

平安添利债券型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 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：2022 年 10 月 25 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 2022 年 10 月 24 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 2022 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	7,365,332,470.47 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	6,990,713,331.38 份	374,619,139.09 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 7 月 1 日-2022 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	-15,857,810.71	-1,197,386.66
2. 本期利润	-29,059,134.25	-1,734,901.95
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0035	-0.0052
4. 期末基金资产净值	7,440,511,420.01	398,295,945.73
5. 期末基金份额净值	1.0643	1.0632

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	-0.43%	0.11%	1.70%	0.06%	-2.13%	0.05%
过去六个月	0.94%	0.10%	2.82%	0.06%	-1.88%	0.04%
过去一年	2.12%	0.08%	5.05%	0.06%	-2.93%	0.02%
过去三年	11.53%	0.07%	14.29%	0.07%	-2.76%	0.00%
过去五年	23.97%	0.06%	27.99%	0.07%	-4.02%	-0.01%
自基金合同生效起至今	73.55%	0.23%	56.54%	0.08%	17.01%	0.15%

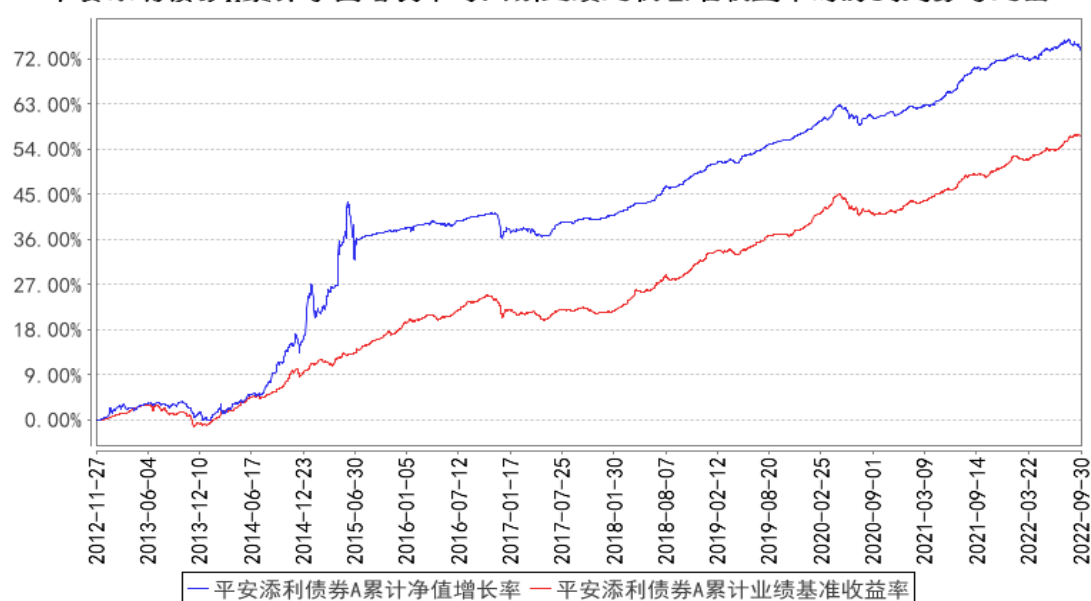
平安添利债券 C

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	-0.53%	0.11%	1.70%	0.06%	-2.23%	0.05%
过去六个月	0.74%	0.10%	2.82%	0.06%	-2.08%	0.04%

