

中國平安精選人民幣債券基金

(中國平安精選投資基金系列之子基金)

中期財務報告（未經審計）

2011年4月28日（成立日）至2011年12月30日期間

中国平安 PINGAN

保險 · 銀行 · 投資

基金經理



中国平安资产管理(香港)
PING AN OF CHINA ASSET MANAGEMENT (HONG KONG)

中國平安精選人民幣債券基金
中期財務報告（未經審計）
2011年4月28日（成立日）至2011年12月30日期間

目錄

	頁數
管理及行政	3
財務狀況報表（未經審計）	4
綜合收益表（未經審計）	5
權益變動表（未經審計）	6
投資組合（未經審核）	7
投資組合的持股變動（未經審核）	10
業績表	11
派息披露	12

重要:

欲瞭解更多有關基金的資料，請參閱基金說明書。基金說明書可於我們的網站下載：

<http://asset.pingan.com.hk>

投資者不應依賴此報告中所載的資料而作出投資決定。

中國平安精選人民幣債券基金 管理及行政

基金經理

中國平安資產管理(香港)有限公司
香港
干諾道中 8 號
遮打大廈 11 樓 1106-1110 室

基金經理的董事

王利平女士	陳德賢先生
羅世禮先生	本睿先生
姚軍先生	童愷先生
姚波先生	萬放先生
蔡方方女士	余文傑女士
麥偉林先生	

受託人及過戶登記處

中銀國際英國保誠信託有限公司
香港
銅鑼灣威菲路道 18 號
萬國寶通中心 12 樓及 25 樓

託管人

中國銀行(香港)有限公司
香港
花園道 1 號
中銀大廈 14 樓

基金經理律師

的近律師行
香港
中環遮打道 18 號
歷山大廈 5 樓

核數師

安永會計師事務所
香港
中環金融街 8 號
國際金融中心 2 期 18 樓

中國平安精選人民幣債券基金
 財務狀況報表（未經審計）
 截至 2011 年 12 月 30 日

	人民幣
資產	
透過損益賬以公平值列賬之金融資產	1,324,513,727
現金及現金等價物	297,234,799
銀行存款以及債券的應收利息	12,367,142
預付費用以及其它應收款	7,609
應收認購資金	1,125,681
提前支付	-
資產合計	<u><u>1,635,248,958</u></u>
負債	
應付贖回資金	209,973
應付管理費	1,329,271
應付受託費	232,622
對單位持有人的應付分派	17,027,827
應付費用以及其它應付款	149,137
負債合計	<u><u>18,948,830</u></u>
權益	
股本	1,682,136,793
未分配利潤	(65,836,665)
權益合計	<u><u>1,616,300,128</u></u>
已發行的單位數目	<u><u>16,983,585.7500</u></u>
每單位之資產淨值	<u><u>95.16</u></u>

中國平安精選人民幣債券基金
 綜合收益表（未經審計）
 2011年4月28日（成立日）至2011年12月30日期間

	人民幣
收入	
透過損益帳以公平值列賬之金融資產之利息收入	22,237,185
銀行存款的利息收入	1,303,401
透過損益帳以公平值列賬之金融資產之淨虧損/收益	(61,938,823)
外匯損/益淨額	-
	<u>(38,398,237)</u>
費用	
管理費	(7,745,631)
受託人費用	(1,355,485)
法律以及專業費用	-
許可費	(9,989)
託管費	(123,595)
核數師薪酬	(135,848)
初始費用	(852,362)
出版費用	(6,786)
經紀費以及其它交易成本	(71,950)
其他費用	(108,955)
	<u>(10,410,601)</u>
期內的利潤以及綜合收益合計	<u>(48,808,838)</u>

中國平安精選人民幣債券基金
 權益變動表（未經審計）
 2011年4月28日（成立日）至2011年12月30日期間

	股本 人民幣	未分配利潤 人民幣	合計 人民幣
2011年4月28日（成立日）	-	-	-
認購單位	1,747,837,346	-	1,747,837,346
贖回單位	(65,700,553)	-	(65,700,553)
股息分派	-	(17,027,827)	(17,027,827)
期內綜合收益合計	-	(48,808,838)	(48,808,838)
截至2011年12月30日	<u>1,682,136,793</u>	<u>(65,836,665)</u>	<u>1,616,300,128</u>

