平安大华行业先锋股票型证券投资基金

2014 年度报告摘要

2014年12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
送出日期：2015 年 3 月 26 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2015 年 3 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华行业先锋股票
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	588,446,441.27 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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×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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安大华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	肖宇鹏	王永民
	联系电话	0755-22623179	010-66594896
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	259,943,068.02	478,152,519.00	-310,103,352.74
本期利润	188,713,265.86	404,228,283.61	59,337,633.68
加权平均基金份额本期利润	0.2538	0.3721	0.0273
本期基金份额净值增长率	23.65%	36.35%	3.43%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.2302	0.0803	-0.1745
期末基金资产净值	723,903,167.09	793,052,477.05	1,801,039,984.17
期末基金份额净值	1.230	1.080	0.934

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.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3.上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。

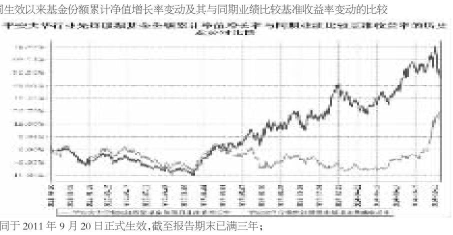
3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	-5.31%	1.64%	37.29%	1.40%	-42.60%	0.24%
过去六个月	11.21%	1.43%	52.96%	1.13%	-41.75%	0.30%
过去一年	23.65%	1.37%	45.02%	1.03%	-21.37%	0.34%
过去三年	74.38%	1.30%	45.51%	1.10%	28.87%	0.20%
自基金合同生效起至今	57.47%	1.26%	31.10%	1.12%	26.37%	0.14%

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%

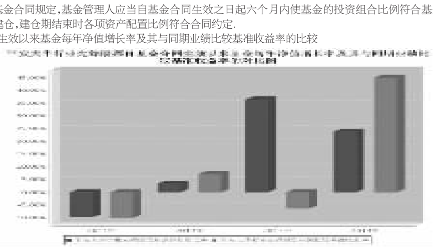
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1、本基金基金合同于 2011 年 9 月 20 日正式生效，截至报告期末已满三年；

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	1.000	59,567,767.39	10,925,780.23	70,493,547.62	
2013	1.800	122,201,018.14	11,103,911.49	133,304,929.63	
2012	0.000	0.00	0.00	0.00	
合计	2.800	181,768,785.53	22,029,691.72	203,798,477.25	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安大华基金管理有限公司（以下简称"平安基金"）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 3 亿元人民币，是目前中国内地基金业注册资本金最高的基金公司之一。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股权 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。

