平安大华深证300指数增强型证券投资基金

2012 年度报告摘要

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
送出日期：2013年3月29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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月22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2012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	平安大华深证300指数增强
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	108,187,945.22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，辅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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	肖宇鹏	唐州徽
	联系电话	0755-22623179	010-66594855
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

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	2012年	2011年12月20日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	1,968,377.19	427,579.42
本期利润	-4,473,366.43	427,579.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0385	0.0010
本期基金份额净值增长率	0.80%	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0636	0.0010
期末基金资产净值	101,310,178.99	418,137,625.64
期末基金份额净值	0.936	1.001

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。

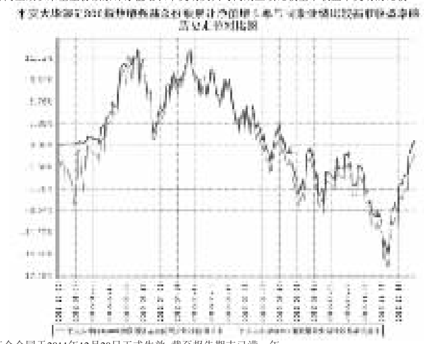
3.2 基金净值表现

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	4.70%	1.24%	3.92%	1.28%	0.78%	-0.04%
过去六个月	-2.60%	1.27%	-3.77%	1.31%	1.17%	-0.04%
过去一年	0.80%	1.16%	2.37%	1.37%	-1.57%	-0.21%
自基金合同生效起至今	0.91%	1.14%	-0.98%	1.36%	1.89%	-0.22%

注：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%

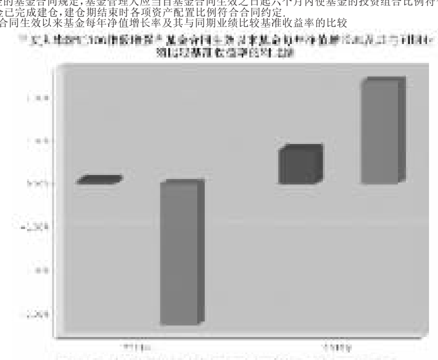
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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合同约定。

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



注：1.本基金合同于2011年12月20日正式生效，截止报告期末已满一年.

2.2011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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	0.800	3,750,646.56	426,462.82	4,177,109.38	
2011	-	-	-	-	
合计	0.800	3,750,646.56	426,462.82	4,177,109.38	

§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2012年12月31日，平安大华共管理五只开放式基金，资产管理总规模逾53亿元。

1、客户服务

2012年3月，平安大华与浙江省新华爱心教育基金会签订了合作协议，正式启动了平安大华"珍珠计划"的系列活动。2012年4月，"转电子账单 捡闪耀珍珠"以宣传单页形式由1季度对账单统一寄送，公司官网同步上线该活动的专题页面。同时，通过短信、邮件、微博的方式向平安大华客户发出活动倡议。活动一推出就得到了众多客户的响应与支持，很多客户在第一时间选择了电子对账单。仅短3个月时间，在2012年新学期开学之前，平安大华与客户一起共捐助了10名"珍珠生"。

2012年8月，平安大华组织基金份额持有人子女和前期捐助的10名珍珠生共同参与平安大华"首届客服节——青少年财商之旅"。目的是让这些学员了解基础金融知识、培养正确的理财观念，并通过参观了平安集团旗下的各系列子公司、平安金融学院、深圳证券交易所和财经媒体等金融机构增加对金融行业的直观认识，同时让不同背景的学员通过知识学习和互动而彼此了解、互相学习。

2012年第二期"平安少年希望之窗"爱心公益支教行动在安徽省六安市顺河平安希望小学举行。该活动由平安大华发起倡议，号召基金持有人作为爱心志愿者，参与希望小学支教行动，该活动从招募志愿者到完成支教共历时1个月，从600多名报名者中遴选了6位基金份额持有人作为志愿者前往希望小学进行为期一周的支教活动。在一周的时间内，志愿者们都竭尽全力的将更多的知识传递给那些山区里的孩子，为他们打开了一扇扇通往梦想的窗户，更不断的激励他们勇敢的张开翅膀去追寻自己心中的梦想。

