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:2013年8月27日

平安大华添利债券型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

§1 重要提示

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	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	467,806,844.65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	305,878,758.64份	161,928,086.01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	唐州徽
	联系电话	0755-22623179	95566
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	tgxxpl@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
基金半年度报告备置地点	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(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%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0312	0.0283
期末基金资产净值	315,430,231.03	166,513,989.57
期末基金份额净值	1.031	1.028

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

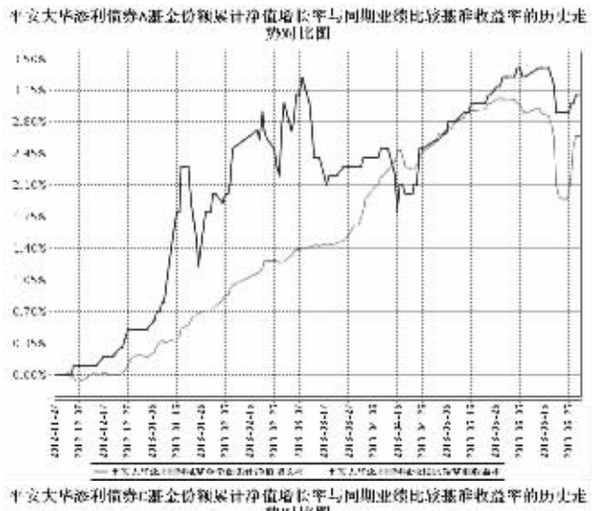
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.19%	0.09%	-0.38%	0.16%	0.19%	-0.07%
过去三个月	0.78%	0.11%	0.98%	0.10%	-0.20%	0.01%
过去六个月	2.59%	0.17%	2.42%	0.08%	0.17%	0.09%
自基金合同生效起至今	3.10%	0.16%	2.65%	0.07%	0.45%	0.09%

平安大华添利债券C

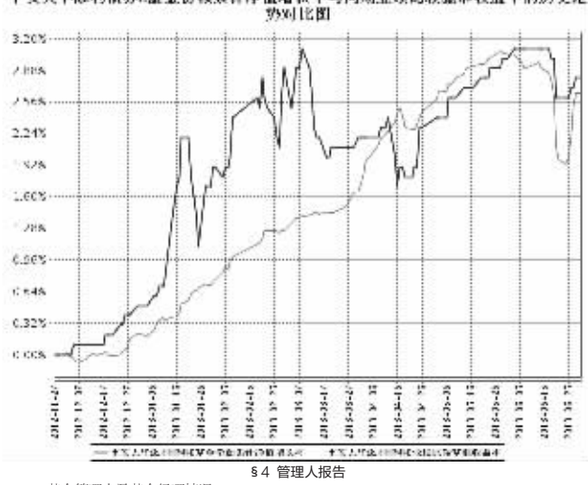
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.19%	0.10%	-0.38%	0.16%	0.19%	-0.06%
过去三个月	0.59%	0.11%	0.98%	0.10%	-0.39%	0.01%
过去六个月	2.29%	0.17%	2.42%	0.08%	-0.13%	0.09%
自基金合同生效起至今	2.80%	0.16%	2.65%	0.07%	0.15%	0.09%

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

平安大华添利债券A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



§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】1917号文批准设立。平安大华总部位于深圳,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。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%;三亚盈湾旅业有限公司,持有股份14.3%。

平安大华秉承"规范、诚信、专业、创新"企业管理理念,致力于通过持续稳定的投资业绩,不断丰富的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2013年6月30日,平安大华共管理5只开放式基金。

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	-	12	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,本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》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。

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

2013年上半年宏观经济基本确立了中长期放缓趋势,在此宏观背景下,本基金退出了权益市场,并未参与可转债的波段操作,而相应增加了债券资产的配置比例。出于对未来流动性中性偏紧的判断,债券组合在保持原有信用债和短期流动性工具合理仓位的基础之上,加大了浮息债的投资比例,从而使得在此轮债券和权益市场大幅调整的情况下,基金净值仍保在持稳健的上升通道之中。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.03元,份额累计净值为1.03元。报告期内,本基金份额A净值增长率为2.59%,同期业绩基准增长率为2.42%;份额C净值增长率为2.29%,同期业绩基准增长率为2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为经过此番资金一役,管理层宏观调控思路更为清晰,防范金融风险、降低债务杠杆、进行存量调整、强调资金效率,而对经济增速放缓的容忍和对淘汰过剩产能的决心,使得经济未来3年的增长中枢将逐渐下移。在此背景下,我们依然看好债券的中长期投资价值,经济增速的下滑将压制债券收益率波动的上限,但与此同时,我们也需关注在流动性中长期外流、机构降低杠杆初期、利率市场化前段和经济结构转型过程中CPI的敏感度,可能会增加债券收益率的震荡区间。因此,未来本基金管理人将密切关注债券收益率波动的幅度,逐步择机增加长久期利率债券和高收益信用债券。对于可转债投资,随着股指连续下挫,大盘蓝筹可转债的估值越来越有优势,为中期投资提供了较好的机会。但由于下半年IPO开闸资金分流,宏观数据低迷,银行去杠杆刚开始,美元升值等不确定因素仍然较多,故对权益市场仍然保持相对谨慎态度,可根据大盘调整幅度和个券估值,择机参与转债投资。

