

平安双季增享 6 个月持有期债券型证券投资
基金
2024 年第 2 季度报告

2024 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 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。

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 2024 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安双季增享 6 个月持有债券	
基金主代码	010651	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 5 日	
报告期末基金份额总额	940,241,011.33 份	
投资目标	在谨慎控制组合净值波动率的前提下，本基金追求基金产品的长期、持续增值，并力争获得超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4 国债期货投资策略；5、资产支持证券投资策略	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*10%+中证全债指数收益率*90%	
风险收益特征	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，但低于混合型基金、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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安双季增享 6 个月持有债券 A	平安双季增享 6 个月持有债券 C
下属分级基金的交易代码	010651	010652
报告期末下属分级基金的份额总额	854,113,136.17 份	86,127,875.16 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	平安双季增享 6 个月持有债券 A	平安双季增享 6 个月持有债券 C
1. 本期已实现收益	5,201,575.26	442,122.38
2. 本期利润	4,378,591.62	359,324.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0049	0.0040
4. 期末基金资产净值	819,022,701.65	81,586,175.17
5. 期末基金份额净值	0.9589	0.9473

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

平安双季增享 6 个月持有债券 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	0.48%	0.14%	1.53%	0.08%	-1.05%	0.06%
过去六个月	0.87%	0.19%	4.01%	0.10%	-3.14%	0.09%
过去一年	-1.16%	0.16%	4.90%	0.09%	-6.06%	0.07%
过去三年	-6.17%	0.26%	11.19%	0.11%	-17.36%	0.15%
自基金合同生效起至今	-4.11%	0.25%	13.55%	0.12%	-17.66%	0.13%

平安双季增享 6 个月持有债券 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	0.40%	0.14%	1.53%	0.08%	-1.13%	0.06%
过去六个月	0.70%	0.19%	4.01%	0.10%	-3.31%	0.09%
过去一年	-1.51%	0.16%	4.90%	0.09%	-6.41%	0.07%

过去三年	-7.15%	0.25%	11.19%	0.11%	-18.34%	0.14%
自基金合同生效起至今	-5.27%	0.24%	13.55%	0.12%	-18.82%	0.12%

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

平安双季增享6个月持有债券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



平安双季增享6个月持有债券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2021年01月05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		
唐煜	平安双季增享6个月持有期债券型证券投资基金基金经理	2023年12月11日	-	8年	唐煜先生，南开大学世界经济专业硕士研究生。曾先后担任广发银行股份有限公司资产管理部固定收益处投资经理，太平洋资产管理有限公司固定收益部固定收益经理、西部利得基金管理有限公司公募投资部基金经理。2022年6月加入平安基金管理有限公司，现任平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安瑞尚六个月持有期混合型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合庆1年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安双季增享6个月持有期债券型证券投资基金、平安合轩1年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠泽纯债债券型证券投资基金、平安合聚1年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
俞瑶	平安双季增享6个月持有期债券型证券投资基金基金经理	2022年12月20日	2024年4月18日	12年	俞瑶女士，香港科技大学投资管理专业硕士，曾先后担任南京证券股份有限公司投资顾问、深圳市万博汇投资控股有限公司运营风险管理经理、天风证券股份有限公司项目经理。2015年9月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资经理，现任平安深证300指数增强型证券投资基金、平安沪深300指数量化增强证券投资基金、平安中证500指数增强型发起式证券投资基金、平安兴鑫回报一年定期开放混合型证券投资基金、平安中证2000增强策略交易型开放式指数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

债券方面，利率债品种在前期债券供需失衡，降准降息预期持续的背景下，收益率不断创出新低。4 月央行通过媒体提醒利率风险，后续地产政策放松，使得利率品种，尤其是长期限关键年期品种出现了震荡调整的行情。至 6 月，地产政策虽然发力，但经济边际走弱，市场对于央行的担忧逐步缓解后，利率再次下行至前低位置。信用债品种供求矛盾突出，超长债供给增加依然不改高息资产短缺的局面，城投供给也在持续缩量，存款搬家导致非银是重要的需求方。信用整体收益率震荡下行。股票方面，二季度，新国九条等政策持续发力，叠加年报、一季度报的发布验证，部分高景气行业得到验证，大盘价值相对走强。转债方面，经历年初的 V 型反弹后，指数持续震荡。整体节奏与权益市场类似，区别在于 4 月底开始逐步有理财等增量资金增配的信号出现，溢价率开始有修复迹象。6 月在权益市场走弱的背景下，转债市场因担心信用风险，再次出

