

平安大华行业先锋股票型证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 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：2012 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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 2012 年 8 月 28 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 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 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	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 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	47
7.9 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48

§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
10.2 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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华行业先锋股票型证券投资基金
基金简称	平安大华行业先锋股票
基金主代码	700001
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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	2,139,576,224.83 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

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
	联系电话	0755-22623179
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn
客户服务电话	400-800-4800	95566
传真	0755-23997878	010-66594942
注册地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场第八层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场第八层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	杨秀丽	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场第八层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2012年1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	-75,466,844.90
本期利润	-37,758,765.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0163
本期加权平均净值利润率	-1.76%
本期基金份额净值增长率	-2.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	-256,131,167.40
期末可供分配基金份额利润	-0.1197
期末基金资产净值	1,883,445,057.43
期末基金份额净值	0.880

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-12.00%

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未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

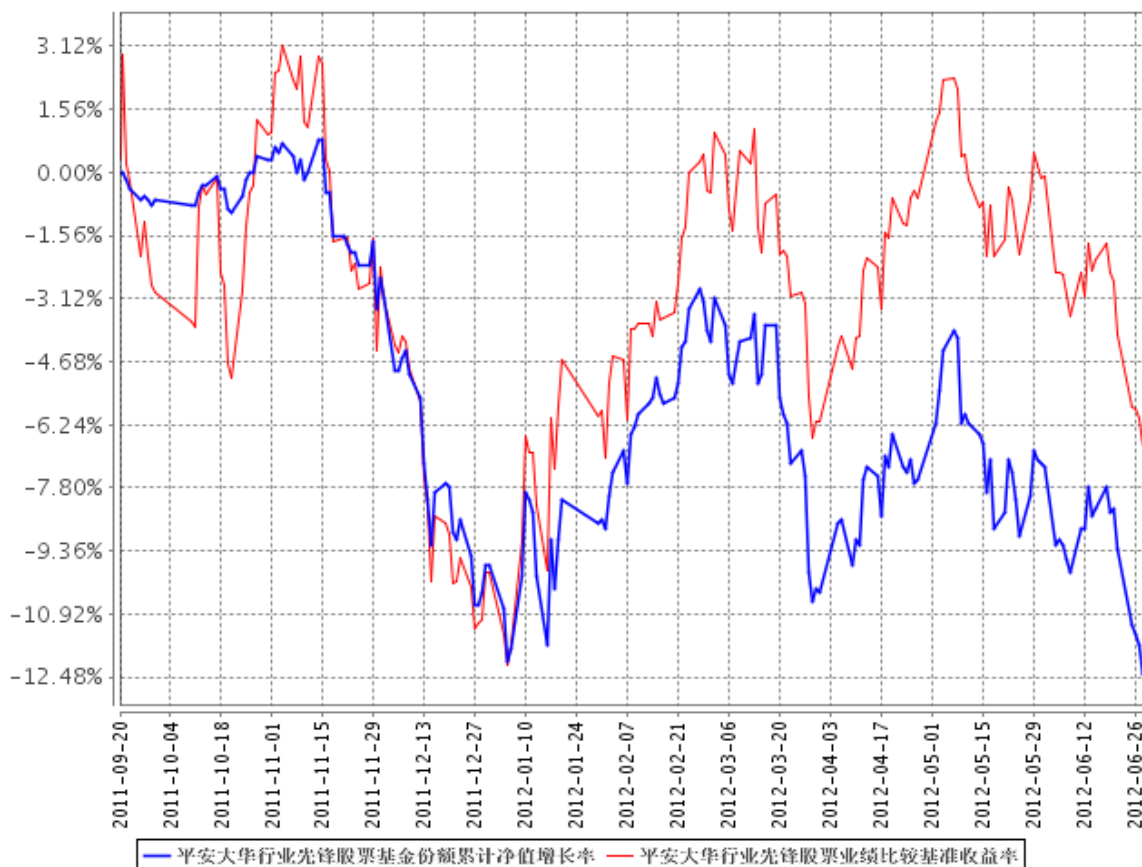
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-5.17%	0.83%	-5.45%	0.92%	0.28%	-0.09%
过去三个月	-1.79%	0.94%	0.64%	0.95%	-2.43%	-0.01%
过去六个月	-2.55%	0.99%	4.80%	1.13%	-7.35%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-12.00%	0.87%	-5.58%	1.17%	-6.42%	-0.30%

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

平安大华行业先锋股票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



3.3 其他指标

§ 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“平安大华”）经中国证监会证监许可【2010】1917号文批准设立。平安大华总部位于深圳，注册资本为3亿元人民币，是目前中国内地基金业注册资本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，持有股份60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股份25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份14.3%。

平安大华秉承“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 2012 年 6 月 30 日，平安大华共管理 3 只开放式基金。

