平安大华策略先锋混合型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31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
报告送出日期:2013年4月19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2013年4月19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	42,235,027.72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1月1日 - 2013年3月31日)
1.本期已实现收益	5,212,708.17
2.本期利润	4,246,553.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0773
4.期末基金资产净值	45,489,574.67
5.期末基金份额净值	1.077

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。

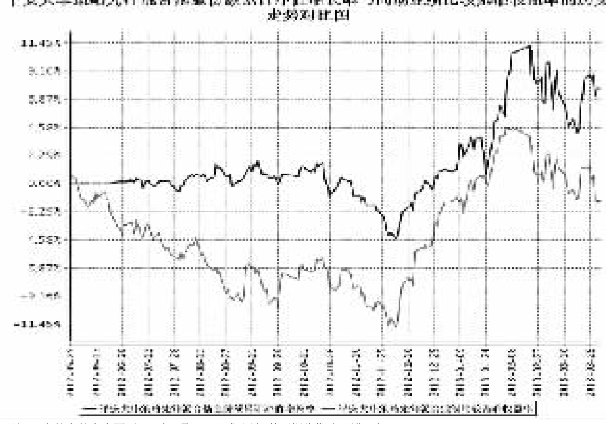
3.2 基金净值表现

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	6.53%	1.19%	0.06%	0.93%	6.47%	0.26%

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

平安大华策略先锋混合型基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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	-	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,现兼任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

2013年股市先扬后抑,总体来看,周期类行业如银行、地产、建筑建材等行业冲高回落态势,而成长股和中小市值个股则总体则呈现逐步上涨的格局。本基金的主要投资策略是集中投资于成长速度快的消费类个股和低估值的大金融类个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年3月31日,本基金份额净值为1.077元,份额累计净值为1.077元。报告期内,本基金份额净值增长率为6.53%,同期业绩基准增长率为0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1季度随着经济复苏进程的一波三折,投资者开始更多思考长期结构问题,而对之前预期较高的周期性行业开始逐步失望。本基金分析未来长期的投资机会仍然会集中在结构转型的成长行业中,另外对于早周期行业如地产、汽车等行业保持谨慎乐观,适当关注过去已经大幅调整到位的行业中的优胜公司。展望2013年全年,经济将继续呈现弱复苏、中低通胀、适当流动性的格局,本基金将积极将自下而上积极把握一些估值合理的成长类公司的投资机会。

§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	28,606,919.98	53.63
	其中:股票	28,606,919.98	53.63
2	固定收益投资	3,964,701.00	7.43
	其中:债券	3,964,701.00	7.43
	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	19,240,801.58	36.07
6	其他资产	1,533,066.09	2.87
7	合计	53,345,488.65	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	采掘业	437,144.00	0.96
C	制造业	13,611,554.00	29.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,335,628.17	2.94
E	建筑业	4,739,671.53	10.42
F	批发和零售业	1,267,209.00	2.79
G	交通运输、仓储和邮政业	557,109.00	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	862,344.00	1.90
J	金融业	4,477,114.60	9.84
K	房地产业	1,319,145.68	2.90
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	28,606,919.98	62.89

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	1,319,700	4,447,389.00	9.78
2	000522	白云山A	181,656	4,432,406.40	9.74
3	600332	广州药业	77,534	2,536,137.14	5.58
4	601328	交通银行	314,400	1,480,824.00	3.26
5	600261	阳光照明	147,654	1,475,063.46	3.24
6	000513	丽珠集团	32,000	1,440,000.00	3.17
7	600750	江中药业	58,880	1,342,464.00	2.95
8	600396	金山股份	215,077	1,335,628.17	2.94
9	601009	南京银行	142,580	1,286,071.60	2.83
10	600739	辽宁成大	92,700	1,267,209.00	2.79

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	3,964,701.00	8.72
8	其他	-	-
9	合计	3,964,701.00	8.72

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	113002	工行转债	36,700	3,964,701.00	8.72

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	57,646.59
2	应收证券清算款	1,450,603.60
3	应收股利	-
4	应收利息	18,701.48
5	应收申购款	6,114.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,533,066.09

5.9.4 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。

5.9.5 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中不存在流通受限情况。

5.9.6 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	79,092,060.83
报告期期间基金总申购份额	2,812,945.29
减:报告期期间基金总赎回份额	39,669,978.40
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	42,235,027.72

