平安大华策略先锋混合型证券投资基金

【2013】第四季度报告

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:2014年1月21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2014年1月10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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华策略先锋混合
交易代码	700003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月29日
报告期末基金份额总额	29,776,391.55份
投资目标	通过积极进行资产配置和灵活运用多种投资策略,在有效控制风险的前提下,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,谋求基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析,结合经济周期理论,形成对不同市场周期的预测和判断,进行积极、灵活的资产配置,确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。股票投资方面,采用积极主动的投资管理策略,在构建股票投资组合时,灵活运用多种投资策略,积极挖掘和利用市场中可行的投资机会,以实现基金的投资目标。债券投资方面,以利率预期策略、类属资产配置和久期策略为主,以品种选择策略、收益率利差策略和债券置换策略为辅,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上,构建能获取长期、稳定收益的固定收益类投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,350,905.63
2.本期利润	-2,110,574.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0671
4.期末基金资产净值	30,662,211.25
5.期末基金份额净值	1.030

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;

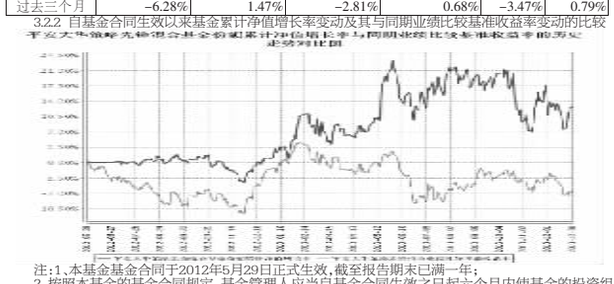
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-6.28%	1.47%	-2.81%	0.68%	-3.47%	0.79%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2012年5月29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。

§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	2012年5月29日	2013年5月29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年加入平安基金,任投资研究部总经理,兼任平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金经理、平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金经理。
黄建军	基金经理	2013年5月29日	-	6	中国人民大学经济学硕士,具有6年证券和基金业从业资格。曾先后任职于国元证券、华夏基金、长盛基金。2012年加入平安大华基金管理公司,任投资研究部研究主管,现担任平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理、平安大华策略先锋混合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

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、《平安大华策略先锋混合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 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,受资金成本上行和经济下滑的影响,传统产业继续下跌,带动指数继续下行。而代表未来改革和发展方向的新兴产业继续受到市场追捧。在行业配置上,本基金对传统行业配置过重,导致业绩落后于基准。

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1.03元,份额累计净值为1.13元。报告期内,本基金份额净值增长率为-6.28%,同期业绩基准增长率为-2.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014,由于受到资金成本的影响,经济增速可能继续下行,因此,传统行业依然缺乏趋势性机会,个股性的投资机会依然需要重点从新兴产业中寻找。军工、环保、国企改革都受国家政策支持的主题,以及普及率有大幅提升空间的硬件设备,和市场发展空间非常广阔的移动互联网和大数据应用,这些领域里面可能继续走出大幅上涨的个股。本基金力求从上述行业中精选出个股,带动基金业绩战胜业绩基准。

§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	21,257,661.22	64.98
	其中:股票	21,257,661.22	64.98
2	固定收益投资	372,896.00	1.14
	其中:债券	372,896.00	1.14
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	6,100,000.00	18.65
	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	3,972,163.14	12.14
6	其他资产	1,008,946.63	3.08
7	合计	32,711,666.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	497,140.00	1.62
C	制造业	11,998,085.66	39.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	838,836.00	2.74
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	4,363,968.76	14.23
J	金融业	847,594.50	2.76
K	房地产业	1,853,262.56	6.04
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	858,773.74	2.80
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	-	-
	合计	21,257,661.22	69.33

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	600118	中国卫星	91,512	1,695,717.36	5.53
2	600372	中航电子	52,456	1,251,600.16	4.08
3	600185	格力地产	143,088	1,197,646.56	3.91
4	600196	复星医药	55,100	1,079,409.00	3.52
5	002642	荣之联	53,600	931,568.00	3.04
6	600171	上海贝岭	101,099	912,923.97	2.98
7	002179	中航光电	52,100	867,465.00	2.83
8	300190	维尔利	38,929	858,773.74	2.80
9	600030	中信证券	66,478	847,594.50	2.76
10	600292	中电远达	32,400	838,836.00	2.74

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	372,896.00	1.22
8	其他	-	-
9	合计	372,896.00	1.22

