

# 平安双债添益债券型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 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：2022 年 7 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 07 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 2022 年 04 月 01 日起至 06 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	3,799,838,033.85 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	3,517,666,374.89 份	282,171,658.96 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（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 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	-9,028,243.70	-1,475,701.93
2. 本期利润	155,822,804.50	11,695,489.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0419	0.0374
4. 期末基金资产净值	4,769,773,229.62	376,478,473.52
5. 期末基金份额净值	1.3559	1.3342

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	3.29%	0.32%	2.87%	0.29%	0.42%	0.03%
过去六个月	-0.70%	0.35%	-1.09%	0.38%	0.39%	-0.03%
过去一年	4.38%	0.30%	7.18%	0.34%	-2.80%	-0.04%
过去三年	24.86%	0.36%	22.78%	0.32%	2.08%	0.04%
自基金合同生效起至今	35.59%	0.32%	33.93%	0.33%	1.66%	-0.01%

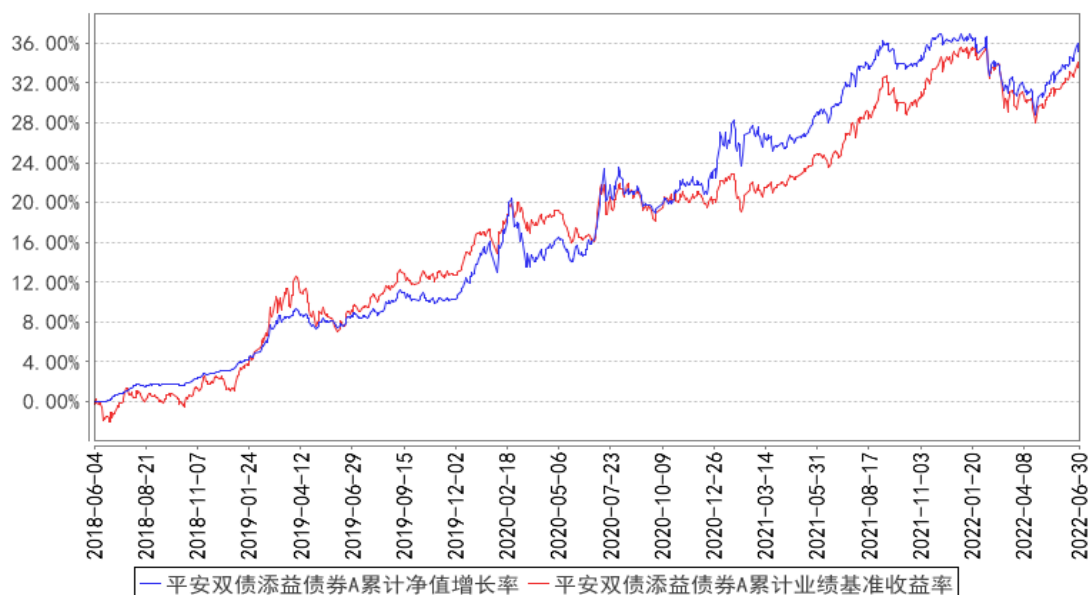
平安双债添益债券 C

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

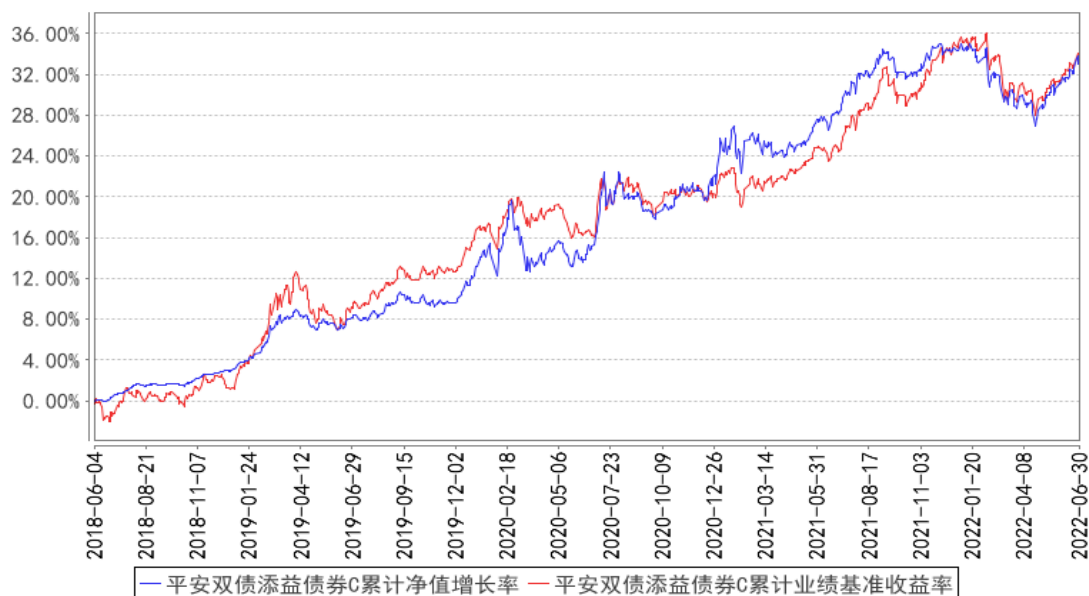
过去三个月	3.19%	0.32%	2.87%	0.29%	0.32%	0.03%
过去六个月	-0.90%	0.35%	-1.09%	0.38%	0.19%	-0.03%
过去一年	3.97%	0.30%	7.18%	0.34%	-3.21%	-0.04%
过去三年	23.39%	0.36%	22.78%	0.32%	0.61%	0.04%
自基金合同生效起至今	33.42%	0.32%	33.93%	0.33%	-0.51%	-0.01%

