

平安添利债券型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 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：2024 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 2024 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 2024 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	4,870,146,553.25 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	4,333,236,098.72 份	536,910,454.53 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 7 月 1 日-2024 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	18,118,254.85	2,291,532.13
2. 本期利润	-30,767,282.20	-5,810,403.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0066	-0.0076
4. 期末基金资产净值	4,865,298,333.00	601,943,410.94
5. 期末基金份额净值	1.1228	1.1211

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	-0.55%	0.08%	1.24%	0.12%	-1.79%	-0.04%
过去六个月	1.31%	0.08%	3.19%	0.11%	-1.88%	-0.03%
过去一年	4.17%	0.07%	7.13%	0.09%	-2.96%	-0.02%
过去三年	9.04%	0.08%	16.57%	0.07%	-7.53%	0.01%
过去五年	19.09%	0.08%	26.83%	0.07%	-7.74%	0.01%
自基金合同生效起至今	85.32%	0.21%	73.71%	0.08%	11.61%	0.13%

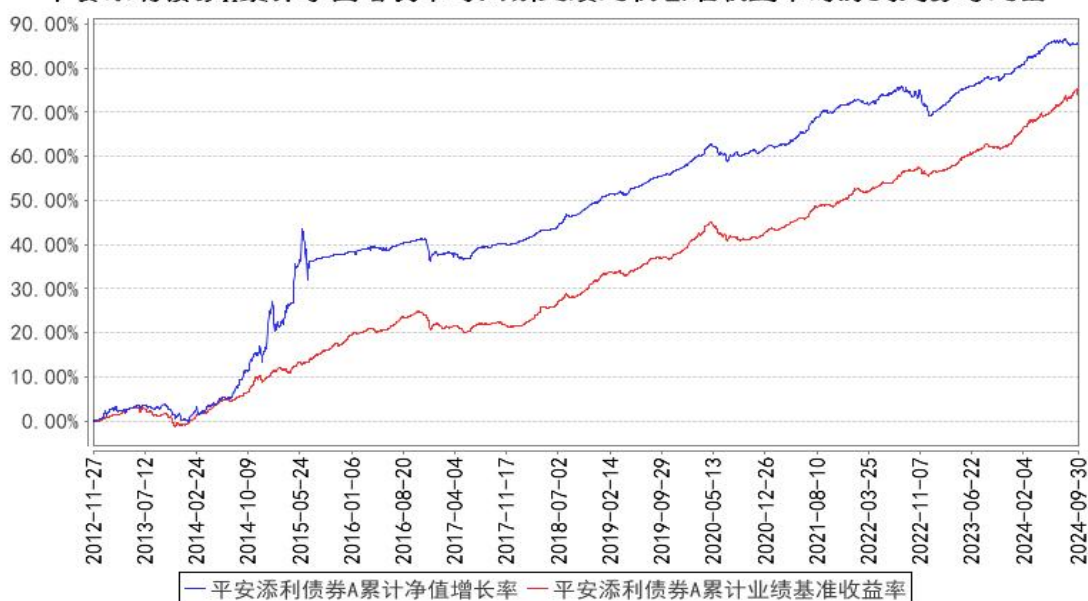
平安添利债券 C

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	-0.66%	0.08%	1.24%	0.12%	-1.90%	-0.04%
过去六个月	1.09%	0.08%	3.19%	0.11%	-2.10%	-0.03%

