

# 平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 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

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8 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贵金属投资明细.....	47
7.9 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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.11 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	56

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金
基金简称	平安大华惠盈纯债
场内简称	-
基金主代码	002795
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 3 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
报告期末基金份额总额	489,564,482.46 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在谨慎控制组合净值波动率的前提下，本基金追求基金产品的长期、持续增值，并力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过对宏观经济周期、行业前景预测和发债主体公司研究的综合运用，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，深入挖掘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。

	本基金将灵活应用组合久期配置策略、类属资产配置策略、个券选择策略、息差策略、现金头寸管理策略等，在合理管理并控制组风险的前提下获得债券市场的整体回报率及超额收益。
业绩比较基准	一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	方琦
	联系电话	0755-22626828	0755-22160168
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fangqi275@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		518048	518001
法定代表人		罗春风	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安大华基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层



### § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	10,796,639.37
本期利润	1,567,303.37
加权平均基金份额本期利润	0.0032
本期加权平均净值利润率	0.33%
本期基金份额净值增长率	0.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	-6,176,923.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0126
期末基金资产净值	483,387,558.91
期末基金份额净值	0.987
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	-1.30%

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

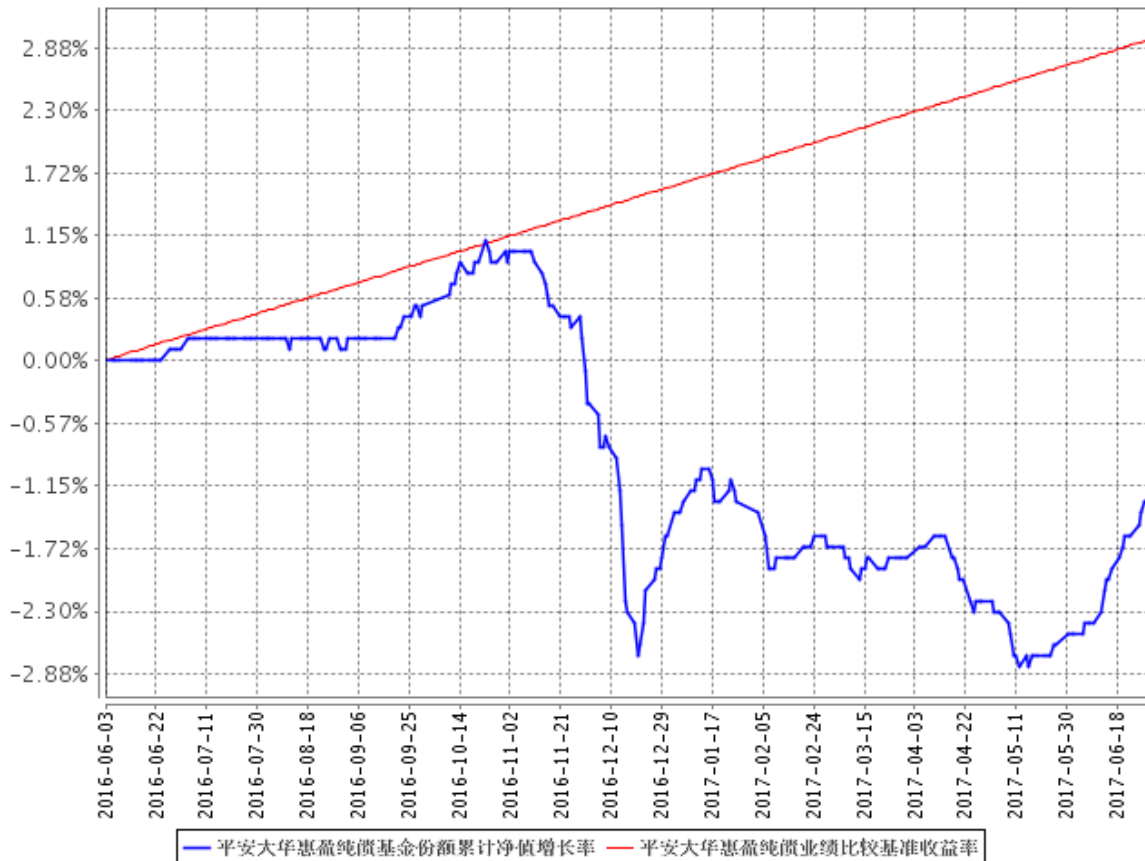
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.23%	0.06%	0.22%	0.01%	1.01%	0.05%
过去三个月	0.51%	0.08%	0.67%	0.01%	-0.16%	0.07%
过去六个月	0.30%	0.09%	1.34%	0.01%	-1.04%	0.08%
过去一年	-1.40%	0.10%	2.73%	0.01%	-4.13%	0.09%
自基金合同生效起至今	-1.30%	0.10%	2.95%	0.01%	-4.25%	0.09%