§7 备查文件目录

7.1 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

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

7.3 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
2013年4月19日

平安大华行业先锋股票型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31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
报告送出日期:2013年4月19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2013年4月19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	1,426,248,298.62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X85% + 中证全债指数收益率X15%
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(2013年1月1日 - 2013年3月31日)
1.本期已实现收益	193,176,845.73
2.本期利润	193,320,669.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.1125
4.期末基金资产净值	1,484,099,709.59
5.期末基金份额净值	1.041

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。

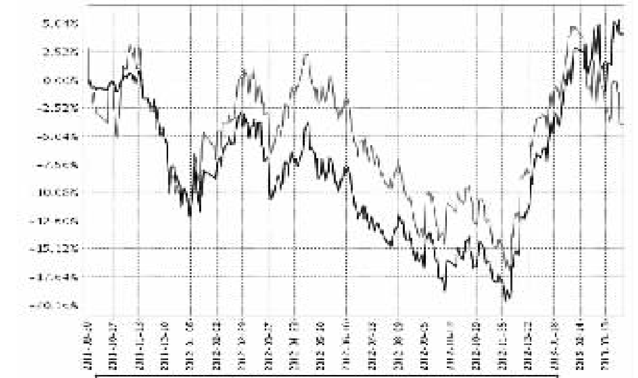
3.2 基金净值表现

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	11.46%	1.18%	-0.64%	1.32%	12.10%	-0.14%

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

平安大华行业先锋股票型基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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		
焦巍	基金经理	2012年10月19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,现任平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金经理。
颜正华	基金经理	2011年9月20日	2012年10月19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,现兼任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 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

2013年1季度股票市场呈现先在经济复苏持续的预期下强势上扬,继而在实际数据面前失望而震荡走低的倒"V"型走势,第四季度带动大盘触底反弹的金融和地产板块在市场对流动性和经济的担心下表现暗淡,而第四季度调整较多的TMT、医药、环保等行业重归市场主流。本基金由于在四季度要集中增持了低估值的银行股,以及一些估值较低的央企蓝筹股,因此在报告期内的前期表现比较落后。在一季度前期,出于对市场风格将从价值向成长转化的判断,本基金进行了较大幅度的行业配置转换,将主要配置从金融行业转向医药、军工和环保及TMT行业。基于对行情将持续结构性分化的判断,本基金仓位基本未做大的变动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年3月31日,本基金份额净值为1.041元,份额累计净值为1.041元。报告期内,本基金份额净值增长率为11.46%,同期业绩基准增长率为-0.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人在去年年底就认为对经济重现2009年的由复苏到过热的期望是不现实的。2013年本基金对市场操作的视角由经济的短周期变化转为政治风格的长周期:对内方面,有着很强基层工作经验背景的新一届政府领导人的政策执行能力决定了地方政府不可能重现近些年来的政策博弈和事实上对规则违反者的奖励。同时领导已经展示了强大的牺牲短期利益来换取长线持续发展的决心。对外方面,新领导层也从"韬光养晦"逐步走向"有所作为"。因此,相对于去年投资操作的"拼博弈",本基金认为今年的投资主调是"听指挥"。长期受益于新型城镇化的医药、环保,制造转型的TMT、科技、军工,将共同构成A股投资的"中国梦"主题。相对于二季度经济可能出现的短周期波动和预期差,上述行业将在长期呈现出更加的确定性。同时,本基金管理人并不认为经济增速的下降对证券市场构成长期的负面影响:一是经济增速下降将降低实体经济对资金的争夺需求;而是经济增速下平台后,成长将成为稀缺品种,因而得到更高的溢价。成长股投资将构成今年结构性行情的主体。

§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	1,240,872,457.12	73.23
	其中:股票	1,240,872,457.12	73.23
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	180,000,000.00	10.62
	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	269,606,329.05	15.91
6	其他资产	4,066,018.77	0.24
7	合计	1,694,544,804.94	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	33,366,205.86	2.25
B	采掘业	44,467,521.56	3.00
C	制造业	836,732,254.99	56.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	112,553,522.79	7.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	102,942,937.76	6.94
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	2,613,756.00	0.18
J	金融业	8,157,221.88	0.55
K	房地产业	15,364,445.98	1.04
L	租赁和商务服务业	6,495,430.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	59,861,378.10	4.03
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	18,317,782.20	1.23
S	综合	-	-
	合计	1,240,872,457.12	83.61

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	600886	国投电力	16,131,541	102,596,600.76	6.91
2	600372	中航电子	4,323,159	99,173,267.46	6.68
3	000538	云南白药	931,759	79,665,394.50	5.37
4	600535	天士力	1,008,544	70,547,652.80	4.75
5	300024	机器人	1,972,838	67,865,627.20	4.57
6	600118	中国卫星	3,668,977	56,392,176.49	3.80
7	600597	光明乳业	3,899,986	55,418,801.06	3.73
8	000999	华润三九	1,731,083	55,394,656.00	3.73
9	000661	长春高新	634,288	54,517,053.60	3.67
10	300026	红日药业	1,079,252	49,429,741.60	3.33

