平安添裕债券型证券投资基金
2021年第4季度报告

2021年12月31日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2022年1月21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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 01 月 20 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 2021 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安添裕债券	
基金主代码	008726	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 17 日	
报告期末基金份额总额	143,430,249.04 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	1、资产配置策略；2、债券投资策略：（1）组合久期配置策略；（2）类属资产配置策略；（3）息差策略；（4）个券选择策略；3、股票投资策略；4、现金头寸管理；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、可转换债券及可交换债券投资策略；8、信用衍生品投资策略	
业绩比较基准	中债综合指数收益率╳90%+沪深 300 指数收益率╳10%	
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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安添裕债券 A	平安添裕债券 C
下属分级基金的交易代码	008726	008727
报告期末下属分级基金的份额总额	139,774,136.05 份	3,656,112.99 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（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）	
	平安添裕债券 A	平安添裕债券 C
1.本期已实现收益	3,283,260.32	61,101.99
2.本期利润	2,967,630.90	50,700.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0179	0.0147
4.期末基金资产净值	151,117,051.99	3,928,545.27
5.期末基金份额净值	1.0812	1.0745

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

平安添裕债券 A

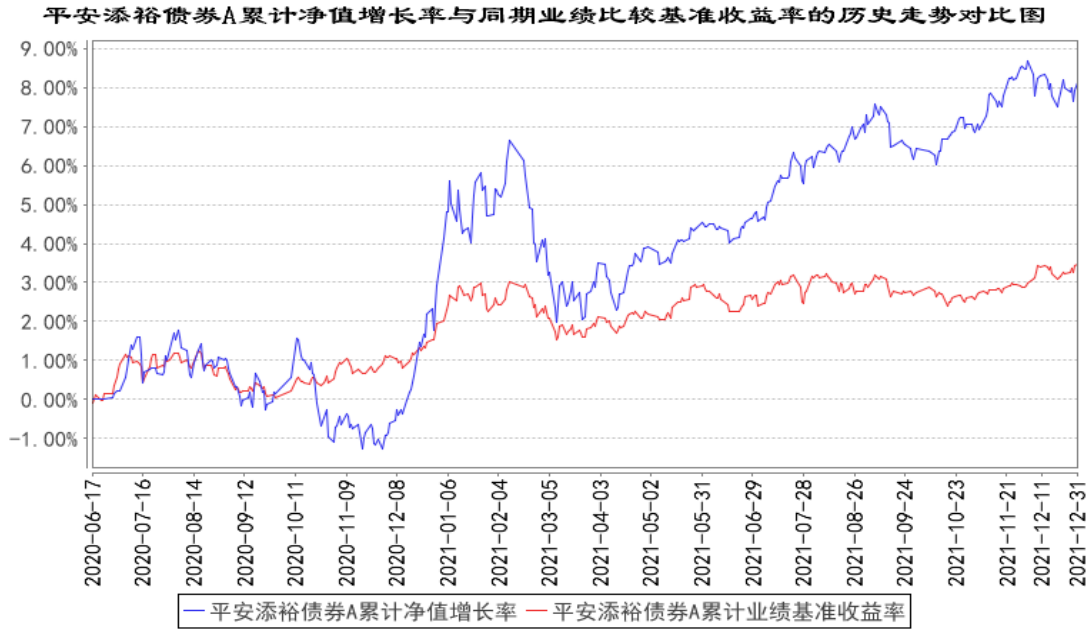
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.59%	0.19%	0.71%	0.09%	0.88%	0.10%
过去六个月	3.18%	0.19%	0.79%	0.11%	2.39%	0.08%
过去一年	5.07%	0.28%	1.50%	0.13%	3.57%	0.15%
自基金合同生效起至今	8.12%	0.28%	3.48%	0.13%	4.64%	0.15%

