（上接B242版）

本基金为保本混合型基金，保本期为三年，保本但不保证收益。在目前国内金融市场环境下，银行定期存款类似于保本定息产品，因此，本基金以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，可以合理的衡量本基金保本的有效性，能够使投资人理性判断本基金产品的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时，本基金管理人可以与基金托管人协商一致，在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

（七）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。

（八）投资限制

1.组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

（2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（5）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

（6）本基金在保本期内投资稳健资产占基金资产的比例不低于60%，投资风险资产占基金资产的比例不高于40%；

（7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（9）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（10）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（11）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（12）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（13）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（14）保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

（15）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

（16）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资比例限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。过渡期结束，本基金进入下一个保本期的，基金管理人应当自下一个保本期开始之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关保本期内投资的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

2.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

（9）法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（九）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2.不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3.有利于基金财产的安全与增值；

4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

（十）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

（十一）基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2013年6月30日。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	707,376,900.00	90.15
	其中：债券	707,376,900.00	90.15
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	47,600,162.75	6.07
	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	8,830,085.88	1.13
6	其他各项资产	20,828,677.66	2.65
7	合计	784,635,826.29	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	49,820,000.00	6.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,168,000.00	18.08
	其中：政策性金融债	140,168,000.00	18.08
4	企业债券	446,354,900.00	57.56
5	企业短期融资券	29,994,000.00	3.87
6	中期票据	41,040,000.00	5.29
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	707,376,900.00	91.22

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	1,400,000	140,168,000.00	18.08
2	112119	12恒邦债	500,000	50,300,000.00	6.49
3	112121	12景兴债	500,000	49,927,500.00	6.44
4	120019	12附息国债19	500,000	49,820,000.00	6.42
5	1282357	12红豆MTN2	400,000	41,040,000.00	5.29

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

8.投资组合报告附注

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。

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。

8.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	584,607.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,224,351.90
5	应收申购款	19,718.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,828,677.66

8.4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。

8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.6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。

本基金在到期期间和过渡期内时，基金的投资适用如下约定：

基金管理人应在到期期间和过渡期内使基金资产保持现金形式，且基金管理人和基金托管人在到期期间（除保本期到期日）和过渡期内应免收基金管理费和基金托管费。

若本基金保本期到期后变更为“平安大华灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准和风险收益特征适用如下：

（一）投资目标

通过捕捉股票市场、债券市场不同演变趋势，把握在不同行情中可行的投资机会，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中长期稳健回报为最终投资目标。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的股票（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、央行票据、短期融资券、超级短期融资券、商业银行次级债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、定期存款等银行存款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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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30%-80%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为20%-70%；权证投资比例不高于基金资产净值的3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%。

（三）投资理念

在资产配置和股票、债券种类选择上注重数量化分析和模型构建。依据股票、固定收益类证券、金融衍生产品等不同市场的风险－收益预期，灵活合理配置大类资产，捕捉不同市场的超额收益机会。

（四）投资策略

1、资产配置策略

本基金基于宏观经济环境、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。

本基金通过平安大华大类资产配置评价体系（TAES）（PINGAN-UOB TACTICAL ASSET EVALUATION SYSTEM）系统化管理各大类资产的配置比例。平安大华大类资产配置评价体系（TAES）分析因素具体包括：宏观经济因素、政府政策因素、盈利因素、估值因素、流动性因素和行为因素六个方面，并将各子因素的细分指标划分为先行指标、同步指标和预警指标三类。

本基金严谨衡量不同类别资产的预期风险/收益特征，评估股票市场相对投资价值。在实际投资运作中，不同时期或预期的大类资产配置策略如下：

（1）预期股票市场将趋势上涨，或整体股票市场处于低估值的安全区域，本基金将通过高仓位配置股票资产，低配或者少配债券资产，以增加获取股票市场潜在收益的可能性。

（2）股票市场处于震荡阶段、方向不明确时，本基金将动态调整股票资产、债券资产比例，以波段操作策略为主。重点选择被市场低估的或因市场情绪变化而大幅下跌的行业中的优质个股进行波段操作，追求投资组合的正阿尔法收益。

（3）预期股票市场将趋势下跌，或整体股票市场处于高估值的风险区域，本基金将及时降低股票资产配置比例，最低可至股票资产最低比例。同时适度增加债券资产配置比例，严格控制投资组合风险，避免或减少可能给投资人带来潜在的资本损失。