### 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。

## § 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		
曾小丽	平安双债添益债券型证券投资基金基金经理	2022 年 1 月 26 日	-	10 年	曾小丽女士，中国人民大学世界经济专业硕士，曾先后担任大公国际资信评估有限公司信用评审委员、信用分析师、光大保德信基金管理有限公司基金经理兼固收研究团队联席团队长。2021 年 8 月加入平安基金管理有限公司，现任平安鼎信债券型证券投资基金、平安鼎弘混合型证券投资基金（LOF）、平安 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安双债添益债券型证券投资基金、平安合享 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基金经理。
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	2022 年 4 月 27 日	11 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、平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金、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、平安双季盈 6 个月持有期债券型证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、平安鑫享混合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

二季度受疫情影响，经济下行压力加大，债券市场收益率整体呈区间震荡走势，短端表现好于中长端。具体来看，4 月利率债期限结构走陡，短端下行，长端上行；信用债利率下降较快。当月央行虽未降低公开市场操作利率，但资金利率中枢明显下移，月度均值大幅低于此前各月，在隔夜市场表现尤为显著。5 月因为票据利率再度走低，PMI 数据不佳，资金面持续宽松，债券配置需求旺盛，从信用到利率，均表现为利率下行、市场走牛。6 月由于 PMI 数据超预期，上海疫情得到控制，美联储加息预期升温，权益市场持续走好等，利率整体以窄幅震荡为主，曲线略有扁平，信用利差有所走阔。

权益市场方面，4 月 A 股在上海疫情升级和人民币汇率快速贬值的双重打击下，所有行业和板块指数普跌，上证综指下探 2900 点下方，市场情绪降至冰点。随着 5 月疫情逐渐缓解，人民币

转为高位震荡，地产基建的政策开始加快落地，市场情绪开始修复，5-6 月股指连续反弹，上证指数重新回到 3400 点附近。整体看，二季度 Wind 全 A 上涨 5.10%，创业板指上涨 5.68%，沪深 300 上涨 6.21%，中证 500 上涨 2.04%；风格上来看，市值因子大盘风格略占优于中小盘；成长风格的表现强于价值风格。转债指数跟随权益市场波动，中证转债指数 4 月份下跌 1.4%，5 月和 6 月分别反弹 2.26%和 3.82%。

