

平安大华添利债券型证券投资基金 2015 年 半年度报告

2015 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：2015 年 8 月 25 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 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.....	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 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.....	39
7.9 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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.11 投资组合报告附注.....	40

§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 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.....	41
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息	46
§12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华添利债券型证券投资基金	
基金简称	平安大华添利债券	
基金主代码	700005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 11 月 27 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	44,811,870.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	平安大华添利债券 A	平安大华添利债券 C
下属分级基金的交易代码:	700005	700006
报告期末下属分级基金的份额总额	24,648,400.08 份	20,163,470.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上，主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合，以期获得和产品期限匹配的债券收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种。预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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
注册地址		深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦酒店 01: 419	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	518048	100818
法定代表人	杨秀丽	田国立

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
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、基金托管人住所

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	深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

§ 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

基金级别	平安大华添利债券 A	平安大华添利债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	6,570,847.46	4,674,431.85
本期利润	5,598,699.75	3,355,997.79
加权平均基金份额本期利润	0.1830	0.1347
本期加权平均净值利润率	14.15%	10.58%
本期基金份额净值增长率	16.00%	15.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	8,483,630.85	6,629,515.89
期末可供分配基金份额利润	0.3442	0.3288
期末基金资产净值	33,425,798.59	27,031,331.94
期末基金份额净值	1.356	1.341
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	35.60%	34.10%

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

平安大华添利债券 A

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	-1.17%	1.44%	0.43%	0.04%	-1.60%	1.40%
过去三个月	8.05%	1.00%	2.21%	0.09%	5.84%	0.91%
过去六个月	16.00%	0.86%	3.17%	0.09%	12.83%	0.77%
过去一年	28.65%	0.63%	8.19%	0.11%	20.46%	0.52%
自基金合同生效起至今	35.60%	0.42%	13.36%	0.09%	22.24%	0.33%