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		
颜正华	基金经理	2011 年 9 月 20 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 年加入平安大华基金公司，任投资研究部总经理，现兼任平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金经理和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合规守信情况的说明

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》、《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。

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。

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

2012 年上半年股票市场先扬后抑，年初在春节攻势和投资者预期政策放松的背景下周期性行业取得了超额收益率，如煤炭、有色、地产、券商等；在中国经济坚持“低开稳走”的大趋势下，投资者对周期性行业开始悲观，资金追逐确定性增长的医药、白酒、服装等消费类行业。银行行业在降息前开始跑输大盘，非银行金融、地产等受益于降息的行业有较大超额收益。

本基金年初持仓较多产业资本增持的早周期行业，如水泥、家电等，但发现这些行业复苏之路还需要继续等待，因此对这些行业在 1 季度进行了减持。基于对人口老龄化长期趋势的分析，在 1 季度逢低增持了医药股。同时也增持了低估值的银行、央企等蓝筹股，但这些管理层倡导的具有罕见投资价值的公司，因为市值过大、缺乏成长想象力反而受到了市场短期的抛弃；同时组合中的机械类个股遭遇业绩地雷，低配了白酒、房地产和券商等行业，本基金业绩表现差强人意。总体来看，今年上半年本基金主要以价值投资为主，但今年上半年成长投资则取得较为显著的超额收益，但是我们仍然坚持以合理估值买入成长股的标准，耐心等待成长股的更好买入机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 0.8800 元，份额累计净值为 0.8800 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-2.55%，同期业绩基准增长率为 4.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年货币政策将进一步松绑，PPI 已经持续下跌，工业增加值增速持续下降，季度 GDP 增速将

下降到 7%左右，衰退中的经济呼吁存款准备金率和利率的进一步下降，这将是股票市场向上的主要驱动力。但另一方面，CPI 只是从高位下降到 2%左右，房价仍然居高不下，让管理层放松时仍然投鼠忌器；而 08 年末的 4 万亿政策的后遗症让政府决策部门不敢轻易使用刺激性的财政政策。即使家电和汽车行业出台了一些补贴政策，但由于相对于 08 年的家电和汽车刺激政策，本次政策边际效应明显下降，如何找到新的下游需求行业来提振消费，拉动经济增长，已然是一个难题。在大的环境压力下，一些城市不得不牺牲经济增长，如广州这样的超拥挤城市反而出限制了汽车销售的政策，经济复苏难度进一步加大。

根据典型的经济周期规律，在利率逐步下降，M1-M2 达到-8%以上剪刀差的时候，股票市场应该是一个千载难逢的买入良机。但是这次情况却比较复杂，本次经济调整是缓慢下行，很多产业的产能仍在逐步增加，因此调整的周期将拉长。反观二级股票市场供给压力巨大，2012 年 2000 家上市公司对应了 1500 次大小非减持，IPO 仍然在市场化大量发行，但是管理层也在积极推进长期资金入市，如潜在的万亿社保资金和 500 亿美元的 QFII 额度。因此将原来 3 季度股市相对乐观的预期判断，修正为谨慎乐观的判断，未来二级市场未来仍将是一个震荡筑底的过程，在震荡过程中结构性机会将层出不穷，但也需严防个股业绩风险。本基金将重点关注如下结构性机会：1、寻找未来在中国经济结构化调整中受益的成长类行业和公司进行投资，如消费、医药、环保等行业，目前来看，能找到的标的估值虽然很高，但仍然值得耐心等待逢低买入的机会；2、政策博弈，在预期未来可能受益政策的行业和板块中提前挖掘到相关投资机会；3、人弃我取，在低估值的蓝筹股中寻找波段机会，银行业、石化、电信运营商等寡头垄断企业均已是超低估值，从产业资本的角度来看看，或许二级市场投资者过于悲观了。

4.6 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。

4.7 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。

§ 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2012年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	482,306,131.11	396,120,215.76
结算备付金		596,557.44	28,901,701.04
存出保证金		2,526,001.26	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,405,005,165.53	1,532,134,454.30
其中：股票投资		1,288,847,165.53	1,355,887,454.30
基金投资		-	-
债券投资		116,158,000.00	176,247,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收证券清算款		666,245.52	389,757,701.77
应收利息	6.4.7.5	2,950,884.81	1,564,466.84
应收股利		-	-
应收申购款		226,362.18	91,848.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,894,277,347.85	2,348,820,388.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		381,647.06	35,166,959.55
应付赎回款		1,129,159.31	7,443,823.89
应付管理人报酬		2,413,481.96	3,165,026.83
应付托管费		402,247.01	527,504.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,052,593.52	3,610,692.22
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,453,161.56	2,128,054.49
负债合计		10,832,290.42	52,042,061.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,139,576,224.83	2,542,341,314.56
未分配利润	6.4.7.10	-256,131,167.40	-245,562,987.86
所有者权益合计		1,883,445,057.43	2,296,778,326.70
负债和所有者权益总计		1,894,277,347.85	2,348,820,388.14

