

平安添利债券型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 2023 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安添利债券	
基金主代码	700005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 11 月 27 日	
报告期末基金份额总额	2,915,749,737.21 份	
投资目标	在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上，主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合，以期获得和产品期限匹配的债券收益。	
业绩比较基准	中证全债指数收益率	
风险收益特征	本基金属于债券型基金，预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安添利债券 A	平安添利债券 C
下属分级基金的交易代码	700005	700006
报告期末下属分级基金的份额总额	2,623,417,800.79 份	292,331,936.42 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	平安添利债券 A	平安添利债券 C
1. 本期已实现收益	30,076,683.55	3,397,152.36
2. 本期利润	30,029,847.10	3,496,610.91
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0114	0.0107
4. 期末基金资产净值	2,861,948,097.79	317,288,422.12
5. 期末基金份额净值	1.0909	1.0854

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

平安添利债券 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	1.09%	0.04%	0.73%	0.06%	0.36%	-0.02%
过去六个月	2.44%	0.04%	2.73%	0.06%	-0.29%	-0.02%
过去一年	2.50%	0.10%	3.59%	0.06%	-1.09%	0.04%
过去三年	10.78%	0.08%	14.89%	0.06%	-4.11%	0.02%
过去五年	21.10%	0.07%	26.23%	0.07%	-5.13%	0.00%
自基金合同 生效起至今	77.89%	0.22%	62.15%	0.08%	15.74%	0.14%

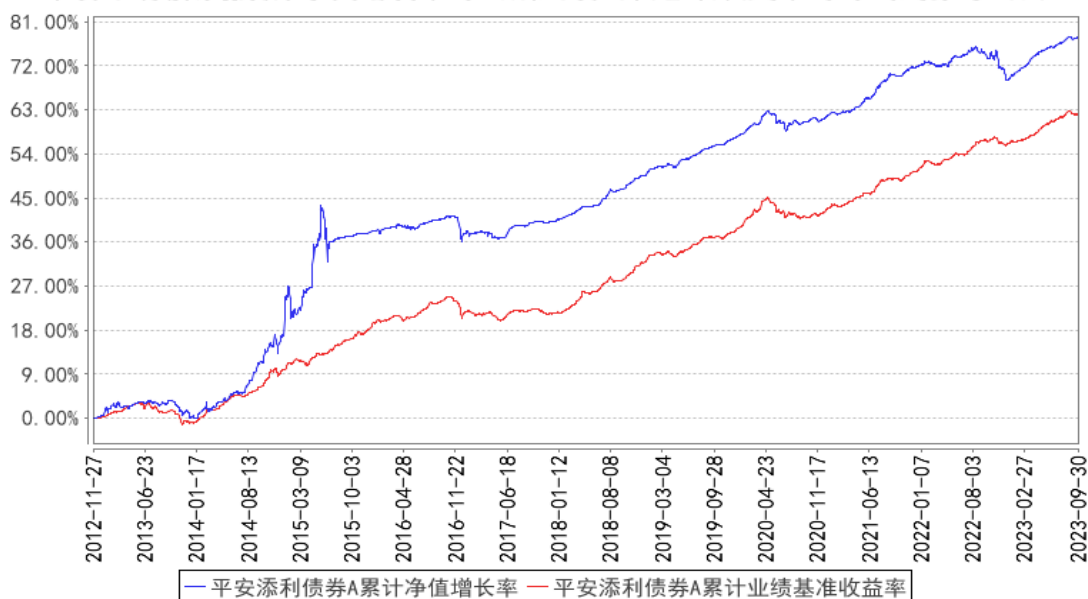
平安添利债券 C

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	1.00%	0.04%	0.73%	0.06%	0.27%	-0.02%
过去六个月	2.24%	0.04%	2.73%	0.06%	-0.49%	-0.02%

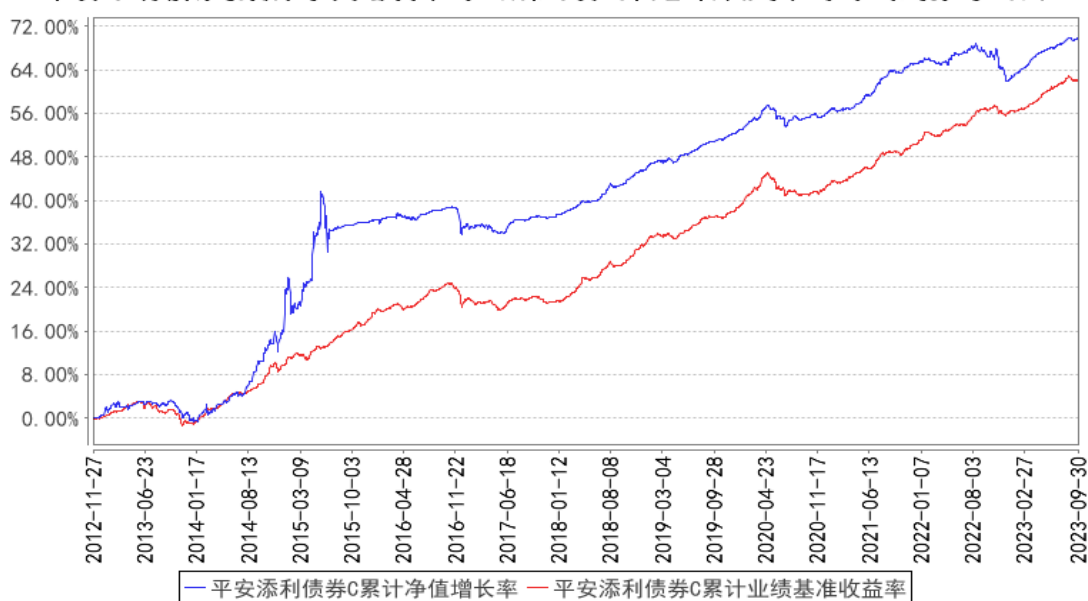
过去一年	2.09%	0.10%	3.59%	0.06%	-1.50%	0.04%
过去三年	9.44%	0.08%	14.89%	0.06%	-5.45%	0.02%
过去五年	18.61%	0.07%	26.23%	0.07%	-7.62%	0.00%
自基金合同生效起至今	69.81%	0.22%	62.15%	0.08%	7.66%	0.14%

