

平安双债添益债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安双债添益债券	
基金主代码	005750	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 4 日	
报告期末基金份额总额	3,193,927,698.62 份	
投资目标	本基金通过对可转债和信用债的积极投资，在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金将密切关注经济运行趋势，把握领先指标，预测未来走势，深入分析国家推行的财政与货币政策对未来宏观经济运行以及投资环境的影响。本基金将根据宏观经济、基准利率水平，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，做出最佳的资产配置及风险控制。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%	
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，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，低于混合型基金、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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安双债添益债券 A	平安双债添益债券 C
下属分级基金的交易代码	005750	005751
报告期末下属分级基金的份额总额	2,719,530,103.05 份	474,397,595.57 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）	
	平安双债添益债券 A	平安双债添益债券 C
1. 本期已实现收益	41,129,538.86	8,384,860.64
2. 本期利润	27,131,540.88	7,164,384.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0169	0.0215
4. 期末基金资产净值	3,642,600,259.36	627,097,012.39
5. 期末基金份额净值	1.3394	1.3219

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

平安双债添益债券 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	3.11%	0.30%	4.05%	0.34%	-0.94%	-0.04%
过去六个月	6.67%	0.26%	7.01%	0.27%	-0.34%	-0.01%
过去一年	12.19%	0.36%	9.36%	0.28%	2.83%	0.08%
过去三年	31.55%	0.34%	28.92%	0.33%	2.63%	0.01%
自基金合同生效起至今	33.94%	0.32%	30.02%	0.33%	3.92%	-0.01%

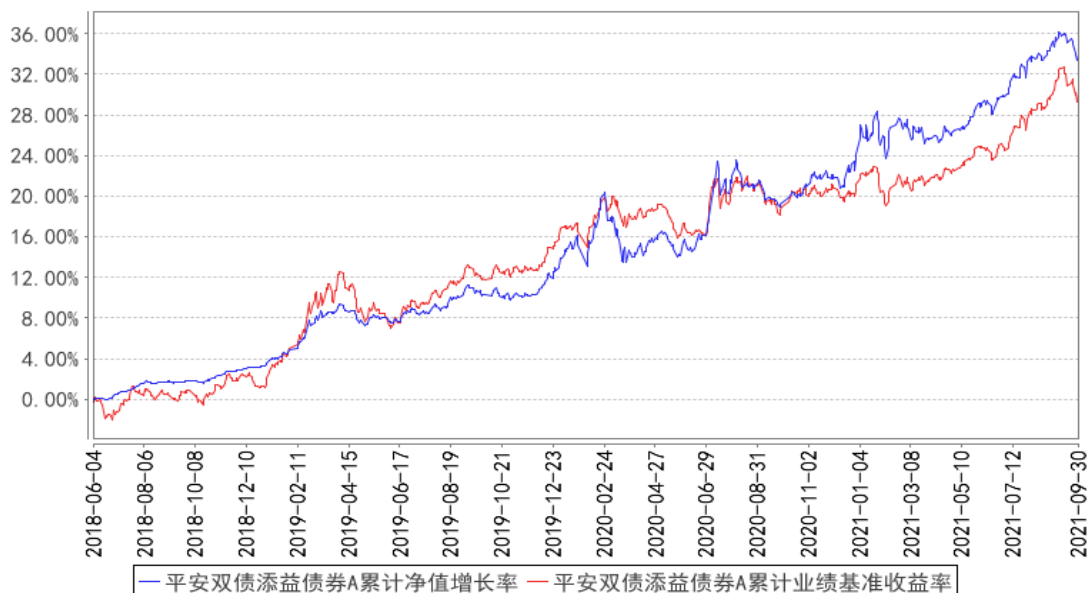
平安双债添益债券 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