注：（1）报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.88 元，基金份额总额 2,139,576,224.83 份。

6.2 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年6月30日
一、收入		-9,584,346.03	-
1.利息收入		7,749,769.32	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,980,908.59	-

债券利息收入		3,016,296.64	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,752,564.09	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-55,536,970.70	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-72,142,212.28	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	710,951.10	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	15,894,290.48	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	37,708,078.97	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	494,776.38	-
减：二、费用		28,174,419.90	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,006,993.87	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,667,832.35	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	9,269,842.07	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	229,751.61	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-37,758,765.93	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-37,758,765.93	-

注：(1)本报告期的期间为 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日。

(2) 本基金合同于 2011 年 9 月 20 日生效，因此无需披露上年度同期比较数据。

6.3 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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）	2,542,341,314.56	-245,562,987.86	2,296,778,326.70

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-37,758,765.93	-37,758,765.93
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）	-402,765,089.73	27,190,586.39	-375,574,503.34
其中：1.基金申购款	21,833,632.25	-1,596,198.16	20,237,434.09
2.基金赎回款	-424,598,721.98	28,786,784.55	-395,811,937.43
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）	2,139,576,224.83	-256,131,167.40	1,883,445,057.43
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：(1)本报告期的期间为 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日。

(2) 本基金合同于 2011 年 9 月 20 日生效，因此无需披露上年度同期比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

李克难

林婉文

王彦

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安大华行业先锋股票型证券投资基金（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[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》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《平安大华行业先锋股票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 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，业经安永华明会计师事务所有限公司(2011)验字第 60937494_H01 号验资报告予以验证。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，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%。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本期间所采用的会计政策与上年度会计报表政策一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认

为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值

的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用

在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通

的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率

差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

- (5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
- (6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；
- (7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；
- (8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
- (9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；
- (3) 基金销售服务费无；
- (4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，分红资金将按除息日基金份额净值转成相应基金份额；
- (2) 每一基金份额享有同等分配权；
- (3) 基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；
- (4) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；
- (5) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 4 次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日期末可供分配利润的 10%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，期末可供分配利润以期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合

同生效不满三个月，收益可不分配；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

(7) 投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	482,306,131.11
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	482,306,131.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,445,296,077.82	1,288,847,165.53	-156,448,912.29
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	115,848,000.00	310,000.00
	合计	115,848,000.00	310,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,561,144,077.82	1,405,005,165.53	-156,138,912.29

注：本年度本基金所投资的股票中，无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末无衍生金融资产。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末无买断式逆回购债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	79,599.45
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	241.65
应收债券利息	2,871,043.71
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,950,884.81

6.4.7.6 其他资产

注：本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,052,593.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,052,593.52

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	3,250,000.00
应付赎回费	4,255.58
预提费用	198,905.98
合计	3,453,161.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,542,341,314.56	2,542,341,314.56
本期申购	21,833,632.25	21,833,632.25
本期赎回(以“-”号填列)	-424,598,721.98	-424,598,721.98
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,139,576,224.83	2,139,576,224.83

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-74,093,544.21	-171,469,443.65	-245,562,987.86

本期利润	-75,466,844.90	37,708,078.97	-37,758,765.93
本期基金份额交易产生的变动数	18,696,045.15	8,494,541.24	27,190,586.39
其中：基金申购款	-994,807.90	-601,390.26	-1,596,198.16
基金赎回款	19,690,853.05	9,095,931.50	28,786,784.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-130,864,343.96	-125,266,823.44	-256,131,167.40

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	764,650.65
定期存款利息收入	1,036,222.22
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	178,801.07
其他	1,234.65
合计	1,980,908.59

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	3,041,391,666.31
减：卖出股票成本总额	3,113,533,878.59
买卖股票差价收入	-72,142,212.28

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	254,505,426.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	251,796,368.28
减：应收利息总额	1,998,106.76
债券投资收益	710,951.10

资产支持证券投资收益

注：本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本报告期内无衍生工具收益

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	15,894,290.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,894,290.48

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	37,708,078.97
——股票投资	37,789,979.49
——债券投资	-81,900.52
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	37,708,078.97

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	494,719.08
转换费收入	57.30
合计	494,776.38

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	9,269,617.07
银行间市场交易费用	225.00
合计	9,269,842.07

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,179.94
银行间账户维护费	16,500.00
银行费用	13,945.63
其他	400.00
合计	229,751.61

6.4.7.20 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
平安证券有限责任公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司

注：于本期，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	1,619,126,687.98	26.99%	-	-

债券交易

注：本报告期无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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	3,750,000,000.00	28.85%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期内无通过关联方进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30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	1,369,423.10	27.08%	412,724.41	13.52%