2、公司荣誉

2012年10月30日，在由《理财周报》主办的"寻找2012中国最受尊敬基金公司"调查活动中，公司副总经理罗春风被评为"2012最佳基金市场风云人物"。

2012年12月18日，平安大华在由和讯网主办的"第十届中国财经风云榜"中荣获"2012年度最佳基金电子商务平台"。

3、其他大事件

平安大华策略先锋混合型证券投资基金首募顺利结束，并于2012年5月29日成立。

平安大华保本混合型证券投资基金首募顺利结束，并于2012年9月11日成立。

平安大华添利债券型证券投资基金首募顺利结束，并于2012年11月27日成立。

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		
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年加入平安基金，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、平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金经理。

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遵规守信情况的说明

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、《平安大华深证300指数增强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，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，各投资组合之间的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

过去的一年是宏观经济形势极其严峻的一年。年初市场曾经预期经济复苏，并且由此引发了周期性行业的一轮上涨行情。但随后，经济并没有复苏而是继续下滑，导致证券市场出现较大幅度的调整。年末，在政策改革和经济复苏的双重预期之下，市场出现了强劲反弹。

本基金立足于跟踪并超于业绩基准。前期，在市场下跌过程中，通过适当降低仓位、增加消费股配置获得了一定的超额收益。12月份，在市场大幅上涨的过程中，由于仓位较低而略微跑输大盘。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日，本基金份额净值为0.9360 元，份额累计净值为 1.016元。报告期内，本基金份额净值增长率为0.80%，同期业绩基准增长率为2.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新的一年是值得期待的一年。一方面，政府即将换届，市场普遍对改革充满期待；另一方面，经济在去年四季度已经见底回升。这些因素都将对股票市场产生积极的影响。

基于对股市的乐观预期，本基金将把仓位维持在上限，并且在增强部分通过阶段性的行业配置和个股选择来获得超额收益，力求战胜业绩基准。

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，本基金于2012年3月2日实施利润分配，每份基金份额派发红利0.08元人民币。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对平安大华深证300指数增强型证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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(2013)审字第60937497_B03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	平安大华深证300指数增强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深证300指数增强型证券投资基金财务报表，包括2012年12月31日的资产负债表和2012年度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、实施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而导致的重大错报。
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报获取合理保证。 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。 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。
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深证300指数增强型证券投资基金2012年12月31日的财务状况以及2012年1月1日至2012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	2013年3月22日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：平安大华深证300指数增强型证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产：		
银行存款	5,513,276.33	220,728,319.20
结算备付金	178,564.23	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	96,057,441.41	-
其中：股票投资	96,057,441.41	-
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	197,000,000.00
应收证券清算款	449,496.18	-
应收利息	1,287.03	537,772.18
应收股利	-	-
应收申购款	118,619.45	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	102,318,684.63	418,266,091.38
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	465,352.96	-
应付管理人报酬	68,422.93	107,054.76
应付托管费	12,074.64	18,892.02
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	301,161.09	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	161,494.02	2,518.96
负债合计	1,008,505.64	128,465.74
所有者权益：		
实收基金	108,187,945.22	417,710,046.22
未分配利润	-6,877,766.23	427,579.42
所有者权益合计	101,310,178.99	418,137,625.64
负债和所有者权益总计	102,318,684.63	418,266,091.38

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值0.936元，基金份额总额108187945.22份。

