平安大华添利债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014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2014年10月22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2014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	
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	63,665,914.71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	
下属两级基金的基金简称	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	38,734,148.74份	24,931,765.97份

§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(2014年7月1日 - 2014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	1,516,464.54	859,809.65
2.本期利润	2,373,069.47	1,382,848.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0587	0.0550
4.期末基金资产净值	43,211,236.47	27,580,701.24
5.期末基金份额净值	1.116	1.106

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

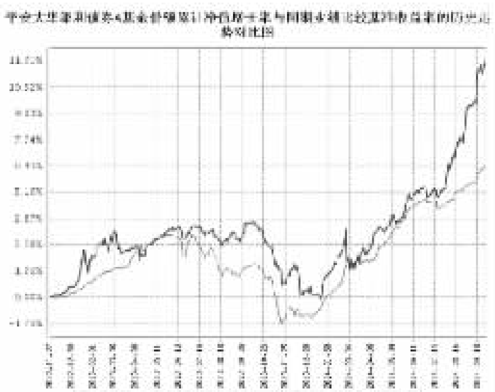
平安大华添利债券A

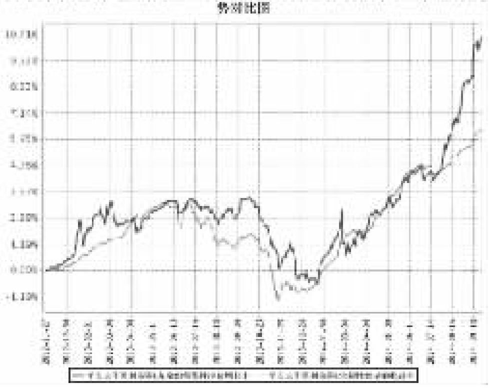
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.88%	0.23%	1.56%	0.06%	4.32%	0.17%

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	5.64%	0.23%	1.56%	0.06%	4.08%	0.17%

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





1、本基金基金合同于2012年11月27日正式生效,截至报告期末已满一年;

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。

§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	基金经理	2012年11月27日	-	13	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、平安大华日增利货币市场基金基金经理、平安大华财富宝货币市场基金基金经理。

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遵规守信情况的说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在经历2季度经济企稳回升的小春天后,7~8月高频数据掉头向下,政策放松预期再度喧嚣尘上,本基金管理人一方面看淡中国中长期经济增速,一方面考虑到政策放松带来的短期流动性宽松和降低融资成本对企业经营状况的底部改善,同时增加了利率债券和可转债的仓位。其中利率债券配置主要以中长期为主,可转债投资主要以稳增长和国企改革为题材的个股,波段操作及时止盈。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金A份额净值为1.116元,份额累计净值为1.116元。报告期内,本基金份额净值增长率为5.88%,同期业绩基准增长率为1.56%。本基金C份额净值为1.106元,份额累计净值为1.106元。报告期内,本基金份额净值增长率为5.64%,同期业绩基准增长率为1.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

8月糟糕的宏观数据大幅低于市场预期,集中体现在产出急剧下滑、地产需求低迷和基建投资的不给力,在前期政策放松稍作停留之际,实体经济立即呈现出较弱的增长,虽有3季度基数原因,但仍体现了经济内生需求的薄弱和对放松政策的依赖性较强。从近期高频数据反映的实体经济状况而言,前端采购和产出库存双双下滑,价格指标也出现下挫,预计短期经济弱势格局仍将继续。虽然国庆前后地产首套房政策松动有助于稳定经济,但现有宏观环境不同于2008年,利润偏薄制约商业银行现有放贷动力,唯有后续政策陆续出台方可稳定经济。

本基金管理人依然看好在经济调整中债券的长期配置价值,但现有债券收益率曲线过于平坦,长端继续下行,有赖于基准利率下调引导的短端收益率下滑,从现有决策当局的表态来看,今年年内基准利率调整的希望不大,而在4季度往往存在年末效应引发的流动性稍有收紧,因此本基金管理人适度缩减久期,待曲线调整后再增加长期债券配置比例。对于可转债,在对基本面不好看的情况下,本基金管理人仓位有所控制,看好来自大盘调整和政策放松预期引致的短期波段机会。

§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	固定收益投资	98,254,880.00	93.46
	其中:债券	98,254,880.00	93.46
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,979,612.96	3.79
7	其他资产	2,891,931.68	2.75
8	合计	105,126,424.64	100.00