业绩比较基准：一年期银行定期存款收益率（税后）+1.2%

### 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

平安大华惠盈纯债基金份额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



- 1、本基金基金合同于 2016 年 6 月 3 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，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### **3.3 其他指标**

本基金本报告期内无其他指标。

## § 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之一。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。截至到 2017 年二季度末，公司旗下共有 39 只公募基金，公募基金管理规模突破 1200 亿元人民币。

#### 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	平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金基金经理、投资研究部执行总经理	2016 年 6 月 3 日	-	16 年	孙健先生，投资研究部执行总经理，基金经理，硕士。曾任湘财证券有限责任公司资产管理总部投资经理，中国太平人寿保险有限公司投资部、太平资产管理有限公司组合投资经理，摩根士丹利华鑫货币市场基金基金经理，银华基金管理有限公司固定收益部副总监、银华货币市场基金基金经理、银华

					<p>信用债券型基金基金经理。2011 年 9 月加入平安大华基金公司，任投资研究部固定收益研究员，现担任“平安大华添利债券型证券投资基金”、“平安大华日增利货币市场基金”、“平安大华保本混合型证券投资基金”、“平安大华安心保本混合型证券投资基金”、“平安大华安享保本混合型证券投资基金”、“平安大华安盈保本混合型证券投资基金”、“平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金”、“平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

- 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合规守信情况的说明

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》、《公开募集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、《平安大华惠盈纯债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。

本基金管理人按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期连续四个季度期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

#### 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

今年上半年债券市场延续了调整的走势，波动较大，债券市场 5 月份收益率达到历史中高水平，短期银行存单和债券收益率具备较高投资价值，6 月份央行提前续做 MLF 给市场宽松预期，银行业自查报告截止时间延后 3 个月，都表明了缓解市场情绪的态度。前期发债收益率大幅上升至企业信贷成本以上，造成大量债券取消发行，影响实体融资，M2 数据，理财数据都显著下行取得去杠杆阶段性成果。报告期内，本基金保持了较高仓位的中高等级信用债券，组合久期适中，投资组合带有杠杆。

#### 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 0.9870 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.30%，业绩比较基准收益率为 1.34%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金认为政策将以稳定为主，不会再加码；中长期经济增速面临下行压力，

投资增速回落是大概率，全球央行在紧缩的道路上继续前行，将给中国债券造成基本面和政策面的背离机会。城投债券收益率回到 2012 年时期水平，部分中短期企业债具备配置价值，在目前短期利率仍旧不高的情况下，配置信用债券获取较高的票息收益。

#### 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、运营部及法律合规监察部相关人员组成。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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万人民币的情形。

## § 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，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对平安大华惠盈纯债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的复核，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：平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	67,689.20	3,909,975.30
结算备付金		174,966.64	736,834.06
存出保证金		-	14,631.12
交易性金融资产	6.4.7.2	502,427,000.00	514,534,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		502,427,000.00	514,534,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		500,000.00	-
应收利息	6.4.7.5	12,159,984.24	9,920,673.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		515,329,640.08	529,116,113.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		31,600,000.00	47,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		0.98	389.96
应付管理人报酬		118,288.83	122,587.86
应付托管费		31,543.71	32,690.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	160.00	-
应交税费		-	-
应付利息		13,569.16	38,580.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	178,518.49	110,000.00
负债合计		31,942,081.17	47,304,248.28
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	489,564,482.46	489,556,004.79
未分配利润	6.4.7.10	-6,176,923.55	-7,744,139.30
所有者权益合计		483,387,558.91	481,811,865.49
负债和所有者权益总计		515,329,640.08	529,116,113.77

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9870 元，基金份额总额 489,564,482.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 6 月 3 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		3,377,715.77	232,560.02
1.利息收入		13,493,288.67	232,560.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,496.50	69,691.08
债券利息收入		13,473,792.17	139.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	162,729.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-886,296.00	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-886,296.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,229,336.00	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	59.10	-
<b>减：二、费用</b>		1,810,412.40	86,631.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	714,815.09	46,496.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	190,617.39	12,399.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	160.00	-
5. 利息支出		707,701.43	-
其中：卖出回购金融资产支出		707,701.43	-

6. 其他费用	6.4.7.20	197,118.49	27,735.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,567,303.37	145,928.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,567,303.37	145,928.03