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

平安添利债券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



平安添利债券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 2012 年 11 月 27 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		
曾小丽	平安添利债券型证券投资基金基金经理	2022年3月21日	-	12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）、平安双债添益债券型证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安5-10年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安添润债券型证券投资基金、平安合顺1年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安恒泰1年持有期混合型证券投资基金、平安稳健增长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遵规守信情况的说明

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

三季度，债市表现总体偏震荡，收益率先下后上。7 月至 8 月下旬，经济依然呈现出偏弱态势，市场等待政策进一步出台落实、资金面维持平稳偏松之下，十年国债收益率震荡下行，随后在 7 月经济金融数据验证仍弱、央行超预期降息之下，债市利率进一步打开向下空间。而 8 月下旬以来，随着房地产优化政策密集出台，市场预期和信心有所变化，叠加经济基本面继续磨底爬坡，地方债加大发行下资金面边际收敛，债市面临阶段性调整压力，叠加机构赎回，十年国债收益率总体震荡上行。

权益和转债市场方面，三季度权益市场整体延续弱势运行的态势，主要宽基指数都出现明显回撤，创业板指跌幅最大，转债指数跌幅相对较小，但 9 月转债估值经历了明显的压缩。具体来看，7 月中上旬市场持续缩量调整，7 月 24 日政治局会议释放明确稳增长信号，市场在触及前低后迎来第一个政策底；而后投资者信心在多重因素影响下再度回落，汇率贬值压力加大，北向资金持续大幅净流出，指数连续下跌并创年内新低；8 月 27 日资本市场政策“四箭齐发”，虽然此后市场再度震荡缩量回落，但市场热点的赚钱效应已经有所改善，市场等待经济修复信号明确。

三季度本基金主要配置中短期信用债品种以获取稳健收益，增配城投债，同时通过杠杆套息、波段交易等方式增厚组合收益。转债方面，整体维持中低仓位，政治局会议之后转债仓位有所提高，主要增加了顺周期方向、医药、电子等行业配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安添利债券 A 的基金份额净值 1.0909 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.09%,同期业绩比较基准收益率为 0.73%;截至本报告期末平安添利债券 C 的基金份额净值 1.0854 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.00%,同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

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	3,830,278,396.21	99.32
	其中: 债券	3,830,278,396.21	99.32
	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	23,574,307.17	0.61
8	其他资产	2,741,094.93	0.07
9	合计	3,856,593,798.31	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	249,436,202.37	7.85
	其中：政策性金融债	186,800,535.52	5.88
4	企业债券	1,084,836,769.27	34.12
5	企业短期融资券	14,368,801.31	0.45
6	中期票据	2,074,189,373.48	65.24
7	可转债（可交换债）	173,404,411.10	5.45
8	同业存单	-	-
9	其他	234,042,838.68	7.36
10	合计	3,830,278,396.21	120.48

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	2028022	20 民生银行二级	2,183,000	219,589,043.61	6.91
2	102101710	21 物产中大 MTN002	1,140,000	115,768,495.08	3.64
3	2080106	20 淮南城投绿色债	1,300,000	108,572,945.36	3.42
4	210202	21 国开 02	1,000,000	102,401,726.03	3.22
5	188424	21 渝隆 02	1,000,000	101,198,794.52	3.18

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

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。北京首都开发股份有限公司在本报告期内被监管部门立案调查。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	38,252.91
2	应收证券清算款	2,126,573.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	576,268.96
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,741,094.93

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	113050	南银转债	6,822,941.92	0.21
2	113659	莱克转债	4,114,650.82	0.13
3	127032	苏行转债	4,000,490.55	0.13
4	113644	艾迪转债	3,990,882.19	0.13
5	113060	浙 22 转债	3,752,566.85	0.12
6	113643	风语转债	3,643,446.58	0.11
7	113021	中信转债	3,494,696.71	0.11
8	110079	杭银转债	3,491,884.11	0.11

