取超越标的指数的收益率表现。
业绩比较基准	深证300指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时,本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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

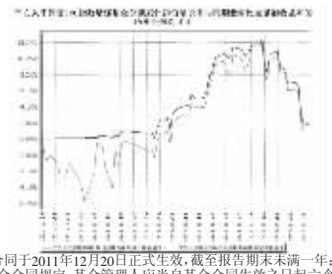
主要财务指标	报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日)
1.本期已实现收益	7,163,149.41
2.本期利润	-3,434,967.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0289
4.期末基金资产净值	113,465,610.81
5.期末基金份额净值	0.945

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

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	1.77%	0.97%	4.17%	1.69%	-2.40%	-0.72%

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



注:1、本基金基金合同于2011年12月20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尚未完成建仓。

3.3 其他指标

单位:人民币元

§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		
焦巍	基金经理	2011年12月20日	-	10	1994年起先后在中国银行、光大银行、湘财证券、汉唐证券、海马投资股份有限公司工作。2009年加入平安大华基金公司,任投资研究部宏观策略研究员,现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券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、平安大华深证300指数增强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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

注:本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4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

一季度A股市场先在对经济探底的阴影下延续去年年底的惯性下跌,又在外围风险溢价水平大幅下降以及对政策放松和制度红利的期盼下出现大幅上扬,最终在对经济数据证伪和政策放松不及预期的担心中短期回落,呈现宽幅震荡但底部抬高的走势。区间内上证指数上涨2.88%,沪深300指数上涨4.65%,本基金的基准深证300指数上涨4.34%。在一季度的宽幅震荡行情中,深证300指数充分体现出高β的特点,在期初和期末的下跌行情中远远落后于上证指数,在中期的上涨行情中则迅速超越上证指数。

由于本基金在年初处于起始建仓期,期初的表现和比较基准呈现出较大的波动差异,尽管避免了期初比较基准大幅下滑的风险,也部分错失了其后比较基准迅速上扬的收益。在季度中期,本基金加大了建仓力度,基本保持了与基准的一致性。但由于建仓期初始阶段对比较基准跟踪程度的把握不够,造成本基金区间内表现总体落后于基准业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年3月31日,本基金份额净值为0.945元,份额累计净值为1.025元。报告期内,本基金份额净值增长率为1.77%,同期业绩基准增长率为4.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为目前的经济处于衰退末期和弱复苏前期的混沌阶段。从全年来看,我们对经济的判断是"利涉大川",即经济的软着陆确定无疑,目前的经济寻底过程不代表库存周期的无限延长。经济的环比低点有可能在一季度已经出现,同比低点则可能出现在二季度与三季度之间。从经济增长的季节分布情况来看,今年可能呈现"I"型的弱复苏走势,既不会有08年的大幅下滑,也难以出现09年的强势"V"型复苏。企业盈利的低点在一季度已经出现,在二季度则可能由于产销率和库存周期重启而有所恢复。与09年复苏时的背景不同的是,今年政策的重点将转向结构调整和长远的制度改革。从中长期的角度来看,宏观经济将不再取决与财政与货币政策放松的力度和经济反转的程度,而是在经济找到平稳增长底部的时机和制度性红利的释放。

我们认为证券市场的走势并不只是经济增长率的简单映射。相反,发达国家的历史经验表明,在经济高速增长期的资本市场往往表现平平,在经济增长挺过台阶式下降的考验,找到结构转型的平衡点后展开一轮牛市进程。因此,我们对今年资本市场的判断是"见龙在田"。即市场已经处在底部的形成阶段,并且在为展开新一轮行情进行逐步的准备。但牛市的真正启动需要实质性制度红利的释放,以及经济库存周期向上的重启。而二季度的不利因素则需要考虑以下几点:一是出现美国经济复苏低于预期、欧债危机发展等因素造成外围市场风险溢价水平重新上升;二是今年政策放松的被动性和相对滞后性造成市场的心理预期波动。但总体来说,我们认为上述不利因素将主要体现为上行通道的复杂性,而不会改变市场震荡上行的总体趋势。

鉴于以上判断,本基金在操作思路上对仓位基本保持在上限区间。增强部分对行业配置则以地产、券商的早周期行业和高β行业为主,同时沿着美国经济复苏的主线配置收益性较高的电子行业。

