平安大华策略先锋混合型证券投资基金

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	平安大华策略先锋混合
基金主代码	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
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	58,393,544.90份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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5月29日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	5,977,176.76	8,726,109.85	488,754.79
本期利润	11,153,160.48	8,663,958.51	1,377,601.96
加权平均基金份额本期利润	0.4107	0.2094	0.0084
本期基金份额净值增长率	33.88%	11.40%	1.10%
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	0.3026	0.0297	−0.0017
期末基金资产净值	80,506,416.81	30,662,211.25	79,984,511.50
期末基金份额净值	1.379	1.030	1.011

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.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。

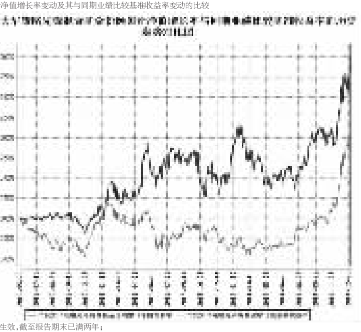
3.2 基金净值表现

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	18.37%	1.43%	26.42%	0.99%	−8.05%	0.44%
过去六个月	31.08%	1.18%	37.12%	0.80%	−6.04%	0.38%
过去一年	33.88%	1.19%	34.35%	0.73%	−0.47%	0.46%
自基金合同生效起至今	50.78%	1.07%	26.30%	0.77%	24.48%	0.30%

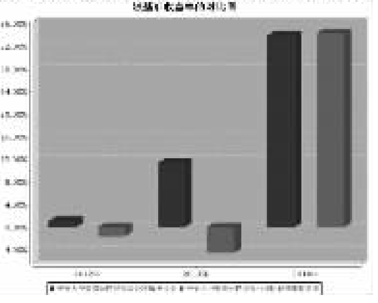
业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%

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2012年5月29日正式生效,截至报告期末已满两年;
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	-	-	-	-	
2013	1.000	3,162,065.60	550,973.87	3,713,039.47	
2012	-	-	-	-	
合计	1.000	3,162,065.60	550,973.87	3,713,039.47	

1、遵照本基金基金合同的规定,本报告期内未进行利润分配。

§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		
黄建军	基金经理	2013年5月29日	-	8	2007年起先后在国元证券公司、华夏基金管理公司从事行业研究工作,在长盛基金管理公司担任基金经理助理。2012年加入平安大华基金管理公司。任投资研究部研究主管,现担任平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理、平安大华策略先锋混合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、《平安大华策略先锋混合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

回顾本年,本公司较为成功的把握了年初的互联网主题,3月份的京津冀主题和11月降息以后的金融地产等行业投资机会,但是没有把握好互联网金融、互联网医疗和互联网教育等领域的大机会,更错过了军工、一带一路等投资机会。

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1.379元,份额累计净值为1.479元。报告期内,本基金份额净值增长率为33.88%,同期业绩基准增长率为34.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年政策宽松贯穿全年,但并未使得实体经济有些许好转,内生需求依然薄弱,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。虽然4季度央行重举降息大旗,但得到的市场反馈是利好出尽,利率价格不降反升,虚拟经济得到了久违的繁荣,杠杆增加后的资金套利加剧,这与当局者最初的政策调控本意相悖,从而制约了央行放松政策的有效实施。

本基金管理人认为:对于2015年而言,在市场已经适应并认可了经济偏弱的背景下,流动性成为决定市场走势的关键因素。基于经济好转并不明显,以及通缩压力逐渐显现的背景,我们认为央行会继续维持较为宽松的货币政策环境。

本基金管理人对2015年的权益投资保持相对乐观,两条选股思路:一是继续看好金融地产等受益于流动性放松的行业,二是倾向于从供给端变革寻找布局的产业方向,看好科技创新、智能化、国企改革等方向。

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,通过合规审查、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

遵照本基金基金合同的规定,本报告期内未进行利润分配。

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

本基金从2014年1月1日至2014年11月3日,2014年11月6日至2014年12月21日期间基金资产净值出现连续20个工作日低于5000万的情况,截止本报告期末,本基金资产净值高于5000万。