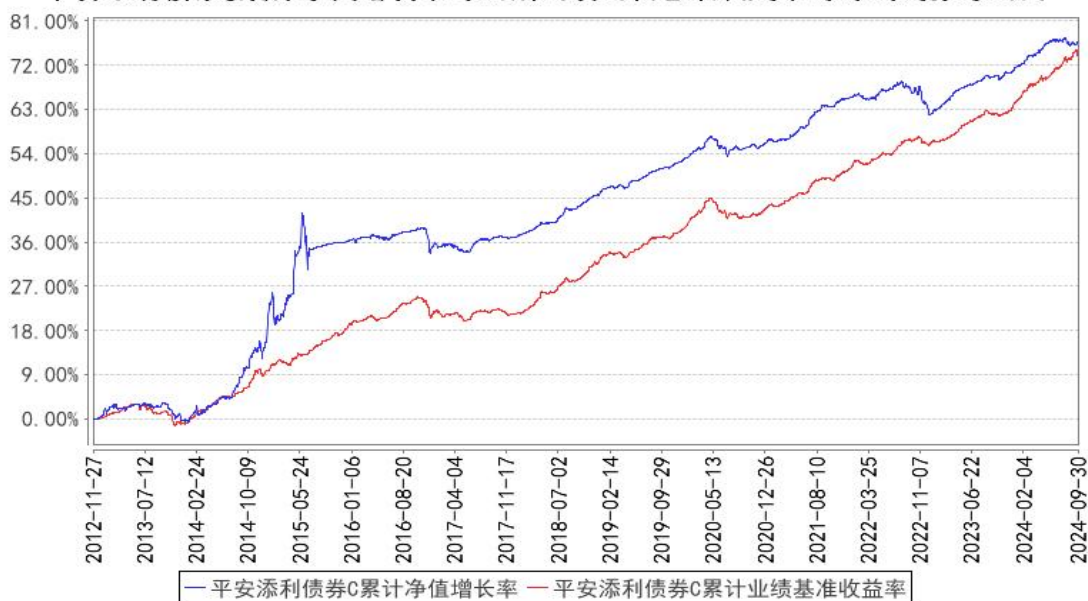
过去一年	3.75%	0.07%	7.13%	0.09%	-3.38%	-0.02%
过去三年	7.71%	0.08%	16.57%	0.07%	-8.86%	0.01%
过去五年	16.71%	0.08%	26.83%	0.07%	-10.12%	0.01%
自基金合同生效起至今	76.18%	0.21%	73.71%	0.08%	2.47%	0.13%

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	-	13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、平安添润债券型证券投资基金、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

报告期内，“三中”全会及随后的政治局工作会议传递出稳增长信号，后期配套政策渐进推出，但对经济的刺激效果有限。国内宏观数据显示内需持续向弱，同时面临贸易摩擦加剧的外部环境，企业盈利能力普遍下滑，信心严重不足。季末，政策出现明显转折，金融部委在金融支持经济高质量发展发布会上宣布了量化宽松及支持资本市场创新工具，同时中央政治局节前召开了经济工作会议，强调加大财政货币政策逆周期调节力度，促进房地产市场止跌回稳，努力提振资本市场，大力引导中长期资金入市。受政策利好刺激，资本市场出现较大波动。债券市场在政策转折前整体收益率水平下行，利率表现强于信用，期间虽有央行进场买卖国债的影响，但随着央行降息和广谱利率下调预期的增强，长端、超长端利率债创出年内新低。在政策转折后，出现股债翘翘板效应，债券收益率大幅度上行，报告期内信用债收益率水平整体甚至最终出现了上行的局面。权益市场则先抑后扬，前期出现了持续性的回调，于节前一周出现了大幅上涨的系统性反弹行情。在此期间红利股前期受到业绩的影响，后期则受到风格影响，整体收益相对偏弱，其余板块均强势反弹。转债市场前期出现相对于权益市场的超调，表面看是信用资质和赎回的冲击，但根本原因仍是权益市场走弱所导致。季末跟随权益市场大幅反弹。

报告期内，转债仓位整体有所下降，债券部分主要以信用债持仓为主，利率债阶段性参与长端波段机会，同时在 30 年期国债触及新低后整体降低了久期和杠杆。

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 1.1228 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.24%；截至本报告期末平安添利债券 C 的基金份额净值 1.1211 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.66%，同期业绩比较基准收益率为 1.24%。

