

平安大华添利债券型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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

报告送出日期：2016 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2016 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华添利债券	
场内简称	-	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	61,690,107.01 份	
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。	
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	
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

下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	700005	700006
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	25,452,373.45 份	36,237,733.56 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月30日）	
	平安大华添利债券 A	平安大华添利债券 C
1. 本期已实现收益	106,241.84	91,690.52
2. 本期利润	440,857.79	504,602.66
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0158	0.0132
4. 期末基金资产净值	35,819,327.70	50,136,211.26
5. 期末基金份额净值	1.407	1.384

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. 所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 本报告期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	净值增长率①	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	1.01%	0.04%	2.20%	0.04%	-1.19%	0.00%

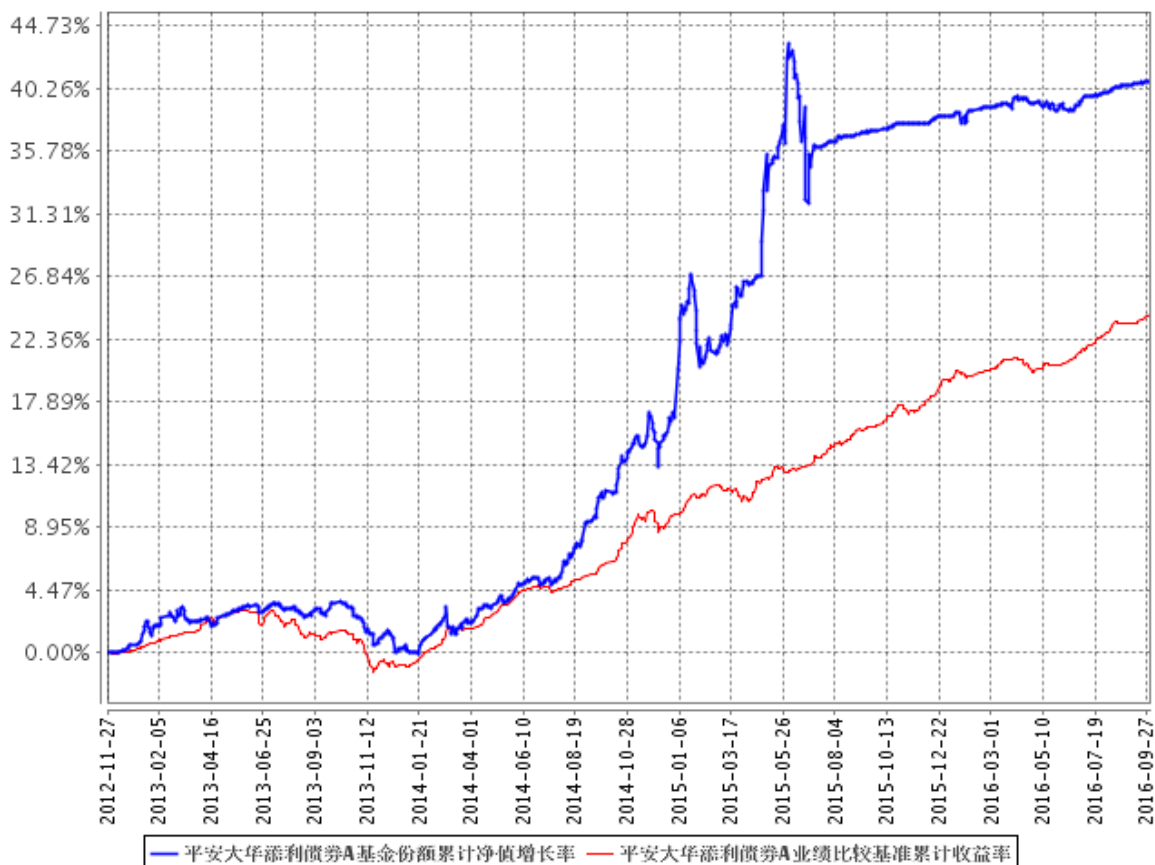
平安大华添利债券 C

阶段	净值增长率①	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	0.95%	0.04%	2.20%	0.04%	-1.25%	0.00%