2、股票投资策略

本基金秉持自下而上的投资理念，在股票投资策略中，通过QV选股标准（品质－价值选股模型）精选个股。同时，针对目前中国经济和证券市场不确定性的特点，采用成长与价值动态均衡投资（GVDBI）策略发掘主题轮动的投资机会。

（1）QV选股标准（品质－价值选股模型）

在此基础上，通过QV选股标准（品质－价值选股模型）对入选股票进行基本面的分析，以从中挑选出质地优良、具有投资价值的股票。QV选股标准（品质－价值选股模型）筛选主要包括以下几个方面：

●品质评估（Quality）

●商业模式（Business Model）：商业模式清晰，有前途。

●公司治理（Management）：公司有良好治理结构，包括管理层水平、战略眼光、执行能力和公司运作架构等方面。

●财务状况（Financial）：财务状况健康。包括较高的ROE，低负债水平，高毛利或低成本，资本开支政策严格。

●估值评级（Valuation）

●未来盈利：对公司未来的盈利进行预测，并评估内在价值。

●合理价格：投资股票的策略持续有效的基础是，可以用合理价格买到有吸引力的股票。如果买入一家优秀企业的股票而支付了过高价格，这将抵消这一优秀企业未来几年所创造的价值。

本基金的股票精选库股票需要有内部深度研究报告支持或基金经理投资报告支持，并通过QV选股标准（品质－价值选股模型）筛选股票构成本基金的股票精选库。本基金精选库每季度调整一次，具体股票数目将根据中国证券市场的发展同步调整。

（2）成长与价值动态均衡投资（GVDBI）

根据“平安大华大类资产配置评价体系”对证券市场走势进行预判，采用成长与价值动态均衡投资（GVDBI）策略：在看多后市的前提下，主要从成长股票中构建基金组合，追求获得更多超额收益；反之，看空后市则主要从价值股票中构建基金组合，追求落袋为安的投资正回报；调整行情中，根据市场多空双方力量强弱和持续时间，采用灵活权重调整策略，平衡基金组合的风险与预期收益。

3、债券投资策略

本基金可投资的债券品种包括国债、中期票据、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、商业银行次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、可转换债券（包括分离交易的可转换债券）、债券回购、定期存款等银行存款等。综合考虑宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势，采取自上而下和自下而上结合的投资策略积极选择和配置债券资产。

本基金在具体债券组合构建时，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。

（1）利率预期策略

首先根据对国内外经济形势的预测，分析市场投资环境的变化趋势，重点关注利率趋势变化。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素，对利率走势形成合理预期。

（2）类属资产配置

在类属资产配置层次，根据市场和类属资产的风险收益特征，在判断各类属的利率期限结构与交易活跃的国家信用等级短期券利率期限结构应具有的合理利差水平基础上，将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等子市场。结合各类属资产的市场容量、信用等级和流动性特点，在此基础上运用修正的均值－方差等模型，对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

（3）久期策略

根据对利率期限结构变化的预判，对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案，以降低可能的利率变化给组合带来的损失。具体久期目标的确定将视利率期限结构变化方向而定，例如在预计利率期限结构可能变的更加陡峭时，不久的将来长期债券的价格可能会由于长期利率的上升而下跌，短期债券的价格可能会由于短期利率的下降而上涨，因此可制定适量降低组合久期的目标，增加对短期债券的投资，同时减少对长期债券的投资。

在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资，获取超额的投资收益。

4、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

5、资产支持证券投资策略

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。

6、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60% ＋ 中证全债指数收益率×40%。

（六）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，低于股票型基金。

（七）投资限制

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

（2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（5）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

（6）本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30%-80%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为20%-70%；

（7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（9）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（10）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（11）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（12）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（13）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（14）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

（15）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%。

（16）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

（17）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%。

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。

（18）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定。

（19）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%。

（20）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

（21）法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金转型之日起开始。

2.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

（9）法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（八）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2.不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3.有利于基金财产的安全与增值；

4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

（九）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

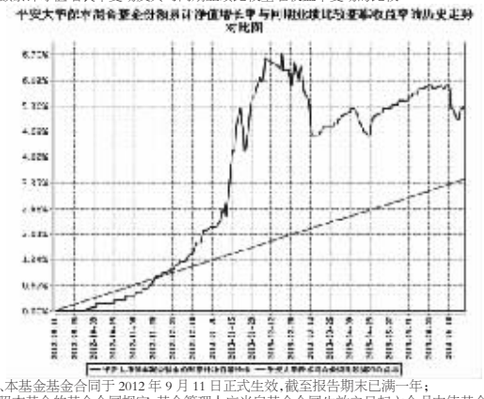
八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、自基金合同生效以来（2012年9月11日）至2013年6月30日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
2012.9.11-2012.12.31	2.20%	0.05%	1.32%	0.01%	0.88%	0.04%
2013.1.1-2013.6.30	3.13%	0.23%	2.08%	0.02%	1.05%	0.21%
自基金合同生效起至今	5.40%	0.18%	3.41%	0.01%	1.99%	0.17%