7.2 利润表

会计主体：平安大华深证300指数增强型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年12月20日(基金合同生效日)至2011年12月31日
一、收入	-2,071,930.10	557,613.66
1.利息收入	749,896.86	546,126.61
其中：存款利息收入	385,646.69	329,301.32
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	364,250.17	216,825.29
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,066,686.52	-
其中：股票投资收益	1,799,545.36	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,267,141.16	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-6,441,743.62	-
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	553,230.14	11,487.05
二、费用	2,401,436.33	130,034.24
1.管理人报酬	952,332.18	107,054.76
2.托管费	168,058.73	18,892.02
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	700,174.91	-
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	580,870.51	4,087.46
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-4,473,366.43	427,579.42
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-4,473,366.43	427,579.42

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华深证300指数增强型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1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)	417,710,046.22	427,579.42	418,137,625.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-4,473,366.43	-4,473,366.43
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）	-309,522,101.00	1,345,130.16	-308,176,970.84
其中：1.基金申购款	133,641,325.74	877,077.35	134,518,403.09
2.基金赎回款	-443,163,426.74	468,052.81	-442,695,373.93
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)	-	-4,177,109.38	-4,177,109.38
五、期末所有者权益(基金净值)	108,187,945.22	-6,877,766.23	101,310,178.99

项目	上年度可比期间 2011年12月20日(基金合同生效日)至2011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)	417,710,046.22	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	427,579.42	427,579.42
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）	-	-	417,710,046.22
其中：1.基金申购款	-	-	417,710,046.22
2.基金赎回款	-	-	-
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)	417,710,046.22	427,579.42	418,137,625.64

注：报表附注为财务报表的组成部分。

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 林婉文 王彦

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安大华深证300指数增强型证券投资基金（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［2011］1689号《关于核准平安大华深证300指数增强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《平安大华深证300指数增强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2011年11月14日至2011年12月16日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集417679038.56元，业经安永华明会计师事务所有限公司（2011）验字第60937497_H02号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金合同》于2011年12月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为417710046.22份基金份额，其中认购资金利息折合31007.66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《平安大华深证300指数增强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，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为90%-95%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-10%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及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%。本基金的业绩比较基准为深证300指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率（税后）×5%。

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2012年12月31日的财务状况以及自2012年1月1日至2012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的内容和更正金额。

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。

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

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。

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年12月20日(基金合同生效日)至2011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	169,291,587.13	33.96%	-	-

债券交易

本报告期内无通过关联方进行的债券交易。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年12月20日(基金合同生效日)至2011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	30,500,000.00	4.61%	-	-

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 2012年1月1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	146,277.78	35.06%	68,432.59	22.72%
关联方名称	上年度可比期间 2011年12月20日(基金合同生效日)至2011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

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年12月20日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	952,332.18	107,054.76
其中：支付销售机构的客户维护费	280,554.24	27,246.17

注：1)基金管理费按前一日的基金资产净值的0.85%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.85%/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3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68,422.93元。（2011年12月31日：人民币107,054.76元）。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年12月20日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	168,058.73	18,892.02

注：1)基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%/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3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12,074.64元。（2011年12月31日：人民币18,892.02元）。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年12月20日(基金合同生效日)至2011年12月31日
基金合同生效日（2011年12月20日）持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
期初持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.24%	2.39%

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

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持有本基金。

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年12月20日(基金合同生效日)至2011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
中国银行	5,513,276.33	-	728,319.20	-
当期利息收入	-	79,899.81	-	12,440.16

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。

7.4.9 期末（2012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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

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
000002	万 科A	2012年12月26日	重大事项	10.12	2013年1月21日	11.13	431,200	3,784,077.70	4,363,744.00	-
000527	美的电器	2012年8月27日	资产重组	9.18	-	-	98,494	1,360,406.26	904,174.92	-
000793	华闻传媒	2012年11月23日	资产重组	6.63	2013年2月28日	7.29	45,855	297,073.83	304,018.65	-
000973	佛塑科技	2012年12月28日	重大事项	4.15	2013年1月18日	4.57	34,782	200,517.28	144,345.30	-
000698	沈阳化工	2012年12月24日	重大事项	4.22	2013年1月31日	4.64	23,339	148,331.14	98,490.58	-
000042	深长城	2012年12月18日	重大事项	20.10	2013年2月5日	22.11	3,883	68,836.90	78,048.30	-
002190	成飞集成	2012年10月16日	资产重组	11.45	2013年1月14日	12.60	5,248	94,299.04	60,089.60	-