5.2 报告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 。

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	3,987,200.00	5.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	94,267,680.00	133.16
	其中:政策性金融债	94,267,680.00	133.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	98,254,880.00	138.79

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	018002	国开1302	200,000	21,180,000.00	29.92
2	140201	14国开01	200,000	20,524,000.00	28.99
3	140221	14国开21	200,000	20,520,000.00	28.99
4	018003	国开1401	111,960	12,091,680.00	17.08
5	140350	14进出50	100,000	10,207,000.00	14.42

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。

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

本基金本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	1,878.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,330,405.83
5	应收申购款	559,647.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,891,931.68

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	44,785,359.80	29,717,589.79
报告期期间基金总申购份额	2,544,090.51	4,944,992.26
减:报告期期间基金总赎回份额	8,595,301.57	9,730,816.08
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	38,734,148.74	24,931,765.97

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第七次会议审议通过,由罗春风先生任职公司总经理职务,任职日期为2014年8月19日。该事项已于 2014 年 8月 21 日公告。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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
2014年10月25日

平安大华深证300指数增强型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014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2014年10月22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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华深证300指数增强
交易代码	700002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
报告期末基金份额总额	43,368,816.72份
投资目标	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过指数复制的方法拟合、跟踪深证300指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过全样本复制的方式拟合、跟踪深证300指数,并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理。以有效降低基金运作成本并提高本基金的投资收益率。 其中指数复制策略采用全样本复制的方式,即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合以拟合标的指数的业绩表现。股票增强策略在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上,辅以有限度的增强操作及一级市场股票投资,以求获取超越标的指数的收益率表现。
业绩比较基准	深证300指数收益率x95%+商业银行活期存款利率(税后)X5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的品种,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时,本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
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

§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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	69,560.00
2.本期利润	7,760,703.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.1530
4.期末基金资产净值	48,193,242.70
5.期末基金份额净值	1.111

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;

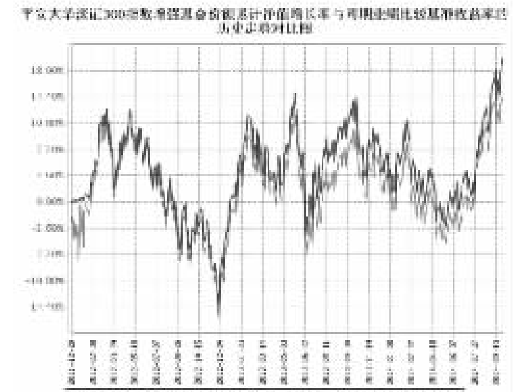
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	16.46%	0.94%	14.94%	0.89%	1.52%	0.05%

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



1、本基金基金合同于2011年12月20日正式生效,截至报告期末已满两年;

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。

§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		
焦巍	基金经理	2011年12月20日	2013年3月19日	12	1994年起先后在中国银行、光大银行、湘财证券、汉唐证券、海马投资股份有限公司工作。2009年加入平安基金,任投资研究部宏观策略研究员,曾任平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理、平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金经理。
黄建军	基金经理	2013年3月19日	-	7	2007年起先后在国元证券公司、华夏基金管理公司从事行业研究工作,在长盛基金管理公司担任基金经理助理。2012年加入平安大华基金管理公司,任投资研究部研究主管。现担任平安大华策略先锋混合型证券投资基金基金经理、平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理。
乔海英	基金经理	2014年9月12日	-	3	南开大学金融学硕士,曾先后任职于博时基金管理有限公司、民生加银基金管理有限公司担任行业研究员,2013年加入平安大华基金管理有限公司,担任行业研究员,现任平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金经理。

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遵规守信情况的说明

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、《平安大华深证300指数增强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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,股票市场呈现单边上涨,个股方面继续呈现价值股和成长股的结构分化走势,小盘股、高市盈率个股涨幅明显强于传统蓝筹和白马成长。风格上市场也格外青睐通过资本运作带来巨大想象空间的公司。行业分化看,代表未来改革和发展方向的新兴产业尤其是军工、移动互联继续受到市场追捧。本基金以跟踪指数为主,报告期内加大了主动管理组合的权重,精选个股对组合业绩带来明显的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.111元,份额累计净值为1.191元。报告期内,本基金份额净值增长率为16.46%,同期业绩基准增长率为14.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014,由于受到资金成本的影响,经济增速可能继续下行,因此,传统行业依然缺乏趋势性机会,个股性的投资机会依然需要重点从新兴产业中寻找。军工、环保、国企改革都受国家政策支持的主题,以及普及率有大幅提升空间的硬件设备,和市场发展空间非常广阔的移动互联网和大数据应用,这些领域里面可能继续走出大幅上涨的个股。本基金力求从上述行业中精选出个股,带动基金业绩战胜业绩基准。