§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")在对平安大华策略先锋混合型证券投资基金(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22613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	平安大华策略先锋混合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策略先锋混合型证券投资基金财务报表,包括2014年12月31日的资产负债表和2014年01月01日至2014年12月31日止期间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策略先锋混合型证券投资基金2014年12月31日的财务状况以及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。	
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号	
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:平安大华策略先锋混合型证券投资基金
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		19,623,648.93	3,291,730.09
结算备付金		313,527.26	680,433.05
存出保证金		25,635.77	23,785.20
交易性金融资产		61,565,090.48	21,630,557.22
其中:股票投资		55,328,188.28	21,257,661.22
基金投资		-	-
债券投资		6,236,902.20	372,896.00
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		-	6,100,000.00
应收证券清算款		1,422,239.16	827,241.50
应收利息		21,785.33	2,501.22
应收股利		-	-
应收申购款		2,214,028.26	155,418.71
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		85,185,955.19	32,711,666.99
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		3,002,292.61	985,868.21
应付赎回款		477,822.47	244,885.75
应付管理人报酬		51,939.21	39,223.24
应付托管费		8,656.55	6,537.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		889,935.16	619,790.90
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		248,892.38	153,150.42
负债合计		4,679,538.38	2,049,455.74
所有者权益:			
实收基金		58,393,544.90	29,776,391.55
未分配利润		22,112,871.91	885,819.70
所有者权益合计		80,506,416.81	30,662,211.25
负债和所有者权益总计		85,185,955.19	32,711,666.99

注:(1)报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.379元,基金份额总额58,393,544.9份。

7.2 利润表

会计主体:平安大华策略先锋混合型证券投资基金
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		12,767,333.51	10,877,653.96
1.利息收入		131,948.81	304,797.39
其中:存款利息收入		58,607.08	86,744.92
债券利息收入		24,057.42	82,311.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		49,284.31	135,741.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		7,402,786.80	10,534,475.90
其中:股票投资收益		6,713,556.45	10,113,629.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益		522,735.63	192,023.31
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		166,494.72	228,823.52
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		5,175,983.72	−62,151.34
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		56,614.18	100,532.01
减:二、费用		1,614,173.03	2,213,695.45
1. 管理人报酬		448,576.50	665,227.26
2. 托管费		74,762.82	110,871.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		724,387.76	1,057,545.13
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		366,445.95	380,051.82
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		11,153,160.48	8,663,958.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		11,153,160.48	8,663,958.51

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:平安大华策略先锋混合型证券投资基金
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)	29,776,391.55	885,819.70	30,662,211.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	11,153,160.48	11,153,160.48
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)	28,617,153.35	10,073,891.73	38,691,045.08
其中:1.基金申购款	74,529,810.33	16,880,031.85	91,409,842.18
2.基金赎回款	−45,912,656.98	−6,806,140.12	−52,718,797.10
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	58,393,544.90	22,112,871.91	80,506,416.81
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)	79,092,060.83	892,450.67	79,984,511.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	8,663,958.51	8,663,958.51
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)	−49,315,669.28	−4,957,550.01	−54,273,219.29
其中:1.基金申购款	31,965,071.22	1,970,457.91	33,935,529.13
2.基金赎回款	−81,280,740.50	−6,928,007.92	−88,208,748.42
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)	-	−3,713,039.47	−3,713,039.47
五、期末所有者权益(基金净值)	29,776,391.55	885,819.70	30,662,211.25

注:报表附注为财务报表的组成部分。
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:
报表附注为财务报表的组成部分。
本报告 - 至 - 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

平安大华策略先锋混合型证券投资基金(以下简称"本基金")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[2012]248号《关于核准平安大华策略先锋混合型证券投资基金募集的批复》核准,由平安大华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为2012年4月23日至2012年5月25日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集459,395,438.15元,业经安永华明会计师事务所有限公司(2012)验字第60937497_A02号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金合同》于2012年5月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为459,456,398.33份基金份额,其中认购资金利息折合60,960.18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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华策略先锋混合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。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%,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×60% + 中证全债指数收益率×40%。