关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,006,993.87	-
其中：支付销售机构的客户维护费	4,030,501.11	-

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：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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) 本报告期末本基金未支付的管理费余额 2,413,481.96 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,667,832.35	-

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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) 本报告期末基金未支付的托管费余额 402,247.01 元。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本报告期内无支付给关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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	-	-
期末持有的基金份额	49,999,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.34%	-

6.4.10.4.2 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

注：无

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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	482,306,131.11	-	-	-

银行存款利息收入	-	764,650.65		
----------	---	------------	--	--

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本报告期末无流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金报告期末未持有短期信用评级债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金报告期末未持有长期信用评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金持有证券在本年度末均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以内	3 个月 -1 年	6 个月 -1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产									
11 央票 79	-	-	69,440,459.02	-	-	-	-	-	-
11 央票 82	-	-	49,577,240.44	-	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	119,017,699.46	-	-	-	-	-	-
负债									

负债总计	-	-	0.00	-	-	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-119,017,699.46	-	-	-	-	-	-
上年度末 2011 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以内	3 个月-1 年	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：上年度末本基金资产除现金外均为股票投资，不存在到期期限问题。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证保证金、债券投资、应收申购款及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以内	3 个月-1 年	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	482,306,131.11	-	-	-	-	-	-	-	-	482,306,131.11
结算备付金	596,557.44	-	-	-	-	-	-	-	-	596,557.44
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	2,526,001.26	2,526,001.26
交易性金融资产	-	-	-	116,158,000.00	-	-	-	-	1,288,847,165.53	1,405,005,165.53

应收证 券清算 款	-	-	-	-	-	-	-	-	666,245.52	666,245.52
应收利 息	-	-	-	-	-	-	-	-	2,950,884.81	2,950,884.81
应收申 购款	-	-	-	-	-	-	-	-	226,362.18	226,362.18
资产总 计	482,902,688.55	-	-	116,158,000.00	-	-	-	-	-1,295,216,659.30	1,894,277,347.85
负债										
应付证 券清算 款	-	-	-	-	-	-	-	-	381,647.06	381,647.06
应付赎 回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,129,159.31	1,129,159.31
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	-	-	-	2,413,481.96	2,413,481.96
应付托 管费	-	-	-	-	-	-	-	-	402,247.01	402,247.01
应付交 易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	3,052,593.52	3,052,593.52
其他负 债	-	-	-	-	-	-	-	-	3,453,161.56	3,453,161.56
负债总 计	-	-	-	-	-	-	-	-	10,832,290.42	10,832,290.42
利率敏 感度缺 口	482,902,688.55	-	-	116,158,000.00	-	-	-	-	-1,284,384,368.88	1,883,445,057.43
上年度 末 2011 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月 以内	6 个 月以 内 3 个月-1 年	6 个月 以内 1 年 以内	1-5 年	5 年 以 上	不计息	合计		
资产										
银行存 款	396,120,215.76	-	-	-	-	-	-	-	-	396,120,215.76
结算备 付金	28,901,701.04	-	-	-	-	-	-	-	-	28,901,701.04
存出保 证金	-	-	-	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性 金融资 产	-	-	-	146,253,000.00	-	-	-	-	-29,994,000.00	-1,355,887,454.30

应收证 券清算 款	-	-	-	-	-	-	-	389,757,701.77	389,757,701.77	
应收利 息	-	-	-	-	-	-	-	1,564,466.84	1,564,466.84	
应收申 购款	-	-	-	-	-	-	-	91,848.43	91,848.43	
资产总 计	425,021,916.80	-	-	146,253,000.00	-	-	-	29,994,000.00	-1,747,551,471.34	2,348,820,388.14
负债										
应付证 券清算 款	-	-	-	-	-	-	-	35,166,959.55	35,166,959.55	
应付赎 回款	-	-	-	-	-	-	-	7,443,823.89	7,443,823.89	
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	-	-	3,165,026.83	3,165,026.83	
应付托 管费	-	-	-	-	-	-	-	527,504.46	527,504.46	
应付交 易费用	-	-	-	-	-	-	-	3,610,692.22	3,610,692.22	
其他负 债	-	-	-	-	-	-	-	2,128,054.49	2,128,054.49	
负债总 计	-	-	-	-	-	-	-	52,042,061.44	52,042,061.44	
利率敏 感度缺 口	425,021,916.80	-	-	146,253,000.00	-	-	-	29,994,000.00	-1,695,509,409.90	2,296,778,326.70

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2012年6月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	利率增加 25 个基准点	-87,568.89	-570,337.75
利率减少 25 个基准点	87,568.89	570,337.75	