§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	46,623,404.22	93.38
	其中:股票	46,623,404.22	93.38
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,949,585.53	5.91
7	其他资产	353,093.15	0.71
8	合计	49,926,082.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,122,763.51	2.33
B	采矿业	954,027.81	1.98
C	制造业	24,479,440.69	50.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	924,713.23	1.92
E	建筑业	675,953.36	1.40
F	批发和零售业	1,254,514.97	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	340,357.20	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,744,797.66	7.77
J	金融业	2,901,749.99	6.02
K	房地产业	1,735,983.66	3.60
L	租赁和商务服务业	1,248,013.30	2.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	653,142.04	1.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	136,215.12	0.28
R	文化、体育和娱乐业	1,004,703.30	2.08
S	综合	314,468.78	0.65
	合计	41,490,844.62	86.09

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	5,132,559.60	10.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,132,559.60	10.65

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

5.3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002399	海普瑞	40,085	1,000,120.75	2.08
2	000651	格力电器	30,750	852,697.50	1.77
3	002181	粤传媒	35,700	676,515.00	1.40
4	002024	苏宁云商	72,927	624,255.12	1.30
5	000776	广发证券	54,637	598,275.15	1.24
6	000783	长江证券	86,266	589,196.78	1.22
7	000625	长安汽车	34,825	477,102.50	0.99
8	000768	中航飞机	30,097	475,231.63	0.99
9	002202	金风科技	40,475	473,557.50	0.98
10	000002	万 科A	50,000	459,000.00	0.95

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600178	*ST东安	199,100	1,421,574.00	2.95
2	300151	昌红科技	67,600	1,299,948.00	2.70
3	002019	鑫富药业	21,920	765,665.60	1.59
4	300049	福瑞股份	19,300	706,380.00	1.47
5	300326	凯利泰	16,800	611,352.00	1.27

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资情况。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资情况。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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情况。

5.10.2 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情况。

5.10.3 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情况。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,534.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	596.65
5	应收申购款	345,961.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	353,093.15

5.11.4 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

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300326	凯利泰	611,352.00	1.27	重大资产重组停牌

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	56,720,322.68
报告期期间基金总申购份额	3,142,293.15
减:报告期期间基金总赎回份额	16,493,799.11
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	43,368,816.72

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	23.06

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第七次会议审议通过,由罗春风先生任职公司总经理职务,任职日期为2014年8月19日。该事项已于 2014 年 8月 21 日公告。

本报告期内本基金资产净值连续20个工作日低于5000万,截止本报告期末,本基金资产净值低于5000万。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安大华深证300指数增强型证券投资基金设立的文件
(2)平安大华深证300指数增强型证券投资基金基金合同
(3)平安大华深证300指数增强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)报告期内平安大华深证300指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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
2014年10月25日

平安大华日增利货币市场基金

2014 第三季度 报告

2014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:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2014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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华日增利货币
交易代码	000379
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月3日
报告期末基金份额总额	10,156,181,851.24份
投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据对未来短期利率变动的预测,确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析方法,确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1. 本期已实现收益	73,517,290.39
2.本期利润	73,517,290.39
3.期末基金资产净值	10,156,181,851.24

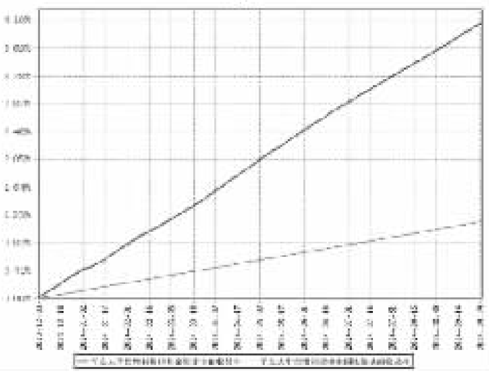
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1584%	0.0011%	0.3450%	0.0000%	0.8134%	0.0011%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1、本基金基金合同于2013年12月3日正式生效,截至报告期末未满一年;