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,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《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1月1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、《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。

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、基金销售机构
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
平安证券有限责任公司("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	10,044,908.87	1.92%	69,838,434.06	9.66%

债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
平安证券	-	-	4,777,049.90	8.67%

本报告期内无通过关联方进行的债券交易。

债券回购交易

本基金本报告期及上年可比期间无通过关联方进行的债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

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	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

本报告期内无通过关联方进行的权证交易。

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	9,144.91	2.22%	210,760.86	23.68%
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	62,437.81	10.41%	201,615.95	32.53%

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	448,576.50	665,227.26
其中:支付销售机构的客户维护费	163,730.35	240,549.50

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51,939.21(2013年12月31日:人民币39223.24)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	74,762.82	110,871.24

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8656.55元(2013年12月31日:人民币6537.22元)。

7.4.8.2.3 销售服务费

本报告期内无支付给关联方的销售服务费。

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

本基金本报告期末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

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末均未投资本基金。

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
深圳中行存款	19,623,648.93	-	3,291,730.09	-
银行存款利息收入	-	53,305.23	-	74,077.48

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

本报告期内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

本报告期内无其他关联交易事项。

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

本报告期末无持有暂时停牌等流通受限股票。

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
002354	科冕木业	2014年10月31日	临时停牌	57.50	-	-	7,993	385,866.16	459,597.50	-
002396	星网锐捷	2014年10月20日	临时停牌	27.31	2015年2月9日	30.04	13,800	416,080.44	376,878.00	-

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

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他事项。

§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	55,328,188.28	64.95
	其中:股票	55,328,188.28	64.95
2	固定收益投资	6,236,902.20	7.32
	其中:债券	6,236,902.20	7.32
	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	-	-
	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	19,937,176.19	23.40
7	其他各项资产	3,683,688.52	4.32
8	合计	85,185,955.19	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	2,215,252.00	2.75
C	制造业	10,483,488.22	13.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,787,500.70	5.95
F	批发和零售业	931,556.00	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	431,499.72	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	752,864.00	0.94
J	金融业	4,107,304.00	5.10
K	房地产业	28,994,628.64	36.02
L	租赁和商务服务业	159,820.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,464,275.00	3.06
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	55,328,188.28	68.73

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	600048	保利地产	537,500	5,815,750.00	7.22
2	000002	万科A	385,908	5,364,121.20	6.66
3	000024	招商地产	177,900	4,694,781.00	5.83
4	600376	首开股份	437,095	4,405,917.60	5.47
5	000069	华侨城A	298,700	2,464,275.00	3.06
6	000961	中南建设	178,111	2,440,120.70	3.03
7	000090	天健集团	170,100	2,347,380.00	2.92
8	601992	金隅股份	228,600	2,318,004.00	2.88
9	600559	老白干酒	46,800	2,309,112.00	2.87
10	000718	苏宁环球	334,508	2,251,238.84	2.80