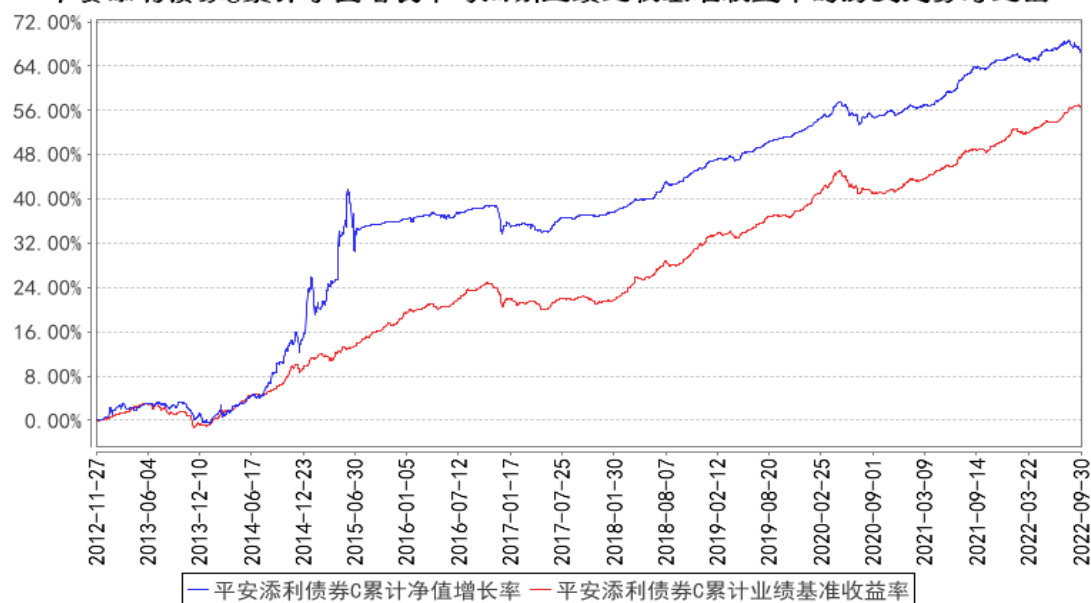
过去一年	1.70%	0.08%	5.05%	0.06%	-3.35%	0.02%
过去三年	10.19%	0.07%	14.29%	0.07%	-4.10%	0.00%
过去五年	21.42%	0.06%	27.99%	0.07%	-6.57%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	66.34%	0.23%	56.54%	0.08%	9.80%	0.15%

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

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		
张文平	公司总经理助理兼固定收益投资总监，平安添利债券型证券投资基金基金经理	2020 年 8 月 20 日	-	11 年	张文平先生，南京大学硕士。先后担任毕马威(中国)企业咨询有限公司南京分公司审计一部审计师、大成基金管理有限公司固定收益部基金经理。2018 年 3 月加入平安基金管理有限公司，现任公司总经理助理兼固定收益投资总监。同时担任平安如意中短债债券型证券投资基金、平安季享裕三个月定期开放债券型证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安季开鑫三个月定期开放债券型证券投资基金、平安双季增享 6 个月持有期债券型证券投资基金、平安惠铭纯债债券型证券投资基金、平安惠澜纯债债券型证券投资基金、平安双季盈 6 个月持有期债券型证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金基金经理。
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	-	11 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 3-5 年期政策性金融债债券型证券投资基金、平安双债添益债券型证券投资基金、平安合享 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、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

三季度，债市表现较好，收益率总体出现下行。7 月、8 月债市收益率逐步下行，资金利率处于较低水平，公开市场操作利率下调进一步推动现券收益率回落。9 月份经济增速边际好转，且海外央行鹰派加息影响市场预期，市场出现震荡调整。权益市场在美联储持续加息预期和地缘政治风险发酵等影响下，三季度以来持续调整，其中前期反弹较多的成长板块跌幅较多，转债指数跟随权益也出现下跌。

三季度本基金纯债部分主要配置高等级信用债获取票息收益，同时 7-8 月通过长久期利率债提高久期获取资本利得收益。转债部分仓位三季度有一定的下降，同时调整了转债的持仓结构，

降低偏股性转债的比例，提高平衡性转债和低价券的比例。

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 1.0643 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.43%，同期业绩比较基准收益率为 1.70%；截至本报告期末平安添利债券 C 的基金份额净值 1.0632 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.53%，同期业绩比较基准收益率为 1.70%。

