

平安大华策略先锋混合型证券投资基金

2014 第二季度报告

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7月18日

基金管理人、基金托管人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。

基金管理人平安大华银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年7月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者有风险,投资需谨慎。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。

本报告期内(2014年4月1日起至2014年6月30日止):

5.2 基金基本情况

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	27,164,408.45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蕴藏的投资机会,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,形成对不同市场板块的长期预期,进行积极、灵活的资产配置,确定组合中股票、债券、货币资金等资产之间的投资比例。投资管理方面,采取积极主动的投资管理策略,在控制投资组合风险、灵活运用多种投资策略、积极挖掘和利用市场中的投资机会,以实现基金的投资目标。投资管理方面,以利率预期策略、资产配置和久期策略为主,以品种选择策略、收益来源策略和择时策略为辅,在控制组合风险、稳定收益的固定收益投资策略。

业绩比较基准:沪深300指数收益率*60%+中债国债指数收益率*40%

风险收益特征:本基金为混合型证券投资基金,其预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金。

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

3.1 主要财务指标

3.2 基金业绩指标

3.3 主要财务指标

3.4 基金管理人

3.5 投资组合报告

3.6 投资组合报告

3.7 投资组合报告

3.8 投资组合报告

3.9 投资组合报告

3.10 投资组合报告

3.11 投资组合报告

3.12 投资组合报告

3.13 投资组合报告

3.14 投资组合报告

3.15 投资组合报告

3.16 投资组合报告

3.17 投资组合报告

3.18 投资组合报告

3.19 投资组合报告

3.20 投资组合报告

3.21 投资组合报告

3.22 投资组合报告

3.23 投资组合报告

3.24 投资组合报告

3.25 投资组合报告

3.26 投资组合报告

3.27 投资组合报告

3.28 投资组合报告

3.29 投资组合报告

3.30 投资组合报告

3.31 投资组合报告

3.32 投资组合报告

3.33 投资组合报告

3.34 投资组合报告

3.35 投资组合报告

3.36 投资组合报告

3.37 投资组合报告

3.38 投资组合报告

3.39 投资组合报告

3.40 投资组合报告

3.41 投资组合报告

3.42 投资组合报告

3.43 投资组合报告

3.44 投资组合报告

3.45 投资组合报告

3.46 投资组合报告

3.47 投资组合报告

3.48 投资组合报告

3.49 投资组合报告

3.50 投资组合报告

3.51 投资组合报告

3.52 投资组合报告

3.53 投资组合报告

3.54 投资组合报告

3.55 投资组合报告

3.56 投资组合报告

3.57 投资组合报告

3.58 投资组合报告

3.59 投资组合报告

3.60 投资组合报告

3.61 投资组合报告

3.62 投资组合报告

3.63 投资组合报告

3.64 投资组合报告

3.65 投资组合报告

3.66 投资组合报告

3.67 投资组合报告

3.68 投资组合报告

3.69 投资组合报告

3.70 投资组合报告

3.71 投资组合报告

3.72 投资组合报告

3.73 投资组合报告

3.74 投资组合报告

3.75 投资组合报告

3.76 投资组合报告

3.77 投资组合报告

3.78 投资组合报告

3.79 投资组合报告

3.80 投资组合报告

3.81 投资组合报告

3.82 投资组合报告

3.83 投资组合报告

3.84 投资组合报告

3.85 投资组合报告

3.86 投资组合报告

3.87 投资组合报告

3.88 投资组合报告

3.89 投资组合报告

3.90 投资组合报告

3.91 投资组合报告

3.92 投资组合报告

3.93 投资组合报告

3.94 投资组合报告

3.95 投资组合报告

3.96 投资组合报告

3.97 投资组合报告

3.98 投资组合报告

3.99 投资组合报告

3.100 投资组合报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明	
姓名	职务	任职日期	离任日期		
周正华	基金经理	2012年5月29日	2013年5月29日	12	1998年先后在中兴通讯、江西证券公司战略中心、国信证券公司投资部工作,在华夏基金管理有限公司担任策略分析师、基金经理,2009年加入平安基金,任投资管理部总经理,兼任平安大华策略先锋混合型证券投资基金。
黄建军	基金经理	2013年5月29日	-	7	2007年先后在中国证券业协会、华夏基金管理有限公司从事研究工作,在长城基金管理有限公司担任基金经理助理,2012年加入平安大华基金管理有限公司,任投资管理部研究主管,现任平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金经理。

