

平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划

2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 日

基金管理人:平安证券股份有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2023 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称：本计划）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。

本计划托管人中信银行股份有限公司根据本计划合同规定，于2023年10月17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。

本计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本计划资产，但不保证本计划一定盈利。

本计划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计划的招募说明书。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》，本计划于 2021 年 5 月 12 日合同变更生效。本计划按照《基金法》及其他有关规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年7月1日起至2023年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安安赢添利半年债券
基金主代码	970011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 05 月 12 日
报告期末基金份额总额	112,403,599.98 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现计划资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	精选信用债做底仓配置，在获取稳健收益的基础上，通过债券波段操作、利率中性策略交易、权益资产投资等方式博取超额收益。本集合计划投资策略具有攻守兼备的特点，在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数*90%+沪深 300 指数*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

基金管理人	平安证券股份有限公司			
基金托管人	中信银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	平安安赢添利半年债券 A	平安安赢添利半年债券 B	平安安赢添利半年债券 C	平安安赢添利半年债券 D
下属分级基金的交易代码	970011	970012	970013	970014
报告期末下属分级基金的份额总额	108,974,701.39 份	1,475,117.42 份	1,953,781.17 份	0.00 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（2023 年 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日）			
	平安安赢添利半年债券 A	平安安赢添利半年债券 B	平安安赢添利半年债券 C	平安安赢添利半年债券 D
1. 本期已实现收益	-968,028.50	-13,566.47	-17,130.94	-
2. 本期利润	-1,526,049.23	-23,148.75	-26,434.59	-
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0132	-0.0128	-0.0135	-
4. 期末基金资产净值	110,662,300.35	1,487,008.11	1,978,521.71	0.00
5. 期末基金份额净值	1.0155	1.0081	1.0127	1.0000

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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损益。

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

平安安赢添利半年债券 A 净值表现

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	-1.29%	0.11%	0.23%	0.08%	- 1.52%	0.03%
过去六个月	-1.47%	0.17%	1.22%	0.08%	- 2.69%	0.09%
过去一年	-2.20%	0.18%	2.77%	0.10%	-	0.08%

					4.97%	
自基金合同生效起至今	1.55%	0.14%	6.27%	0.11%	-	0.03%
					4.72%	

平安安赢添利半年债券 B 净值表现

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	-1.36%	0.11%	0.23%	0.08%	- 1.59%	0.03%
过去六个月	-1.62%	0.17%	1.22%	0.08%	- 2.84%	0.09%
过去一年	-2.49%	0.18%	2.77%	0.10%	- 5.26%	0.08%
自基金合同生效起至今	0.81%	0.14%	6.39%	0.11%	- 5.58%	0.03%

平安安赢添利半年债券 C 净值表现

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	-1.32%	0.11%	0.23%	0.08%	- 1.55%	0.03%
过去六个月	-1.53%	0.17%	1.22%	0.08%	- 2.75%	0.09%
过去一年	-2.30%	0.18%	2.77%	0.10%	- 5.07%	0.08%
自基金合同生效起至今	1.27%	0.14%	6.13%	0.11%	- 4.86%	0.03%

平安安赢添利半年债券 D 净值表现

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	0.00%	0.00%	0.23%	0.08%	- 0.23%	- 0.08%
过去六个月	0.00%	0.00%	1.22%	0.08%	- 1.22%	- 0.08%
过去一年	0.00%	0.00%	2.77%	0.10%	- 2.77%	- 0.10%
自基金合同生效起至今	0.00%	0.00%	6.27%	0.11%	- 6.27%	- 0.11%

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

平安安赢添利半年债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年05月12日-2023年09月30日)



平安安赢添利半年债券B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年05月12日-2023年09月30日)



平安安赢添利半年债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年05月12日-2023年09月30日)



平安安赢添利半年债券D累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年05月12日-2023年09月30日)



§ 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		
阮毅	投资经理	2023-	-	5年	阮毅，2011年6月加入上海浦