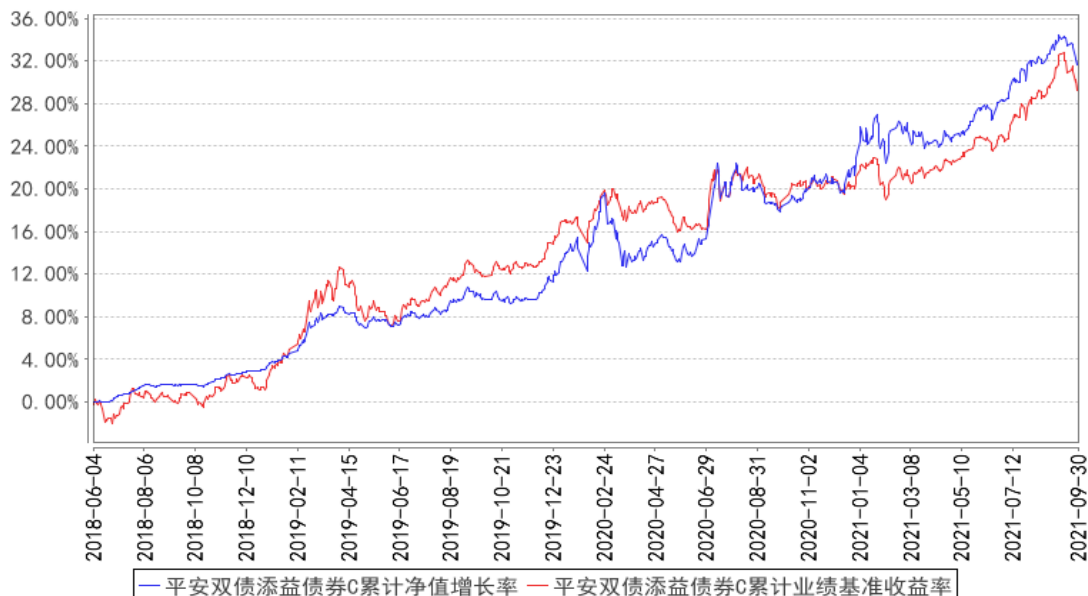
过去三个月	3.01%	0.30%	4.05%	0.34%	-1.04%	-0.04%
过去六个月	6.46%	0.26%	7.01%	0.27%	-0.55%	-0.01%
过去一年	11.75%	0.36%	9.36%	0.28%	2.39%	0.08%
过去三年	29.99%	0.34%	28.92%	0.33%	1.07%	0.01%
自基金合同生效起至今	32.19%	0.32%	30.02%	0.33%	2.17%	-0.01%

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

平安双债添益债券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



平安双债添益债券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 2018 年 06 月 04 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	公司总经理助理兼固定收益投资总监，平安双债添益债券型证券投资基金基金经理	2020 年 8 月 20 日	-	10 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，现任公司总经理助理兼固定收益投资总监。同时担任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、平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金、平安恒鑫混合型证券投资基金、平安双季增享 6 个月持有期债券型证券投资基金、平安惠铭纯债债券型证券投资基金、平安惠澜纯债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》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

三季度，受制于地产调整政策和上游资源品大幅上涨带来的工业生产颓势，经济增长边际有所弱化。疫情有所反复，新冠病毒的新疗法发挥作用尚需时日。通胀方面，碳中和带来的供给压缩使得大宗商品价格一路上行，推动 PPI 快速上行；猪肉价格作为国内通胀“压舱石”，维持 CPI 处于低位。货币政策方面，虽然进行了一次降准，但是总体仍是稳字当头。债券收益率先下后上。受监管政策影响，商业银行永续债和二级债品种调整幅度较大。策略上，报告期内本产品以赚取票息和套息收益为主，同时，动态调整组合久期和杠杆，适当进行波段交易以增厚组合收益。转债方面，本产品以绝对收益思路为主，通过挖掘结构性机会，实现了收益率增强。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安双债添益债券 A 的基金份额净值 1.3394 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.11%，同期业绩比较基准收益率为 4.05%；截至本报告期末平安双债添益债券 C 的基金份额净值 1.3219 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.01%，同期业绩比较基准收益率为 4.05%。

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低于 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	5,120,912,497.89	97.18
	其中：债券	5,120,912,497.89	97.18
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	60,536,530.81	1.15
	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	29,283,680.94	0.56
8	其他资产	58,550,917.55	1.11
9	合计	5,269,283,627.19	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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	172,249,899.20	4.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	183,013,100.00	4.29
	其中：政策性金融债	80,147,000.00	1.88
4	企业债券	970,404,800.00	22.73
5	企业短期融资券	1,235,991,000.00	28.95
6	中期票据	1,713,646,000.00	40.14