6.4.13.4.2 外汇风险

由于本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,288,847,165.53	68.43	1,355,887,454.30	59.03
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	116,158,000.00	6.17	176,247,000.00	7.67
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,405,005,165.53	74.60	1,532,134,454.30	66.71

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2012年6月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	基金业绩比较基准增加 5%	77,622,257.70	39,185,147.72
	基金业绩比较基准减少 5%	-77,622,257.70	-39,185,147.72

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 X85%+中证全债指数收益率 X15%

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2012 年 8 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,288,847,165.53	68.04
	其中：股票	1,288,847,165.53	68.04
2	固定收益投资	116,158,000.00	6.13
	其中：债券	116,158,000.00	6.13
	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	482,902,688.55	25.49
6	其他各项资产	6,369,493.77	0.34
7	合计	1,894,277,347.85	100.00

7.2 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	24,829,631.85	1.32
B	采掘业	27,556,106.60	1.46
C	制造业	659,707,536.00	35.03
C0	食品、饮料	31,164,845.39	1.65
C1	纺织、服装、皮毛	120,669,954.83	6.41
C2	木材、家具	16,328,899.50	0.87
C3	造纸、印刷	288,500.00	0.02
C4	石油、化学、塑胶、塑料	54,625,735.95	2.90
C5	电子	58,297,611.62	3.10
C6	金属、非金属	22,677,289.42	1.20
C7	机械、设备、仪表	243,397,773.14	12.92
C8	医药、生物制品	112,256,902.96	5.96
C99	其他制造业	23.19	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,706,310.52	0.46
E	建筑业	173,409,596.82	9.21
F	交通运输、仓储业	9,922,998.56	0.53
G	信息技术业	29,401,511.15	1.56
H	批发和零售贸易	28,787,258.66	1.53

I	金融、保险业	109,101,764.83	5.79
J	房地产业	79,188,471.37	4.20
K	社会服务业	118,979,664.58	6.32
L	传播与文化产业	10,083,299.76	0.54
M	综合类	9,173,014.83	0.49
	合计	1,288,847,165.53	68.43

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601668	中国建筑	51,499,950	172,009,833.00	9.13
2	600177	雅戈尔	13,653,097	115,914,793.53	6.15
3	002073	软控股份	13,824,621	115,850,323.98	6.15
4	601117	中国化学	14,839,516	85,624,007.32	4.55
5	601166	兴业银行	3,132,290	40,657,124.20	2.16
6	600195	中牧股份	1,987,808	33,912,004.48	1.80
7	600030	中信证券	2,207,108	27,875,774.04	1.48
8	600893	航空动力	1,655,792	21,541,853.92	1.14
9	600048	保利地产	1,571,243	17,817,895.62	0.95
10	600372	中航电子	968,392	17,421,372.08	0.92
11	600519	贵州茅台	70,447	16,847,400.05	0.89
12	002241	歌尔声学	459,741	16,775,949.09	0.89
13	600143	金发科技	2,748,977	16,411,392.69	0.87
14	002043	兔宝宝	4,599,690	16,328,899.50	0.87
15	600707	彩虹股份	2,706,700	16,023,664.00	0.85
16	000024	招商地产	631,103	15,480,956.59	0.82
17	600138	中青旅	690,256	12,410,802.88	0.66
18	600340	华夏幸福	674,733	12,205,919.97	0.65
19	600079	人福医药	523,317	12,135,721.23	0.64
20	000002	万科A	1,306,038	11,636,798.58	0.62
21	600378	天科股份	1,319,995	11,417,956.75	0.61
22	600383	金地集团	1,735,211	11,244,167.28	0.60
23	000826	桑德环境	462,019	10,580,235.10	0.56
24	002294	信立泰	375,698	10,143,846.00	0.54
25	300267	尔康制药	472,493	10,012,126.67	0.53
26	002168	深圳惠程	1,054,044	9,781,528.32	0.52
27	600717	天津港	1,499,857	9,479,096.24	0.50