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	584,136.00	2.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,512,513.25	43.77
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-
E	建筑业	812,612.10	2.84
F	批发和零售业	1,545,762.00	5.41
G	交通运输、仓储和邮政业	551,744.00	1.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,734,635.72	16.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	555,174.00	1.94
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	-	-
合计		21,296,577.07	74.50

本基金报告期末无股指期货投资。

5.8 报告期末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

本基金报告期末无公允价值权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.0.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.2 本基金投资股指期货的投资策略

6.0.3 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.0.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.5 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.6 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.7 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.17 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.21 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.23 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.27 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.31 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.33 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.35 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.37 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.39 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.41 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.43 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.44 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.45 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.46 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.47 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.48 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.49 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.50 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.51 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.52 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.53 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.54 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.55 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.56 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.57 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.58 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.59 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.60 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.61 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.62 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.63 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.64 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.65 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.66 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.67 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.68 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.69 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.70 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.71 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.72 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.73 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.74 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.75 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.76 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.77 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.78 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.79 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.80 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.81 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.82 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.83 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.84 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.85 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.86 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.87 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.88 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.89 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.90 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.91 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.92 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.93 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.94 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.95 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.96 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.97 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.98 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.99 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.100 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

平安大华保本混合型证券投资基金

2014 第二季度报告

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7月18日

基金管理人、基金托管人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。

基金管理人平安大华银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年7月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者有风险,投资需谨慎。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。

本报告期内(2014年4月1日起至2014年6月30日止):

5.2 基金基本情况

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	383,100,133.81份

投资目标:采用投资组合保险技术,以保本为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:采用保本策略起点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

3.1 主要财务指标

3.2 基金业绩指标

3.3 主要财务指标

3.4 基金管理人

3.5 投资组合报告

3.6 投资组合报告

3.7 投资组合报告

3.8 投资组合报告

3.9 投资组合报告

3.10 投资组合报告

3.11 投资组合报告

3.12 投资组合报告

3.13 投资组合报告

3.14 投资组合报告

3.15 投资组合报告

3.16 投资组合报告

3.17 投资组合报告

3.18 投资组合报告

3.19 投资组合报告

3.20 投资组合报告

3.21 投资组合报告

3.22 投资组合报告

3.23 投资组合报告

3.24 投资组合报告

3.25 投资组合报告

3.26 投资组合报告

3.27 投资组合报告

3.28 投资组合报告

3.29 投资组合报告

3.30 投资组合报告

3.31 投资组合报告

3.32 投资组合报告

3.33 投资组合报告

3.34 投资组合报告

3.35 投资组合报告

3.36 投资组合报告

3.37 投资组合报告

3.38 投资组合报告

3.39 投资组合报告

3.40 投资组合报告

3.41 投资组合报告

3.42 投资组合报告

3.43 投资组合报告

3.44 投资组合报告

3.45 投资组合报告

3.46 投资组合报告

3.47 投资组合报告

3.48 投资组合报告

3.49 投资组合报告

3.50 投资组合报告

3.51 投资组合报告

3.52 投资组合报告

3.53 投资组合报告

3.54 投资组合报告

3.55 投资组合报告

3.56 投资组合报告

3.57 投资组合报告

3.58 投资组合报告

3.59 投资组合报告

3.60 投资组合报告

3.61 投资组合报告

3.62 投资组合报告

3.63 投资组合报告

3.64 投资组合报告

3.65 投资组合报告

3.66 投资组合报告

3.67 投资组合报告

3.68 投资组合报告

3.69 投资组合报告

3.70 投资组合报告

3.71 投资组合报告

3.72 投资组合报告

3.73 投资组合报告

3.74 投资组合报告

3.75 投资组合报告

3.76 投资组合报告

3.77 投资组合报告

3.78 投资组合报告

3.79 投资组合报告

3.80 投资组合报告

3.81 投资组合报告

3.82 投资组合报告

3.83 投资组合报告

3.84 投资组合报告

3.85 投资组合报告

3.86 投资组合报告

3.87 投资组合报告

3.88 投资组合报告

3.89 投资组合报告

3.90 投资组合报告

3.91 投资组合报告

3.92 投资组合报告

3.93 投资组合报告

3.94 投资组合报告

3.95 投资组合报告

3.96 投资组合报告

3.97 投资组合报告

3.98 投资组合报告

3.99 投资组合报告

3.100 投资组合报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明	
姓名	职务	任职日期	离任日期		
孙健	基金经理	2012年9月11日	-	13	2003年起,先后在湘财证券资产管理、中国平安人寿保险有限公司投资部、太平资产管理公司、新华资产管理公司、新华资产管理公司担任基金经理,2011年加入平安基金,任投资管理部研究员,现任平安大华保本混合型证券投资基金基金经理。