注：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。二、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。

九、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1.基金管理人的管理费；

2.基金托管人的托管费；

3.基金财产拨划支付的银行费用；

4.基金合同生效后的基金信息披露费用；

5.基金份额持有人大会费用；

6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7.基金的证券交易费用；

8、基金的开户费用、账户维护费用

9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5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，支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5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，支付日期顺延。

若保本期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“平安大华灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上，此项调整无需召开基金份额持有人大会。

本基金在到期期间（除保本期到期日）和过渡期内，基金管理人和基金托管人应免收基金管理费和基金托管费。

3.除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十、其他应披露事项

（一）本基金管理人、基金托管人目前无重大诉讼事项。

（二）最近半年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。

（三）2013年3月12日至2013年9月11日发布的公告：

1、2013年3月29日，平安大华保本混合型证券投资基金2012年年度报告及其摘要

2、2013年4月19日，平安大华保本混合型证券投资基金2013第一季度报告

3、2013年7月17日，平安大华保本混合型证券投资基金2013第二季度报告

4、2013年8月27日，平安大华保本混合型证券投资基金2013年半年度报告

5、2013年8月19日，关于新增深圳市前海凤凰财富基金销售有限公司为基金代销机构的公告

（四）《招募说明书》与本次更新的招募说明书内容若有不一致之处，以本次更新的招募说明书为准。

十一、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、及其他相关法律法规的要求及基金合同的规定，对2012年8月9日公布的《平安大华保本混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1、根据最新资料，更新了“二、基金管理人”部分。

2、根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。

3、根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。

4、“十四、基金的投资”中，根据最新资料，更新了“（十一）基金投资组合报告”的内容。

5、根据最新资料，更新了“十五、基金的业绩”的内容。

6、在“二十七、其他应披露的事项”部分，更新了2013年3月12日至2013年9月11日期间涉及本基金的公告。

平安大华基金管理有限公司
2013年10月25日

孚日集团股份有限公司

2013 第三季度报告 证券代码：002083 证券简称：孚日股份 公告编号：定2013-004

第一节 重要提示

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

所有董事均已出席了审议本次季报的董事会会议。

公司负责人孙日贵、主管会计工作负责人吴明凤及会计机构负责人张萌声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

第二节 主要财务数据及股东变化

一、主要会计数据和财务指标

公司是否因会计政策变更及会计差错更正等追溯调整或重述以前年度会计数据

□ 是 √ 否

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减（%）
总资产（元）	6,774,668,117.30	6,926,140,003.08	-2.19%
归属于上市公司股东的净资产（元）	2,847,650,245.85	2,806,805,764.27	1.46%

	本报告期	本报告期比上年同期增减（%）	年初至报告期末	年初至报告期末比上年同期增减（%）
营业收入（元）	1,064,341,171.50	-0.84%	3,279,457,540.21	-2.66%
归属于上市公司股东的净利润（元）	6,701,645.74	81.37%	131,237,346.45	49.47%
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润（元）	6,707,010.27	54.46%	130,852,247.51	142.97%
经营活动产生的现金流量净额（元）	--	--	957,995,682.30	59.24%
基本每股收益（元/股）	0.007	75%	0.14	55.56%
稀释每股收益（元/股）	0.007	75%	0.14	55.56%
加权平均净资产收益率（%）	0.23%	0.1%	4.65%	1.62%

非经常性损益项目和金额

√ 适用 □ 不适用

单位：元

项目	年初至报告期期末金额	说明
非流动资产处置损益（包括已计提资产减值准备的冲销部分）	-279,488.63	
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	138,282.86	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	654,671.03	
减：所得税影响额	128,366.32	
合计	385,098.94	--