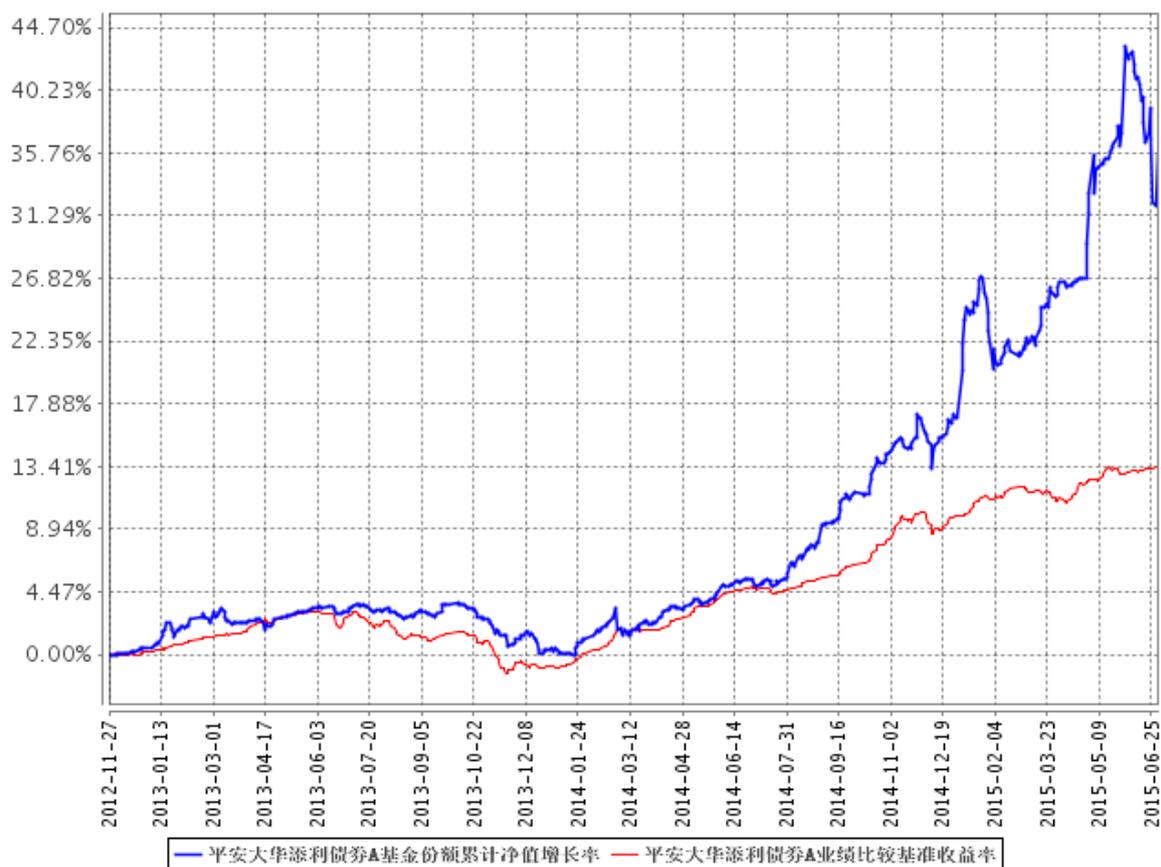
平安大华添利债券 C

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	-1.18%	1.43%	0.43%	0.04%	-1.61%	1.39%
过去三个月	7.97%	1.00%	2.21%	0.09%	5.76%	0.91%
过去六个月	15.70%	0.86%	3.17%	0.09%	12.53%	0.77%
过去一年	28.08%	0.64%	8.19%	0.11%	19.89%	0.53%
自基金合同生效起至今	34.10%	0.42%	13.36%	0.09%	20.74%	0.33%

