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

（平安安赢添利半年债券 D）产品资料概要

编制日期：2021年5月12日

送出日期：2021 年 5 月 12 日

本概要提供本集合计划的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

(一) 产品概况

产品简称	平安安赢添利半年债券D	**基金代码**	970014
管理人	平安证券股份有限公司	**托管人**	中信银行股份有限公司
资产管理合同生效日	2021-5-12		
基金类型	债券型	**交易币种**	人民币
运作方式	开放式	**开放频率**	6个月滚动持有，每个运作期到期日提出赎回申请
基金经理	朱燕琼	**开始担任本集合计划基金经理的日期**	2021-5-12
		证券从业日期	2017-6-5
	姜杰特	**开始担任本集合计划基金经理的日期**	2021-5-12
		证券从业日期	2015-3-1
	秦石	**开始担任本集合计划基金经理的日期**	2021-5-12
		证券从业日期	2012-10-25

(二) 集合计划投资与净值表现

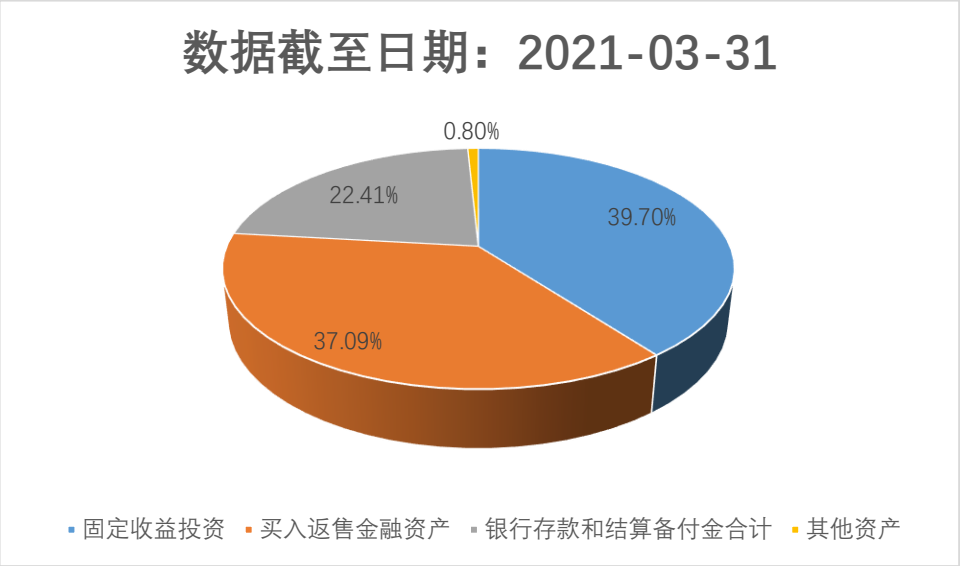
1、 投资目标与投资策略

请仔细阅读《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》的“第九部分 集合计划的投资”了解详细情况。

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。
投资范围	本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。 如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本集合计划的投资组合比例为：本计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	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。 具体策略：大类资产轮动投资策略、债券久期及骑乘策略、利率中性策略、杠杆套利策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、信用债投资策略、可转债博弈及套利策略、权益投资策

	略
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*90%+沪深 300指数收益率*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。

2、 投资组合资产配置图表/区域配置图表



（三） 投资本集合计划涉及的费用

1、 集合计划销售相关费用

以下费用在申购/赎回集合计划过程中收取：

申购费（前收费）	本集合计划D类集合计划份额不收取申购费用。
赎回费	本集合计划D类份额因设置最短持有期限，不收取赎回费。

2、 集合计划运作相关费用

以下费用将从集合计划资产中扣除：

费用类型	**收费方式/年费率**
管理费	0.4%
托管费	0.05%
销售服务费	0%
其他费用	与集合计划相关的信息披露费用、会计师费、律师费等按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

注：本集合计划交易证券、基金等产生的费用和税费，按实际发生额从集合计划资产扣除

（四） 风险揭示与重要提示

1、 风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划面临的风险包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、特定风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险等。其中，特定风险包括：

（1）本集合计划为债券型集合计划，债券资产不低于集合计划资产的 80%。因此，本集合计划需要承担债券市场整体下跌的风险。

（2）就 D 类计划份额而言：每个运作期到期日前，D 类集合计划份额持有人不能提出赎回申请。

对于 D 类计划份额的每份申购份额，第一个运作期指该计划份额申购确认日起（即第一个运作期起始日），至计划份额申购确认日满 6 个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指计划份额申购确认日满 12 个月对应的月度对日止，第三个运作期指计划份额申购确认日满 18 个月对应的月度对日止。以此类推。

每个运作期到期日， D 类集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果 D 类集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一工作日起该计划份额进入下一个运作期。

（3）本集合计划投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的集合计划所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成集合计划财产损失。

（4）本集合计划可投资于国债期货。国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，相应期限国债收益率微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有

在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

（5）为对冲信用风险，本计划可能投资信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

2、 重要提示

中国证监会对本集合计划的备案，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险

本集合计划管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运营集合计划财产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合计划投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人。

集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，集合计划管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，集合计划管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定的之后，如需及时、准确获取集合计划的相关信息，敬请同时关注集合计划管理人发布的相关临时公告等。

（五） 其他资料查阅方式

以下资料详见集合计划管理人网站(www.stock.pingan.com),客服电话为95511-8。

- 资产管理合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括季度报告、中期报告和年度报告
- 集合计划份额净值
- 集合计划销售机构及联系方式
- 其他重要资料