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2012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2012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。

§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	96,057,441.41	93.88
	其中：股票	96,057,441.41	93.88
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	5,691,840.56	5.56
6	其他各项资产	569,402.66	0.56
7	合计	102,318,684.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	1,528,880.93	1.51
B	采掘业	4,549,622.55	4.49
C	制造业	51,074,348.07	50.41
C0	食品、饮料	7,995,888.47	7.89
C1	纺织、服装、皮毛	743,744.38	0.73
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	382,933.16	0.38
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,113,758.31	5.05
C5	电子	5,044,445.02	4.98
C6	金属、非金属	8,488,311.52	8.38
C7	机械、设备、仪表	15,830,293.40	15.63
C8	医药、生物制品	6,940,542.08	6.85
C99	其他制造业	534,431.73	0.53
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,442,818.36	1.42
E	建筑业	1,414,240.55	1.40
F	交通运输、仓储业	817,043.13	0.81
G	信息技术业	3,044,530.40	3.01
H	批发和零售贸易	3,417,208.36	3.37
I	金融、保险业	6,745,563.59	6.66
J	房地产业	8,648,212.71	8.54
K	社会服务业	2,220,106.12	2.19
L	传播与文化产业	1,132,248.61	1.12
M	综合类	1,764,979.96	1.74
	合计	87,799,803.34	86.66

8.2.2 期末积极投资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	采掘业	1,860.65	0.00
C	制造业	4,065,926.55	4.01
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	959,318.00	0.95
C6	金属、非金属	1,000,780.55	0.99
C7	机械、设备、仪表	1,006,050.00	0.99
C8	医药、生物制品	1,099,778.00	1.09
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	803,887.56	0.79
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	1,021,200.00	1.01
J	房地产业	2,364,763.31	2.33
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	8,257,638.07	8.15

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

8.3.1 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

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	000002	万 科A	431,200	4,363,744.00	4.31
2	000651	格力电器	115,577	2,947,213.50	2.91
3	000858	五 粮 液	88,050	2,485,651.50	2.45
4	600036	招商银行	169,110	2,325,262.50	2.30
5	000157	中联重科	202,800	1,867,788.00	1.84
6	002024	苏宁电器	212,662	1,414,202.30	1.40
7	000776	广发证券	82,549	1,272,905.58	1.26
8	000568	泸州老窖	33,881	1,199,387.40	1.18
9	002304	洋河股份	11,878	1,109,048.86	1.09
10	000338	潍柴动力	43,267	1,095,087.77	1.08

8.3.2 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

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	600340	华夏幸福	60,650	1,712,149.50	1.69
2	601009	南京银行	111,000	1,021,200.00	1.01
3	600031	三一重工	95,000	1,006,050.00	0.99
4	300020	银江股份	62,902	803,887.56	0.79
5	600332	广州药业	40,900	794,278.00	0.78

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	000002	万 科A	9,949,488.63	2.38
2	600030	中信证券	8,749,992.00	2.09
3	000858	五 粮 液	6,724,775.80	1.61
4	002024	苏宁电器	6,408,651.40	1.53
5	600036	招商银行	5,729,058.82	1.37
6	000157	中联重科	5,531,276.00	1.32
7	002157	正邦科技	5,361,077.36	1.28
8	600406	国电南瑞	5,029,012.92	1.20
9	600999	招商证券	4,716,958.93	1.13
10	000651	格力电器	4,526,889.47	1.08
11	000024	招商地产	4,506,214.53	1.08
12	000063	中兴通讯	4,250,791.88	1.02
13	600372	中航电子	3,779,136.89	0.90
14	600340	华夏幸福	3,558,673.04	0.85
15	601601	中国太保	3,344,976.00	0.80
16	000630	铜陵有色	3,266,292.74	0.78
17	000069	华侨城A	3,239,103.37	0.77
18	000538	云南白药	2,998,760.04	0.72
19	600100	同方股份	2,974,094.10	0.71
20	601009	南京银行	2,947,205.28	0.70