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	113003	重工转债	3,200	372,896.00	1.22

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资情况。

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

本基金本报告期末无权证投资情况。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资情况。

5.8.2 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情况。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,785.20
2	应收证券清算款	827,241.50
3	应收股利	-
4	应收利息	2,501.22
5	应收申购款	155,418.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,008,946.63

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	372,896.00	1.22

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300190	维尔利	858,773.74	2.80	临时停牌

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	33,296,606.09
报告期期间基金总申购份额	4,477,540.66
减:报告期期间基金总赎回份额	7,997,755.20
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	29,776,391.55

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期末无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安大华策略先锋混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华策略先锋混合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)报告期内平安大华策略先锋混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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
2014年1月21日

平安大华保本混合型证券投资基金

【2013】第四季度报告

基金管理人:平安大华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月10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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华保本混合
交易代码	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
报告期末基金份额总额	540,596,503.42份
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。
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
基金保证人	中国投融资担保有限公司(原名"中国投资担保有限公司")

§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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	2,382,577.14
2.本期利润	-9,324,180.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0158
4.期末基金资产净值	565,716,172.44
5.期末基金份额净值	1.046

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;

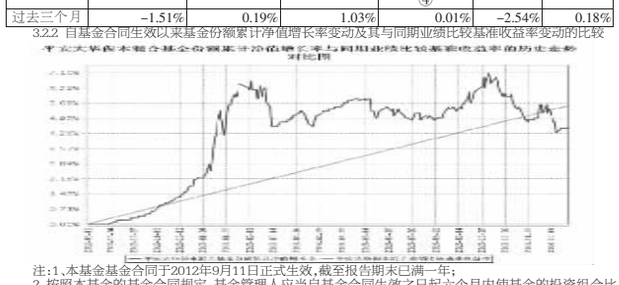
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-1.51%	0.19%	1.03%	0.01%	-2.54%	0.18%

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		
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。

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

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、《平安大华保本混合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 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

基于对2013年4季度宏观经济将逐月回落的判断以及对三中全会行情的期许,本基金管理人对权益市场的投资思路为波段操作,适度增加了医药和军工板块的仓位,并及时锁定收益。由于前期无风险债券的仓位较重,在4季度收益率上升速度和幅度较大的情况下,考虑到未来货币政策层面松动的可能性不大,而流动性将长期保持中性偏紧的状态,本基金降低了利率债券的仓位进行止损操作。

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-1.51%,同期业绩基准增长率为1.03%。

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。

§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	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	其他资产	11,022,748.38	1.91
7	合计	576,199,060.16	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	-	-
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

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

代码	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	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

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	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

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	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

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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

本基金本报告期末无权证投资。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资情况。

5.8.2 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情况。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

基金投资的前十名股票没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
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

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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不存在流通受限的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	639,459,689.85
报告期期间基金总申购份额	671,796.98
减:报告期期间基金总赎回份额	99,534,983.41
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	540,596,503.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期末无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安大华保本混合型证券投资基金设立的文件

(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)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)报告期内平安大华保本混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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
2014年1月21日

平安大华深证300指数增强型证券投资基金

【2013】第四季度报告

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:2014年1月21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2014年1月10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2013年10月1日起至12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	64,015,616.20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,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。
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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-182,251.94
2.本期利润	-2,189,465.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0345
4.期末基金资产净值	63,096,828.05
5.期末基金份额净值	0.986

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;

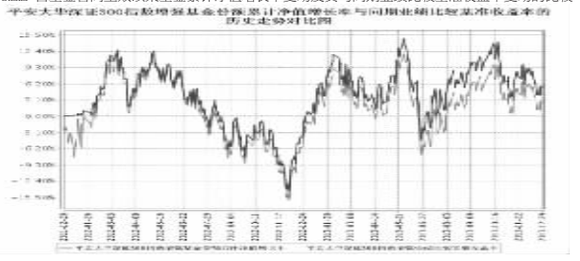
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-3.62%	1.14%	-2.51%	1.13%	-1.11%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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,截至报告期末已满二年;

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。

§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	2013年3月19日	11	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,现任平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金经理。
黄建军	基金经理	2013年3月19日	-	6	中国人民大学经济学硕士,具有6年证券和基金业从业资格。曾先后任职于国元证券、华夏基金、长盛基金。2012年加入平安大华基金管理公司,任投资研究部研究主管,现担任平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理、平安大华策略先锋混合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

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