		05-29		<p>东发展银行总行资产管理部，历任债券交易员、产品经理、投资经理和固收专户投资主管，专户管理规模超过 1000 亿，管理产品曾获证券时报评选最佳开发式产品奖项，2018 年 5 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司。2018 年 10 月至 2021 年 7 月任华泰紫金智盈债券型证券投资基金基金经理。2019 年 5 月至 2021 年 7 月任华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 7 月任华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 7 月任华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月任华泰紫金智鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月任华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2021 年 8 月加入平安证券股份有限公司。2021 年 10 月至 2023 年 5 月任平安证券年年安 6 号单一资产管理计划投资经理。2021 年 10 月至 2023 年 5 月任平安证券星辰 1 号集合资产管理计划、平安证券星辰 3 号集合资产管理计划、平安证券星辰 5 号集合资产管理计划、平安证券星火 1 号集合资产管理计划、平安证券星火 2 号集合资产管理计划、平安证券星云 1 号集合资产管理计划投资经理。2021 年 10 月至 2022 年 4 月任平安证券星耀光银 1 号集合资产管理计划、平安证券成长 5 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券成长 6 号 FOF 集</p>
--	--	-------	--	---

			<p>合资产管理计划、平安证券成长 7 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券星耀光银 2 号集合资产管理计划、平安证券星耀光银 3 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 3 月至 2022 年 4 月任平安证券成长 8 号 FOF 集合资产管理计划、平安证券成长 9 号 FOF 集合资产管理计划投资经理。2022 年 4 月至 2023 年 5 月任平安证券星虹工享 1 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 6 月至 2023 年 5 月任平安证券星耀泰乾 9 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 10 月至 2023 年 5 月任平安证券星耀稳世 1 号集合资产管理计划投资经理。2022 年 11 月至 2023 年 5 月任平安证券星虹工享 2 号集合资产管理计划、平安证券星虹工享 3 号集合资产管理计划投资经理。自 2023 年 5 月 29 日起至今担任《平安证券现金宝现金管理型集合资产管理计划》《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划》投资经理。</p>
--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等有关法律法规及本计划资产管理合同、招募说明书等有关法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本计划资产，在控制风险的前提下，为本计划持有人谋求最大利益。报告期，本计划运作合法合规，不存在损害本计划持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

管理人通过建立完善规范、合规的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析等手段，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度等，建立集中交易管理机制，并重视交易执行环节的公平交易措施，以时间优

先、价格优先作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，确保公平对待各投资组合。报告期，管理人公平交易制度总体执行情况良好，未发现本计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本计划不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的其他资管计划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出现超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债市整体呈现 V 型走势。7 月上旬债市窄幅震荡，政策博弈依然是市场关注焦点；下旬政治局会议对地产等方面的一些新提法令债市承压，收益率有所调整。进入 8 月，随着偏弱信贷数据的公布以及超预期降息的到来，债市大幅走强；但随后在止盈压力以及稳增长举措的累积下有所回调。9 月，央行加大公开市场投放，并降准 0.25%。但季末信贷冲量、双节取现等影响下，跨季资金价格不断走高；加上地产优化政策开始实施并持续加码，多重利空影响下，收益率普遍上行。全季度看，收益率曲线平坦化上行，信用利差收窄。10 年国债到期收益率上行 4bp 至 2.68%，1 年国债到期收益率上行 30bp 至 2.17%，1 年 AAA 中短期票据到期收益率上行 8bp 至 2.55%，1 年 AAA 存单到期收益率上行 15bp 至 2.47%。三季度上证指数下跌 2.86%，深证成指下跌 8.32%，沪深 300 下跌 3.98%，创业板指下跌 9.53%，科创 50 指数下跌 11.67%，市场整体表现为普跌，但是结构差异较大。期间，华为产业链、减肥药、煤炭、券商等板块均有阶段性行情，热点较多，主题呈现轮番上涨的行情。煤炭、银行、非银、石油石化等板块涨幅靠前。电力设备、消费者服务、传媒、计算机等板块跌幅靠前。目前经济已度过短期压力最大的阶段，PMI 连续 4 个月回升，六大口径数据有不同程度改善，预计后续将继续好转。出口触底、地产放松、信贷投放加快是短期经济企稳的主要动能；新一轮地方债务化解亦有助于公共部门资产负债表修复。PMI 口径下的年内经济谷底是 5 月，读数为 48.8；6-8 月先后恢复至 49.0、49.3、49.7；9 月进一步上行至经验荣枯线之上的 50.2。当前经济运行面临新的困难挑战，主要是国内需求不足，一些企业经营困难，重点领域风险隐患较多，外部环境复杂严峻。

