

平安添利债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 20 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 2021 年 01 月 19 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 2020 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安添利债券	
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	
报告期末基金份额总额	8,336,232,535.82 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，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	平安添利债券 A	平安添利债券 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	7,373,434,302.06 份	962,798,233.76 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（2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日）	
	平安添利债券 A	平安添利债券 C
1. 本期已实现收益	59,504,001.67	8,859,350.84
2. 本期利润	55,838,051.79	7,303,800.00
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0094	0.0071
4. 期末基金资产净值	8,572,658,557.76	1,081,244,711.31
5. 期末基金份额净值	1.1626	1.1230

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 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	0.84%	0.04%	1.31%	0.05%	-0.47%	-0.01%
过去六个月	0.95%	0.06%	0.52%	0.07%	0.43%	-0.01%
过去一年	2.79%	0.08%	3.05%	0.10%	-0.26%	-0.02%
过去三年	15.42%	0.05%	17.72%	0.08%	-2.30%	-0.03%
过去五年	17.09%	0.08%	19.67%	0.08%	-2.58%	0.00%
自基金合同生效起至今	61.93%	0.25%	42.98%	0.08%	18.95%	0.17%

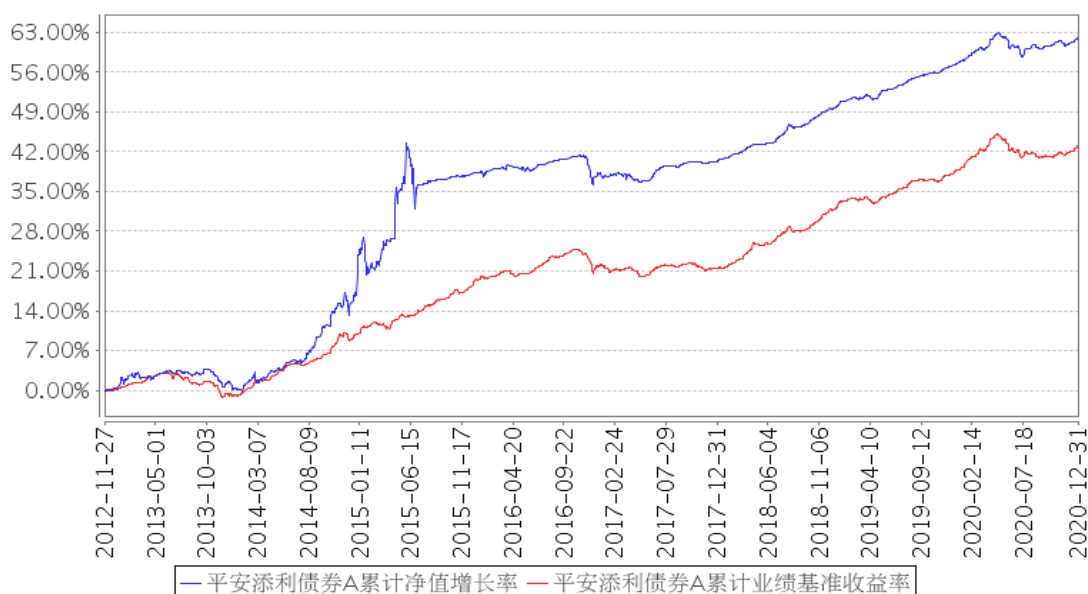
平安添利债券 C

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	0.74%	0.04%	1.31%	0.05%	-0.57%	-0.01%
过去六个月	0.75%	0.06%	0.52%	0.07%	0.23%	-0.01%

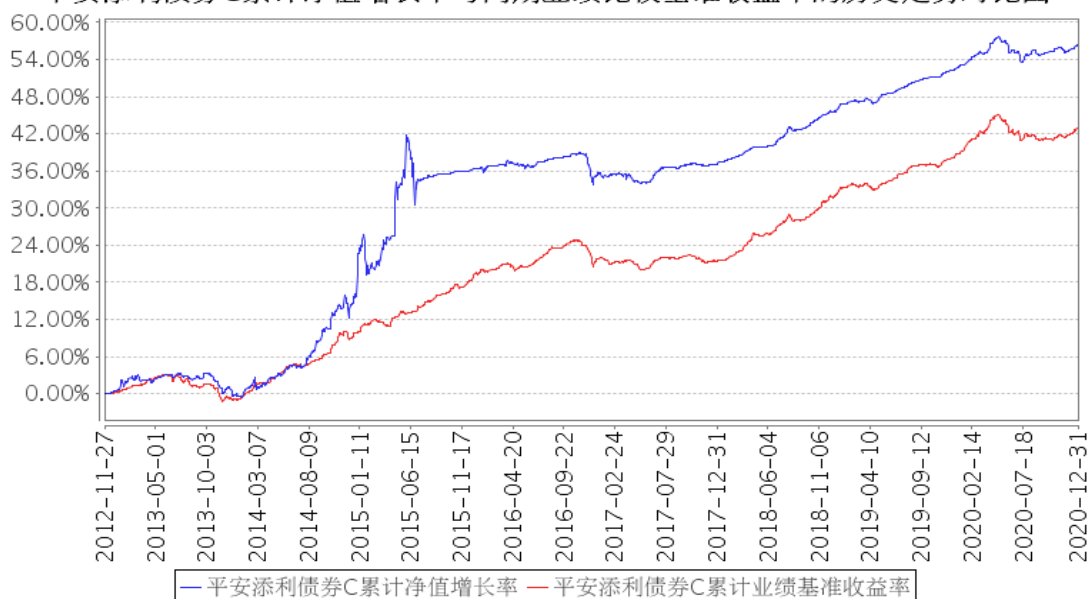
过去一年	2.38%	0.08%	3.05%	0.10%	-0.67%	-0.02%
过去三年	14.01%	0.06%	17.72%	0.08%	-3.71%	-0.02%
过去五年	14.60%	0.08%	19.67%	0.08%	-5.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	56.31%	0.25%	42.98%	0.08%	13.33%	0.17%