§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	107,351,682.89	92.14
	其中:股票	107,351,682.89	92.14
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	8,971,727.74	7.70
6	其他资产	179,830.55	0.15
7	合计	116,503,241.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	1,536,327.00	1.35
B	采掘业	4,838,979.08	4.26
C	制造业	58,391,683.97	51.46
C0	食品、饮料	10,409,448.02	9.17
C1	纺织、服装、皮毛	1,116,208.62	0.98
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	585,869.36	0.52
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,268,012.05	5.52
C5	电子	4,783,403.61	4.22
C6	金属、非金属	10,381,284.50	9.15
C7	机械、设备、仪表	17,860,141.98	15.74
C8	医药、生物制品	6,672,256.23	5.88
C99	其他制造业	315,059.60	0.28
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,363,755.99	1.20
E	建筑业	937,094.00	0.83
F	交通运输、仓储业	780,531.77	0.69
G	信息技术业	4,316,216.66	3.80
H	批发和零售贸易	5,071,306.64	4.47
I	金融、保险业	6,351,147.27	5.60
J	房地产业	8,626,275.85	7.60
K	社会服务业	2,331,910.22	2.06
L	传播与文化产业	1,119,116.64	0.99
M	综合类	2,214,974.04	1.95
	合计	97,879,319.13	86.26

5.2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	978,363.76	0.86
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	978,363.76	0.86
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	5,017,000.00	4.42
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	3,477,000.00	3.06
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	9,472,363.76	8.35

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

5.3.1报告期末指数投资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	000002	万 科A	474,870	3,931,923.60	3.47
2	000858	五 粮 液	98,909	3,248,171.56	2.86
3	000651	格力电器	118,566	2,410,446.78	2.12
4	002024	苏宁电器	239,298	2,333,155.50	2.06
5	600036	招商银行	193,848	2,306,791.20	2.03
6	000157	中联重科	226,811	1,964,183.26	1.73
7	000063	中兴通讯	103,337	1,697,826.91	1.50
8	002304	洋河股份	10,526	1,548,900.90	1.37
9	000568	泸州老窖	38,136	1,490,736.24	1.31
10	000527	美的电器	99,631	1,307,158.72	1.15

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600030	中信证券	300,000	3,477,000.00	3.06
2	600406	国电南瑞	100,000	3,157,000.00	2.78
3	600100	同方股份	200,000	1,860,000.00	1.64
4	600372	中航电子	30,000	722,100.00	0.64
5	000049	德赛电池	9,902	256,263.76	0.23

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-

5.5 报告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

注: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名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,317.79
5	应收申购款	177,512.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	179,830.55

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金报告期末积极投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	417,710,046.22
本报告期基金总申购份额	94,215,834.07
减:本报告期基金总赎回份额	391,841,752.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	120,084,127.37

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 报告期内本基金进行2012年第一次分红,本次分红每10份基金份额派发红利0.8元,权益登记日为3月2日,除息日为3月2日,现金红利发放日为3月5日。指定媒体公告时间为2012年2月29日。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1)中国证监会批准平安大华深证300指数增强型证券投资基金设立的文件

2)平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金合同

3)平安大华深证300指数增强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)报告期内平安大华深证300指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

8.3 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
2012年4月25日

平安大华行业先锋股票型证券投资基金

【2012】第一季度报告

基金管理人:平安大华基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年4月25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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月20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2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华行业先锋股票
交易代码	700001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月20日
报告期末基金份额总额	2,281,310,490.94份
投资目标	深入研究中国宏观经济、证券市场发展过程中的结构性和趋势性规律,把握不同行业在此变化趋势中可行的投资机会,以超越业绩比较基准表现为首要投资目标,并以追求基金资产的长期稳健回报为最终投资目标。
投资策略	从全球、区域的宏观层面(经济增长、通货膨胀和利息的预期)出发,依据工业增加值与CPI的变动划分经济周期的不同阶段(复苏、扩张、滞涨、萧条)。同时,将行业非系统风险均值与其分布的GINI系数结合运用,全面准确地判断大类资产风险程度和收益前景,统筹考量短、中、长期资产配置比例。股票投资在投资时钟策略基础上秉持自下而上选股理念,精选有成长潜力的优质股票构建投资组合。债券投资以目标久期管理和品种选择策略为主,以收益率利差策略、债券置换策略为辅,构造能获取稳定收益的固定收益类投资品种组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×85% + 中证全债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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