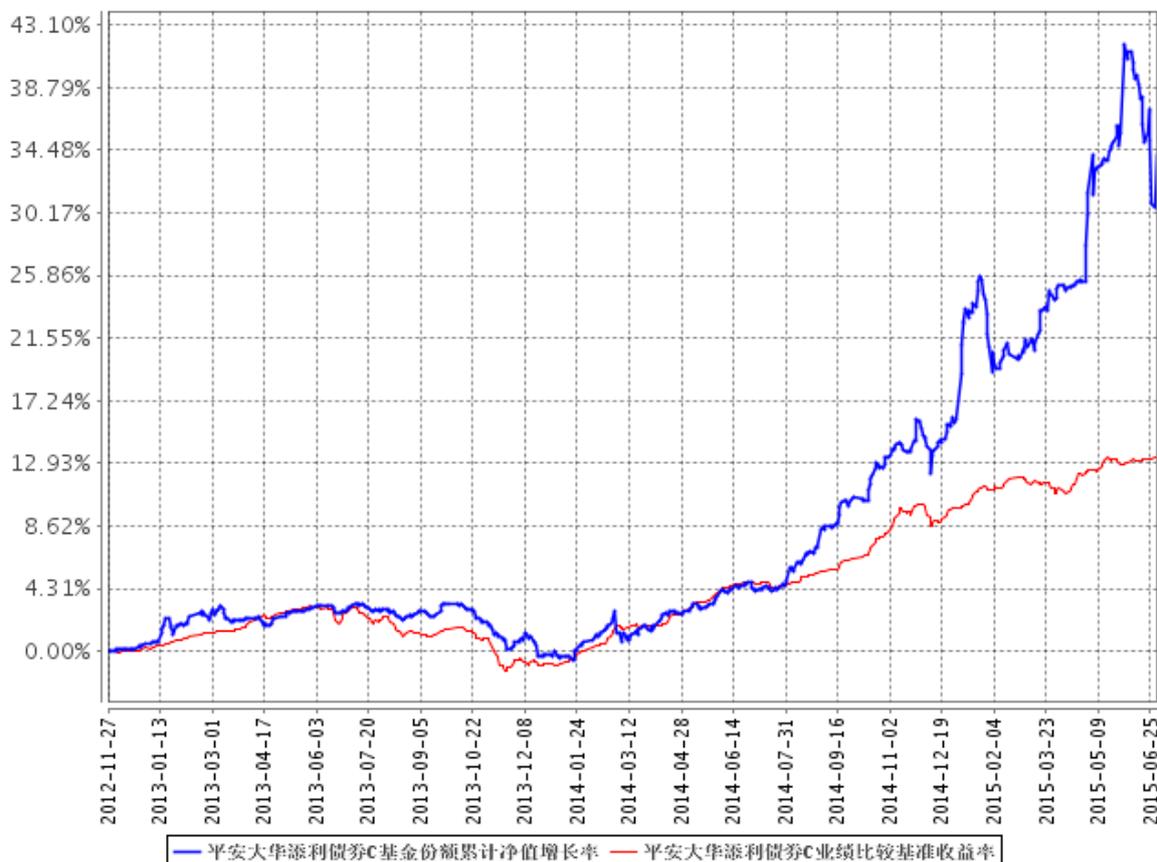
业绩比较基准：中证全债指数收益率

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

平安大华添利债券A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



平安大华添利债券C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



- 1、本基金基金合同于 2012 年 11 月 27 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。

§ 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 2015 年 6 月 30 日，平安基金共管理 9 只开放式基金，资产管理总规模超 200 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		
孙健	基金经理	2012 年 11 月 27 日	-	14	自 2001 年起，先后在湘财证券资产管理部、中国太平人寿保险公司投资部 / 太平资产管理公司从事投资工作，2006 年起，分别在摩根士丹利华鑫基金公司、银华基金公司担任基金经理。2011 年 9 月加入平安基金，任投资研究部固定收益研究员，现担任平安大华保本混合型证券投资基金基金经理、平安大华添利债券型证券投资基金

					金基金经理、平安大华日增利货币市场基金基金经理、平安大华财富宝货币市场基金基金经理、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金基金经理、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

- 1、此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《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、《平安大华添利债券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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 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

2015 年第二季度宏观经济延续不断探底的过程，虽然房地产销量大幅回转是众多疲弱指标中的一抹亮色，但因库存过高被质疑地产投资回升不可存续，其余领域更未出现好转的迹象，因此第二季度宽松政策迭出，稳增长政策再次祭出，在此刺激下权益市场加速上扬，但是债券市场并未呈现上行走势，除了短期债券在宽松流动性助推下下行幅度较大，10 年长期债反倒呈现出箱体震荡行情。第二季度本基金管理人择机借助可转债参与权益市场的上扬，对纯债投资相对谨慎，逐渐降低了长期债券的投资比例，缩短了久期，以短期票息收入为主，基金净值保持稳健持续增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金 A 份额净值为 1.356 元，份额累计净值为 1.356 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 16.00%，同期业绩基准增长率为 3.17%。本基金 C 份额净值为 1.341 元，份额累计净值为 1.341 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 15.70%，同期业绩基准增长率为 3.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年第二季度财政货币政策持续加码，但仍未阻止宏观经济基本面的整体颓势，权益市场也终于在上半年赚得盆满钵盈后，6 月开始出现大幅调整，继而演变为流动性危机，如若救助不力，或对金融机构和实体经济形成较大伤害。本基金未来操作思路以安全性和流动性为主要准则，暂时回避可转债，增配短期债券资产，增加类现金资产，提高组合的信用评级，组合久期控制在 3 年以内。

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。

4.8 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”）在对平安大华添利债券型证券投资基金（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：平安大华添利债券型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,411,793.65	6,544,944.16
结算备付金		143,894.56	86,920.22
存出保证金		15,582.82	4,996.02
交易性金融资产	6.4.7.2	57,817,664.94	51,663,415.60
其中：股票投资		2,982,029.82	-
基金投资		-	-
债券投资		54,835,635.12	51,663,415.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		10,095,194.65	-
应收利息	6.4.7.5	693,569.48	863,849.27
应收股利		-	-
应收申购款		114,639.86	59,099.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		70,292,339.96	59,223,224.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		-	-
应付赎回款		9,580,218.15	592,320.42
应付管理人报酬		44,835.64	37,401.76