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	600030	中信证券	8,748,731.10	2.09
2	000002	万 科A	6,552,725.99	1.57
3	002157	正邦科技	5,583,008.85	1.34
4	600406	国电南瑞	4,886,587.58	1.17
5	600999	招商证券	4,770,123.77	1.14
6	002024	苏宁电器	4,298,705.39	1.03
7	000024	招商地产	4,120,099.89	0.99
8	600036	招商银行	3,968,696.86	0.95
9	600372	中航电子	3,848,989.76	0.92
10	000858	五 粮 液	3,626,441.67	0.87
11	000157	中联重科	3,488,531.31	0.83
12	601601	中国太保	3,401,836.56	0.81
13	000063	中兴通讯	3,304,463.32	0.79
14	000069	华侨城A	2,989,894.10	0.72
15	600100	同方股份	2,785,074.91	0.67
16	000049	德赛电池	2,776,482.62	0.66
17	000538	云南白药	2,392,550.95	0.57
18	600016	民生银行	2,380,123.26	0.57
19	000656	金科股份	2,377,791.49	0.57
20	600519	贵州茅台	2,315,881.41	0.55

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	299,573,891.31
卖出股票收入(成交)总额	198,874,251.64

注：8.4.1项"买入金额"、8.4.2项"卖出金额"及8.4.3项"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买入或卖出金额（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

本报告期末本基金未持有债券投资。

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

本报告期末本基金未持有债券投资。

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 投资组合报告附注

8.9.1

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。

8.9.2

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。

8.9.3 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	-
2	应收证券清算款	449,496.18
3	应收股利	-
4	应收利息	1,287.03
5	应收申购款	118,619.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	569,402.66

8.9.4 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。

8.9.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1期末指数投资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	000002	万 科A	4,363,744.00	4.31	重大事项

8.9.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前五名股票中不存在流通受限情况。

8.9.6 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
3,658	29,575.71	19,440,650.47	17.97%	88,747,294.75	82.03%

9.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	25,314.04	0.0200%

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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年12月20日)基金份额总额	417,710,046.22
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	133,641,325.74
减：本报告期基金总赎回份额	443,163,426.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	108,187,945.22

§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

2012年3月20日，经平安大华基金管理有限公司股东会审议通过，免去蔡方方女士董事职务，高鹏先生出任董事。

(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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2013年3月17日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

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

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。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2012年度审计的报酬为60,000.00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	
国信证券	2	282,869,407.70	56.75%	232,728.50	55.78%	-
平安证券	2	169,291,587.13	33.96%	146,277.78	35.06%	-
中信证券	2	46,287,148.12	9.29%	38,208.56	9.16%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
申万证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	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12个交易单元：国信证券（上海、深圳各1个）、平安证券（上海、深圳各1个）、中信证券（上海、深圳各1个）、中航证券、方正证券（上海、深圳各1个）、国海证券（上海、深圳各1个）、中投证券、民生证券（上海、深圳各1个）、湘财证券、申万证券（上海、深圳各1个）、中金公司（上海、深圳各1个）、兴业证券。

报告期内未停止租用交易单元。

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
国信证券	-	-	435,300,000.00	65.78%	-	-
平安证券	-	-	30,500,000.00	4.61%	-	-
中信证券	-	-	196,000,000.00	29.62%	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无

平安大华基金管理有限公司

2013年3月29日