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

平安添利债券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



注：1、本基金基金合同于 2012 年 11 月 27 日正式生效；

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基金合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 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		
张文平	固定收益投资中心投资执行总经理，平安添利债券型证券投资基金基金经理	2020年8月20日	-	9年	张文平先生，南京大学硕士。先后担任毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。2018年3月加入平安基金管理有限公司，现任固定收益投资中心投资执行总经理。同时担任平安短债债券型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安如意中短债债券型证券投资基金、平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金、平安5-10年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安惠享纯债债券型证券投资基金、平安合庆1年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安双债添益债券型证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，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，本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 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运作分析

四季度，经济延续修复的步伐，但是复苏速率逐步放缓。此外，四季度发生了超预期的信用违约风波，在此背景下，央行的货币政策总体宽松，呵护市场。在此背景下，债市收益率震荡下行，长端受制于经济复苏下行幅度相对有限，但中短端下行明显。报告期内，本基金的投资操作相对稳健，根据市场情况动态调整杠杆、久期水平，同时积极寻找一二级市场错误定价的投资机会，在兼顾安全性、流动性和收益性的情况下，本基金净值有所增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安添利债券 A 的基金份额净值为 1.1626 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.84%，截至本报告期末平安添利债券 C 的基金份额净值为 1.1230 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.74%，同期业绩比较基准收益率为 1.31%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 5,000 万元的情形。

§ 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,467,291,282.90	94.87
	其中：债券	12,419,191,282.90	94.50
	资产支持证券	48,100,000.00	0.37
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	445,341,988.02	3.39
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	57,321,280.79	0.44
8	其他资产	171,601,357.88	1.31
9	合计	13,141,555,909.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

注：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	150,780,000.00	1.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	756,989,500.00	7.84
	其中：政策性金融债	496,548,500.00	5.14
4	企业债券	2,813,261,782.90	29.14
5	企业短期融资券	265,748,000.00	2.75
6	中期票据	8,431,406,800.00	87.34
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	1,005,200.00	0.01
10	合计	12,419,191,282.90	128.64

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	160316	16 进出 16	3,000,000	301,830,000.00	3.13
2	101801568	18 大唐集 MTN003	2,800,000	282,996,000.00	2.93
3	102002315	20 中电投 MTN024	2,500,000	251,225,000.00	2.60
4	102002268	20 广州城投 MTN003	2,000,000	202,140,000.00	2.09
5	102002158	20 中电投 MTN020	2,000,000	201,300,000.00	2.09

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值 比例（%）
1	138473	南链优 05	150,000	15,000,000.00	0.16
2	138466	20 华弘 1A	130,000	13,000,000.00	0.13
3	138472	集顺优 11	95,000	9,500,000.00	0.10
4	138457	鹏程 3A1	40,000	4,000,000.00	0.04
5	165867	威新 05 优	40,000	4,000,000.00	0.04
6	138465	联易融 19	26,000	2,600,000.00	0.03

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

注：本基金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

注：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

注：本基金本报告期无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

中国银行保险监督管理委员会上海监管局于 2020 年 8 月 10 日做出沪银保监银罚决字(2020)12 号处罚决定, 由于上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“公司”): 1. 未按专营部门制规定开展同业业务; 2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目; 3. 延迟支付同业投资资金吸收存款; 4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保; 5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制; 6. 个人消费贷款贷后管理未尽职; 7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模; 8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职; 9. 办理无真实贸易背景的贴现业务; 10. 委托贷款资金来源审查未尽职; 11. 未按权限和程序办理委托贷款业务; 12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务。根据相关规定对公司罚款 2100 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析, 认为该事项有利于公司规范开展业务, 对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程, 符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内, 本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	195,653.32
2	应收证券清算款	95,846.85
3	应收股利	-
4	应收利息	170,235,350.60
5	应收申购款	1,074,507.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	171,601,357.88

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: 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

注: 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	平安添利债券 A	平安添利债券 C
报告期期初基金份额总额	3,180,919,702.31	478,931,042.23
报告期期间基金总申购份额	5,507,161,765.27	984,316,965.96
减：报告期期间基金总赎回份额	1,314,647,165.52	500,449,774.43
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	7,373,434,302.06	962,798,233.76

§ 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

注：无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准平安添利债券型证券投资基金募集的文件
- (2) 平安添利债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安添利债券型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

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基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 1 月 20 日