二季度本基金纯债部主要配置高等级信用债获取票息收益，同时阶段性通过长久期利率债提高久期获取资本利得收益。转债部分，一方面优选估值合理有成长性的优质个券，另一方面通过量化策略优选性价比较高的低价券进行配置。

#### 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 1.3559 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.29%，同期业绩比较基准收益率为 2.87%；截至本报告期末平安双债添益债券 C 的基金份额净值 1.3342 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.19%，同期业绩比较基准收益率为 2.87%。

#### 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	6,060,874,247.94	98.60
	其中：债券	6,060,874,247.94	98.60
	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	-	-
	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	41,330,343.15	0.67
8	其他资产	44,945,655.51	0.73
9	合计	6,147,150,246.60	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	5,095,746.58	0.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	429,300,191.77	8.34
	其中：政策性金融债	409,314,361.63	7.95
4	企业债券	490,396,997.28	9.53
5	企业短期融资券	30,385,208.77	0.59
6	中期票据	3,211,650,116.19	62.41
7	可转债（可交换债）	1,751,859,981.88	34.04
8	同业存单	-	-
9	其他	142,186,005.47	2.76
10	合计	6,060,874,247.94	117.77

### 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	102103030	21 江西交投 MTN008	2,000,000	205,449,786.30	3.99
2	102102086	21 大唐集 MTN005	1,500,000	155,722,791.78	3.03
3	210306	21 进出 06	1,500,000	152,810,958.90	2.97
4	210216	21 国开 16	1,400,000	142,263,972.60	2.76
5	102002053	20 鄂交投 MTN001	1,300,000	136,393,813.15	2.65

### 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

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 7 月 13 日作出银保监罚决字（2021）31 号决定，由于中国进出口银行违规经营，罚没 7345.6 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）9 号处罚决定，由于中国进出口银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，根据相关规定，对其处以罚款 420 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）8 号处罚决定，由于国家开发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差；五、未报送债券投资业务 EAST 数据；六、漏报权益类投资业务 EAST 数据；七、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；八、漏报保函业务 EAST 数据；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、漏报授信信息 EAST 数据；十三、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、EAST 系统《关联关系》表漏报；十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报；十七、理财产品登记不规范，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对国

家开发银行罚款 440 万元。

本基金管理人对上述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。我们对上述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	557,254.92
2	应收证券清算款	42,406,478.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,981,922.43
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	44,945,655.51

### 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	110043	无锡转债	37,373,734.87	0.73
2	113635	升 21 转债	35,524,158.16	0.69
3	123132	回盛转债	34,991,151.57	0.68
4	110053	苏银转债	33,291,337.24	0.65
5	123107	温氏转债	31,831,991.17	0.62
6	123114	三角转债	31,331,344.61	0.61
7	113049	长汽转债	30,488,144.44	0.59
8	128140	润建转债	30,294,252.12	0.59
9	110079	杭银转债	29,824,730.75	0.58
10	123105	拓尔转债	29,277,986.12	0.57
11	128120	联诚转债	28,324,856.80	0.55
12	113602	景 20 转债	28,041,309.32	0.54
13	110075	南航转债	26,977,367.25	0.52
14	113050	南银转债	26,830,996.79	0.52
15	113527	维格转债	26,726,943.84	0.52
16	128119	龙大转债	26,370,295.64	0.51