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	8,678,862,994.61	98.59
	其中：债券	8,678,862,994.61	98.59
	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	62,135,975.27	0.71
8	其他资产	61,850,721.94	0.70
9	合计	8,802,849,691.82	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	340,511,637.66	4.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	576,546,118.91	7.36
	其中：政策性金融债	380,850,646.58	4.86
4	企业债券	1,812,781,217.39	23.13
5	企业短期融资券	420,197,939.72	5.36
6	中期票据	4,263,181,988.72	54.39
7	可转债（可交换债）	493,403,259.88	6.29
8	同业存单	-	-
9	其他	772,240,832.33	9.85
10	合计	8,678,862,994.61	110.72

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	1728023	17 民生银行二级 02	3,200,000	333,639,101.37	4.26
2	229946	22 贴现国债 46	3,000,000	299,275,747.25	3.82
3	2028022	20 民生银行二级	2,700,000	272,923,027.40	3.48
4	102002196	20 陕延油 MTN005	2,100,000	223,966,265.75	2.86
5	012283157	22 越秀集团 SCP013	2,000,000	200,132,054.79	2.55

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 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）20 号处罚决定，由于民生银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、未报送贸易融资业务 EAST 数据；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、债券投资业务 EAST 数据存在偏差；五、未报送权益类投资业务 EAST 数据；六、未报送公募基金投资业务 EAST 数据；七、未报送其他担保类业务 EAST 数据；八、未报送不可无条件撤销的贷款承诺业务 EAST 数据；九、漏报委托贷款业务 EAST 数据；十、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；十一、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十二、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十三、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、报送不实数据；十六、面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对中国民生银行股份有限公司罚款 490 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字（2022）8 号处罚决定，由于国家开发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差；五、未报送债券投资业务 EAST 数据；六、漏报权益类投资业务 EAST 数据；七、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；八、漏报保函业务 EAST 数据；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、漏报授信信息 EAST 数据；十三、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、EAST 系统《关联关系》表漏报；十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报；十七、理财产品登记不规范，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对国家开发银行罚款 440 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

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	232,769.11
2	应收证券清算款	61,445,943.35
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	172,009.48
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	61,850,721.94

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	110085	通 22 转债	81,742,170.48	1.04
2	110080	东湖转债	65,145,036.35	0.83
3	127012	招路转债	50,897,204.60	0.65
4	123107	温氏转债	31,844,351.74	0.41
5	111000	起帆转债	31,665,863.31	0.40
6	123108	乐普转 2	29,390,394.76	0.37
7	113629	泉峰转债	27,874,326.14	0.36
8	128037	岩土转债	22,566,727.73	0.29
9	110056	亨通转债	21,804,447.33	0.28
10	123121	帝尔转债	17,738,776.35	0.23
11	127055	精装转债	17,078,584.33	0.22
12	128087	孚日转债	15,949,316.17	0.20
13	127037	银轮转债	12,458,034.69	0.16
14	123120	隆华转债	9,061,900.76	0.12
15	113027	华钰转债	8,917,795.80	0.11
16	113534	鼎胜转债	7,875,990.55	0.10
17	123133	佩蒂转债	7,857,299.32	0.10
18	113025	明泰转债	7,676,623.34	0.10

19	113636	甬金转债	7,439,076.08	0.09
20	127014	北方转债	6,701,077.90	0.09

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	8,338,271,310.73	330,235,571.74
报告期期间基金总申购份额	738,862,486.87	119,523,280.98
减：报告期期间基金总赎回份额	2,086,420,466.22	75,139,713.63
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	6,990,713,331.38	374,619,139.09

§ 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	2022/07/01—2022/09/30	2,107,249,787.67	-	-	2,107,249,787.67	28.61
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

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 10 月 25 日