

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

2022 年第 2 季度报告

2022 年 06 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:2022 年 07 月 20 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2022年7月12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2022年04月01日起至2022年06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	216,497,670.57 份			
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数*90%+沪深 300 指数*10%			
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	200,361,104.81 份	10,903,266.07 份	5,233,299.69 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（2022 年 04 月 01 日-2022 年 06 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	1,967,664.04	102,198.69	77,090.28	-
2. 本期利润	2,905,364.78	164,598.09	120,193.00	-
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0137	0.0129	0.0131	-
4. 期末基金资产净值	209,534,868.46	11,361,630.59	5,464,555.24	0.00
5. 期末基金份额净值	1.0458	1.0420	1.0442	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	1.33%	0.04%	1.61%	0.14%	-0.28%	-0.10%
过去六个月	1.35%	0.05%	0.78%	0.15%	0.57%	-0.10%
过去一年	4.12%	0.06%	2.88%	0.13%	1.24%	-0.07%
自基金转型日起至今	4.58%	0.24%	3.73%	0.13%	0.85%	0.11%

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	1.25%	0.04%	1.61%	0.14%	-0.36%	-0.10%
过去六个月	1.19%	0.05%	0.78%	0.15%	0.41%	-0.10%

过去一年	3.81%	0.06%	2.88%	0.13%	0.93%	- 0.07%
自基金转型 日起至今	4.20%	0.06%	3.84%	0.13%	0.36%	- 0.07%

平安安赢添利半年债券 C 净值表现

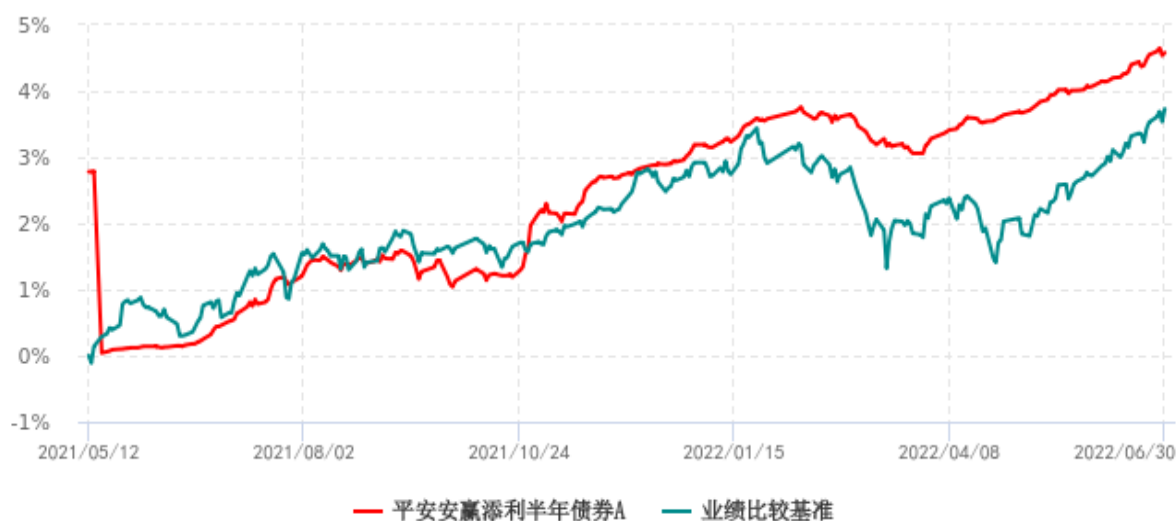
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.30%	0.04%	1.61%	0.14%	- 0.31%	- 0.10%
过去六个月	1.29%	0.05%	0.78%	0.15%	0.51%	- 0.10%
过去一年	4.01%	0.06%	2.88%	0.13%	1.13%	- 0.07%
自基金转型 日起至今	4.42%	0.06%	3.58%	0.13%	0.84%	- 0.07%

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%	1.61%	0.14%	- 1.61%	- 0.14%
过去六个月	0.00%	0.00%	0.78%	0.15%	- 0.78%	- 0.15%
过去一年	0.00%	0.00%	2.88%	0.13%	- 2.88%	- 0.13%
自基金转型 日起至今	0.00%	0.00%	3.73%	0.13%	- 3.73%	- 0.13%

3.2.2 自基金转型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-2022年06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14日-2022年06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17日-2022年06月30日)



注：红线为平安安赢添利半年债券 C 数据，蓝线为业绩比较基准数据。

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-2022年06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		

朱燕琼	投资经理	2021-05-12	-	8 年	<p>朱燕琼，现任平安证券资产管理事业部固定收益团队投资经理，北京大学经济学硕士。2013 年-2014 年就职于埃克森美孚（中国）投资有限公司，担任财务分析师。2014 年-2017 年就职于兴业信托，担任资产管理部投资经理。2017 年加入平安证券资产管理事业部，自 2017 年 8 月 31 日起担任平安证券现金宝集合资产管理计划、平安证券稳健资本一号 7 期集合资产管理计划投资经理至今。</p>
姜杰特	投资经理	2021-05-12	-	8 年	<p>姜杰特，现任平安证券资产管理部固定收益团队投资经理，华东师范大学金融硕士。2014 年 7 月至 2015 年 10 月就职于江海证券有限公司，担任债券融资承做经理，2015 年 11 月加入平安证券股份有限公司，曾任固定收益投资经理助理。自 2017 年 9 月 28 日起至今担任平安证券稳健资本一号集合资产管理计划投资经理。自 2017 年 9 月 28 日起至 2019 年 7 月 10 日担任平安证券橙明 1 号集合资产管理计划投资经理、平安证券橙明 2 号集合资产管理计划、平安证券橙明 3 号集合资产管理计划投资经理。自 2017 年 9 月 28 日起至 2018 年 12 月 25 日担任平安证券橙明 4 号集合资产管理计划投资经理。自 2017 年 9 月 28 日起至 2018 年 11 月 7 日担任平安证券橙金 1 号集合资产管理计划投资经理。自 2018 年 3 月 12 日起至 2018 年 11 月 25 日担任平安证券安稳 1 号集合资产管理计划投资经理。自 2020 年 3 月 6 日起至今担任平安证券现金宝集合资产管理计划投资经理。</p>