应付托管费		12,810.18	10,686.24
应付销售服务费		10,518.93	8,346.53
应付交易费用	6.4.7.7	19,291.04	4,453.59
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	167,535.49	272,382.42
负债合计		9,835,209.43	925,590.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	44,811,870.92	50,043,463.03
未分配利润	6.4.7.10	15,645,259.61	8,254,170.68
所有者权益合计		60,457,130.53	58,297,633.71
负债和所有者权益总计		70,292,339.96	59,223,224.67

6.2 利润表

会计主体：平安大华添利债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年6月30日
一、收入		9,564,269.33	6,390,826.83
1.利息收入		1,436,958.97	2,509,464.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,715.76	43,615.15
债券利息收入		1,400,086.08	2,428,339.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,157.13	37,509.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,403,102.52	-1,156,839.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	983,206.58	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,419,895.94	-1,156,839.27
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,290,581.77	5,028,763.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	14,789.61	9,438.36

列)			
减：二、费用		609,571.79	922,495.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	246,145.84	406,289.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,327.38	116,082.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	62,694.61	82,958.91
4. 交易费用	6.4.7.19	41,864.69	6,635.45
5. 利息支出		79,010.33	114,104.18
其中：卖出回购金融资产支出		79,010.33	114,104.18
6. 其他费用	6.4.7.20	109,528.94	196,424.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,954,697.54	5,468,331.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,954,697.54	5,468,331.47

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华添利债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	50,043,463.03	8,254,170.68	58,297,633.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,954,697.54	8,954,697.54
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）	-5,231,592.11	-1,563,608.61	-6,795,200.72
其中：1.基金申购款	73,161,433.59	22,043,925.68	95,205,359.27
2.基金赎回款	-78,393,025.70	-23,607,534.29	-102,000,559.99
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）	44,811,870.92	15,645,259.61	60,457,130.53

项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	162,997,546.79	288,504.07	163,286,050.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,468,331.47	5,468,331.47
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)	-88,494,597.20	-1,943,662.98	-90,438,260.18
其中：1.基金申购款	9,488,743.66	217,969.64	9,706,713.30
2.基金赎回款	-97,983,340.86	-2,161,632.62	-100,144,973.48
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)	74,502,949.59	3,813,172.56	78,316,122.15

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

基金管理人负责人

林婉文

主管会计工作负责人

张南南

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安大华添利债券型证券投资基金（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]1070号《关于核准平安大华添利债券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《平安大华添利债券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10月22日至2012年11月23日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,355,253,004.98元，业经安永华明会计师事务所有限公司(2012)验字第60937497_B03号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华添利债券型证券投资基金基金合同》于2012

年 11 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,356,468,699.53 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,215,694.55 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《平安大华添利债券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债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会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）。本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%；本基金保留的现金以及投资于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中证全债指数收益率。

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 3 号《半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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 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

本期报告期除交易所上市或挂牌转让的固定收益品种估值方法变更外，所采用会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

根据中国证券投资基金业协会发布的《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“新估值标准”），经与托管行协商一致，本公司自 2015 年 3 月 31 日起对旗下基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（新估值标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。于 2015 年 3 月 31 日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.5%。

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事项。

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]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。

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、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。

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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	1,411,793.65
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,411,793.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,796,027.96	2,982,029.82	186,001.86

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,036,232.30	6,351,835.12
	银行间市场	48,080,997.36	48,483,800.00
	合计	56,117,229.66	54,835,635.12
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	58,913,257.62	57,817,664.94	-1,095,592.68

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

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

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

本基金本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

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	1,093.13
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	58.64
应收债券利息	692,411.41
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.30
合计	693,569.48

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日

交易所市场应付交易费用	15,156.54
银行间市场应付交易费用	4,134.50
合计	19,291.04

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,275.34
预提费用	161,260.15
合计	167,535.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安大华添利债券 A		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,608,896.56	29,608,896.56
本期申购	26,894,330.55	26,894,330.55
本期赎回(以“-”号填列)	-31,854,827.03	-31,854,827.03
- 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	24,648,400.08	24,648,400.08