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因

□ 适用 √ 不适用

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

单位：股

报告期末股东总数	91,499

前10名股东持股情况

股东名称	股东性质	持股比例（%）	持股数量	持有有限售条件的股份数量	质押或冻结情况	
					股份状态	数量
山东孚日控股股份有限公司	境内非国有法人	23.42%	219,818,617		质押	143,000,000
孙日贵	境内自然人	6.44%	60,413,796	60,310,347	质押	53,500,000
平安信托有限责任公司－平安财富*睿富六号集合资金信托计划	其他	2.13%	20,000,000			
孙勇	境内自然人	2.06%	19,359,664	16,822,398		
单秋娟	境内自然人	1.97%	18,449,258		质押	13,500,000
中信证券股份有限公司约定购回专用账户	其他	1.53%	14,398,400			
杨宝坤	境内自然人	1.43%	13,461,071			
张武先	境内自然人	1.11%	10,373,157			
秦丽华	境内自然人	0.89%	8,396,912			
吕希耀	境内自然人	0.76%	7,104,876		质押	2,000,000

前10名无限售条件股东持股情况

股东名称	持有无限售条件股份数量	股份种类	
		股份种类	数量
山东孚日控股股份有限公司	219,818,617	人民币普通股	219,818,617
平安信托有限责任公司－平安财富*睿富六号集合资金信托计划	20,000,000	人民币普通股	20,000,000
单秋娟	18,449,258	人民币普通股	18,449,258
中信证券股份有限公司约定购回专用账户	14,398,400	人民币普通股	14,398,400
杨宝坤	13,461,071	人民币普通股	13,461,071
张武先	10,373,157	人民币普通股	10,373,157
秦丽华	8,396,912	人民币普通股	8,396,912
吕希耀	7,104,876	人民币普通股	7,104,876
王培凤	4,095,000	人民币普通股	4,095,000
郭丙州	3,272,587	人民币普通股	3,272,587
上述股东关联关系或一致行动的说明	孙日贵、孙勇、单秋娟、杨宝坤、张武先、秦丽华、吕希耀、王培凤、郭丙州均为山东孚日控股股份有限公司的股东，除此之外未知其他股东之间有无关联关系或是否属于一致行动人。		
参与融资融券业务股东情况说明（如有）	公司股东山东孚日控股股份有限公司通过普通证券账户持有183,818,617股，通过中信证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户持有3600万股，实际合计持有219,818,617股。		

公司股东在报告期内是否进行约定购回交易

□ 是 √ 否

第三节 重要事项

一、报告期主要会计报表项目、财务指标发生重大变动的情况及原因

1、资产负债表项目

(1)货币资金2013年9月30日期末数322,392,599.19元，比期初数减少38.8%，主要原因是付款及时所致。

(2) 预付账款2013年9月30日期末数136,554,864.13元，比期初数增加50.38%，主要原因是预付原材料款所致。

（3）应收票据2013年9月30日期末数为7,804,217.4元，比期初数减少56.19%，主要原因是本期使用银行承兑汇票方式进行结算的货款减少。

（4）其他流动资产2013年9月30日期末数为0元，比期初数减少100%，主要原因是预交税金转应交税金。

（5）长期股权投资2013年9月30日期末数为1,217,966.59元，比期初数减少97.27%，主要原因是处置了对埃孚光伏的投资所致。

（6）预收账款2013年9月30日期末数为145,133,393.48元，比期初数增加229.41%，主要是孚日地产预收房款增加所致。

（7）应交税费2013年9月30日期末数为36,146,076.39元，期初数为-18,374,891.17元，主要是期初进项税额留抵较多。

（8）其他流动负债2013年9月30日期末数为31,630,230.89元，比期初数减少87.68%，主要原因是偿还短期债券所致。

（9）长期借款2013年9月30日期末数为400,000,000元，比期初数增加82.04%，主要是增加新的长期借款所致。

（10）库存股2013年9月30日期末数为98,048,206元，比期初数增加1139.38%，主要是回购股票增加所致。

（11）未分配利润2013年9月30日期末数为535,365,824.43元，比期初数增加32.47%，主要是本年利润增加所致。

2、利润表项目

（1）管理费用2013年1-9月发生数为222,701,460.77元，比上年同期数增加52.93%，其主要原因是公司光伏项目相关资产的折旧计入管理费用所致。

（2）投资收益2013年1-9月发生数为-2,082,593.42元，上年同期数32,017,080.89元，主要是报告期内公司完成了埃孚光伏的清算注销工作，投资损失主要是处置埃孚光伏的清算损失。

（3）营业外收入2013年1-9月发生数为2,503,250.38元，比上年同期数减少96.04%，其主要原因是去年同期政府补助较多。

（4）营业外支出2013年1-9月发生数为1,989,785.12元，比上年同期数减少38.3%，其主要原因是处置非流动资产减少所致。

（5）所得税费用2013年1-9月发生数为49,130,871.57元，比上年同期增加64.