平安基金秉承"规范、诚信、专业、创新"企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富的客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现"以专业承载信赖"的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2014 年 12 月 31 日，平安基金共管理七只开放式基金，资产管理总规模超 125 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2014年 9 月 22 日	12	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，任平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金经理。
胡昆明	基金经理	2014年 9 月 12 日	–	12	北京大学光华管理学院硕士。12 年证券基金从业经验，曾先后任职于巨田证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、平安资产管理有限公司担任行业研究员、行业研究经理、高级行业研究经理，2009 年加入平安大华基金管理有限公司，担任行业研究员，现任平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定并下发了《平安大华基金管理有限责任公司公平交易管理制度》、《平安大华基金管理有限责任公司异常交易监控及报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期连续四个季度期间内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2014 年宏观经济数据，国内工业产出持续下滑，企业利润同比降至个位数，价格指标下挫显著，短期经济弱势格局仍将继续。与此相对应的是财政和货币政策持续宽松，对中小企业的减税，四季度的降息，都显示出降低社会融资成本的决心；但从全年来看，社会融资成本仍维持在高位。因此，我们的持仓主要集中于信息服务、军工等与宏观经济相关度低的行业，中小盘和创业板的个股居多；但在 2014 年 11 月降息后，随着大盘股的上涨，小盘股持续下跌，导致基金净值出现下滑，本基金管理人对没有抓住四季度大盘股的行情深表歉意。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.230 元，份额累计净值为 1.510 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 23.65%，同期业绩基准增长率为 45.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人看好 2015 年权益资产的投资机会，特别是在经济调整过程中，私人部门的资产重新配置，将使得权益类资产越来越受到资金的追捧。2014 年四季度以来的巨额日成交量，已经使得市场具备了趋势性向上的基础，我们认为主板和中小板创业板均有投资机会，市场赚钱效应仍很大。在降低社会融资成本的背景下，金融改革、国企改革、政府放松管制，都将为市场注入好的预期，金融、地产、国企整合、新兴技术和互联网对传统行业的渗透，都是我们看好的方向。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切以规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部、运营部及监察稽核部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理，特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的基金管理人于 2014 年 02 月 15 日发布《平安大华行业先锋股票型证券投资基金分红公告》，收益分配基准日为 2014 年 2 月 12 日，每 10 份基金份额发放现金红利为 1 元，具体参见本报告"7.4.11 利润分配情况"。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对平安大华行业先锋股票型证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字（2015）第 22611 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	平安大华行业先锋股票型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的平安大华行业先锋股票型证券投资基金财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人平安大华基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、实施和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了平安大华行业先锋股票型证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况	
注册会计师的姓名	曹银华	边晓红
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼	
审计报告日期	2015年 3 月 20 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安大华行业先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年 12 月 31 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		61,925,880.40	31,968,547.27
结算备付金		9,508,915.19	6,874,798.72
存出保证金		429,264.93	361,120.54
交易性金融资产		534,500,263.76	637,232,737.71
其中：股票投资		534,500,263.76	637,232,737.71
基金投资		–	–
债券投资		–	–
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		110,000,000.00	110,000,000.00
应收证券清算款		67,419,409.30	18,225,567.92
应收利息		18,671.72	46,840.22
应收股利		–	–
应收申购款		1,003,201.60	123,882.45
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		784,805,606.90	804,833,494.83
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2014年 12 月 31 日**	**上年度末 2013年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		40,701,036.85	–
应付赎回款		6,622,763.07	1,867,258.24
应付管理人报酬		1,008,844.23	996,768.29
应付托管费		168,140.68	166,128.05
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		10,432,140.37	6,631,151.16
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		1,969,514.61	2,119,712.04
负债合计		60,902,439.81	11,781,017.78
所有者权益：			
实收基金		588,446,441.27	734,086,917.80
未分配利润		135,456,725.82	58,965,559.25
所有者权益合计		723,903,167.09	793,052,477.05
负债和所有者权益总计		784,805,606.90	804,833,494.83

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.230 元，基金份额总额 588,446,441.27 份。

7.2 利润表

会计主体：平安大华行业先锋股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		214,305,732.71	437,300,979.69
1.利息收入		3,157,199.49	3,536,782.31
其中：存款利息收入		1,407,603.81	1,352,626.90
债券利息收入		69,904.11	249.53
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		1,679,691.57	2,183,905.88
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以"-"填列）		281,829,925.75	506,945,656.98
其中：股票投资收益		278,806,968.72	504,128,557.87
基金投资收益		–	–
债券投资收益		614,102.05	52,880.47
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		2,408,854.98	2,764,218.64
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		-71,229,802.16	-73,924,235.39
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		–	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）		548,409.63	742,775.79
减：二、费用		25,592,466.85	33,072,696.08
1.管理人报酬		12,773,699.86	17,408,377.91
2.托管费		2,128,949.96	2,901,396.29
3.销售服务费		–	–
4.交易费用		10,245,408.89	12,288,395.15
5.利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6.其他费用		444,408.14	474,526.73
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		188,713,265.86	404,228,283.61
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		188,713,265.86	404,228,283.61

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华行业先锋股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	734,086,917.80	58,965,559.25	793,052,477.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	–	188,713,265.86	188,713,265.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-145,640,476.53	-41,728,551.67	-187,369,028.20
其中：1.基金申购款	399,676,359.28	56,427,333.27	456,103,692.55
2.基金赎回款	-545,316,835.81	-98,155,884.94	-643,472,720.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	–	-70,493,547.62	-70,493,547.62
五、期末所有者权益（基金净值）	588,446,441.27	135,456,725.82	723,903,167.09
项目	**上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日**		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,928,774,089.86	-127,734,105.69	1,801,039,984.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	–	404,228,283.61	404,228,283.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-1,194,687,172.06	-84,223,689.04	-1,278,910,861.10
其中：1.基金申购款	144,181,188.08	9,919,210.52	154,100,398.60
2.基金赎回款	-1,338,868,360.14	-94,142,899.56	-1,433,011,259.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	–	-133,304,929.63	-133,304,929.63
五、期末所有者权益（基金净值）	734,086,917.80	58,965,559.25	793,052,477.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