注：本基金于 2016 年 6 月 3 日成立，故无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	489,556,004.79	-7,744,139.30	481,811,865.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,567,303.37	1,567,303.37
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）	8,477.67	-87.62	8,390.05
其中：1.基金申购款	68,692.64	-1,197.14	67,495.50
2.基金赎回款	-60,214.97	1,109.52	-59,105.45
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）	489,564,482.46	-6,176,923.55	483,387,558.91
项目	上年度可比期间 2016年6月3日(基金合同生效日)至2016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）	210,067,616.31	-	210,067,616.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	145,928.03	145,928.03
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	210,067,616.31	145,928.03	210,213,544.34

注：本基金于 2016 年 6 月 3 日成立，故无上年度可比期间数据。

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：

罗春风

林婉文

胡明

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

平安大华惠盈纯债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[2016]233号《关于准予平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金注册的批复》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《平安大华惠盈纯债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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币210,067,615.23元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第695号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金基金合同》于2016年6月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,067,616.31份基金份额,其中认购资金利息折合1.08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,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、国债期货、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款收益率(税后)+1.2%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

### 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

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	67,689.20
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	67,689.20

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日



		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	107,021,000.55	101,276,000.00	-5,745,000.55
	银行间市场	424,132,102.82	401,151,000.00	-22,981,102.82
	合计	531,153,103.37	502,427,000.00	-28,726,103.37
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		531,153,103.37	502,427,000.00	-28,726,103.37

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	652.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	70.83
应收债券利息	12,159,261.36

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	12,159,984.24

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	160.00
合计	160.00

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	178,518.49
合计	178,518.49

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	489,556,004.79	489,556,004.79
本期申购	68,692.64	68,692.64
本期赎回(以“-”号填列)	-60,214.97	-60,214.97
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	489,564,482.46	489,564,482.46

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,486,694.33	-19,230,833.63	-7,744,139.30
本期利润	10,796,639.37	-9,229,336.00	1,567,303.37
本期基金份额交易产生的变动数	288.97	-376.59	-87.62
其中：基金申购款	2,210.32	-3,407.46	-1,197.14
基金赎回款	-1,921.35	3,030.87	1,109.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,283,622.67	-28,460,546.22	-6,176,923.55

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	17,335.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,119.80
其他	41.33
合计	19,496.50

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期末未持有股票。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-886,296.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-886,296.00

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,486,752.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	6,621,048.00

本总额	
减：应收利息总额	1,752,000.00
买卖债券差价收入	-886,296.00

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末未发生贵金属投资。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-9,229,336.00
——股票投资	-
——债券投资	-9,229,336.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-9,229,336.00

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	59.10
合计	59.10

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额 100% 归入基金财产。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	160.00
合计	160.00

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	197,118.49

**6.4.7.21 分部报告**

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表批准报出日，本基金并无需作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 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**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 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
平安大华基金管理有限公司（“平安大华”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人，基金销售机构

平安信托有限责任公司	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
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
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
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无关联方债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本报告期内无通过关联方进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年6月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付	714,815.09	46,496.86



的管理费		
其中：支付销售机构的客 户维护费	61.47	-

注：支付基金管理人平安大华基金管理有限公司的管理人管理费按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年6月3日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	190,617.39	12,399.17

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.08\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期无支付给关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期末未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金于本期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 6 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2016 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
平安银行	67,689.20	17,335.37	120,414,717.09	36,913.28

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于本期末未持有银行间市场债券正回购。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 31,600,000.00 元，于 2017 年 7 月 24 日(先后)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制订了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通

过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.1 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.1.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有短期信用评级的债券。

##### 6.4.13.1.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	437,415,000.00	411,350,000.00
AAA 以下	40,976,000.00	83,016,000.00
未评级	24,036,000.00	20,168,000.00
合计	502,427,000.00	514,534,000.00

注：以上按长期信用评级的债券投资未评级债券为政策性金融债。

##### 6.4.13.2 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.3 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.3.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 201 7年 6月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	67,689.20	-	-	-	-	-	67,689.20
结 算 备 付 金	174,966.64	-	-	-	-	-	174,966.64
交 易 性 金 融 资 产	-	20,026,000.00	279,253,000.00	87,889,000.00	115,259,000.00	-	502,427,000.00
应 收	-	-	-	-	-	500,000.00	500,000.00

证 券 清 算 款							
应 收 利 息	-	-	-	-	-	12,159,984.24	12,159,984.24
资 产 总 计	242,655.84	20,026,000.00	279,253,000.00	87,889,000.00	115,259,000.00	12,659,984.24	515,329,640.08
负 债							
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	31,600,000.00	-	-	-	-	-	31,600,000.00
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	0.98	0.98