28	300024	机器人	429,028	9,468,647.96	0.50
29	600253	天方药业	1,420,701	9,362,419.59	0.50
30	002236	大华股份	304,283	9,341,488.10	0.50
31	000009	中国宝安	917,301	9,173,010.00	0.49
32	600066	宇通客车	401,783	9,024,046.18	0.48
33	600594	益佰制药	452,006	8,949,718.80	0.48
34	300026	红日药业	371,774	8,930,011.48	0.47
35	002155	辰州矿业	447,285	8,659,437.60	0.46
36	600467	好当家	1,192,107	8,463,959.70	0.45
37	000798	中水渔业	1,230,585	8,355,672.15	0.44
38	600837	海通证券	860,700	8,288,541.00	0.44
39	300096	易联众	740,000	8,140,000.00	0.43
40	000783	长江证券	881,632	8,022,851.20	0.43
41	000860	顺鑫农业	500,000	8,010,000.00	0.43
42	600498	烽火通信	300,834	7,975,109.34	0.42
43	600161	天坛生物	529,167	7,551,213.09	0.40
44	600886	国投电力	1,681,174	7,296,295.16	0.39
45	000527	美的电器	620,000	6,851,000.00	0.36
46	000963	华东医药	222,120	6,708,024.00	0.36
47	600859	王府井	230,000	6,292,800.00	0.33
48	600694	大商股份	183,300	6,131,385.00	0.33
49	600600	青岛啤酒	158,723	6,061,631.37	0.32
50	002450	康得新	380,649	6,056,125.59	0.32
51	600736	苏州高新	1,000,000	5,660,000.00	0.30
52	601555	东吴证券	631,550	5,582,902.00	0.30
53	601688	华泰证券	519,200	5,451,600.00	0.29
54	002068	黑猫股份	787,450	5,394,032.50	0.29
55	000776	广发证券	180,539	5,385,478.37	0.29
56	600489	中金黄金	249,685	5,373,221.20	0.29
57	000026	飞亚达A	494,856	5,369,187.60	0.29
58	002011	盾安环境	500,000	5,325,000.00	0.28
59	600637	百视通	405,516	5,312,259.60	0.28
60	000625	长安汽车	1,082,900	5,284,552.00	0.28
61	600547	山东黄金	160,800	5,280,672.00	0.28
62	000016	深康佳A	1,376,502	5,120,587.44	0.27
63	600999	招商证券	437,882	5,083,810.02	0.27
64	300070	碧水源	164,281	4,912,001.90	0.26
65	600061	中纺投资	1,000,000	4,900,000.00	0.26
66	002385	大北农	249,962	4,849,262.80	0.26

67	600549	厦门钨业	110,200	4,838,882.00	0.26
68	002018	华星化工	999,961	4,729,815.53	0.25
69	002662	京威股份	200,000	4,278,000.00	0.23
70	002091	江苏国泰	400,000	4,156,000.00	0.22
71	300188	美亚柏科	176,065	4,107,596.45	0.22
72	002485	希努尔	360,501	4,073,661.30	0.22
73	000962	东方钨业	300,000	4,008,000.00	0.21
74	002638	勤上光电	229,459	3,625,452.20	0.19
75	300081	恒信移动	200,000	3,560,000.00	0.19
76	002629	仁智油服	200,000	3,536,000.00	0.19
77	300251	光线传媒	150,000	3,501,000.00	0.19
78	300142	沃森生物	83,139	3,182,560.92	0.17
79	002475	立讯精密	102,627	3,032,627.85	0.16
80	601633	长城汽车	168,306	2,995,846.80	0.16
81	600961	株冶集团	300,000	2,952,000.00	0.16
82	600266	北京城建	192,351	2,921,811.69	0.16
83	000931	中关村	499,940	2,824,661.00	0.15
84	000728	国元证券	252,400	2,753,684.00	0.15
85	000153	丰原药业	407,441	2,738,003.52	0.15
86	600038	哈飞股份	163,259	2,724,792.71	0.14
87	002551	尚荣医疗	173,313	2,672,486.46	0.14
88	002611	东方精工	257,192	2,551,344.64	0.14
89	600983	合肥三洋	317,656	2,541,248.00	0.13
90	002353	杰瑞股份	50,000	2,425,000.00	0.13
91	300182	捷成股份	99,950	2,348,825.00	0.12
92	002099	海翔药业	219,140	2,331,649.60	0.12
93	002430	杭氧股份	191,486	2,315,065.74	0.12
94	600582	天地科技	160,082	2,313,184.90	0.12
95	300171	东富龙	79,301	2,260,078.50	0.12
96	300127	银河磁体	80,900	2,242,548.00	0.12
97	002400	省广股份	115,000	2,202,250.00	0.12
98	600543	莫高股份	140,097	2,157,493.80	0.11
99	300136	信维通信	129,000	2,076,900.00	0.11
100	600486	扬农化工	109,447	1,986,463.05	0.11
101	000402	金融街	299,988	1,958,921.64	0.10
102	002432	九安医疗	224,814	1,942,392.96	0.10
103	002554	惠博普	172,243	1,825,775.80	0.10
104	600586	金晶科技	384,838	1,712,529.10	0.09
105	300207	欣旺达	121,664	1,710,595.84	0.09