______罗春风______ ______林婉文______ ____李娟____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安大华行业先锋股票型证券投资基金投资基金(以下简称"本基金")，系经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2011]1111 号《关于核准平安大华行业先锋股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人平安大华基金管理有限公司向社会公开发行募集，本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为 2011 年 8 月 15 日至 2011 年 9 月 16 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,197,219,239.94 元，经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2011)验字第 60937497_H01 号验资报告。经向中国证监会备案，《平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,198,155,247.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 936,007.43 份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司，注册登记机构为平安大华基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称"中国银行"）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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。本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中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，基金保留的现金以及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%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×85% + 中证全债指数收益率×15%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称"企业会计准则"）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2014 年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税；及根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券责任公司（"平安证券"）	基金管理人的股东的子公司
中国平安保险（集团）股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
平安证券	85,097,067.93	1.18%	980,046,137.11	12.14%

债券交易

本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的债券交易。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
平安证券	–	–	920,000,000.00	10.26%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
平安证券	77,472.30	1.38%	2,247,924.75	21.55%
关联方名称	**上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日**			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
平安证券	879,126.50	13.21%	2,170,452.45	32.73%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,773,699.86	17,408,377.91
其中：支付销售机构的客户维护费	3,113,506.80	4,498,112.08

注：1）基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%/ 当年天数
H 为每日应支付的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 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、休息日等，支付日期顺延。

2）本期末本基金未支付的管理费余额 1,008,844.23 元（2013 年 12 月 31 日：996,768.29 元）。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,128,949.96	2,901,396.29

注：1）基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/ 当年天数
H 为每日应支付的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 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、休息日等，支付日期顺延。

2）本期末本基金未支付的托管费余额 168,140.68 元（2013 年 12 月 31 日：人民币 166,128.05 元）。

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间均无销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2011 年 9 月 20 日）持有的基金份额	–	49,999,000.00
期初持有的基金份额	–	49,999,000.00
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减：期间赎回/卖出总份额	–	49,999,000.00
期末持有的基金份额	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	61,925,880.40	1,112,742.23	31,968,547.27	1,224,635.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均无参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项说明。

7.4.9 期末（ 2014 年 12 月 31 日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期内无因认购新发 / 增发而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300168	万达信息	2014年 12 月 31 日	重大事项	46.20	2015年 1 月 8 日	44.50	504,878	12,085,238.10	23,325,363.60	–

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2014 年 12 月 31 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	534,500,263.76	68.11
	其中：股票	534,500,263.76	68.11
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	110,000,000.00	14.02
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	71,434,795.59	9.10
7	其他各项资产	68,870,547.55	8.78
8	合计	784,805,606.90	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	28,301,051.77	3.91
C	制造业	179,131,341.70	24.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,899,821.44	4.68
E	建筑业	21,840,000.00	3.02
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	17,720,575.90	2.45
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,388,103.62	11.24
J	金融业	88,544,459.40	12.23
K	房地产业	67,555,082.56	9.33
L	租赁和商务服务业	16,119,827.37	2.23
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	534,500,263.76	73.84

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600588	用友网络	1,894,838	44,509,744.62	6.15
2	002303	美盈森	2,000,081	26,841,087.02	3.71
3	300168	万达信息	504,878	23,325,363.60	3.22
4	601668	中国建筑	3,000,000	21,840,000.00	3.02
5	600048	保利地产	2,000,000	21,640,000.00	2.99
6	600036	招商银行	1,300,000	21,567,000.00	2.98
7	600019	宝钢股份	3,000,000	21,030,000.00	2.91
8	000939	凯迪电力	1,862,815	20,956,668.75	2.89
9	600271	航天信息	675,627	20,613,379.77	2.85
10	002662	京威股份	1,639,598	19,839,135.80	2.74

