

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:2017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。

基金经理王平对中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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。

基金经理王平承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,本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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金名称	平安大华添利债券
基金代码	-
交易方式	定期开放式
基金合同生效日	2012年11月27日
报告期末基金资产总额	705,300,060.04元
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,在保持资产流动性的同时,追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金主要投资于货币市场工具、信用等级较高的固定收益类金融工具,并根据宏观经济形势、市场变化及资金需求,适时调整投资组合,以达到既保本又增值的双重目的。
业绩比较基准	本基金的业绩基准为银行存款基准利率(税后)+0.5%。
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,属于投资于货币市场基金中的中低风险品种,预期风险、预期收益均低于货币市场基金,低于股票型基金。
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
下属分级基金的交易代码	700000 700006
下属分级基金的申购赎回代码	- -
报告期末下属分级基金的份额	744,373,043.02份 23,067,021.24份
下属分级基金的申购赎回总额	- -

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期:2017年7月1日 - 2017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	13,680,009.31 406,302.27
2.本期利润	10,210,906.62 206,963.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0153 0.0116
4.期末基金资产净值	1,042,076,210.07 32,050,419.08
5.期末基金份额净值	1.000 1.070

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。  
3.2.1 本基金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 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 0.03% 0.04% 0.02% 0.04% 0.03% 0.00%

平安大华添利债券C

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 0.03% 0.06% 0.01% 0.04% 0.02% 0.01%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券A

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.15% 100% 0.00% -20%-20% 0.00%

平安大华添利债券C

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券A

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券C

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券A

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券C

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券A

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券C

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券A

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券C

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券A

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券C

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券A

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券C

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券A

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券C

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券A

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券C

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券A

阶段 净值增长 累计净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率差值 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.00% 0.24% 2.00% 0.27% 0.28% 0.11%

中证全债指数收益率

3.2.2 本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的比较

平安大华添利债券C