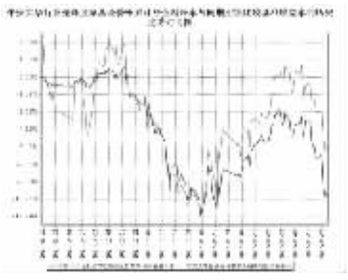
主要财务指标	报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-59,377,801.56
2.本期利润	-7,148,801.58
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0030
4.期末基金资产净值	2,045,145,272.80
5.期末基金份额净值	0.896

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

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	-0.78%	1.05%	4.13%	1.29%	-4.91%	-0.24%

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



注:1、本基金基金合同于2011年9月20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,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

单位:人民币元

§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		
颜正华	基金经理	2011年9月20日	-	12	1998年起先后在中兴通讯、江南证券公司策略中心、国海证券公司投资部工作,在华夏基金管理公司担任策略分析师、基金经理。2009年加入平安大华基金公司,任投资研究部总经理,现兼任平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金经理。

注:证券从业的含义遵从行业协会《证券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、平安大华行业先锋股票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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

注:本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4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

2012年一季度市场震荡持续上涨后在季末快速回调,上证指数、深圳成指、沪深300、中小板指、创业板指的涨幅分别为2.88%、5.51%、4.65%、2.73%、-6.99%。从行业来看,涨幅居前的行业包括有色金属、房地产、家电、汽车、商业、基础化工、电子、煤炭等,涨幅靠后的是通信、医药、计算机、电力公用、农林牧渔等。涨幅较好的行业通常具有流动性敏感或者早周期的特征。

本基金作为以投资时钟为策略方向的股票型产品,我们在判断经济处于衰退期的基础上,期初重点选取了早周期行业如家电、汽车、水泥等进行配置,同时加大对必需消费品的投资力度。但从实际经济运行的情况来看,经济衰退的时间比预期还要更长一些,因此本基金在本轮反弹行情中逐步减持了早周期的品种,而逐步增持了今年1季度业绩增长相对比较好的医药、银行以及消费类品种。但从投资者情绪来看,依然是对早周期的行业更加偏好,特别是强周期的有色、房地产、煤炭、券商等,而本基金基于谨慎的原则对这些行业均采取低配的投资策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年3月31日,本基金份额净值为0.896元,份额累计净值为0.896元。报告期内,本基金份额净值增长率为-0.78%,同期业绩基准增长率为4.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金预计本轮经济调整时间会延续到今年三季度左右,但是股市作为经济的晴雨表,可能在之前率先筑底企稳。随着未来市场利率和准备金率的逐步下调,资金面将逐步宽松,企业经营的财务成本压力也逐步下降,在这个过程中,虽然企业效益增速继续下降,但证券市场可能不再杀估值,而只是降低盈利预期。而随着最后官方利率的下降到底,则宣告货币政策的实质性放松开始,经济将进入复苏周期,而股票市场将提前开始上涨。因此本基金基于投资时钟规律的分析,对今年全年的行情谨慎乐观。

最为关键的是,随着证券市场的持续调整,股票市场中越来越多的公司的投资价值逐步凸显,一些公司已经跌破产业资本的重置价值,因此吸引了产业资本的增持。一些ROE超过15%、竞争力突出的公司,股价却一直徘徊在每股净资产附近,如果未来中国上市公司的分红税能够减免到国际证券市场水平,这些上市公司的理论长期分红收益率将可以达到甚至远超银行理财产品收益率。

§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	1,718,279,518.65	83.38
	其中:股票	1,718,279,518.65	83.38
2	固定收益投资	146,792,000.00	7.12
	其中:债券	146,792,000.00	7.12
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	190,397,208.65	9.24
6	其他资产	5,306,614.57	0.26
7	合计	2,060,775,341.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	24,250,437.24	1.19
B	采掘业	37,254,221.36	1.82
C	制造业	948,274,813.27	46.37
C0	食品、饮料	182,657,690.64	8.93
C1	纺织、服装、皮毛	133,442,828.70	6.52
C2	木材、家具	15,960,924.30	0.78
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	66,243,950.45	3.24
C5	电子	35,930,249.52	1.76
C6	金属、非金属	10,882,015.74	0.53
C7	机械、设备、仪表	170,081,031.63	8.32
C8	医药、生物制品	333,076,097.91	16.29
C99	其他制造业	24.38	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	157,074,847.50	7.68
F	交通运输、仓储业	15,699,101.96	0.77
G	信息技术业	48,548,258.74	2.37
H	批发和零售贸易	36,529,132.99	1.79
I	金融、保险业	338,609,117.94	16.56
J	房地产业	26,190,072.48	1.28
K	社会服务业	68,777,621.83	3.36
L	传播与文化产业	17,071,888.93	0.83
M	综合类	4.41	0.00
	合计	1,718,279,518.65	84.02