7	可转债（可交换债）	536,500,698.69	12.57
8	同业存单	-	-
9	其他	309,107,000.00	7.24
10	合计	5,120,912,497.89	119.94

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	149639	21 金街 05	1,600,000	159,488,000.00	3.74
2	012102258	21 南电 SCP010	1,500,000	150,270,000.00	3.52
3	184004	21 空港债	1,400,000	138,992,000.00	3.26
4	019649	21 国债 01	1,351,240	135,232,099.20	3.17
5	102101856	21 郑州经开 MTN001	1,300,000	130,039,000.00	3.05

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

注：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

注：本基金报告期末未持有贵金属投资。

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：本基金本报告期末未持有权证投资。

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

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	125,289.38
2	应收证券清算款	534,220.16
3	应收股利	-
4	应收利息	37,837,136.77
5	应收申购款	20,054,271.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,550,917.55

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113009	广汽转债	77,602,615.00	1.82
2	127018	本钢转债	29,205,894.24	0.68
3	118000	嘉元转债	20,376,655.00	0.48
4	127030	盛虹转债	19,833,743.64	0.46
5	113549	白电转债	19,508,280.00	0.46
6	128141	旺能转债	18,785,960.16	0.44
7	113568	新春转债	18,549,960.00	0.43
8	113025	明泰转债	16,043,866.90	0.38
9	110041	蒙电转债	15,584,994.00	0.37
10	123060	苏试转债	15,295,628.70	0.36
11	128018	时达转债	13,460,700.96	0.32
12	113550	常汽转债	13,436,077.20	0.31
13	128097	奥佳转债	12,361,540.80	0.29
14	128096	奥瑞转债	11,901,644.64	0.28
15	128101	联创转债	11,265,793.20	0.26
16	132007	16 凤凰 EB	11,178,058.50	0.26
17	127012	招路转债	10,882,697.50	0.25
18	128109	楚江转债	10,304,004.20	0.24
19	113044	大秦转债	9,756,379.20	0.23
20	123050	聚飞转债	9,385,842.60	0.22

21	113528	长城转债	8,899,827.20	0.21
22	110072	广汇转债	8,856,695.00	0.21
23	123035	利德转债	8,642,332.20	0.20
24	123070	鹏辉转债	8,298,120.10	0.19
25	113527	维格转债	8,135,297.80	0.19
26	110055	伊力转债	8,044,161.20	0.19
27	128081	海亮转债	8,036,240.00	0.19
28	110077	洪城转债	7,981,241.40	0.19
29	128095	恩捷转债	7,678,339.20	0.18
30	128113	比音转债	7,466,237.45	0.17
31	123071	天能转债	7,297,203.00	0.17
32	123022	长信转债	7,147,692.90	0.17
33	110045	海澜转债	6,316,974.40	0.15
34	113537	文灿转债	4,060,572.00	0.10
35	113504	艾华转债	3,825,778.50	0.09
36	113577	春秋转债	3,450,838.50	0.08
37	128140	润建转债	1,778,722.00	0.04
38	123085	万顺转 2	1,512,143.60	0.04
39	123025	精测转债	1,460,495.00	0.03
40	123078	飞凯转债	1,240,554.60	0.03
41	123100	朗科转债	1,107,510.65	0.03

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	平安双债添益债券 A	平安双债添益债券 C
报告期期初基金份额总额	756,318,737.02	208,182,880.29
报告期期间基金总申购份额	2,514,690,104.77	438,810,868.29
减：报告期期间基金总赎回份额	551,478,738.74	172,596,153.01
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	2,719,530,103.05	474,397,595.57

§ 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

根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》和相关基金基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对本基金就引入侧袋机制事宜修订基金合同、托管协议等法律文件。修订自 2021 年 7 月 23 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 7 月 23 日发布的《平安基金管理有限公司关于公司旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修改基金合同部分条款的公告》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安双债添益债券型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安双债添益债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安双债添益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 10 月 26 日