投资操作层面，本集合计划以配置高等级信用债为主，利率品种主要用以短期交易、增厚收益，另有配置少部分低价转债，股票主要在医药、人工智能等新兴成长型方向布局。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末平安安赢添利半年债券 A 基金份额净值为 1.0155 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.29%，同期业绩比较基准收益率为 0.23%；截至报告期末平安安赢添利半年债券 B 基金份额净值为 1.0081 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.23%；截至报告期末平安安赢添利半年债券 C 基金份额净值为 1.0127 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.23%；截至报告期末平安安

赢添利半年债券 D 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满二百人或者资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	12,518,945.00	9.04
	其中：股票	12,518,945.00	9.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	121,698,890.13	87.89
	其中：债券	121,698,890.13	87.89
	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	4,182,118.68	3.02
8	其他资产	70,228.28	0.05
9	合计	138,470,182.09	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	851,621.00	0.75
C	制造业	6,865,952.00	6.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	386,250.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,912,448.00	1.68

J	金融业	1,540,480.00	1.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	962,194.00	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,518,945.00	10.97

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	600	1,079,130.00	0.95
2	600028	中国石化	140,300	851,621.00	0.75
3	600941	中国移动	8,300	803,606.00	0.70
4	600036	招商银行	24,000	791,280.00	0.69
5	603867	新化股份	24,500	766,850.00	0.67
6	601995	中金公司	20,000	749,200.00	0.66
7	601728	中国电信	123,800	716,802.00	0.63
8	603259	药明康德	8,300	715,294.00	0.63
9	002415	海康威视	16,500	557,700.00	0.49
10	300502	新易盛	12,000	552,000.00	0.48

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	6,538,883.98	5.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	82,106,447.45	71.94
	其中：政策性金融债	41,400,302.76	36.28
4	企业债券	3,265,869.45	2.86
5	企业短期融资券	5,026,769.37	4.40
6	中期票据	20,509,176.66	17.97
7	可转债（可交换债）	4,251,743.22	3.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	121,698,890.13	106.63

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	CND100045707	21 国开 03	300,000	31,208,602.62	27.35
2	CND10005R756	22 农发清发 05	100,000	10,191,700.14	8.93
3	CND100058NN1	22 国债 13	65,000	6,538,883.98	5.73
4	CND100043DH6	21 河钢集 MTN001	50,000	5,213,707.88	4.57
5	CND100045FV7	21 陕延油 MTN001	50,000	5,143,363.01	4.51

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：本计划报告期末未持有未按公允价值计量的资产支持证券。

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：本计划不涉及贵金属投资，报告期末未持有贵金属。

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：本计划不涉及权证投资，报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本计划报告期内未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本计划报告期内未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

齐鲁银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国保险监督管理委员会及其地方机构的处罚。陕西延长石油(集团)有限责任公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会及其地方机构的处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本计划投资前十名股票未超出本计划合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	39,740.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,487.80
8	其他	-
9	合计	70,228.28

5.11.4 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	127040	国泰转债	1,082,538.01	0.95
2	110075	南航转债	1,060,928.28	0.93
3	110093	神马转债	998,316.50	0.87
4	110079	杭银转债	558,713.62	0.49
5	113052	兴业转债	485,024.29	0.42
6	CND100048552	苏行转债	36,367.57	0.03
7	113055	成银转债	18,693.65	0.02
8	113050	南银转债	10,234.45	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	平安安赢添利半年债券 A	平安安赢添利半年债券 B	平安安赢添利半年债券 C	平安安赢添利半年债券 D
报告期期初基金份额总额	121,596,637.42	2,526,704.14	1,953,781.17	0.00

报告期期间基金总申购份额	-	10.92	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	12,621,936.03	1,051,597.64	-	-
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	108,974,701.39	1,475,117.42	1,953,781.17	0.00

§ 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：本计划管理人未运用固有资金投资本计划。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本计划管理人未运用固有资金投资本计划。

§ 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：报告期内本计划未出现单一投资者持有本计划份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1)《关于准予平安证券稳健资本一号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]261号）；
- (2)《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- (3)《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划更新的招募说明书》；
- (4)《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；
- (5)《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同生效公告》；
- (6) 管理人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

广东省深圳市福田区福田街道福华三路 15 号与金田路交汇处卓越世纪中心 1 号楼 36 层。

9.3 查阅方式

- (1) 书面查阅：可在营业时间于管理人文件存放地点免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- (2) 网络查阅：管理人网站：<https://stock.pingan.com/>。

平安证券股份有限公司
二〇二三年十月二十五日