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	000002	万科A	9,254,917.12	30.18
2	600048	保利地产	7,730,597.14	25.21
3	000024	招商地产	7,513,248.04	24.50
4	600376	首开股份	5,156,973.35	16.82
5	600340	华夏幸福	3,929,149.12	12.81
6	600223	鲁商置业	3,731,813.00	12.17
7	600185	格力地产	3,722,683.10	12.14
8	000090	天健集团	3,669,866.42	11.97
9	002273	水晶光电	3,509,018.42	11.44
10	002146	荣盛发展	3,280,865.05	10.70
11	600372	中航电子	3,184,843.89	10.39
12	300036	超图软件	3,093,891.40	10.09
13	300328	宜安科技	3,036,092.84	9.90
14	601992	金隅股份	2,737,898.51	8.93
15	300288	朗玛信息	2,644,988.85	8.63
16	000758	中色股份	2,420,514.00	7.89
17	600266	北京城建	2,350,188.12	7.66
18	000961	中南建设	2,342,032.88	7.64
19	300166	东方国信	2,306,114.95	7.52
20	600118	中国卫星	2,205,845.00	7.19
21	002261	拓维信息	2,197,372.62	7.17
22	600000	浦发银行	2,177,563.00	7.10
23	000718	苏宁环球	2,116,239.36	6.90
24	000069	华侨城A	2,112,486.00	6.89
25	300183	东软载波	2,065,332.17	6.74
26	600559	老白干酒	2,045,318.00	6.67
27	600677	航天通信	1,999,595.05	6.52
28	300077	国民技术	1,971,331.52	6.43
29	002305	南国置业	1,956,402.32	6.38
30	600030	中信证券	1,942,400.00	6.33
31	300334	津膜科技	1,919,288.10	6.26
32	300293	蓝英装备	1,824,221.80	5.95
33	600180	瑞茂通	1,766,042.00	5.76
34	000831	*ST关铝	1,765,123.79	5.76
35	600858	银座股份	1,719,379.00	5.61
36	600261	阳光照明	1,712,706.25	5.59
37	300233	金城医药	1,706,820.30	5.57
38	600111	包钢稀土	1,685,778.00	5.50
39	600016	民生银行	1,663,904.12	5.43
40	002373	千方科技	1,662,185.00	5.42
41	300037	新宙邦	1,654,148.48	5.39
42	600153	建发股份	1,599,718.16	5.22
43	600363	联创光电	1,599,383.00	5.22
44	300300	汉鼎股份	1,555,523.84	5.07
45	600837	海通证券	1,545,306.00	5.04
46	300007	汉威电子	1,542,142.50	5.03
47	600549	厦门钨业	1,541,834.00	5.03
48	002185	华天科技	1,538,551.00	5.02
49	002199	东晶电子	1,492,642.00	4.87
50	002279	久其软件	1,489,571.95	4.86
51	002642	荣之联	1,464,821.69	4.78
52	601098	中南传媒	1,430,344.01	4.66
53	300327	中颖电子	1,425,185.00	4.65
54	600325	华发股份	1,422,704.50	4.64
55	300124	汇川技术	1,408,867.24	4.59
56	300207	欣旺达	1,399,853.77	4.57
57	601668	中国建筑	1,395,134.00	4.55
58	300055	万邦达	1,386,164.21	4.52
59	002030	达安基因	1,382,708.40	4.51
60	300058	蓝色光标	1,382,514.20	4.51
61	002501	利源精制	1,370,725.90	4.47
62	002354	科冕木业	1,355,462.50	4.42
63	600183	生益科技	1,345,299.60	4.39
64	300098	高新兴	1,313,535.20	4.28
65	601166	兴业银行	1,304,327.00	4.25
66	600993	马应龙	1,278,529.60	4.17
67	000997	新大陆	1,272,080.98	4.15
68	002456	欧菲光	1,256,350.00	4.10
69	000686	东北证券	1,254,122.00	4.09
70	000728	国元证券	1,247,531.00	4.07
71	300187	永清环保	1,222,234.17	3.99
72	600585	海螺水泥	1,212,423.73	3.95
73	300188	美亚柏科	1,206,188.38	3.93
74	300020	银江股份	1,196,159.43	3.90
75	603000	人民网	1,189,839.00	3.88
76	002299	圣农发展	1,160,026.00	3.78
77	600196	复星医药	1,159,165.38	3.78
78	600126	杭钢股份	1,151,317.36	3.75
79	000656	金科股份	1,135,155.00	3.70
80	000568	泸州老窖	1,125,980.00	3.67