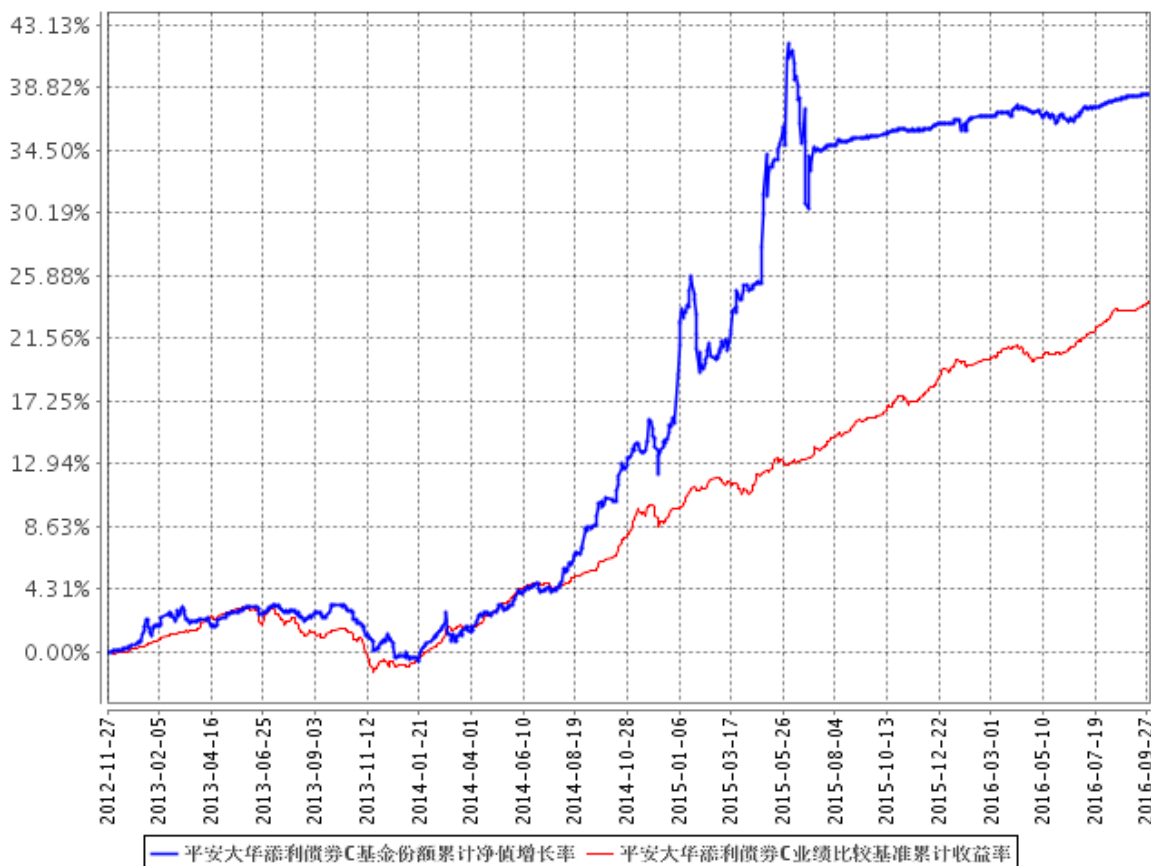
业绩比较基准：中证全债指数收益率

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，截至报告期末已满三年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓。

3.3 其他指标

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙健	本基金的基金经理	2012 年 11 月 27 日	-	15	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

				<p>理。2011 年 9 月加入平安基金，现担任平安大华保本混合型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华日增利货币市场基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华添利债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度宏观经济疲弱中闪现亮点，货币市场流动性保持紧平衡态势，信贷及社会融资水平有

所改善，预计政府将继续以稳增长为基调，施行偏中性的货币政策与积极的财政政策。展望四季度，房地产调控政策在中长期影响经济的回暖，但利好债市。汇率继续承压使流动性过度宽松预期降低。本基金 3 季度资产配置依然以利率债为主，适度增加了高等级信用债的投资比例。

三季度债券市场受配置压力影响，使得债市收益率持续下行。期限利差和信用利差在低位运行将加剧市场的波动。四季度债券市场的机会来自于波动。市场会受到 CPI、经济数据等影响阶段性地调整，地方政府对房地产市场的调控将影响房地产的销售以及投资，利好债市。本基金投资以利率债券，高等级债券和可转债为主，保留了充分的流动性。未来将择机加大组合的久期和杠杆率，主要以利率债券为主；做好可转债重点品种的跟踪和研究，择机参与选择期权进攻性强的品种重点投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，本基金 A 份额净值为 1.407 元，份额累计净值为 1.407 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 1.01%，同期业绩基准增长率为 2.20%。本基金 C 份额净值为 1.384 元，份额累计净值为 1.384 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 0.95%，同期业绩基准增长率为 2.20%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,838,469.65	91.96
	其中：债券	79,838,469.65	91.96
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,069,682.08	5.84

8	其他资产	1,912,693.67	2.20
9	合计	86,820,845.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,001,000.00	5.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,617,575.20	70.52
	其中：政策性金融债	60,617,575.20	70.52
4	企业债券	14,004,766.95	16.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	215,127.50	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	79,838,469.65	92.88

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	140201	14 国开 01	200,000	20,184,000.00	23.48
2	150212	15 国开 12	150,000	15,204,000.00	17.69
3	070208	07 国开 08	150,000	14,974,500.00	17.42
4	140216	14 国开 16	100,000	10,152,000.00	11.81
5	112116	12 中桥债	56,227	5,692,983.75	6.62

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末无资产支持证券投资情况。

5.7 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

本基金报告期末无贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末无权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2

基金投资的前十名股票没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,163.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,875,130.06
5	应收申购款	33,399.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,912,693.67

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 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
报告期期初基金份额总额	37,980,728.18	41,616,764.69
报告期期间基金总申购份额	776,003.57	6,295,851.42
减：报告期期间基金总赎回份额	13,304,358.30	11,674,882.55
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	25,452,373.45	36,237,733.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未使用固有资金投资本基金

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安大华添利债券型证券投资基金设立的文件
- (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) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 报告期内平安大华添利债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

8.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安大华基金管理有限公司
2016 年 10 月 25 日