金额单位：人民币元

平安大华添利债券 C		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,434,566.47	20,434,566.47
本期申购	46,267,103.04	46,267,103.04
本期赎回(以“-”号填列)	-46,538,198.67	-46,538,198.67
- 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	20,163,470.84	20,163,470.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安大华添利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,189,178.92	826,046.12	5,015,225.04
本期利润	6,570,847.46	-972,147.71	5,598,699.75
本期基金份额交易产生的变动数	-2,276,395.53	439,869.25	-1,836,526.28
其中：基金申购款	7,170,620.16	1,024,524.25	8,195,144.41
基金赎回款	-9,447,015.69	-584,655.00	-10,031,670.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,483,630.85	293,767.66	8,777,398.51

单位：人民币元

平安大华添利债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,674,598.33	564,347.31	3,238,945.64
本期利润	4,674,431.85	-1,318,434.06	3,355,997.79
本期基金份额交易产生的变动数	-719,514.29	992,431.96	272,917.67
其中：基金申购款	11,571,333.76	2,277,447.51	13,848,781.27
基金赎回款	-12,290,848.05	-1,285,015.55	-13,575,863.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,629,515.89	238,345.21	6,867,861.10

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	28,530.93
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,052.94
其他	131.89
合计	29,715.76

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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	16,648,046.32
减：卖出股票成本总额	15,664,839.74
买卖股票差价收入	983,206.58

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	9,419,895.94
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,419,895.94

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	183,122,152.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	171,636,265.77
减：应收利息总额	2,065,991.02
买卖债券差价收入	9,419,895.94

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,290,581.77
——股票投资	186,001.86
——债券投资	-2,476,583.63
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-2,290,581.77

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,975.08
转换费 C 类 700006	463.42
转换费 A 类 700005	351.11
合计	14,789.61

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	38,957.19
银行间市场交易费用	2,907.50
合计	41,864.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	49,588.57
银行间账户维护费	13,700.00
银行费用	6,568.79
合计	109,528.94

6.4.7.21 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报出日，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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	16,648,046.32	100.00%	-	-

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	221,518,583.64	100.00%	-	-

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	50,200,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无权证交易。

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 2015年1月1日至2015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	15,156.54	100.00%	15,156.54	100.00%

本基金上年度可比期间无应付关联方的佣金。

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 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	246,145.84
其中：支付销售机构的客 户维护费	90,784.47	154,315.19

注：1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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。

2) 本期末本基金未支付的管理费余额 48,528.69 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,327.38	116,082.68

注：1) 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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。

2) 本期末本基金未支付的托管费余额 12,810.18 元。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华添利债券 A	平安大华添利债券 C	合计
平安大华基金管理费有限公司	-	60,522.21	60,522.21
中国银行股份有限公司	-	-	-
平安证券	-	-	-
合计	-	60,522.21	60,522.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安大华添利债券 A	平安大华添利债券 C	合计
平安大华基金管理费有限公司	-	93,654.65	93,654.65
合计	-	93,654.65	93,654.65

1) C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，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。

2) 本期末本基金未支付的销售服务费余额 10518.93 元。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）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**

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

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。

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	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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
中国银行股份有限公司	1,411,793.65	28,530.93	2,836,244.98	40,848.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，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

本报告期内无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**

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015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**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末未进行银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未进行交易所市场债券正回购。

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股票，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	30,196,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,951,800.00	4,000,800.00
合计	38,147,800.00	4,000,800.00

1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债和央票。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
AAA	0.00	-
AAA 以下	6,351,835.12	26,749,615.60
未评级	10,336,000.00	20,913,000.00
合计	16,687,835.12	47,662,615.60

1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

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。

6.4.13.4 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	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