现了系统性下跌行情，低价转债受影响较大。报告期内，纯债部分大幅度减持了久期较短的利率品种，阶段性增持超长期国债和 3-5 年的银行二永债。半年末组合久期再次回到一个中性偏保守的水平。权益部分相对上季末有小幅的提升，坚持行业分散化原则，主要增配了煤炭、有色、家电、船舶制造等行业，主要减配了医药生物、汽车、计算机、公用事业等行业。基金转债仓位相对上季末持平略降。主要增配有业绩支撑的中低价转债品种。转债行业同样较为分散，主要分布于煤炭、家电、公用事业、汽配等行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安双季增享 6 个月持有债券 A 的基金份额净值 0.9589 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.53%；截至本报告期末平安双季增享 6 个月持有债券 C 的基金份额净值 0.9473 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准收益率为 1.53%。

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	107,783,749.12	11.82
	其中：股票	107,783,749.12	11.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	783,091,748.24	85.86
	其中：债券	783,091,748.24	85.86
	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	7,001,438.36	0.77
	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	10,774,476.69	1.18
8	其他资产	3,363,114.48	0.37
9	合计	912,014,526.89	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

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	20,241,611.00	2.25
C	制造业	70,413,494.96	7.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,612,730.00	0.29
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	2,296,805.00	0.26
J	金融业	2,706,144.00	0.30
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,512,964.16	1.06
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	107,783,749.12	11.97

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

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	688480	赛恩斯	341,456	9,512,964.16	1.06
2	600150	中国船舶	222,900	9,074,259.00	1.01
3	000333	美的集团	106,300	6,856,350.00	0.76
4	601699	潞安环能	299,200	5,424,496.00	0.60
5	603596	伯特利	131,784	5,126,397.60	0.57
6	601225	陕西煤业	184,900	4,764,873.00	0.53
7	000338	潍柴动力	291,100	4,727,464.00	0.52
8	300274	阳光电源	76,020	4,715,520.60	0.52
9	603993	洛阳钼业	402,100	3,417,850.00	0.38
10	600600	青岛啤酒	45,700	3,325,589.00	0.37

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	102,448,360.66	11.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	132,835,799.15	14.75
	其中：政策性金融债	122,719,522.44	13.63
4	企业债券	212,788,636.16	23.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	263,333,785.77	29.24
7	可转债（可交换债）	71,685,166.50	7.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	783,091,748.24	86.95

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	230020	23 附息国债 20	1,000,000	102,448,360.66	11.38
2	240241	23 财券 G5	800,000	81,985,380.82	9.10
3	102383020	23 晋能煤业 MTN009	600,000	62,175,049.18	6.90
4	240179	23 中大 01	600,000	62,167,841.09	6.90
5	240277	23 兴业 Y1	500,000	53,209,073.98	5.91

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。

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：本基金本报告期内无国债期货投资。

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

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	145,646.42
2	应收证券清算款	3,216,074.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,393.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,363,114.48

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	123145	药石转债	6,242,859.12	0.69
2	113637	华翔转债	3,753,236.16	0.42
3	111017	蓝天转债	3,646,097.89	0.40
4	128141	旺能转债	3,380,759.80	0.38
5	127095	广泰转债	2,997,276.26	0.33
6	113563	柳药转债	2,808,202.41	0.31
7	123188	水羊转债	2,800,762.03	0.31
8	127027	能化转债	2,760,338.89	0.31
9	123190	道氏转 02	2,722,850.64	0.30
10	127090	兴瑞转债	2,201,276.13	0.24
11	113661	福 22 转债	2,166,457.77	0.24
12	113061	拓普转债	2,143,696.77	0.24
13	123213	天源转债	2,139,890.55	0.24
14	118038	金宏转债	2,071,102.43	0.23

15	118025	奕瑞转债	2,056,824.20	0.23
16	123233	凯盛转债	2,008,537.27	0.22
17	123212	立中转债	1,981,098.96	0.22
18	113524	奇精转债	1,970,826.90	0.22
19	127073	天赐转债	1,922,215.78	0.21
20	128049	华源转债	1,891,650.55	0.21
21	110058	永鼎转债	1,891,141.26	0.21
22	113577	春秋转债	1,803,690.86	0.20
23	113678	中贝转债	1,802,537.61	0.20
24	127068	顺博转债	1,773,361.10	0.20
25	123193	海能转债	1,354,190.83	0.15
26	123090	三诺转债	1,069,381.57	0.12
27	123231	信测转债	1,054,620.76	0.12
28	123150	九强转债	1,006,779.53	0.11
29	123200	海泰转债	901,794.89	0.10
30	113598	法兰转债	883,749.79	0.10
31	127069	小熊转债	456,489.57	0.05
32	123194	百洋转债	452,958.33	0.05
33	123107	温氏转债	126.20	0.00

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：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

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	平安双季增享 6 个月持有 债券 A	平安双季增享 6 个月持有 债券 C
报告期期初基金份额总额	944,252,167.16	95,495,336.53
报告期期间基金总申购份额	185,914.17	9,018.53
减：报告期期间基金总赎回份额	90,324,945.16	9,376,479.90
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	854,113,136.17	86,127,875.16

§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季增享 6 个月持有期债券型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安双季增享 6 个月持有期债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安双季增享 6 个月持有期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

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

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：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2024 年 7 月 18 日