106	600426	华鲁恒升	218,200	1,612,498.00	0.09
107	002378	章源钨业	50,000	1,583,000.00	0.08
108	600292	九龙电力	106,336	1,410,015.36	0.07
109	600200	江苏吴中	153,099	1,402,386.84	0.07
110	002325	洪涛股份	94,451	1,399,763.82	0.07
111	000581	威孚高科	50,000	1,370,000.00	0.07
112	002415	海康威视	50,000	1,360,000.00	0.07
113	300273	和佳股份	74,922	1,330,614.72	0.07
114	600458	时代新材	100,000	1,255,000.00	0.07
115	600199	金种子酒	50,000	1,249,000.00	0.07
116	300257	开山股份	40,000	1,140,000.00	0.06
117	000651	格力电器	50,000	1,042,500.00	0.06
118	002203	海亮股份	123,300	1,030,788.00	0.05
119	600690	青岛海尔	81,700	957,524.00	0.05
120	600456	宝钛股份	50,000	938,500.00	0.05
121	002583	海能达	49,942	877,980.36	0.05
122	300170	汉得信息	50,000	863,000.00	0.05
123	002564	张化机	70,500	860,100.00	0.05
124	300088	长信科技	50,000	834,000.00	0.04
125	300079	数码视讯	50,000	831,000.00	0.04
126	002566	益盛药业	55,138	828,724.14	0.04
127	601100	恒立油缸	74,851	823,361.00	0.04
128	300027	华谊兄弟	50,000	791,500.00	0.04
129	300110	华仁药业	65,798	776,416.40	0.04
130	600585	海螺水泥	50,000	741,000.00	0.04
131	601126	四方股份	49,929	730,461.27	0.04
132	000401	冀东水泥	50,000	703,000.00	0.04
133	000063	中兴通讯	50,000	698,000.00	0.04
134	300078	中瑞思创	50,000	696,000.00	0.04
135	002154	报喜鸟	50,000	681,500.00	0.04
136	600888	新疆众和	64,873	670,138.09	0.04
137	000039	中集集团	50,000	665,000.00	0.04
138	000786	北新建材	50,000	647,000.00	0.03
139	000969	安泰科技	50,001	611,512.23	0.03
140	000413	宝石A	50,000	595,500.00	0.03
141	600469	风神股份	67,076	592,951.84	0.03
142	300126	锐奇股份	57,273	566,429.97	0.03
143	600495	晋西车轴	50,000	532,500.00	0.03
144	002535	林州重机	65,000	508,950.00	0.03

145	000157	中联重科	50,000	501,500.00	0.03
146	002271	东方雨虹	35,400	481,440.00	0.03
147	601098	中南传媒	49,952	478,540.16	0.03
148	000933	神火股份	50,000	456,000.00	0.02
149	600787	中储股份	49,989	443,902.32	0.02
150	000060	中金岭南	50,000	431,000.00	0.02
151	000430	ST 张家界	45,000	425,700.00	0.02
152	000778	新兴铸管	50,000	334,500.00	0.02
153	000629	攀钢钒钛	50,000	329,000.00	0.02
154	002177	御银股份	50,000	327,000.00	0.02
155	002078	太阳纸业	50,000	288,500.00	0.02
156	002064	华峰氨纶	50,000	269,500.00	0.01
157	600223	鲁商置业	50,000	262,000.00	0.01
158	601766	中国南车	50,000	228,000.00	0.01
159	600401	海润光伏	21,701	198,347.14	0.01
160	600337	美克股份	21,500	129,000.00	0.01
161	000028	一致药业	28	833.84	0.00
162	000858	五粮液	1	32.76	0.00
163	600729	重庆百货	1	28.22	0.00
164	600298	安琪酵母	1	24.61	0.00
165	002007	华兰生物	1	24.58	0.00
166	002345	潮宏基	1	23.19	0.00
167	000999	华润三九	1	21.85	0.00
168	000566	海南海药	1	19.30	0.00
169	600422	昆明制药	1	18.63	0.00
170	300006	莱美药业	1	15.84	0.00
171	600261	阳光照明	1	11.90	0.00
172	000862	银星能源	1	7.09	0.00
173	000069	华侨城 A	1	6.38	0.00
174	600846	同济科技	1	4.83	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002073	软控股份	193,512,499.21	8.43

2	600177	雅戈尔	168,949,375.29	7.36
3	601668	中国建筑	167,679,290.00	7.30
4	601166	兴业银行	118,361,953.13	5.15
5	600036	招商银行	106,919,299.84	4.66
6	600016	民生银行	103,788,434.40	4.52
7	600000	浦发银行	81,744,219.70	3.56
8	000538	云南白药	64,994,241.00	2.83
9	000568	泸州老窖	62,831,439.39	2.74
10	601328	交通银行	59,455,803.40	2.59
11	601288	农业银行	54,450,000.00	2.37
12	601939	建设银行	53,680,000.00	2.34
13	600143	金发科技	52,921,056.25	2.30
14	601398	工商银行	46,325,000.00	2.02
15	601117	中国化学	44,308,835.05	1.93
16	600498	烽火通信	44,023,671.44	1.92
17	600195	中牧股份	39,414,336.66	1.72
18	600276	恒瑞医药	37,431,468.68	1.63
19	000069	华侨城 A	35,948,789.84	1.57
20	600519	贵州茅台	31,766,174.26	1.38