81	600699	均胜电子	1,120,721.00	3.66
82	000550	江铃汽车	1,119,577.85	3.65
83	600850	华东电脑	1,118,559.00	3.65
84	600787	中储股份	1,113,041.99	3.63
85	002245	澳洋顺昌	1,104,481.44	3.60
86	002484	江海股份	1,100,151.00	3.59
87	300049	福瑞股份	1,094,287.94	3.57
88	300275	梅安森	1,075,345.56	3.51
89	002439	启明星辰	1,052,591.80	3.43
90	600703	三安光电	1,049,365.00	3.42
91	002606	大连电瓷	1,042,986.90	3.40
92	000811	烟台冰轮	1,025,617.00	3.34
93	002108	沧州明珠	1,015,614.00	3.31
94	002219	恒康医疗	1,007,977.38	3.29
95	002136	安纳达	1,006,890.00	3.28
96	300079	数码视讯	987,074.04	3.22
97	300149	量子高科	969,312.90	3.16
98	300030	阳普医疗	961,666.22	3.14
99	002019	亿帆鑫富	957,868.98	3.12
100	600879	航天电子	956,580.00	3.12
101	300206	理邦仪器	939,602.00	3.06
102	300002	神州泰岳	935,239.00	3.05
103	600125	铁龙物流	930,204.04	3.03
104	601888	中国国旅	929,506.00	3.03
105	300244	迪安诊断	927,406.00	3.02
106	002550	千红制药	926,013.34	3.02
107	002415	海康威视	917,976.00	2.99
108	600104	上汽集团	900,357.00	2.94
109	600887	伊利股份	891,293.00	2.91
110	002051	中工国际	891,231.00	2.91
111	601012	隆基股份	882,246.00	2.88
112	300004	南风股份	869,884.00	2.84
113	300078	中瑞思创	844,682.40	2.75
114	002366	丹甫股份	841,681.77	2.75
115	300017	网宿科技	836,001.73	2.73
116	000963	华东医药	824,053.00	2.69
117	600416	湘电股份	820,828.00	2.68
118	300195	长荣股份	820,070.25	2.67
119	000777	中核科技	803,873.80	2.62
120	300248	新开普	801,478.81	2.61
121	002402	和而泰	797,418.96	2.60
122	600694	大商股份	788,433.70	2.57
123	000402	金融街	786,275.00	2.56
124	000045	深纺织A	785,732.00	2.56
125	000501	鄂武商A	785,160.56	2.56
126	300110	华仁药业	779,876.00	2.54
127	601336	新华保险	769,098.00	2.51
128	300011	鼎汉技术	758,876.18	2.47
129	002234	民和股份	757,530.00	2.47
130	002410	广联达	757,016.00	2.47
131	300010	立思辰	745,715.93	2.43
132	601555	东吴证券	743,034.16	2.42
133	601208	东材科技	742,171.00	2.42
134	000799	酒鬼酒	737,671.00	2.41
135	600292	中电远达	730,530.49	2.38
136	300291	华录百纳	729,349.00	2.38
137	002073	软控股份	724,487.04	2.36
138	002131	利欧股份	717,485.00	2.34
139	300113	顺网科技	714,716.63	2.33
140	002230	科大讯飞	704,776.00	2.30
141	600050	中国联通	700,900.00	2.29
142	002236	大华股份	696,756.00	2.27
143	300274	阳光电源	696,290.51	2.27
144	300096	易联众	695,593.00	2.27
145	300070	碧水源	695,201.00	2.27
146	300177	中海达	694,575.82	2.27
147	600386	北巴传媒	692,476.00	2.26
148	300210	森远股份	680,138.00	2.22
149	300236	上海新阳	679,724.00	2.22
150	300226	上海钢联	674,453.00	2.20
151	002161	远望谷	674,306.00	2.20
152	300253	卫宁软件	674,182.00	2.20
153	600637	百视通	673,779.30	2.20
154	600522	中天科技	670,052.00	2.19
155	600999	招商证券	664,669.00	2.17
156	002460	赣锋锂业	652,842.00	2.13
157	601009	南京银行	641,579.58	2.09
158	002025	航天电器	635,196.00	2.07
159	002318	久立特材	623,278.00	2.03
160	002405	四维图新	620,993.64	2.03
161	600718	东软集团	615,783.00	2.01
162	300251	光线传媒	615,729.00	2.01
163	300168	万达信息	615,380.78	2.01