中國平安精選人民幣債券基金
 投資組合（未經審核）
 截至 2011 年 12 月 30 日

	面值	市場價值 人民幣	資產 淨值 %
定息證券			
百慕達			
BEIJING ENTERPRISES WATER 3.75% S/A 30JUN2014 SER HK	47,000,000	46,921,510	2.90
BEIJING ENTERPRISES WATER 5% S/A 30JUN2016 SER HK	30,000,000	29,550,000	1.83
CHINA WINDPOWER 6.375% S/A 04APR2014 SER HK	34,230,000	29,266,650	1.81
GENTING HONG KONG LTD 3.95% S/A 30JUN2014 SER HK	40,000,000	38,800,000	2.40
SILVERY CASTLE LTD 2.75% S/A 14JUL2014 SER HK	50,000,000	48,500,000	3.00
開曼群島			
ANSTOCK LTD 4.25% S/A 20SEP2016 REGS	34,000,000	33,490,000	2.07
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP LTD 6.5% S/A 22JUL2014	57,450,000	55,340,436	3.42
GLOBAL BIO-CHEM 7% S/A 16MAY2014 SER HK	23,000,000	19,435,000	1.20
INTIME DEPARTMENT STORE 4.65% S/A 21JUL2014 SER HK	62,000,000	59,520,000	3.68
MELCO CROWN ENTERTAINMENT LTD 3.75% S/A 09MAY2013 SER HK	25,000,000	24,125,000	1.49
NEW FOCUS AUTO TECH HLDGS LTD 3.75% S/A 17AUG2013	6,000,000	5,906,796	0.37
PCD STORES GROUP LTD 5.25% S/A 01FEB2014 SER HK	51,000,000	48,883,500	3.02
ZHONGSHENG GROUP 4.75% S/A 21APR2014 SER HK	66,000,000	57,373,140	3.55
中國			
BAOSTEEL GROUP CORP LTD 3.5% S/A 01DEC2014 REGS	43,000,000	42,892,500	2.65
BAOSTEEL GROUP CORP LTD 4.375% S/A 01DEC2016 REGS	6,000,000	6,045,000	0.37
CHINA GOVT BOND 1.94% S/A 18AUG2018 REGS	20,000,000	19,282,000	1.19
EASTERN AIR OVERSEAS HK CORP LTD 4% S/A 08AUG2014	15,300,000	15,289,137	0.95

中國平安精選人民幣債券基金
投資組合（未經審核）（續）
截至 2011 年 12 月 30 日

法國

AIR LIQUIDE FINANCE 3% S/A 19SEP2016	36,000,000	35,010,000	2.17
--------------------------------------	------------	------------	------

德國

BSH BOSCH UND SIEMENS HAUSGERATE 3.375% S/A 28SEP2016 REGS	48,000,000	47,280,000	2.93
---	------------	------------	------

香港

BYD CO LTD/HK 4.5% S/A 28APR2014 SER HK	47,000,000	35,463,380	2.19
CHENMING HK 2.95% S/A 13APR2014 SER HK	43,000,000	41,710,000	2.58
CHINA RESOURCES POWER 3.75% S/A 12NOV15 SER HKB	19,000,000	19,000,000	1.18
FAR EAST HORIZON LTD 3.9% S/A 03JUN2014 SER HK	52,000,000	48,629,880	3.01
HKCG FINANCE 1.4% S/A 11APR2016 SER HK	8,000,000	7,368,800	0.46
ICBC ASIA LTD 6% S/A 04NOV2021	35,000,000	35,875,000	2.22
SINGAMAS CONTAIN 4.75% S/A 14APR2014 SER HK	61,000,000	54,893,290	3.40
SINOTRUK HONG KONG LTD 2.95% S/A 29OCT2012 SER HK	32,000,000	31,913,600	1.97
UA FINANCE BVI 4% S/A 28APR2014 SER HK	31,000,000	29,140,000	1.80