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。

§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:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		28,666,771.39	1,635,120,647.97
结算备付金		13,640.86	11,418,181.82
存出保证金		16,134.53	-
交易性金融资产		504,969,000.00	686,423,128.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		504,969,000.00	686,423,128.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	65,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		9,038,732.59	5,931,900.37
应收股利		-	-
应收申购款		87,087.08	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		542,791,366.45	2,403,893,858.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		37,699,816.45	-
应付证券清算款		5,007,680.28	34,024,084.77
应付赎回款		17,404,674.23	-
应付管理人报酬		315,835.37	1,399,571.32
应付托管费		90,238.69	399,877.55
应付销售服务费		64,897.37	333,759.15
应付交易费用		7,368.57	3,775.00
应交税费		-	-
应付利息		48,475.45	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		208,159.44	-
负债合计		60,847,145.85	36,161,067.79
所有者权益:			
实收基金		467,806,844.65	2,356,468,699.53
未分配利润		14,137,375.95	11,264,090.84
所有者权益合计		481,944,220.60	2,367,732,790.37
负债和所有者权益总计		542,791,366.45	2,403,893,858.16

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

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		-
基金投资收益		-
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(损失以"-"号填列)		278,817.42
减:二、费用		5,881,838.33
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、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		35,519,361.61
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		35,519,361.61

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(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:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	2,356,468,699.53	11,264,090.84	2,367,732,790.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	35,519,361.61	35,519,361.61
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)	-1,888,661,854.88	-32,646,076.50	-1,921,307,931.38
其中:1.基金申购款	79,007,446.68	1,682,447.37	80,689,894.05
2.基金赎回款	-1,967,669,301.56	-34,328,523.87	-2,001,997,825.43
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)	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。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

_____李克难_____ _____林婉文_____ _____王彦____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 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2013年6月30日的财务状况以及自2013年1月1日至2013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

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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]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。

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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
深圳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
三亚盈湾旅业有限公司	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
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,477,130.05
其中:支付销售机构的客户维护费	-

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×0.70%÷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315,835.37元。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	993,465.78

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×0.20%÷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90,238.69元。

6.4.8.2.3 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 2013年1月1日至2013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
平安大华基金管理有限公司	-	769,138.76	769,138.76
合计	-	769,138.76	769,138.76

注: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×0.40%÷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64,897.37元。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	28,666,771.39	529,392.84	-	-

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。

6.4.8.6 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。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额29,699,835.45元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
130213	13国开13	2013年7月8日	100.77	300,000	30,231,000.00
合计				300,000	30,231,000.00

-

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30止,本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额7,999,981.00元,于2013年7月11日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他事项。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	504,969,000.00	93.03
	其中:债券	504,969,000.00	93.03
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	28,680,412.25	5.28
6	其他各项资产	9,141,954.20	1.68
7	合计	542,791,366.45	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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。

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

本基金本报告期未买入股票。

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

本基金本报告期未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未买卖股票。

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	29,847,000.00	6.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	141,078,000.00	29.27
	其中:政策性金融债	141,078,000.00	29.27
4	企业债券	203,623,000.00	42.25
5	企业短期融资券	130,421,000.00	27.06
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	504,969,000.00	104.78

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	130213	13国开13	1,400,000	141,078,000.00	29.27
2	1280295	12临泾经开债	400,000	41,628,000.00	8.64
3	1280077	12芜湖建投债02	400,000	41,208,000.00	8.55
4	1280270	12曲靖债	300,000	31,179,000.00	6.47
5	041271011	12岚桥CP001	300,000	30,105,000.00	6.25

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 投资组合报告附注

7.10.1

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。

7.10.2

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。

7.10.3 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	16,134.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,038,732.59
5	应收申购款	87,087.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,141,954.20

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.10.6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
合计	5,550	84,289.52	1,494,021.09	0.32%	466,312,823.56	99.68%

8.3 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	0.00	0.0000%
	平安大华添利债券C	976.87	0.0006%
	合计	976.87	0.0002%

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0。

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为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