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600886	国投电力	128,603,481.02	16.22
2	002048	宁波华翔	125,591,650.34	15.84
3	002049	同方国芯	91,615,839.51	11.55
4	300017	网宿科技	72,772,238.77	9.18
5	600372	中航电子	70,967,816.24	8.95
6	600118	中国卫星	69,230,429.74	8.73
7	300037	新宙邦	59,884,156.31	7.55
8	002030	达安基因	56,292,369.49	7.10
9	300124	汇川技术	55,872,596.67	7.05
10	300147	香雪制药	52,804,965.06	6.66
11	002390	信邦制药	51,935,039.74	6.55
12	000550	江铃汽车	51,124,199.00	6.45
13	300168	万达信息	50,319,491.03	6.35
14	002179	中航光电	46,986,156.75	5.92
15	600588	用友网络	42,220,502.30	5.32
16	002353	杰瑞股份	41,971,328.95	5.29
17	002368	太极股份	41,224,546.51	5.20
18	300024	机器人	41,048,410.57	5.18
19	002303	美盈森	40,918,490.04	5.16
20	600446	金证股份	40,406,121.08	5.10
21	600271	航天信息	39,244,773.75	4.95
22	002649	博彦科技	38,281,300.09	4.83
23	002065	东华软件	37,326,444.28	4.71
24	600036	招商银行	37,061,057.06	4.67
25	300012	华测检测	35,985,039.15	4.54
26	600637	百视通	35,263,388.10	4.45
27	000027	深圳能源	34,078,592.17	4.30
28	002690	美亚光电	33,379,620.91	4.21
29	002611	东方精工	31,835,602.70	4.01
30	000651	格力电器	29,273,727.63	3.69
31	300369	绿盟科技	28,769,645.20	3.63
32	002022	科华生物	28,761,211.13	3.63
33	001696	宗申动力	28,007,069.04	3.53
34	000768	中航飞机	27,993,969.52	3.53
35	002228	合兴包装	27,989,811.82	3.53
36	600580	卧龙电气	26,802,758.45	3.38
37	600999	招商证券	26,618,257.01	3.36
38	002019	亿帆鑫富	26,267,614.46	3.31
39	300049	福瑞股份	25,886,268.13	3.26
40	002023	海特高新	25,802,130.31	3.25
41	000988	华工科技	24,451,857.01	3.08
42	601818	光大银行	24,449,615.46	3.08
43	600143	金发科技	23,350,186.14	2.94
44	300273	和佳股份	23,254,542.92	2.93
45	600624	复旦复华	22,999,872.13	2.90
46	300322	硕贝德	22,992,835.63	2.90
47	601098	中南传媒	22,832,133.46	2.88
48	300244	迪安诊断	22,358,185.34	2.82
49	002268	卫士通	22,158,189.79	2.79
50	000939	凯迪电力	21,628,608.04	2.73
51	000919	金陵药业	21,530,075.83	2.71
52	002662	京威股份	21,389,190.05	2.70
53	002338	奥普光电	21,169,655.39	2.67
54	600597	光明乳业	20,933,322.63	2.64
55	000733	振华科技	20,853,313.23	2.63
56	300002	神州泰岳	20,533,902.33	2.59
57	600019	宝钢股份	20,505,400.00	2.59
58	002535	林州重机	20,403,481.81	2.57
59	002727	一心堂	20,256,197.04	2.55
60	601668	中国建筑	20,146,432.42	2.54
61	600104	上汽集团	19,994,355.18	2.52
62	600879	航天电子	19,890,745.33	2.51
63	600048	保利地产	19,782,099.52	2.49
64	002285	世联行	19,482,623.13	2.46
65	600125	铁龙物流	19,214,003.88	2.42
66	300291	华录百纳	19,027,694.23	2.40
67	300274	阳光电源	18,995,069.49	2.40
68	000963	华东医药	18,981,584.11	2.39
69	300178	腾邦国际	18,724,767.19	2.36
70	600832	东方明珠	18,719,303.33	2.36
71	600415	小商品城	18,637,094.71	2.35
72	002334	英威腾	18,622,484.84	2.35
73	600885	宏发股份	18,574,453.91	2.34
74	300007	汉威电子	18,012,369.22	2.27
75	300177	中海达	17,989,393.64	2.27
76	600030	中信证券	17,333,000.00	2.19
77	002657	中科金财	16,837,420.46	2.12
78	300383	光环新网	16,449,122.30	2.07
79	002051	中工国际	16,331,987.34	2.06