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	118,288.83	118,288.83
应付托管费	-	-	-	-	-	31,543.71	31,543.71
应付交易费用	-	-	-	-	-	160.00	160.00
应付利息	-	-	-	-	-	13,569.16	13,569.16
其他负债	-	-	-	-	-	178,518.49	178,518.49
负债总计	31,600,000.00	-	-	-	-	342,081.17	31,942,081.17

计							
利率敏感程度缺口	-31,357,344.16	20,026,000.00	279,253,000.00	87,889,000.00	115,259,000.00	12,317,903.07	483,387,558.91
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,909,975.30	-	-	-	-	-	3,909,975.30
结算备付金	736,834.06	-	-	-	-	-	736,834.06



存出保证金	14,631.12	-	-	-	-	-	14,631.12
交易性金融资产	33,408,000.00	-	266,132,000.00	96,296,000.00	118,698,000.00	-	514,534,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	9,920,673.29	9,920,673.29
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	38,069,440.48	-	266,132,000.00	96,296,000.00	118,698,000.00	9,920,673.29	529,116,113.77
负债							
卖出回	47,000,000.00	-	-	-	-	-	47,000,000.00

购 金 融 资 产 款							
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	389.96	389.96
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	122,587.86	122,587.86
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	32,690.11	32,690.11
应 付 利 息	-	-	-	-	-	38,580.35	38,580.35
其 他	-	-	-	-	-	110,000.00	110,000.00

负 债							
负 债 总 计	47,000,000.00	-	-	-	-	304,248.28	47,304,248.28
利 率 敏 感 度 缺 口	-8,930,559.52	-	266,132,000.00	96,296,000.00	118,698,000.00	9,616,425.01	481,811,865.49

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

**6.4.13.3.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	3,020,675.94	3,562,209.51
	市场利率上升 25 个基点	-2,978,439.04	-3,513,064.92

**6.4.13.3.2 外汇风险**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.3.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中债券占基金资产的不低于 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.3.3.1 其他价格风险敞口

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类资产。

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 8 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	502,427,000.00	97.50
	其中：债券	502,427,000.00	97.50
	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	242,655.84	0.05
7	其他各项资产	12,659,984.24	2.46
8	合计	515,329,640.08	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内无港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	24,036,000.00	4.97
	其中：政策性金融债	24,036,000.00	4.97
4	企业债券	393,927,000.00	81.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	84,464,000.00	17.47
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	502,427,000.00	103.94

## 7.6 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

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	101456005	14 粤铁建 MTN001	400,000	42,436,000.00	8.78
2	1382212	13 鄂交投 MTN1	400,000	42,028,000.00	8.69
3	078035	07 江西高速 债	400,000	41,980,000.00	8.68
4	112123	12 中山 01	400,000	40,976,000.00	8.48
5	078081	07 广汽债	400,000	40,540,000.00	8.39

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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

本基金本报告期无贵金属投资。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

#### 7.10.3 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。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

基金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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.11.2

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	12,159,984.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,659,984.24

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有转股期的可转债券。

### 7.11.5 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。

### 7.11.6 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

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
210	2,331,259.44	489,439,119.76	99.97%	125,362.70	0.03%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	177.04	0.0000%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年6月3日）基金份额总额	210,067,616.31
本报告期期初基金份额总额	489,556,004.79
本报告期基金总申购份额	68,692.64
减：本报告期基金总赎回份额	60,214.97
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	489,564,482.46

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第三十八次会议审议通过，由付强先生任职公司副总经理，任职日期为 2017 年 1 月 20 日。

2、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由李兆良先生、李娟娟女士、刘雪生先生、潘汉腾先生接替曹勇先生、刘茂山先生、郑学定先生、黄士林先生任职公司第三届董事会董事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

3、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由巢傲文先生、李峥女士接替张云平、毛晴峰先生为第三届监事会监事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
英大证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-

东北证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
英大证券	-	-	15,000,000.00	5.01%	-	-

银河证券	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	222,100,000.00	74.23%	-
中信建投	-	-	9,800,000.00	3.28%	-
中泰证券	-	-	15,000,000.00	5.01%	-
联讯证券	-	-	35,200,000.00	11.76%	-
平安证券	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	2,100,000.00	0.70%	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）及摘要 2016 年第 1 期	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 16 日
2	平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 19 日
3	平安大华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 1 月 23 日
4	平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金 2016 年年度报告及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 3 月 30 日
5	平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017 年 4 月 24 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	489,439,119.76	0.00	0.00	489,439,119.76	99.97
产品特有风险							
流动性风险							



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金的文件；
- 2、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金基金合同；
- 3、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金托管协议；
- 4、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安大华基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>。

平安大华基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日