

平安大华策略先锋混合型证券投资基金

2012 第三季度报告

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10月24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预示其未来表现。

本报告自2012年7月1日起至9月30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:2011年12月20日

报告期末基金份额总额:99,928,867.63份

投资策略
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的投资机会,谋求基金资产的持续、稳健增值。

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:本基金为混合型证券投资基金,其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金和货币型基金,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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日至2012年9月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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.本基金净值表现
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

过去三个月 0.60% 0.34% -4.12% 0.71%

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,截至报告期末未满一年;

2.按照本基金的基金合同约定,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

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 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

顾正华 基金经理 2012年5月20日 - 12

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,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,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.3.3 公平交易专项说明

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

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.3 公平交易专项说明

4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.5 公平交易专项说明

4.4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.37 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.39 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.41 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.43 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.45 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.46 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.47 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.48 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.49 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.50 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

净值增长率为0.60%,同期业绩基准增长率为-4.12%。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着新一轮投资稳增长财政政策的逐步出台,市场信心有所恢复,周期类行业面临一定的投资机会,但基于长期产能过剩仍需保持谨慎态度为好;未来投资机会仍然集中在结构转型的成长行业中,但需要等待合理估值。展望4季度,预计在资金偏紧的情况下,市场仍主要是结构性行情,短期适当关注周期类行业的反弹机会,长期把握成长类行业回调买入的机会。

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 15,904,216.91 15.65

其中:股票 15,904,216.91 15.65

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 78,000,000.00 76.73

其中:买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 6,565,262.25 6.46

6 其他资产 1,181,468.63 1.16

7 合计 101,650,947.79 100.00

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 4,091,623.00 4.07

B 采矿业 - -

C 制造业 9,013,250.95 8.96

CO 食品、饮料 - -

C1 纺织、服装、皮毛 1,055,232.90 1.05

C2 木材、家具 - -

C3 造纸、印刷 - -

C4 石油、化学、塑胶、塑料 - -

C5 电子 961,408.00 0.96

C6 金属、非金属 - -

C7 机械、设备、仪表 4,989,562.05 4.96

C8 医药、生物制品 2,007,048.00 1.99

C9 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 376,242.00 0.37

G 信息技术业 958,293.00 0.95

H 批发和零售贸易 - -

I 金融、保险业 - -

J 房地产业 - -

K 社会服务业 - -

L 传播与文化业 - -

M 综合类 1,464,807.66 1.46

合计 15,904,216.91 15.80

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 300210 森远股份 275,417 4,056,892.41 4.03

2 000758 中航光电 399,700 2,953,783.00 2.93

3 000292 中汇金 208,200 2,007,048.00 1.99

4 601117 中国化学 213,218 1,464,807.66 1.46

5 000860 顺鑫农业 86,200 1,137,840.00 1.13

6 600177 雅戈尔 141,642 1,055,232.90 1.05

7 002106 鲁商置业 59,200 961,408.00 0.96

8 300270 中微电子 39,194 958,293.00 0.95

9 002013 中航精机 82,246 932,669.64 0.93

10 300240 华力创通 43,800 376,242.00 0.37

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本报告期末无债券投资组合

5.5 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债券投资明细

注:本报告期末无债券投资组合

5.6 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资产支持证券投资明细

注: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序的前五名权证投资明细

注:本报告期末无权证投资

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 应收证券清算款 -

3 应收股利 1,066,429.90

4 应收利息 -

5 应收申购款 18,203.87

6 其他应收款 96,834.86

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,181,468.63

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。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

5.9 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期初基金份额总额 459,456,398.33

本报告期基金总申购份额 1,932,365.74

减:本报告期基金总赎回份额 361,459,896.44

本报告期基金净申购份额 573,505.63

本报告期末基金份额总额 99,928,867.63

5.10 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 基金管理人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

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内免费查阅,也可按工本费购买复印件

2 投资者对本报告如有任何疑问,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10月24日

平安大华行业先锋股票型证券投资基金

2012 第三季度报告

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10月24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预示其未来表现。

本报告自2012年7月1日起至9月30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:2,057,800,864.28份

投资策略
深入研究中国经济、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管理投资目标,并以追求基金资产的长期稳健增值为最终投资目标。

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

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2012年7月1日至2012年9月30日)

1.本期已实现收益 -113,783,051.43

2.本期利润 -89,548,242.29

3.加权平均基金份额本期利润 -0.04226

4.期末基金资产净值 1,724,090,734.46

5.期末基金份额净值 0.838

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.本基金净值表现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

过去三个月 -4.77% 0.82% -5.82% 1.01%

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约定,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

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 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

顾正华 基金经理 2011年9月20日 - 12

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,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,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.3.3 公平交易专项说明

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

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.3 公平交易专项说明

4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.5 公平交易专项说明

4.4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明