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	7,002,698,033.52	98.58
	其中：债券	7,002,698,033.52	98.58
	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	39,890,490.00	0.56
8	其他资产	61,323,196.68	0.86
9	合计	7,103,911,720.20	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	102,823,760.00	1.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	809,338,686.40	14.80

	其中：政策性金融债	335,821,839.41	6.14
4	企业债券	1,078,980,457.08	19.74
5	企业短期融资券	15,226,882.19	0.28
6	中期票据	4,593,088,452.20	84.01
7	可转债（可交换债）	345,410,707.93	6.32
8	同业存单	-	-
9	其他	57,829,087.72	1.06
10	合计	7,002,698,033.52	128.08

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	102481609	24 晋能煤业 MTN007	1,150,000	116,460,563.01	2.13
2	102383306	23 晋能煤业 MTN011	1,085,000	114,229,096.45	2.09
3	102483184	24 京住总集 MTN002	1,100,000	109,834,795.07	2.01
4	220202	22 国开 02	1,040,000	105,908,385.75	1.94
5	240011	24 付息国债 11	1,000,000	101,815,733.70	1.86

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

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	86,255.59
2	应收证券清算款	59,271,027.47
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,965,913.62
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	61,323,196.68

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	113065	齐鲁转债	19,052,758.17	0.35
2	113055	成银转债	8,224,793.61	0.15
3	111016	神通转债	7,635,291.37	0.14
4	123185	能辉转债	7,451,826.34	0.14
5	118028	会通转债	7,404,679.15	0.14
6	127101	豪鹏转债	6,239,339.35	0.11
7	123076	强力转债	6,107,564.89	0.11
8	123218	宏昌转债	6,098,328.67	0.11
9	118031	天 23 转债	5,843,878.86	0.11
10	111004	明新转债	5,763,503.54	0.11
11	128137	洁美转债	5,710,518.75	0.10
12	123182	广联转债	5,660,916.38	0.10
13	123176	精测转 2	5,389,712.73	0.10
14	127053	豪美转债	5,305,885.82	0.10
15	132026	G 三峡 EB2	5,260,484.04	0.10
16	123228	震裕转债	5,107,029.39	0.09
17	127100	神码转债	5,091,762.47	0.09

18	111018	华康转债	5,040,432.38	0.09
19	127052	西子转债	4,993,977.78	0.09
20	113662	豪能转债	4,993,411.07	0.09
21	113681	镇洋转债	4,925,615.57	0.09
22	111008	沿浦转债	4,876,010.25	0.09
23	113050	南银转债	4,746,585.11	0.09
24	113641	华友转债	4,491,040.64	0.08
25	123217	富仕转债	4,202,809.61	0.08
26	123101	拓斯转债	4,135,588.21	0.08
27	113069	博 23 转债	4,107,430.11	0.08
28	127088	赫达转债	4,089,242.00	0.07
29	123184	天阳转债	4,001,348.56	0.07
30	127090	兴瑞转债	3,961,768.51	0.07
31	113678	中贝转债	3,910,108.73	0.07
32	123213	天源转债	3,896,709.18	0.07
33	127078	优彩转债	3,829,151.37	0.07
34	123145	药石转债	3,774,782.50	0.07
35	113668	鹿山转债	3,370,862.88	0.06
36	118039	煜邦转债	3,312,144.88	0.06
37	113639	华正转债	3,281,337.98	0.06
38	123237	佳禾转债	3,249,461.92	0.06
39	118009	华锐转债	3,243,805.15	0.06
40	123087	明电转债	3,171,128.31	0.06
41	118037	上声转债	3,164,255.18	0.06
42	118043	福立转债	3,137,886.60	0.06
43	123177	测绘转债	3,127,354.88	0.06
44	118036	力合转债	3,123,630.77	0.06
45	123226	中富转债	3,114,743.58	0.06
46	118012	微芯转债	3,113,926.08	0.06
47	118013	道通转债	3,085,608.93	0.06
48	123159	崧盛转债	3,029,558.90	0.06
49	113664	大元转债	3,020,113.01	0.06
50	127095	广泰转债	2,993,045.72	0.05
51	118034	晶能转债	2,966,473.68	0.05
52	123231	信测转债	2,902,947.41	0.05
53	111013	新港转债	2,902,074.66	0.05
54	127071	天箭转债	2,847,538.34	0.05
55	113653	永 22 转债	2,758,897.87	0.05
56	113060	浙 22 转债	2,754,091.77	0.05
57	123225	翔丰转债	2,700,163.46	0.05
58	113673	岱美转债	2,625,678.04	0.05
59	127087	星帅转 2	2,582,283.49	0.05