2015 年 6 月 30 日							
资产							
银行存款	1,411,793.65	-	-	-	-	-	1,411,793.65
结算备付金	143,894.56	-	-	-	-	-	143,894.56
存出保证金	15,582.82	-	-	-	-	-	15,582.82
交易性金融资产	10,022,500.00	4,999,500.00	23,125,800.00	10,336,000.00	6,351,835.12	2,982,029.82	57,817,664.94
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-10,095,194.65	10,095,194.65
应收利息	-	-	-	-	-	693,569.48	693,569.48
应收申购款	-	-	-	-	-	114,639.86	114,639.86
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,593,771.03	4,999,500.00	23,125,800.00	10,336,000.00	6,351,835.12	13,885,433.81	70,292,339.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-9,580,218.15	9,580,218.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	44,835.64	44,835.64
应付托管费	-	-	-	-	-	12,810.18	12,810.18
应付销售	-	-	-	-	-	10,518.93	10,518.93

服务费							
应付交易费用						19,291.04	19,291.04
其他负债						167,535.49	167,535.49
负债总计						9,835,209.43	9,835,209.43
利率敏感缺口	11,593,771.03	4,999,500.00	23,125,800.00	10,336,000.00	6,351,835.12		
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,544,944.16						6,544,944.16
结算备付金	86,920.22						86,920.22
存出保证金	4,996.02						4,996.02
交易性金融资产			-30,750,415.60	10,340,000.00	10,573,000.00		-51,663,415.60
应收利息						863,849.27	863,849.27
应收申购款						59,099.40	59,099.40
资产总计	6,636,860.40		-30,750,415.60	10,340,000.00	10,573,000.00	922,948.67	59,223,224.67
负债							
应付赎回						592,320.42	592,320.42

款							
应付管理人报酬		-	-	-	-	37,401.76	37,401.76
应付托管费		-	-	-	-	10,686.24	10,686.24
应付销售服务费		-	-	-	-	8,346.53	8,346.53
应付交易费用		-	-	-	-	4,453.59	4,453.59
其他负债		-	-	-	-	272,382.42	272,382.42
负债总计		-	-	-	-	925,590.96	925,590.96
利率敏感度缺口	6,636,860.40		-30,750,415.60	10,340,000.00	10,573,000.00		-

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（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	86,781.64	558,893.13
	市场利率上升 25 个基点	-86,422.26	-550,025.16

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。本基金为纯债基金，不直接从二级市场买入股票、权

证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，因所持可转换公司债券转股形成的股票、因投资于分离型可转换债券而产生的权证，将在其可上市交易后不超过 10 个交易日的时间内卖出，因此无重大其他价格风险。

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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	57,817,664.94	95.63	51,663,415.60	88.62

6.4.14 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 2015 年 月 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	2,982,029.82	4.24
	其中：股票	2,982,029.82	4.24

2	固定收益投资	54,835,635.12	78.01
	其中：债券	54,835,635.12	78.01
	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	1,555,688.21	2.21
7	其他各项资产	10,918,986.81	15.53
8	合计	70,292,339.96	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	2,982,029.82	4.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,982,029.82	4.93

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	600016	民生银行	300,003	2,982,029.82	4.93

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	002408	齐翔腾达	7,893,660.12	13.54
2	600016	民生银行	5,749,535.96	9.86
3	600028	中国石化	4,817,671.62	8.26

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	002408	齐翔腾达	8,391,595.83	14.39
2	600028	中国石化	5,150,357.59	8.83
3	600016	民生银行	3,106,092.90	5.33

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	18,460,867.70
卖出股票收入（成交）总额	16,648,046.32

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	2,952,300.00	4.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,336,000.00	17.10

	其中：政策性金融债	10,336,000.00	17.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	35,195,500.00	58.22
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,351,835.12	10.51
8	其他	-	-
9	合计	54,835,635.12	90.70

7.6 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	140201	14 国开 01	100,000	10,336,000.00	17.10
2	128009	歌尔转债	40,004	6,351,835.12	10.51
3	041560015	15 永泰能源 CP001	50,000	5,054,000.00	8.36
4	041558024	15 宜华 CP001	50,000	5,048,500.00	8.35
5	041559006	15 亨通 CP001	50,000	5,045,000.00	8.34