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末无债券投资情况。

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

本报告期末无债券投资情况。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,185,412.09
2	应收证券清算款	2,417,802.91
3	应收股利	-
4	应收利息	93,869.00
5	应收申购款	368,934.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,066,018.77

5.9.4 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。

5.9.5 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。

5.9.6 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	1,928,774,089.86
报告期期间基金总申购份额	11,701,386.89
减:报告期期间基金总赎回份额	514,227,178.13
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,426,248,298.62

§7 备查文件目录

7.1 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

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

7.3 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
2013年4月19日

平安大华深证300指数增强型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31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
报告送出日期:2013年4月19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2013年4月19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	78,804,638.29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x95%+商业银行活期存款利率(税后)X5%
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1月1日 - 2013年3月31日)
1.本期已实现收益	93,304.07
2.本期利润	2,865,867.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0323
4.期末基金资产净值	75,659,249.93
5.期末基金份额净值	0.960

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	2.56%	1.40%	2.76%	1.37%	-0.20%	0.03%

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

平安大华深证300指数增强型基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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。

§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	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。现任平安大华深证300指数增强型基金基金经理。

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 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,在经济复苏的预期带动下,A股市场在1-2月份继续反弹。春节过后,随着各项经济数据逐渐公布,市场再次对于经济复苏的势头表示怀疑,A股市场也因此下跌。本基金在经济复苏逐步证伪的过程中,降低了前期超配的部分周期性行业,而增加了医药、TMT等消费股的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年3月31日,本基金份额净值为0.960元,份额累计净值为1.040元。报告期内,本基金份额净值增长率为2.56%,同期业绩基准增长率为2.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

鉴于对经济的判断,在投资策略上,本基金将把仓位维持在接近上限的位置,通过选择部分优质个股对指数组合中的股票进行替换,力求战胜业绩基准。

§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	71,646,766.69	93.35
	其中:股票	71,646,766.69	93.35
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	4,937,881.49	6.43
6	其他资产	167,945.91	0.22
7	合计	76,752,594.09	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	1,103,215.23	1.46
B	采掘业	3,366,745.30	4.45
C	制造业	41,661,596.86	55.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,658,929.17	2.19
E	建筑业	1,738,467.14	2.30
F	批发和零售业	3,627,944.98	4.80
G	交通运输、仓储和邮政业	538,489.86	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,282,268.52	3.02
J	金融业	3,740,714.15	4.94
K	房地产业	4,633,975.15	6.12
L	租赁和商务服务业	306,778.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	974,062.45	1.29
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	597,395.06	0.79
S	综合	354,386.76	0.47
	合计	66,584,968.63	88.01

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	1,272,222.50	1.68
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	-	-
J	金融业	1,684,379.90	2.23
K	房地产业	2,105,195.66	2.78
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	5,061,798.06	6.69

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	243,033	2,615,035.08	3.46
2	000651	格力电器	83,658	2,390,109.06	3.16
3	000858	五 粮 液	58,462	1,306,041.08	1.73
4	000776	广发证券	97,279	1,269,490.95	1.68
5	000157	中联重科	155,270	1,248,370.80	1.65
6	000423	东阿阿胶	19,804	1,031,788.40	1.36
7	002024	苏宁电器	156,198	994,981.26	1.32
8	000895	双汇发展	11,611	938,168.80	1.24
9	000527	美的电器	98,494	904,174.92	1.20
10	000538	云南白药	10,210	872,955.00	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	600162	香江控股	325,378	2,105,195.66	2.78
2	601166	兴业银行	97,363	1,684,379.90	2.23
3	600597	光明乳业	30,850	438,378.50	0.58
4	002528	英飞拓	31,300	344,300.00	0.46
5	600252	中恒集团	23,400	298,584.00	0.39

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末无债券投资情况。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,863.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,063.25
5	应收申购款	142,019.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	167,945.91

5.9.4 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。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.9.5.1 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

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	000527	美的电器	904,174.92	1.20	临时停牌

5.9.5.2 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

本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.9.6 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	108,187,945.22
报告期期间基金总申购份额	13,043,782.47
减:报告期期间基金总赎回份额	42,427,089.40
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	78,804,638.29

§7 备查文件目录

7.1 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

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

7.3 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
2013年4月19日