

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
送递日期:2013年8月27日

§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2013年8月26日复核了本报告中的财务状况、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2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 平安大华添利债券

基金主代码 700005

基金运作方式 约定型开放式

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 467,806,844.65份

基金份额在存续期间 不定期

下属分级基金的基本基金简称: 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 305,878,758.64份 161,928,086.01份

2.2 基金产品说明

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。

本基金采用利差策略、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,主动管理寻找价值低估的固定收益品种,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 基金管理人与基金托管人

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 唐徽

联系电话 022-22623179 95566

电子邮箱 fundservice@pingan.com.cn tgxpl@bank-of-china.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

基金半年度报告置地点 基金管理人、基金托管人处

§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

基金简称 平安大华添利债券A 平安大华添利债券C

报告期(2013年1月1日-2013年6月30日) 报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)

本期已实现收益 23,113,797.85 13,512,629.65

本期利润 22,037,852.74 13,481,508.87

加权平均基金份额本期利润 0.0373 0.0361

本期基金份额净值增长率 2.59% 2.29%

3.1.1 期间数据和指标

报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)

本期已实现收益 23,113,797.85

本期利润 22,037,852.74

加权平均基金份额本期利润 0.0373

本期基金份额净值增长率 2.59%

3.1.2 期末数据和指标

报告期(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 0.0312(0.0283)

期末基金份额净值 315,430,231.03 166,513,989.57

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责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.本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前序列示。

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(%) 基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -0.19% 0.09% -0.38% 0.16% 0.19% -0.07%

过去三个月 0.78% 0.11% 0.98% 0.10% -0.20% 0.01%

过去六个月 2.59% 0.17% 2.42% 0.08% -0.13% 0.09%

自基金合同生效起至今 3.10% 0.16% 2.65% 0.07% 0.15% 0.09%

平安大华添利债券C

阶段 份额净值增长率(%) 基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -0.19% 0.10% -0.38% 0.16% 0.19% -0.06%

过去三个月 0.59% 0.11% 0.98% 0.10% -0.39% 0.01%

过去六个月 2.29% 0.17% 2.42% 0.08% -0.13% 0.09%

自基金合同生效起至今 2.80% 0.16% 2.65% 0.07% 0.15% 0.09%

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

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额总额为467,806,844.65份,其中A类基金份额为305,878,758.64份,C类基金份额为161,928,086.01份,A类基金份额净值为1.031元,C类基金份额净值为1.028元。

6.2 利润表

会计主体:平安大华添利债券型证券投资基金管理人

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目 附注号 本期 2013年1月1日至2013年6月30日

一、收入 41,401,199.94

1.利息收入 16,406,891.79

其中:存款利息收入 1,853,993.53

债券利息收入 12,588,828.11

资产支持证券利息收入 -

买入返售金融资产收入 1,964,070.15

其他利息收入 -

2.投资收益(损失以“-”填列) 25,822,556.62

其中:股票投资收益 -

债券投资收益 25,822,556.62

资产支持证券投资收益 -

衍生工具收益 -

股利收益 -

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) -1,107,065.89

4.汇兑收益(损失以“-”号填列) -

5.其他收入 278,817.42

减:二、费用 5,881,833.83

1.管理人报酬 3,477,130.05

2.托管费 993,465.78

3.销售服务费 769,138.76

4.交易费用 19,664.57

5.利息支出 387,253.90

其中:卖出回购金融资产支出 387,253.90

6.其他费用 235,185.27

三、利得总额(损失以“-”号填列) 35,159,361.61

减:所得税费用 -

四、净利润(净亏损以“-”号填列) 35,159,361.61

注:本基金合同于2012年11月27日生效,因此无需披露比较数据。

6.3 所有者权益变动表

会计主体:平安大华添利债券型证券投资基金管理人

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目 附注号 本期 2013年1月1日至2013年6月30日

一、实收基金 2,356,468,699.53

其中:本期利润 11,264,090.84

2,367,732,790.37

二、本期利润 35,159,361.61

三、本期基金份额变动数 -1,888,661,854.88

(净值减少以“-”号填列) -32,646,076.50

-1,921,307,931.38

四、期末余额 467,806,844.65

14,137,375.95

481,944,220.60

注:本基金合同于2012年11月27日生效,因此无需披露比较数据。

6.4 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]1017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,是目前中国内地注册资本资金量最高的基金公司。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%;三亚盈旅实业有限公司,持有股份14.3%。

平安大华秉承“规范、诚信、专业、创新”的经营理念,致力于持续稳定的投

资服务,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2013年6月30日,平安大华共管理15只开放式基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理助理)及其基金业绩助理简介

姓名 职务 (本基金的基金经理(助理)期限) 证券从业年限 说明

孙健 基金经理 2012年11月27日 -

自2001年起,先后在渤海证券研究所担任研究员,现担任平安大华华泰混合型证券投资基金基金经理,平安大华华泰债券型证券投资基金基金经理,平安大华华泰债券型证券投资基金基金经理。

2006年起,分别在摩根士丹利华鑫基金公司、平安大华基金管理有限公司担任基金经理,平安大华华泰债券型证券投资基金基金经理。

2012年11月27日,平安大华华泰债券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,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》、《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细则,《平安大华添利债券型证券投资基金管理合同》及其他有关法律法规的规定,勤勉尽责的履行管理人职责,并不存在损害基金持有人利益的行为。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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

本报告期内,基金管理人严格执行《公平交易制度》