

平安大华添利债券型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

基金管理人:平安大华基金管理有限公司

报告送出日期:2014年1月21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2014年1月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等内容，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 平安大华添利债券

交易代码 700005

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2013年11月27日

报告期末基金份额总额 162,997,546.79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健增值。

投资策略 本基金主要采用利率策略、息差策略和积极投资策略，在严格控制流动风险、利率半风险以及信用风险的基础上，主动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。预期收益与风险高于货币市场基金，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

下属两级基金的交易代码 700005 700006

报告期末下属两级基金的份额总额 106,137,469.81份 56,860,076.98份

§ 3 主要财务指标

主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31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 -2,886,952.32 -1,611,768.87

2.本期利润 -5,089,933.65 -2,879,005.04

3.期初平均基金份额净值 -0.0330 -0.0351

4.期末基金份额净值 106,515,991.99 56,770,058.87

5.期末可供分配基金份额净值 1.004 0.998

注:1.本期已实现收益不包含利息再投资收益，本期利润不包含利息再投资收益。

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。

3.2.1 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 0.21% 0.21% 0.21%

平安大华添利债券C 0.17% -0.31% 0.12% -0.78% 0.05%

3.2.2 本报告期基金份额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 0.21% 0.21% 0.21%

平安大华添利债券C 0.17% -0.31% 0.12% -0.78% 0.05%

3.2.3 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

5.2.1 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

5.2.2 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.3 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.4 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.5 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.6 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.7 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.8 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.9 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.10 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.11 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.12 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.13 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.14 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.15 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.16 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.17 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.18 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.19 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.20 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.21 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.22 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.23 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.24 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.25 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.26 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.27 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.28 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.29 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.30 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.31 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.32 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.33 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.34 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.35 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.36 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.37 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.38 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.39 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.40 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.41 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.42 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.43 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.44 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.45 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资组合

5.2.46 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合

5.2.47 本报告期末按公允价值占基金资产净值比例