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	600185	格力地产	5,319,750.52	17.35
2	000002	万科A	5,115,787.89	16.68
3	600340	华夏幸福	4,489,197.19	14.64
4	000024	招商地产	4,235,870.71	13.81
5	600118	中国卫星	4,134,478.38	13.48
6	600372	中航电子	4,114,171.61	13.42
7	600048	保利地产	3,511,871.85	11.45
8	002273	水晶光电	3,446,759.46	11.24
9	300328	宜安科技	3,275,471.71	10.68
10	600030	中信证券	3,050,181.10	9.95
11	300166	东方国信	2,986,279.71	9.74
12	300288	朗玛信息	2,941,217.85	9.59
13	300036	超图软件	2,931,573.66	9.56
14	300077	国民技术	2,642,227.84	8.62
15	600266	北京城建	2,562,156.92	8.36
16	002642	荣之联	2,514,395.24	8.20
17	002261	拓维信息	2,500,117.85	8.15
18	600196	复星医药	2,380,602.49	7.76
19	300183	东软载波	2,252,617.87	7.35
20	600677	航天通信	2,167,803.68	7.07
21	002185	华天科技	2,023,078.40	6.60
22	603000	人民网	2,000,922.56	6.53
23	600180	瑞茂通	1,984,360.98	6.47
24	600261	阳光照明	1,839,495.90	6.00
25	002373	联信永益	1,836,527.17	5.99
26	000831	*ST关铝	1,802,282.00	5.88
27	300098	高新兴	1,760,366.17	5.74
28	300334	津膜科技	1,759,747.71	5.74
29	300233	金城医药	1,753,180.20	5.72
30	300007	汉威电子	1,689,338.45	5.51
31	600376	首开股份	1,672,728.00	5.46
32	600111	北方稀土	1,649,456.00	5.38
33	600016	民生银行	1,640,568.80	5.35
34	000090	天健集团	1,610,812.00	5.25
35	600363	联创光电	1,605,042.30	5.23
36	300327	中颖电子	1,600,751.72	5.22
37	600460	士兰微	1,571,669.63	5.13
38	300017	网宿科技	1,533,477.00	5.00
39	002501	利源精制	1,513,827.40	4.94
40	000686	东北证券	1,504,467.00	4.91
41	300055	万邦达	1,503,130.80	4.90
42	600183	生益科技	1,494,630.00	4.87
43	600549	厦门钨业	1,484,457.00	4.84
44	600153	建发股份	1,463,480.60	4.77
45	002199	东晶电子	1,446,661.70	4.72
46	601668	中国建筑	1,434,847.47	4.68
47	002279	久其软件	1,422,419.20	4.64
48	300207	欣旺达	1,403,156.33	4.58
49	600223	鲁商置业	1,401,393.00	4.57
50	002146	荣盛发展	1,394,131.00	4.55
51	600292	中电远达	1,375,935.76	4.49
52	000728	国元证券	1,367,215.44	4.46
53	300058	蓝色光标	1,362,435.35	4.44
54	600993	马应龙	1,361,694.42	4.44
55	300300	汉鼎股份	1,341,756.40	4.38
56	300113	顺网科技	1,338,920.69	4.37
57	600325	华发股份	1,337,812.00	4.36
58	000997	新大陆	1,331,002.00	4.34
59	002030	达安基因	1,329,222.70	4.34
60	601098	中南传媒	1,328,671.03	4.33
61	601166	兴业银行	1,267,902.00	4.14
62	002299	圣农发展	1,231,187.00	4.02
63	600850	华东电脑	1,200,922.00	3.92
64	300049	福瑞股份	1,196,054.71	3.90
65	002484	江海股份	1,194,472.45	3.90
66	002456	欧菲光	1,189,798.36	3.88
67	300187	永清环保	1,172,112.42	3.82
68	600699	均胜电子	1,159,129.64	3.78
69	600126	杭钢股份	1,157,093.18	3.77
70	600585	海螺水泥	1,141,090.00	3.72
71	600787	中储股份	1,139,177.00	3.72
72	300020	银江股份	1,138,201.56	3.71
73	002245	澳洋顺昌	1,132,736.00	3.69
74	002312	三泰电子	1,120,909.80	3.66
75	300253	卫宁软件	1,119,141.00	3.65
76	002153	石基信息	1,114,548.70	3.63
77	000568	泸州老窖	1,109,227.00	3.62
78	300157	恒泰艾普	1,106,131.00	3.61
79	000656	金科股份	1,103,195.00	3.60
80	000550	江铃汽车	1,094,649.51	3.57
81	002439	启明星辰	1,080,085.59	3.52
82	300248	新开普	1,061,846.00	3.46