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
F	批发和零售业	14,227.60	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

本基金报告期末无股指期货投资。

5.8 报告期末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

本基金报告期末无公允价值权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.0.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.2 本基金投资股指期货的投资策略

6.0.3 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.0.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.5 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.6 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.7 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.17 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.21 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.23 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.27 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.31 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.33 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.35 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.37 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.39 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.41 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.43 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.44 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.45 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.46 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.47 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.48 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.49 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.50 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.51 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.52 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.53 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.54 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.55 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.56 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.57 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.58 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.59 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.60 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.61 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.62 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.63 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.64 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.65 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.66 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.67 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.68 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.69 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.70 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.71 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.72 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.73 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.74 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.75 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.76 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.77 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.78 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.79 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.80 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.81 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.82 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.83 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.84 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.85 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.86 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.87 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.88 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.89 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.90 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.91 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.92 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.93 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.94 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.95 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.96 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.97 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.98 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.99 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

6.0.100 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

平安大华日增利货币市场基金

2014 第二季度报告

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7月18日

基金管理人、基金托管人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。

基金管理人平安大华银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年7月15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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者有风险,投资需谨慎。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。

本报告期内(2014年4月1日起至2014年6月30日止):

5.2 基金基本情况

基金简称	平安大华日增利货币
交易代码	000379
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月3日
报告期末基金份额总额	5,077,119,268.42份

投资目标:在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。

投资策略:根据对未来短期利率变动的预测,确定和调整基金投资组合的平均剩余期限,对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法,确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的资产配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。

业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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:中国建设银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

3.2 基金业绩指标

3.3 主要财务指标

3.4 基金管理人

3.5 投资组合报告

3.6 投资组合报告

3.7 投资组合报告

3.8 投资组合报告

3.9 投资组合报告

3.10 投资组合报告

3.11 投资组合报告

3.12 投资组合报告

3.13 投资组合报告

3.14 投资组合报告

3.15 投资组合报告

3.16 投资组合报告

3.17 投资组合报告

3.18 投资组合报告

3.19 投资组合报告

3.20 投资组合报告

3.21 投资组合报告

3.22 投资组合报告

3.23 投资组合报告

3.24 投资组合报告

3.25 投资组合报告

3.26 投资组合报告

3.27 投资组合报告

3.28 投资组合报告

3.29 投资组合报告

3.30 投资组合报告

3.31 投资组合报告

3.32 投资组合报告

3.33 投资组合报告

3.34 投资组合报告

3.35 投资组合报告

3.36 投资组合报告

3.37 投资组合报告

3.38 投资组合报告

3.39 投资组合报告

3.40 投资组合报告

3.41 投资组合报告

3.42 投资组合报告

3.43 投资组合报告

3.44 投资组合报告

3.45 投资组合报告

3.46 投资组合报告

3.47 投资组合报告

3.48 投资组合报告

3.49 投资组合报告

3.50 投资组合报告

3.51 投资组合报告

3.52 投资组合报告

3.53 投资组合报告

3.54 投资组合报告

3.55 投资组合报告

3.56 投资组合报告

3.57 投资组合报告

3.58 投资组合报告

3.59 投资组合报告

3.60 投资组合报告

3.61 投资组合报告

3.62 投资组合报告

3.63 投资组合报告

3.64 投资组合报告

3.65 投资组合报告

3.66 投资组合报告

3.67 投资组合报告

3.68 投资组合报告

3.69 投资组合报告

3.70 投资组合报告

3.71 投资组合报告

3.72 投资组合报告

3.73 投资组合报告

3.74 投资组合报告

3.75 投资组合报告

3.76 投资组合报告

3.77 投资组合报告

3.78 投资组合报告

3.79 投资组合报告

3.80 投资组合报告