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内无国债期货投资。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内无国债期货投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	15,582.82
2	应收证券清算款	10,095,194.65
3	应收股利	-
4	应收利息	693,569.48
5	应收申购款	114,639.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,918,986.81

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128009	歌尔转债	6,351,835.12	10.51

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无流通受限股票。

7.11.6 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。

§ 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

份额级别	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
平安大华添利债券 A	1,046	23,564.44	0.00	0.00%	24,648,400.08	100.00%
平安大华添利债券 C	792	25,458.93	0.00	0.00%	20,163,470.84	100.00%
合计	1,838	24,380.78	0.00	0.00%	44,811,870.92	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	平安大华添利债券 A	72,929.99	0.2959%
	平安大华添利债券 C	0.00	0.0000%
	合计	72,929.99	0.1627%

8.3 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	份额级别	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	平安大华添利债券 A	0
	平安大华添利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安大华添利债券 A	0
	平安大华添利债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安大华添利债券 A	平安大华添利债券 C
基金合同生效日（2012 年 11 月 27 日）基金份额总额	1,372,938,565.07	983,530,134.46
本报告期期初基金份额总额	29,608,896.56	20,434,566.47
本报告期基金总申购份额	26,894,330.55	46,267,103.04
减：本报告期基金总赎回份额	31,854,827.03	46,538,198.67
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	24,648,400.08	20,163,470.84

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

基金管理人：

(1) 2015 年 5 月 20 日，经平安大华基金管理有限公司股东会审议通过，冯方女士出任监事，林卸伟先生不再担任监事。

(2) 2015 年 6 月 12 日，经平安大华基金管理有限公司董事会审议通过，汪涛先生出任公司副总经理。

基金托管人：

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

本基金聘用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，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	16,648,046.32	100.00%	15,156.54	100.00%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-

银河证券	2	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-

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 2 个交易单元：兴业证券（深圳 1 个）、中银国际证券（上海一个）

(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。

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	221,518,583.64	100.00%	50,200,000.00	100.00%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：本基金租用的证券公司交易单元本期无权证交易。

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	平安大华基金管理有限公司 2014 年 12 月 31 日基金净值 公告	中国证券报、证券时 报	2015 年 1 月 1 日
2	平安大华基金管理有限公司 关于旗下部分基金参加齐鲁 证券网上交易基金申购费率 优惠活动的公告	中国证券报、证券时 报	2015 年 3 月 20 日
3	关于平安大华基金管理有限 公司旗下基金参与天天基金 费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时 报	2015 年 4 月 14 日
4	平安大华旗下基金关于新增 上海联泰资产管理有限公司 为基金代销机构并开通基金 转换、定期定额投资业务的公 告	中国证券报、证券时 报	2015 年 5 月 15 日
5	平安大华旗下基金关于新增 广发证券股份有限公司为基 金代销机构并开通基金转换、 定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时 报	2015 年 6 月 5 日
6	平安大华旗下基金关于新增 一路财富（北京）信息科技有 限公司为基金代销机构并开 通基金转换、定期定额投资业 务的公告	中国证券报、证券时 报	2015 年 6 月 11 日
7	平安大华基金管理有限公司 高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时 报	2015 年 6 月 17 日
8	平安大华旗下基金关于新增 上海汇付金融服务有限公司 为基金代销机构并开通基金 转换、定期定额投资业务的公 告	中国证券报、证券时 报	2015 年 6 月 19 日
9	平安大华旗下基金关于新增 申万宏源证券有限公司为基 金代销机构并开通基金转换、 定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时 报	2015 年 6 月 19 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添利债券型证券投资基金的文件；
- 2、平安大华添利债券型证券投资基金基金合同；
- 3、平安大华添利债券型证券投资基金托管协议；
- 4、平安大华添利债券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、报告期内平安大华添利债券型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路星河发展中心大厦 5 楼

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
2015 年 8 月 25 日