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。

§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	基金经理	2013年12月3日	-	13	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、平安大华日增利货币市场基金基金经理、平安大华财富宝货币市场基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《平安大华日增利货币市场基金基金合同》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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年3季度货币市场流动性整体宽松,7天回购利率季度平均维持在3.5%附近,阶段性飙升来自于IPO期间对货币市场的冲击。本基金3季度资产配置在比较债券和存款相对优势的情况下,重心侧重于短融和浮息债投资,银行存款为辅,在交易所回购出现阶段性冲高时适度增加了回购仓位,使得本基金年化收益保持稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为1.1584%,同期业绩基准增长率为0.3450%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

8月糟糕的宏观数据大幅低于市场预期,集中体现在产出急剧下滑、地产需求低迷和基建投资的不给力,在前期政策放松稍作停留之际,实体经济立即呈现出较弱的增长,虽有3季度基数原因,但仍体现了经济内生需求的薄弱和对放松政策的依赖性较强。从近期高频数据反映的实体经济状况而言,前端采购和产出库存双双下滑,价格指标也出现下挫,预计短期经济弱势格局仍将继续。虽然国庆前后地产首套房政策松动有助于稳定经济,但现有宏观环境不同于2008年,利润偏薄制约商业银行现有放贷动力,唯有后续政策陆续出台方可稳定经济。

本基金管理人依然看好在经济调整债券的长期配置价值,现有债券收益率曲线过于平坦,短端价值突出,债券资本利得有赖于基准利率下调引导的短端收益率下滑。本基金管理人认为,未来银行间流动性依然宽松,银行存款性价比不高,资产配置仍以债券投资为主,同时灵活把握市场波段操作机会。

§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	固定收益投资	3,607,152,604.25	35.50
	其中:债券	3,527,152,604.25	34.71
	资产支持证券	80,000,000.00	0.79
2	买入返售金融资产	2,331,540,649.16	22.94
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	4,162,358,182.16	40.96
4	其他资产	60,793,637.13	0.60
5	合计	10,161,845,072.70	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.51	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	122
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	92

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	25.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.31	-
2	30天(含)-60天	10.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.76	-
3	60天(含)-90天	21.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.92	-
4	90天(含)-180天	21.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.46	-
5	180天(含)-397天(含)	21.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.46	-

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,264,515,842.34	12.45
	其中:政策性金融债	1,264,515,842.34	12.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,262,636,761.91	22.28
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,527,152,604.25	34.73
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	1,264,515,842.34	12.45

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100236	10国开36	3,200,000	320,405,905.38	3.15
2	120227	12国开27	1,500,000	147,840,020.09	1.46
3	130235	13国开35	1,400,000	136,774,076.18	1.35
4	130242	13国开42	1,300,000	130,979,220.30	1.29
5	090205	09国开05	1,300,000	130,250,741.63	1.28
6	130212	13国开12	1,200,000	119,306,760.31	1.17
7	130250	13国开50	1,000,000	101,020,431.62	0.99
8	041458046	14魏桥铝电CP001	1,000,000	100,022,863.21	0.98
9	130217	13国开17	1,000,000	98,179,499.74	0.97
10	041452019	14西王CP003	800,000	80,675,210.89	0.79

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.2095%
报告期内偏离度的最低值	-0.0008%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1207%

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十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	期末市值	占基金资产净值比例(%)
1	1489100	14鑫宁1A1(总价)	800,000	80,000,000.00	0.79

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益。

5.8.2

本报告期内不存在"持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券"的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	60,406,935.39
4	应收申购款	386,701.74
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	60,793,637.13

5.8.5 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

报告期期初基金份额总额	5,077,119,268.42
报告期期间基金总申购份额	14,553,325,631.96
减:报告期期间基金总赎回份额	9,474,263,049.14
报告期期末基金份额总额	10,156,181,851.24

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第七次会议审议通过,由罗春风先生任职公司总经理职务,任职日期为2014年8月19日。该事项已于 2014 年 8月 21 日公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安大华日增利货币市场基金设立的文件
(2)平安大华日增利货币市场基金基金合同
(3)平安大华日增利货币市场基金托管协议
(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
(5)报告期内平安大华日增利货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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
2014年10月25日