83	002354	科冕木业	1,042,216.08	3.40
84	300275	梅安森	1,034,541.72	3.37
85	002136	安纳达	1,031,600.00	3.36
86	002219	恒康医疗	1,024,938.88	3.34
87	002606	大连电瓷	1,009,457.93	3.29
88	300079	数码视讯	986,490.78	3.22
89	000811	烟台冰轮	975,822.50	3.18
90	601555	东吴证券	969,408.00	3.16
91	600879	航天电子	949,581.00	3.10
92	300206	理邦仪器	946,455.00	3.09
93	600637	百视通	944,889.90	3.08
94	300188	美亚柏科	944,495.82	3.08
95	002108	沧州明珠	941,970.74	3.07
96	600703	三安光电	933,803.00	3.05
97	300037	新宙邦	925,715.76	3.02
98	601888	中国国旅	909,215.00	2.97
99	002550	千红制药	905,292.02	2.95
100	000777	中核科技	883,828.26	2.88
101	300002	神州泰岳	882,163.29	2.88
102	000963	华东医药	880,363.45	2.87
103	002390	信邦制药	876,247.80	2.86
104	600104	上汽集团	876,218.00	2.86
105	002366	丹甫股份	872,581.00	2.85
106	002415	海康威视	869,844.00	2.84
107	600171	上海贝岭	853,569.09	2.78
108	600990	四创电子	850,686.98	2.77
109	300190	维尔利	841,251.45	2.74
110	300030	阳普医疗	837,475.22	2.73
111	600416	湘电股份	833,508.00	2.72
112	002234	民和股份	831,971.30	2.71
113	600858	银座股份	828,580.07	2.70
114	300010	立思辰	826,469.91	2.70
115	300244	迪安诊断	819,335.55	2.67
116	002019	鑫富药业	818,028.00	2.67
117	600887	伊利股份	814,958.98	2.66
118	002179	中航光电	811,613.73	2.65
119	601012	隆基股份	810,398.00	2.64
120	300168	万达信息	807,892.31	2.63
121	300149	量子高科	803,066.35	2.62
122	300004	南风股份	799,281.94	2.61
123	300011	鼎汉技术	795,025.28	2.59
124	300195	长荣股份	793,165.00	2.59
125	300078	中瑞思创	791,367.30	2.58
126	002285	世联地产	766,338.97	2.50
127	002410	广联达	765,372.00	2.50
128	000799	酒鬼酒	763,004.00	2.49
129	002051	中工国际	758,334.00	2.47
130	000402	金融街	756,071.74	2.47
131	601992	金隅股份	753,523.00	2.46
132	000501	鄂武商A	746,463.98	2.43
133	601208	东材科技	740,412.00	2.41
134	002230	科大讯飞	740,277.00	2.41
135	002657	中科金财	736,244.00	2.40
136	002402	和而泰	728,163.40	2.37
137	300070	碧水源	723,293.34	2.36
138	002073	软控股份	719,895.30	2.35
139	300274	阳光电源	718,780.75	2.34
140	600386	北巴传媒	707,214.00	2.31
141	300177	中海达	706,589.00	2.30
142	600694	大商股份	704,225.00	2.30
143	600999	招商证券	701,913.00	2.29
144	002253	川大智胜	701,606.12	2.29
145	300251	光线传媒	700,738.00	2.29
146	601336	新华保险	693,459.00	2.26
147	300096	易联众	693,155.00	2.26
148	300024	机器人	692,533.50	2.26
149	002318	久立特材	687,765.89	2.24
150	002161	远望谷	687,517.00	2.24
151	601009	南京银行	686,438.06	2.24
152	300291	华录百纳	686,285.00	2.24
153	300110	华仁药业	684,924.20	2.23
154	002236	大华股份	679,096.00	2.21
155	600522	中天科技	667,152.46	2.18
156	002405	四维图新	664,651.37	2.17
157	600050	中国联通	661,500.00	2.16
158	002400	省广股份	659,834.55	2.15
159	300236	上海新阳	653,892.00	2.13
160	000045	深纺织A	647,616.00	2.11
161	300210	森远股份	646,358.00	2.11
162	300298	三诺生物	646,289.90	2.11
163	002017	东信和平	639,805.87	2.09
164	002131	利欧股份	633,037.38	2.06
165	300269	联建光电	631,001.00	2.06
166	002460	赣锋锂业	625,570.93	2.04
167	002138	顺络电子	624,871.55	2.04
168	300289	利德曼	624,242.00	2.04