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。

7.4.2 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	600887	伊利股份	223,833,815.94	9.75
2	002024	苏宁电器	114,454,034.93	4.98
3	600016	民生银行	97,347,285.95	4.24
4	600036	招商银行	96,818,854.13	4.22
5	600839	四川长虹	96,600,309.86	4.21
6	600352	浙江龙盛	90,934,986.02	3.96
7	000877	天山股份	85,629,581.54	3.73
8	000538	云南白药	84,474,066.04	3.68
9	600000	浦发银行	79,477,054.29	3.46
10	000401	冀东水泥	68,390,053.79	2.98
11	601166	兴业银行	67,564,581.62	2.94
12	600585	海螺水泥	66,211,555.90	2.88

13	000568	泸州老窖	60,822,607.65	2.65
14	601328	交通银行	58,434,849.86	2.54
15	601288	农业银行	53,850,000.00	2.34
16	601939	建设银行	52,140,000.00	2.27
17	600655	豫园商城	50,635,662.43	2.20
18	600028	中国石化	49,140,651.81	2.14
19	600104	上汽集团	49,043,814.13	2.14
20	601398	工商银行	46,768,238.58	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。

7.4.3 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	3,008,703,610.33
卖出股票收入（成交）总额	3,041,391,666.31

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。

7.5 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	116,158,000.00	6.17
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	116,158,000.00	6.17

7.6 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

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	1101079	11 央行票据 79	700,000	67,753,000.00	3.60

2	1101082	11 央行票据 82	500,000	48,405,000.00	2.57
---	---------	---------------	---------	---------------	------

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

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。

7.9.3 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	2,526,001.26
2	应收证券清算款	666,245.52
3	应收股利	-
4	应收利息	2,950,884.81
5	应收申购款	226,362.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,369,493.77

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告期投资组合报告附注中无其他文字描述部分。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
41,516	51,536.18	241,070,881.53	11.27%	1,898,505,343.30	88.73%

8.2 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
基金管理公司所有从业人员 持有本基金	4,028,935.40	0.19%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。

§ 9 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	2,542,341,314.56
本报告期基金总申购份额	21,833,632.25
减：本报告期基金总赎回份额	424,598,721.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,139,576,224.83

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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) 基金管理人的重大人事变动情况

2012 年 3 月 30 日，经平安大华基金管理有限公司股东会审议通过，免去蔡方方女士董事职务，高鹏先生出任公司董事。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金继续聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务，未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
平安证券	2	1,619,126,687.98	26.99%	1,369,423.10	27.08%	-
中投证券	1	1,219,447,214.76	20.33%	1,040,742.69	20.58%	-
方正证券	2	810,362,466.72	13.51%	688,802.18	13.62%	-
中信证券	2	706,208,464.24	11.77%	584,441.07	11.56%	-
申万证券	2	441,394,095.39	7.36%	363,756.78	7.19%	-
中金公司	2	334,936,269.90	5.58%	272,138.07	5.38%	-
兴业证券	1	241,782,011.70	4.03%	211,074.45	4.17%	-

湘财证券	1	211,667,112.64	3.53%	171,979.86	3.40%	-
银河证券	2	146,020,824.31	2.43%	123,753.00	2.45%	-
招商证券	2	116,049,973.89	1.93%	101,311.88	2.00%	-
广发证券	1	70,855,586.88	1.18%	60,050.39	1.19%	-
民生证券	2	51,279,378.99	0.85%	43,459.39	0.86%	-
中航证券	1	30,445,189.24	0.51%	25,878.34	0.51%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 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
平安证券	-	-	3,750,000,000.00	28.85%	-	-
中投证券	83,553,426.50	20.14%	7,400,000,000.00	56.92%	-	-
方正证券	279,366,257.40	67.32%	650,000,000.00	5.00%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	52,041,517.50	12.54%	1,200,000,000.00	9.23%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	关于增加中信证券（浙江）有限责任公司为平安大华基金管理有限责任公司旗下证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 2 月 13 日
2	关于针对农业银行借记卡开通网上交易定期定额投资以及相关费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 2 月 27 日
3	关于平安大华行业先锋股票型证券投资基金增加广发证券股份有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 5 日
4	平安大华基金管理有限公司关于开通汇付天下-天天盈基金网上交易业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 26 日
5	关于开通平安大华基金旗下开放式基金转换业务及针对网上交易实施转换费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 6 月 4 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华行业先锋股票型证券投资基金的文件；
- 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、平安大华行业先锋股票型证券投资基金招募说明书；

- 5、中国证监会批准设立平安大华基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内平安大华行业先锋股票型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

深圳市福田区金田路大中华国际交易广场第八层

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>

平安大华基金管理有限公司
2012 年 8 月 29 日