9	113549	白电转债	3,442,937.53	0.11
10	128123	国光转债	3,333,249.90	0.10
11	127082	亚科转债	3,104,054.90	0.10
12	127050	麒麟转债	2,895,311.51	0.09
13	113651	松霖转债	2,621,119.50	0.08
14	113055	成银转债	2,492,517.26	0.08
15	110088	淮 22 转债	2,473,172.60	0.08
16	123050	聚飞转债	2,442,577.36	0.08
17	118024	冠宇转债	2,395,897.53	0.08
18	113062	常银转债	2,354,080.55	0.07
19	128120	联诚转债	2,230,057.21	0.07
20	110059	浦发转债	2,176,314.52	0.07
21	118009	华锐转债	2,073,190.30	0.07
22	113052	兴业转债	2,063,874.52	0.06
23	113057	中银转债	2,002,461.78	0.06
24	110062	烽火转债	1,976,578.63	0.06
25	123169	正海转债	1,939,899.20	0.06
26	127054	双箭转债	1,909,413.70	0.06
27	113594	淳中转债	1,906,560.82	0.06
28	123162	东杰转债	1,876,586.30	0.06
29	118007	山石转债	1,873,141.64	0.06
30	118027	宏图转债	1,868,987.26	0.06
31	123143	胜蓝转债	1,821,329.59	0.06
32	113043	财通转债	1,804,767.12	0.06
33	113655	欧 22 转债	1,797,186.99	0.06
34	110067	华安转债	1,739,189.18	0.05
35	113654	永 02 转债	1,706,898.95	0.05
36	127068	顺博转债	1,642,586.30	0.05
37	128087	孚日转债	1,612,089.04	0.05
38	123153	英力转债	1,560,060.90	0.05
39	113530	大丰转债	1,516,144.63	0.05
40	113566	翔港转债	1,472,138.63	0.05
41	113649	丰山转债	1,450,768.70	0.05
42	123059	银信转债	1,360,064.38	0.04
43	111011	冠盛转债	1,358,581.92	0.04
44	111008	沿浦转债	1,299,619.45	0.04
45	113066	平煤转债	1,269,172.33	0.04
46	118028	会通转债	1,254,166.03	0.04
47	123100	朗科转债	1,229,299.27	0.04
48	113600	新星转债	1,222,310.96	0.04
49	113662	豪能转债	1,200,138.36	0.04
50	123090	三诺转债	1,196,324.66	0.04

51	127081	中旗转债	1,170,174.28	0.04
52	123179	立高转债	1,160,767.67	0.04
53	127062	垒知转债	1,155,043.56	0.04
54	111009	盛泰转债	1,101,456.71	0.03
55	127034	绿茵转债	1,080,075.34	0.03
56	128076	金轮转债	1,056,058.08	0.03
57	123138	丝路转债	1,055,974.36	0.03
58	123142	申昊转债	1,050,623.01	0.03
59	128101	联创转债	1,001,793.97	0.03
60	113064	东材转债	987,606.86	0.03
61	128074	游族转债	949,532.49	0.03
62	127045	牧原转债	940,165.26	0.03
63	110061	川投转债	897,926.03	0.03
64	113656	嘉诚转债	806,234.11	0.03
65	123173	恒锋转债	701,456.85	0.02
66	123054	思特转债	694,529.04	0.02
67	113634	珀莱转债	686,477.40	0.02
68	123164	法本转债	685,012.33	0.02
69	127039	北港转债	635,930.14	0.02
70	113524	奇精转债	631,890.27	0.02
71	113504	艾华转债	631,568.49	0.02
72	118033	华特转债	626,187.81	0.02
73	113527	维格转债	625,529.45	0.02
74	113577	春秋转债	624,944.52	0.02
75	128134	鸿路转债	620,762.33	0.02
76	127078	优彩转债	615,425.62	0.02
77	113047	旗滨转债	599,000.68	0.02
78	127041	弘亚转债	589,037.67	0.02
79	118025	奕瑞转债	588,849.59	0.02
80	123168	惠云转债	584,067.67	0.02
81	110092	三房转债	575,031.10	0.02
82	128122	兴森转债	418,710.41	0.01
83	118012	微芯转债	376,367.18	0.01
84	113563	柳药转债	375,684.66	0.01
85	123119	康泰转 2	368,672.88	0.01
86	113042	上银转债	327,205.89	0.01

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	平安添利债券 A	平安添利债券 C
报告期期初基金份额总额	2,657,816,516.84	347,626,545.64
报告期期间基金总申购份额	676,263,755.00	72,427,405.08
减：报告期期间基金总赎回份额	710,662,471.05	127,722,014.30
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	2,623,417,800.79	292,331,936.42

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023/07/01-2023/09/04	627,358,327.22	-	367,157,747.10	260,200,580.12	8.92
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量

赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

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) 中国证监会核准平安添利债券型证券投资基金募集的文件
- (2) 平安添利债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安添利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

2023 年 10 月 24 日