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	601668	中国建筑	51,499,950	157,074,847.50	7.68
2	002073	软控股份	10,020,865	136,684,598.60	6.68
3	600177	雅戈尔	13,799,670	133,442,808.90	6.52
4	600887	伊利股份	5,517,127	121,597,479.08	5.95
5	600016	民生银行	15,999,928	100,319,548.56	4.91
6	600036	招商银行	8,371,070	99,615,733.00	4.87
7	601166	兴业银行	6,131,762	81,675,069.84	3.99
8	000538	云南白药	1,209,776	59,545,174.72	2.91
9	601117	中国化学	9,789,518	57,268,680.30	2.80
10	000568	泸州老窖	1,399,969	54,724,788.21	2.68

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	116,009,000.00	5.67
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	30,783,000.00	1.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	146,792,000.00	7.18

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101079	11央行票据79	700,000	67,669,000.00	3.31
2	1101082	11央行票据82	500,000	48,340,000.00	2.36
3	122100	11华仪债	300,000	30,783,000.00	1.51

5.6 报告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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,231,864.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,932,482.24
5	应收申购款	142,268.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,306,614.57

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,542,341,314.56
本报告期基金总申购份额	13,516,669.23
减:本报告期基金总赎回份额	274,547,492.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,281,310,490.94

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1)中国证监会批准平安大华行业先锋股票型证券投资基金设立的文件

2)平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金合同

3)平安大华行业先锋股票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)报告期内平安大华行业先锋股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

8.3 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
2012年4月25日

证券代码:300235　　证券简称:方直科技　　公告编号:2012-013

深圳市方直科技股份有限公司

【2012】第一季度报告

§1 重要提示

1.1 本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本报告所载资料不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

1.2 公司第一季度财务报告未经会计师事务所审计。

1.3 公司负责人黄元忠、主管会计工作负责人孙晓玲及会计机构负责人(会计主管人员)廖晓莉声明:保证季度报告中财务报告的真实、完整。

§2 公司基本情况

2.1 主要会计数据及财务指标

单位:元

	本报告期末	上年度期末	本报告期末比上年度期末增减(%)
资产总额(元)	305,845,683.03	291,625,094.23	4.88%
归属于上市公司股东的所有者权益(或股东权益)(元)	292,164,967.94	283,418,280.56	3.09%
归属于上市公司股东的每股净资产(元/股)	6.64	6.44	3.11%
	年初至报告期期末		比上年同期增减(%)
经营活动产生的现金流量净额(元)	6,291,318.46		13.04%
每股经营活动产生的现金流量净额(元/股)	0.14		-17.65%
	报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减(%)
营业总收入(元)	24,044,061.47	23,123,536.50	3.98%
归属于上市公司股东的净利润(元)	8,746,687.38	11,115,722.98	-21.31%
基本每股收益(元/股)	0.20	0.34	-41.18%
稀释每股收益(元/股)	0.20	0.34	-41.18%
加权平均净资产收益率(%)	3.04%	12.75%	-9.71%
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	3.04%	10.81%	-7.77%

非经常性损益项目

□ 适用 √ 不适用

2.2 报告期末股东总人数及前十名无限售条件股东持股情况表

单位:股

报告期末股东总数(户)		4,771
前十名无限售条件流通股股东持股情况		
股东名称(全称)	期末持有无限售条件流通股的数量	种类
郑春雷	580,000	人民币普通股
袁东升	132,849	人民币普通股
赖昌建	106,900	人民币普通股
施生根	103,700	人民币普通股
中融国际信托有限公司-中融宏石1号证券投资	85,000	人民币普通股
冯均强	75,174	人民币普通股
王卫平	68,000	人民币普通股
金兴根	61,700	人民币普通股
海通证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	61,401	人民币普通股
厉星祥	60,000	人民币普通股

2.3 限售股份变动情况表

单位:股

股东名称	期初限售股数	本期解除限售股数	本期增加限售股数	期末限售股数	限售原因	解除限售日期
黄元忠	9,965,330	0	0	9,965,330	首发承诺	2014-06-29
陈克让	7,177,355	0	0	7,177,355	首发承诺	2014-06-29
黄晓峰	7,177,355	0	0	7,177