秦石	投资经理	2021-05-12	-	10 年	秦石，现任平安证券资产管理事业部权益投资团队投资经理，上海交通大学硕士。2012 年 3 月-2015 年 6 月就职于东方证券股份有限公司自营部，从事二级市场研究，历任研究员、研究组长。2015 年 9 月-2016 年 12 月就职于鹰海医疗信息技术有限公司，职位总经理助理，负责投融资工作。2017 年 1 月-2019 年 10 月，就职于寻常投资有限公司，担任资深研究员。2019 年 10 月加入平安证券资产管理事业部，担任投资经理。自 2020 年 5 月 1 日起至 2021 年 4 月 30 日担任平安证券强债 1-10 号集合资产管理计划投资经理。2020 年 6 月 19 日至 2021 年 3 月 16 日担任平安证券成长 1-3 号 FOF 集合资产管理计划投资经理。2021 年 1 月 26 日至 2021 年 4 月 30 日担任平安证券信享添利 1 号集合资产管理计划投资经理。
----	------	------------	---	------	--

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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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，未发现本集合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

二季度债市呈现 N 字形走势。4 月降准幅度不及预期，上海疫情出现拐点，利率再度上行。但 5 月北京疫情反复，各项经济数据普遍呈现回落的态势，更强稳增长政策预期落空，全国稳大盘会议之后长端对基本面重定价。6 月上海全面解封，疫情管控松动，风险偏好有所提升，债市开启小复苏交易。全季度看，收益率小幅上行，10 年国债上行约 3bp 至 2.82%。股票市场四月份受疫情影响有较大幅度下跌，五月开启反弹。

本报告期内，本集合计划以配置中高等级信用债为主，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；股票五月份慢慢加仓，参与新能源板块，取得了一定收益。后续关注地产链条复苏，等待新能源板块调整后的布局机会。

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 1.0458 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.33%，同期业绩比较基准收益率为 1.61%；截至报告期末平安安赢添利半年债券 B 基金份额净值为 1.0420 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.25%，同期业绩比较基准收益率为 1.61%；截至报告期末平安安赢添利半年债券 C 基金份额净值为 1.0442 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.30%，同期业绩比较基准收益率为 1.61%；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 1.61%。

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，本集合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	3,248,276.00	1.33
	其中：股票	3,248,276.00	1.33
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	235,423,757.94	96.52
	其中：债券	225,188,319.58	92.32
	资产支持证券	10,235,438.36	4.20
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	4,167,766.45	1.71
8	其他资产	1,078,648.44	0.44
9	合计	243,918,448.83	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	497,430.00	0.22
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,750,846.00	1.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	3,248,276.00	1.43

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	600438	通威股份	11,300	676,418.00	0.30
2	000651	格力电器	18,000	606,960.00	0.27

3	002705	新宝股份	23,100	507,969.00	0.22
4	002714	牧原股份	9,000	497,430.00	0.22
5	002245	蔚蓝锂芯	21,100	489,731.00	0.22
6	300073	当升科技	5,200	469,768.00	0.21

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	13,248,941.10	5.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,887,890.41	9.23
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	51,845,871.24	22.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	133,513,041.09	58.98
7	可转债（可交换债）	5,692,575.74	2.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	225,188,319.58	99.48

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	102101328	21 靖江北辰 MTN002	200,000	21,104,356.16	9.32
2	CND10000B082	16 苏南通一带债	500,000	21,103,945.21	9.32
3	CND10003NQB0	20 华夏租赁债 01	200,000	20,887,890.41	9.23
4	102101055	21 国盛 MTN002	200,000	20,346,504.11	8.99
5	102100980	21 赣粤 MTN001(乡村振兴)	200,000	20,322,378.08	8.98

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	193291	吉化热 02	100,000	10,235,438.36	4.52

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本计划不涉及股指期货投资，报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货定价原理，通过多头或空头套期保值等策略进行操作。管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险，以达到降低投资组合整体风险的目的。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
TF2209	TF2209	18	18,206,100.00	23,200.00	-
公允价值变动总额合计(元)					23,200.00
国债期货投资本期收益(元)					6,450.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					23,200.00

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

本计划投资前十名证券的发行主体未涉及被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	435,203.28
2	应收证券清算款	531,882.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	51,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,562.46
8	其他	-
9	合计	1,078,648.44

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	110079	杭银转债	1,252,830.14	0.55
2	CND100048552	苏行转债	1,135,522.32	0.50
3	110075	南航转债	1,118,750.68	0.49
4	113011	光大转债	1,063,308.22	0.47
5	113013	国君转债	568,002.05	0.25
6	113043	财通转债	554,162.33	0.24

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	220,562,178.05	14,723,569.42	10,143,025.09	0.00
报告期期间基金总申购份额	-	382,649.53	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	20,201,073.24	4,202,952.88	4,909,725.40	-
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	200,361,104.81	10,903,266.07	5,233,299.69	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》；
- (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益田路平安金融中心南塔 23 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

二〇二二年七月二十日