80	002484	江海股份	15,996,689.82	2.02
81	300151	昌红科技	15,993,350.34	2.02
82	603000	人民网	15,943,464.86	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002048	宁波华翔	149,488,611.79	18.85
2	600372	中航电子	140,534,663.75	17.72
3	600118	中国卫星	132,704,074.69	16.73
4	600886	国投电力	120,223,648.08	15.16
5	002049	同方国芯	111,754,524.10	14.09
6	300024	机器人	100,106,771.85	12.62
7	300124	汇川技术	96,000,356.70	12.11
8	300017	网宿科技	76,976,914.23	9.71
9	600637	百视通	76,713,511.85	9.67
10	000550	江铃汽车	73,506,284.02	9.27
11	002390	信邦制药	71,992,253.20	9.08
12	002030	达安基因	69,498,770.80	8.76
13	300168	万达信息	68,213,128.42	8.60
14	600597	光明乳业	63,785,728.81	8.04
15	300369	绿盟科技	63,239,360.76	7.97
16	002179	中航光电	62,014,399.79	7.82
17	300037	新宙邦	50,038,308.24	6.31
18	002368	太极股份	48,637,843.92	6.13
19	600446	金证股份	48,348,570.19	6.10
20	603000	人民网	46,906,677.29	5.91
21	300383	光环新网	45,858,488.39	5.78
22	300133	华策影视	44,345,831.78	5.59
23	300147	香雪制药	44,263,856.69	5.58
24	002611	东方精工	42,012,328.40	5.30
25	002353	杰瑞股份	38,734,203.90	4.88
26	002649	博彦科技	37,788,922.91	4.76
27	000768	中航飞机	36,248,849.76	4.57
28	002065	东华软件	35,650,694.81	4.50
29	600196	复星医药	34,862,749.42	4.40
30	300012	华测检测	34,611,216.34	4.36
31	300049	福瑞股份	28,820,542.64	3.63
32	002690	美亚光电	28,766,601.60	3.63
33	002022	科华生物	28,748,780.13	3.63
34	000651	格力电器	27,563,837.09	3.48
35	002228	合兴包装	26,943,383.80	3.40
36	600580	卧龙电气	25,633,743.64	3.23
37	000988	华工科技	25,554,255.67	3.22
38	300244	迪安诊断	24,816,995.42	3.13
39	001696	宗申动力	24,253,945.68	3.06
40	002727	一心堂	23,569,276.07	2.97
41	002019	亿帆鑫富	23,392,652.68	2.95
42	601098	中南传媒	22,893,144.77	2.89
43	600030	中信证券	22,359,749.66	2.82
44	002023	海特高新	21,826,770.77	2.75
45	002338	奥普光电	21,587,093.97	2.72
46	002657	中科金财	21,299,446.18	2.69
47	000027	深圳能源	21,272,015.37	2.68
48	000733	振华科技	21,209,274.36	2.67
49	300347	泰格医药	21,089,276.59	2.66
50	600832	东方明珠	20,615,098.77	2.60
51	002535	林州重机	20,585,968.73	2.60
52	300334	津膜科技	20,565,661.88	2.59
53	300274	阳光电源	20,367,392.93	2.57
54	000919	金陵药业	20,297,107.38	2.56
55	002292	奥飞动漫	19,921,872.79	2.51
56	600879	航天电子	19,876,676.13	2.51
57	300151	昌红科技	19,791,659.77	2.50
58	600885	宏发股份	19,670,597.26	2.48
59	600104	上汽集团	19,593,488.81	2.47
60	000963	华东医药	19,574,921.36	2.47
61	600271	航天信息	19,454,544.76	2.45
62	300002	神州泰岳	19,177,950.96	2.42
63	002051	中工国际	18,721,183.70	2.36
64	002334	英威腾	18,582,518.91	2.34
65	600893	中航动力	18,268,483.49	2.30
66	002303	美盈森	18,187,399.34	2.29
67	300322	硕贝德	18,060,775.00	2.28
68	300291	华录百纳	17,999,363.79	2.27
69	300007	汉威电子	17,475,553.40	2.20
70	600624	复旦复华	17,278,024.57	2.18
71	300177	中海达	17,156,713.19	2.16
72	002595	豪迈科技	16,355,783.19	2.06
73	600036	招商银行	16,248,045.10	2.05
74	300170	汉得信息	16,153,237.02	2.04
75	002642	荣之联	16,006,526.21	2.02
76	002484	江海股份	15,872,274.24	2.00