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	273,516,314.28
卖出股票收入(成交)总额	250,834,195.44

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	6,236,902.20	7.75
8	其他	-	-
9	合计	6,236,902.20	7.75

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110028	冠城转债	42,330	6,236,902.20	7.75

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

本基金本报告期末无贵金属投资。

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

本基金本报告期内无股指期货投资。

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内无股指期货投资。

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

基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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	25,635.77
2	应收证券清算款	1,422,239.16
3	应收股利	-
4	应收利息	21,785.33
5	应收申购款	2,214,028.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,683,688.52

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期无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

本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§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
2,005	29,123.96	98,825.23	0.17%	58,294,719.67	99.83%

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	15,324.40	0.0262%

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(2012年5月29日)基金份额总额	459,456,398.33
本报告期期初基金份额总额	29,776,391.55
本报告期基金总申购份额	74,529,810.33
减:本报告期基金总赎回份额	45,912,656.98
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	58,393,544.90

§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、林湘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主席。
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、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。
9、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。报告期内本基金应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45,000.00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	
兴业证券	2	90,551,333.49	17.27%	64,327.82	15.58%	-
国信证券	2	67,591,526.66	12.89%	48,016.79	11.63%	-
长城证券	2	58,716,416.63	11.20%	40,233.59	9.75%	-
中金公司	2	54,361,252.65	10.37%	49,490.34	11.99%	-
国金证券	1	39,133,952.25	7.46%	35,627.64	8.63%	-
安信证券	2	36,112,869.81	6.89%	25,654.72	6.21%	-
招商证券	2	31,728,055.57	6.05%	28,885.35	7.00%	-
民生证券	2	26,749,356.12	5.10%	19,002.63	4.60%	-
申万证券	2	25,459,108.70	4.86%	23,178.03	5.61%	-
中信建投	1	20,813,089.50	3.97%	14,785.68	3.58%	-
银河证券	2	23,408,774.16	4.46%	21,311.27	5.16%	-
长江证券	1	12,313,765.17	2.35%	11,210.31	2.72%	-
东方证券	2	10,374,018.85	1.98%	7,369.67	1.79%	-
平安证券	2	10,044,908.87	1.92%	9,144.91	2.22%	-
中信证券	2	8,740,839.68	1.67%	7,957.67	1.93%	-
广发证券	1	4,548,948.91	0.87%	4,141.42	1.00%	-
西南证券	1	3,641,373.95	0.69%	2,493.91	0.60%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-

1.本报告期内本基金租用证券公司交易单元变更情况:
(1)报告期内新增1个交易单元:西南证券(深圳1个)
(2)报告期内未停止租用交易单元。
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
兴业证券	21,548,138.00	65.83%	135,600,000.00	60.89%	-	-
国信证券	314,985.00	0.96%	30,600,000.00	13.74%	-	-
长城证券	1,349,370.69	4.12%	6,100,000.00	2.74%	-	-
中金公司	351,505.93	1.07%	10,800,000.00	4.85%	-	-
国金证券	616,548.50	1.88%	21,200,000.00	9.52%	-	-
安信证券	403,625.60	1.23%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	4,943,031.80	15.10%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	3,208,149.70	9.80%	18,400,000.00	8.26%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

无

§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