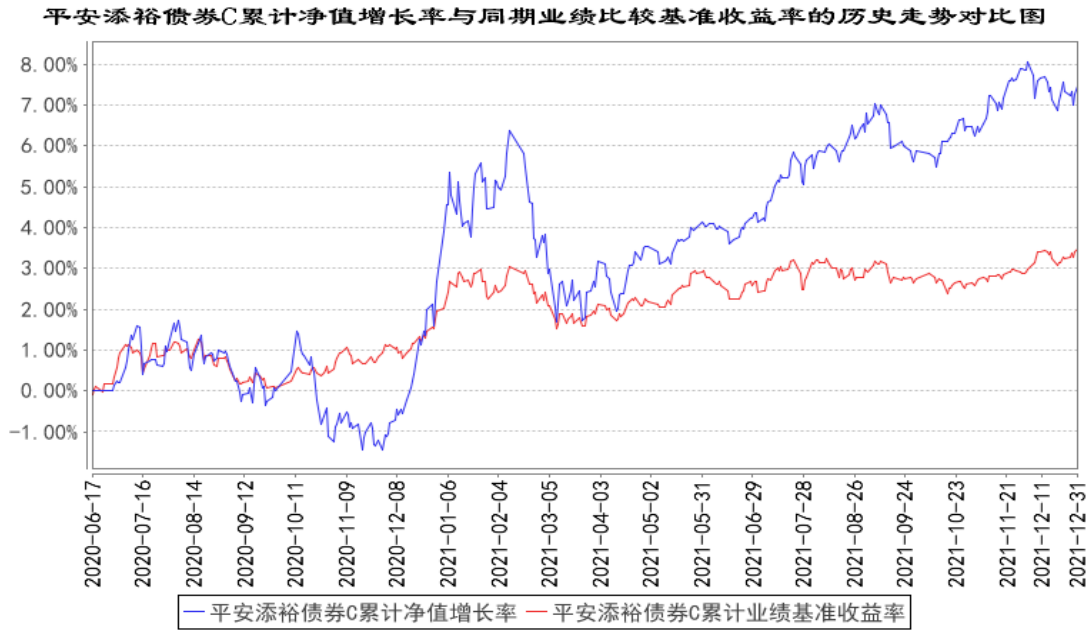
平安添裕债券 C

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	1.47%	0.19%	0.71%	0.09%	0.76%	0.10%
过去六个月	2.96%	0.20%	0.79%	0.11%	2.17%	0.09%
过去一年	4.65%	0.28%	1.50%	0.13%	3.15%	0.15%

自基金合同生效起至今	7.45%	0.28%	3.48%	0.13%	3.97%	0.15%

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





注：1、本基金合同于 2020 年 06 月 17 日生效；

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合同约定。

§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		
韩克	平安添裕债券型证券投资基金基金经理	2020 年 6 月 17 日	-	10 年	韩克先生，浙江大学金融学硕士。曾先后担任南方基金管理有限公司债券交易员、研究员、投资经理助理。2019 年 6 月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心投资经理。现担任平安可转债债券型证券投资基金、平安合颖定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠智纯债债券型证券投资基金、平安添裕债券型证券投资基金、平安恒泽混合型证券投资基金、平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金、平安瑞尚六个月持有期混合型证券投资基金、平安安享灵活配置混合型证券投资基金、平安估值优势灵活配置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

第 4 季度国内经济下行压力加大，房地产行业受整体政策影响，下行压力逐步体现，对经济的拖累较为明显。受此影响，央行的货币政策逐步趋于宽松，四季度进一步进行了降准操作，在此基础上，债券市场有较为明显涨幅，4 季度纯债录得较好表现。权益方面，第 4 季度在 PPI 逐步见顶的背景下，高景气行业表现出现分化，而一些增速稳定的行业，如消费等，经过前三季度的估值消化，4 季度表现较好。本基金债券部分的投资策略，在第 4 季度积极参与债券市场的投资机会，期间保持较长的组合久期，使债券部分处于相对进攻状态。权益部分的投资策略，在行业和个股充分分散化的原则基础上，选股兼顾行业景气度以及估值、公司质地三方面，并且在四季度，加大了对部分周期行业底部附近的配置以及适当降低了一些景气高点行业的个股配置权重。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安添裕债券 A 的基金份额净值 1.0812 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.59%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%；截至本报告期末平安添裕债券 C 的基金份额净值 1.0745 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.47%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%。