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,476,117,929.02
卖出股票收入（成交）总额	3,786,427,569.53

注："买入股票成本"或"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未持有债券投资。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未持仓投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	429,264.93
2	应收证券清算款	67,419,409.30
3	应收股利	–
4	应收利息	18,671.72
5	应收申购款	1,003,201.60
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	68,870,547.55

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300168	万达信息	23,325,363.60	3.22	重大事项

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
18,462	31,873.39	29,515,181.13	5.02%	558,931,260.14	94.98%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	131,308.47	0.0223%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 9 月 20 日）基金份额总额	3,198,155,247.37
本报告期期初基金份额总额	734,086,917.80
本报告期基金总申购份额	399,676,359.28
减：本报告期基金总赎回份额	545,316,835.81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	–
本报告期期末基金份额总额	588,446,441.27

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2014 年 2 月 28 日，经基金管理人 2014 年第一次股东会审议通过，选举杨秀丽女士、罗春风先生、姚波先生、陈敬达先生、聂丹女士、王世荣先生、张文杰先生、刘茂山先生、郑学定先生、黄士林先生、曹勇先生为第二届董事会董事；选举张云平先生、林闻伟先生为第二届监事会监事。
2、2014 年 3 月 4 日，经基金管理人职工代表大会选举，郭晶、毛晴峰担任第二届监事会职工监事。
3、2014 年 3 月 19 日，经基金管理人第二届董事会第二次会议审议，选举杨秀丽女士担任第二届董事会董事长。
4、2014 年 3 月 20 日，经基金管理人第二届监事会第一次会议审议，选举张云平先生担任第二届监事会监事长。
5、2014 年 9 月 24 日，经基金管理人 2014 年第七次股东会审议通过，同意由郑强先生担任第二届董事会董事，聂丹女士不再担任基金管理人董事。
6、2014 年 3 月 21 日，基金管理人发布公告，自 2014 年 3 月 19 日 起，李克难先生离任总经理。
7、2014 年 8 月 21 日，基金管理人发布公告，自 2014 年 8 月 19 日起，罗春风先生就任公司总经理。
8、基金管理人发布公告，于 2014 年 9 月 12 日增聘胡昆明先生为平安大华行业先锋股票型证券投资基金的基金经理，与焦巍共同管理本基金。
9、焦巍先生于 2014 年 9 月 22 日因个人原因离任，自 2014 年 9 月 22 日后不再担任平安大华行业先锋股票型证券投资基金的基金经理。
10、2014 年 2 月 14 日本基金托管人中国银行股份有限公司公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任中国银行行长。
11、报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

根据平安集团审计的统一安排，平安大华基金管理有限公司第二届董事会第八次会议决议，2014 年 7 月 22 日改聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。普华永道中天会计师事务所有限公司系首次向本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所--普华永道中天会计师事务所有限公司 2014 年度审计的报酬为 90,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	1,292,909,744.87	17.92%	918,485.32	16.31%	–
兴业证券	2	1,085,020,139.08	15.04%	770,797.65	13.69%	–
长城证券	2	983,098,804.45	13.62%	673,276.16	11.95%	–
中金公司	2	746,076,276.15	10.34%	679,227.20	12.06%	–
银河证券	2	440,393,175.20	6.10%	400,934.92	7.12%	–
民生证券	2	429,813,538.51	5.96%	305,340.54	5.42%	–
招商证券	2	303,976,583.30	4.21%	276,740.91	4.91%	–
申万证券	2	300,476,244.83	4.16%	273,553.92	4.86%	–
西南证券	1	299,145,213.40	4.15%	204,885.04	3.64%	–
国金证券	1	263,479,155.05	3.65%	239,871.09	4.26%	–
东方证券	2	257,097,081.58	3.56%	182,641.98	3.24%	–
长江证券	1	224,981,532.98	3.12%	204,825.47	3.64%	–
中信证券	2	215,089,493.09	2.98%	195,818.05	3.48%	–
安信证券	2	163,503,124.12	2.27%	116,153.10	2.06%	–
广发证券	1	115,840,772.64	1.61%	105,461.51	1.87%	–
平安证券	2	85,097,067.93	1.18%	77,472.30	1.38%	–
中信建投	1	9,534,699.67	0.13%	6,773.39	0.12%	–
方正证券	1	–	–	–	–	–
中投证券	1	–	–	–	–	–
国海证券	2	–	–	–	–	–

注：1、本报告期内基金租用证券公司交易单元变更情况

报告期内新增 1 个交易单元：西南证券（深圳一个）；退租三个：湘财证券（深圳 1 个）、方正证券（上海 1 个）、中航证券（上海 1 个）

2、基金交易单元的选择标准如下：

（1）研究实力
（2）业务服务水平
（3）综合类研究服务对投资业绩贡献度
（4）专题类服务

3、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	–	–	366,000,000.00	4.40%	–	–
兴业证券	–	–	5,217,000,000.00	62.69%	–	–
长城证券	–	–	210,000,000.00	2.52%	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	410,000,000.00	4.93%	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
申万证券	–	–	–	–	–	–
西南证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	1,089,000,000.00	13.09%	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	1,030,000,000.00	12.38%	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
国海证券	–	–	–	–	–	–

注：本基金租用的证券公司交易单元本期无权证交易。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

平安大华基金管理有限公司
2015 年 3 月 26 日