17	127005	长证转债	26,209,082.96	0.51
18	113598	法兰转债	25,627,768.73	0.50
19	127038	国微转债	25,396,337.10	0.49
20	128044	岭南转债	24,737,101.08	0.48
21	123103	震安转债	24,734,479.62	0.48
22	113629	泉峰转债	24,154,964.38	0.47
23	123022	长信转债	23,311,391.12	0.45
24	113025	明泰转债	23,169,243.11	0.45
25	113504	艾华转债	22,840,651.47	0.44
26	113565	宏辉转债	21,734,658.50	0.42
27	128095	恩捷转债	21,651,342.47	0.42
28	113013	国君转债	21,583,302.47	0.42
29	110038	济川转债	20,927,464.70	0.41
30	123060	苏试转债	20,547,028.11	0.40
31	123078	飞凯转债	20,453,804.76	0.40
32	123100	朗科转债	20,386,342.11	0.40
33	128087	孚日转债	20,365,538.28	0.40
34	128066	亚泰转债	20,118,976.15	0.39
35	128109	楚江转债	20,001,055.38	0.39
36	113620	傲农转债	19,872,136.99	0.39
37	110074	精达转债	19,721,402.60	0.38
38	118000	嘉元转债	19,694,966.03	0.38
39	123075	贝斯转债	19,392,217.44	0.38
40	118003	华兴转债	18,021,258.62	0.35
41	127045	牧原转债	17,328,160.92	0.34
42	113637	华翔转债	17,193,194.97	0.33
43	113546	迪贝转债	16,598,876.98	0.32
44	123121	帝尔转债	16,246,924.66	0.32
45	128034	江银转债	15,784,703.94	0.31
46	113033	利群转债	15,112,207.33	0.29
47	113017	吉视转债	14,894,295.89	0.29
48	128075	远东转债	14,752,306.85	0.29
49	127040	国泰转债	13,905,271.48	0.27
50	113030	东风转债	13,301,661.04	0.26
51	110064	建工转债	13,265,728.77	0.26
52	123059	银信转债	11,889,971.92	0.23
53	127047	帝欧转债	11,634,193.37	0.23
54	127016	鲁泰转债	11,026,043.85	0.21
55	113524	奇精转债	10,944,807.77	0.21
56	123131	奥飞转债	10,916,498.06	0.21
57	128106	华统转债	10,852,584.93	0.21
58	110056	亨通转债	10,557,753.42	0.21

59	113530	大丰转债	10,528,705.48	0.20
60	128076	金轮转债	10,327,883.36	0.20
61	128111	中矿转债	10,230,991.23	0.20
62	123070	鹏辉转债	10,135,330.38	0.20
63	118001	金博转债	9,925,243.51	0.19
64	128132	交建转债	9,410,373.15	0.18
65	128017	金禾转债	9,171,024.66	0.18
66	123071	天能转债	9,107,756.10	0.18
67	127043	川恒转债	8,697,158.90	0.17
68	110048	福能转债	8,672,205.24	0.17
69	128135	洽洽转债	8,150,144.43	0.16
70	123080	海波转债	7,849,571.29	0.15
71	128023	亚太转债	7,530,272.88	0.15
72	113566	翔港转债	7,470,210.41	0.15
73	128139	祥鑫转债	6,841,439.73	0.13
74	113626	伯特转债	6,659,155.66	0.13
75	128081	海亮转债	6,651,738.33	0.13
76	110052	贵广转债	6,446,202.96	0.13
77	128042	凯中转债	6,177,732.88	0.12
78	127031	洋丰转债	5,939,944.00	0.12
79	127049	希望转 2	5,890,606.73	0.11
80	127020	中金转债	5,828,398.32	0.11
81	113596	城地转债	5,672,070.40	0.11
82	113505	杭电转债	5,363,438.48	0.10
83	127050	麒麟转债	4,259,510.06	0.08
84	113616	韦尔转债	3,831,665.75	0.07
85	123112	万讯转债	3,446,617.74	0.07
86	128022	众信转债	3,292,333.51	0.06
87	123133	佩蒂转债	3,111,499.51	0.06
88	127042	嘉美转债	2,794,264.80	0.05
89	127037	银轮转债	2,749,926.03	0.05
90	110082	宏发转债	2,478,435.07	0.05

#### 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	3,978,226,244.06	359,914,156.12
报告期期间基金总申购份额	52,430,051.90	22,332,405.22
减:报告期期间基金总赎回份额	512,989,921.07	100,074,902.38
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	3,517,666,374.89	282,171,658.96

## § 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

无。

## § 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

2022 年 7 月 20 日