日本

ORIX CORP 2% S/A 24MAR2014 SER HK	23,500,000	22,442,500	1.39
ORIX CORP 4% S/A 29NOV2014	21,800,000	21,647,400	1.34
SUMITOMO MITSUI FINANCE & LEASING 3% S/A 12SEP2014	20,000,000	19,834,280	1.23

盧森堡

VTB BANK (VTB CAPITAL SA) 2.95% S/A 23DEC2013 SER HK	29,400,000	28,402,752	1.76
---	------------	------------	------

荷蘭

VOLKSWAGEN INTL FIN 2.15% S/A 23MAY2016 SER HK	16,000,000	15,440,000	0.96
---	------------	------------	------

中國平安精選人民幣債券基金
投資組合（未經審核）（續）
截至 2011 年 12 月 30 日

新加坡

GLOBAL LOGISTIC 3.375% S/A 11MAY2016 SER HK	46,000,000	45,080,000	2.79
---	------------	------------	------

超國家

ASIAN DEV BANK 2.85% S/A 21OCT2020	5,000,000	5,125,000	0.32
------------------------------------	-----------	-----------	------

美國

CATERPILLAR FIN 1.35% S/A 12JUL2013 SER HK	30,000,000	29,550,000	1.83
--	------------	------------	------

英屬處女島

CNPC GOLDEN AUTUMN LTD 2.55% S/A 26OCT2013 REGS	10,000,000	9,995,000	0.62
--	------------	-----------	------

OCT TRAVEL INVESTMENT LTD 3.5% S/A 25MAY2014 SER HK	25,700,000	24,672,000	1.53
--	------------	------------	------

RAINBOW DAYS LTD 3% S/A 30JUN2016 SER HK	35,000,000	32,418,750	2.01
--	------------	------------	------

RIGHT CENTURY 1.85% S/A 03JUN2014	46,000,000	43,843,520	2.71
-----------------------------------	------------	------------	------

ROAD KING INFRASTRUCTURE FINANCE 2011 LTD 6% S/A 25FEB2014 SER HK	44,300,000	37,164,156	2.30
--	------------	------------	------

SINOCHEM OFFS 1.8% S/A 18JAN2014 SER HK	23,000,000	21,993,750	1.36
---	------------	------------	------

總投資		1,324,513,727	81.96
-----	--	---------------	-------

其他資產淨值		<u>291,786,401</u>	<u>18.04</u>
--------	--	--------------------	--------------

截至 2011 年 12 月 30 日的資產淨值		<u><u>1,616,300,128</u></u>	<u>100.00</u>
--------------------------	--	-----------------------------	---------------

總投資成本		<u><u>1,386,683,939</u></u>	
-------	--	-----------------------------	--

中國平安精選人民幣債券基金
 投資組合的持股變動（未經審核）
 2011年4月28日（成立日）至2011年12月30日期間

上市/報價投資

	2011年12月30日	2011年4月28日 (成立日)
	%	%
定息證券		
百慕達	11.94	-
開曼群島	18.80	-
中國	5.16	-
法國	2.17	-
德國	2.93	-
香港	18.81	-
日本	3.96	-
盧森堡	1.76	-
荷蘭	0.96	-
新加坡	2.79	-
超國家	0.32	-
美國	1.83	-
英屬處女島	10.53	-
總投資	81.96	-
其他資產淨值	18.04	100.00
截至2011年12月30日的資產淨值	100.00	100.00

中國平安精選人民幣債券基金

業績表

2011年4月28日（成立日）至2011年12月30日期間

	基金資產淨值		每單位資產淨值	
財政年度結束 2011年12月30日	人民幣	1,616,300,128	人民幣	95.16

	最高 每單位資產淨值		最低 每單位資產淨值	
財政年度結束 2011年12月30日	人民幣	100.00	人民幣	94.98

中國平安精選人民幣債券基金
派息披露
2011年派息記錄

除淨日	分派日	每單位派息		總派息	
2011年12月15日	2012年1月9日	人民幣	1.0	人民幣	17,027,827