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	29,427,348.94	13.64
	其中：股票	29,427,348.94	13.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	172,727,028.45	80.04
	其中：债券	172,727,028.45	80.04
	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	11,012,566.86	5.10
8	其他资产	2,646,912.73	1.23
9	合计	215,813,856.98	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	-	-
C	制造业	21,581,120.54	13.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	429,831.00	0.28
E	建筑业	445,208.00	0.29
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	888,705.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	545,292.00	0.35
J	金融业	5,537,192.40	3.57
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	29,427,348.94	18.98

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	002142	宁波银行	46,830	1,792,652.40	1.16
2	600036	招商银行	36,000	1,753,560.00	1.13
3	601166	兴业银行	80,400	1,530,816.00	0.99
4	300207	欣旺达	27,400	1,155,184.00	0.75
5	688599	天合光能	12,388	977,413.20	0.63
6	688301	奕瑞科技	1,957	972,433.30	0.63
7	600029	南方航空	130,500	888,705.00	0.57
8	002311	海大集团	11,300	828,290.00	0.53
9	600519	贵州茅台	400	820,000.00	0.53
10	002886	沃特股份	25,500	786,420.00	0.51

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	6,231,000.00	4.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	28,759,200.00	18.55
	其中：政策性金融债	10,009,000.00	6.46
4	企业债券	39,801,150.00	25.67
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	68,208,380.00	43.99
7	可转债（可交换债）	9,391,298.45	6.06
8	同业存单	-	-
9	其他	20,336,000.00	13.12
10	合计	172,727,028.45	111.40

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	101900578	19 西宁城投 MTN002	150,000	14,455,500.00	9.32
2	2128016	21 民生银行永续债 01	140,000	13,843,200.00	8.93
3	2180198	21 宜昌城控债	100,000	10,474,000.00	6.76
4	2128032	21 兴业银行二级 01	100,000	10,200,000.00	6.58
5	102101710	21 物产中大 MTN002	100,000	10,175,000.00	6.56

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

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日做出银保监罚决字〔2021〕11 号，由于中国银行股份有限公司：向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款、违规向关系人发放信用贷款、向无资金缺口企业发放流动资金贷款、存款月末冲时点、为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票等。根据相关规定对公司罚款 8761.355 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 7 月 13 日作出银保监罚决字〔2021〕26 号决定，由于中国民生银行股份有限公司逾期未履行行政义务，内部制度不完善，违规经营等，根据相关规定罚款 11450 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 7 月 13 日作出银保监罚决字〔2021〕31 号决定，由于中国进出口银行违规经营，罚没 7345.6 万元。

中国人民银行于 2021 年 8 月 13 日作出银罚字〔2021〕26 号处罚决定，由于兴业银行股份有限公司违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定。根据相关规定对公司处以罚款 5 万元。

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本

报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	62,367.13
2	应收证券清算款	300,529.16
3	应收股利	-
4	应收利息	2,283,047.41
5	应收申购款	969.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,646,912.73

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	110076	华海转债	791,481.60	0.51
2	110063	鹰 19 转债	536,644.80	0.35
3	128072	翔鹭转债	526,114.00	0.34
4	128134	鸿路转债	511,193.10	0.33
5	128107	交科转债	505,036.80	0.33
6	113047	旗滨转债	477,344.00	0.31
7	127033	中装转 2	466,488.00	0.30
8	128037	岩土转债	457,760.00	0.30
9	128096	奥瑞转债	417,778.90	0.27
10	113591	胜达转债	401,636.00	0.26
11	110061	川投转债	398,992.50	0.26
12	113623	凤 21 转债	373,833.90	0.24
13	127018	本钢转债	328,512.60	0.21
14	128120	联诚转债	316,883.20	0.20
15	128143	锋龙转债	314,188.00	0.20
16	113504	艾华转债	239,695.60	0.15
17	123023	迪森转债	236,240.80	0.15

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	平安添裕债券 A	平安添裕债券 C
报告期期初基金份额总额	191,991,926.46	3,433,661.85
报告期期间基金总申购份额	24,632,094.34	1,078,172.49
减:报告期期间基金总赎回份额	76,849,884.75	855,721.35
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	139,774,136.05	3,656,112.99

§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添裕债券型证券投资基金募集注册的文件

（2）平安添裕债券型证券投资基金基金合同

（3）平安添裕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

基金管理人、基金托管人住所

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：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2022 年 1 月 21 日