60	110085	通 22 转债	2,574,450.00	0.05
61	123221	力诺转债	2,558,886.33	0.05
62	127074	麦米转 2	2,409,336.99	0.04
63	123114	三角转债	2,405,538.93	0.04
64	123143	胜蓝转债	2,402,553.40	0.04
65	113634	珀莱转债	2,402,016.35	0.04
66	111011	冠盛转债	2,329,803.11	0.04
67	127072	博实转债	2,258,285.98	0.04
68	123174	精锻转债	2,246,039.54	0.04
69	123172	漱玉转债	2,181,372.41	0.04
70	113066	平煤转债	2,061,759.92	0.04
71	123178	花园转债	2,052,196.77	0.04
72	123168	惠云转债	1,979,505.58	0.04
73	113064	东材转债	1,972,522.53	0.04
74	113061	拓普转债	1,887,864.28	0.03
75	118011	银微转债	1,833,723.36	0.03
76	123229	艾录转债	1,800,603.51	0.03
77	127064	杭氧转债	1,799,003.03	0.03
78	123203	明电转 02	1,795,615.62	0.03
79	123197	光力转债	1,739,912.22	0.03
80	128136	立讯转债	1,717,437.09	0.03
81	127093	章鼓转债	1,700,419.23	0.03
82	123165	回天转债	1,691,516.77	0.03
83	110075	南航转债	1,659,257.67	0.03
84	118044	赛特转债	1,639,450.75	0.03
85	123210	信服转债	1,607,599.22	0.03
86	123152	润禾转债	1,558,799.88	0.03
87	123219	宇瞳转债	1,368,527.71	0.03
88	113628	晨丰转债	1,366,887.67	0.03
89	123222	博俊转债	1,354,911.19	0.02
90	127081	中旗转债	1,322,288.44	0.02
91	113546	迪贝转债	1,290,335.62	0.02
92	113577	春秋转债	1,270,615.07	0.02
93	123120	隆华转债	1,260,283.65	0.02
94	113621	彤程转债	1,213,529.15	0.02
95	123113	仙乐转债	1,168,024.53	0.02
96	118025	奕瑞转债	1,127,298.36	0.02
97	123235	亿田转债	1,111,132.84	0.02
98	127094	红墙转债	1,048,181.49	0.02
99	123205	大叶转债	677,664.69	0.01
100	127056	中特转债	643,620.16	0.01
101	113631	皖天转债	642,500.14	0.01

102	127097	三羊转债	625,517.81	0.01
103	113669	景 23 转债	597,074.57	0.01
104	128129	青农转债	524,663.38	0.01
105	111005	富春转债	94,625.09	0.00
106	111014	李子转债	33,143.32	0.00
107	111017	蓝天转债	6,082.46	0.00
108	113648	巨星转债	2,187.17	0.00
109	123227	雅创转债	1,264.98	0.00
110	123107	温氏转债	1,230.92	0.00
111	127105	龙星转债	819.97	0.00
112	123100	朗科转债	115.25	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：本基金本报告期末未持有股票。

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	4,495,224,356.82	1,024,263,746.14
报告期期间基金总申购份额	751,672,640.52	153,946,987.99
减：报告期期间基金总赎回份额	913,660,898.62	641,300,279.60
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	4,333,236,098.72	536,910,454.53

§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

2024 年 10 月 24 日