

平安双盈添益债券型证券投资基金

2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 04 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 2023 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安双盈添益债券	
基金主代码	016447	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 5 日	
报告期末基金份额总额	44,573,948.82 份	
投资目标	在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	1、资产配置策略；2、信用债投资策略；3、可转债及可交换债投资策略：（1）可转换债券投资策略，（2）可分离交易可转债投资策略，（3）可交换债券投资策略；4、普通债券投资策略；5、现金头寸管理；6、国债期货投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、信用衍生品投资策略。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×10%+中证综合债券指数收益率×80%+1 年期定期存款利率（税后）×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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安双盈添益债券 A	平安双盈添益债券 C
下属分级基金的交易代码	016447	016448
报告期末下属分级基金的份额总额	25,783,594.91 份	18,790,353.91 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 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）	
	平安双盈添益债券 A	平安双盈添益债券 C
1. 本期已实现收益	68,213.12	109,235.07
2. 本期利润	275,711.02	145,771.27
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0042
4. 期末基金资产净值	26,033,249.97	18,944,594.12
5. 期末基金份额净值	1.0097	1.0082

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

平安双盈添益债券 A

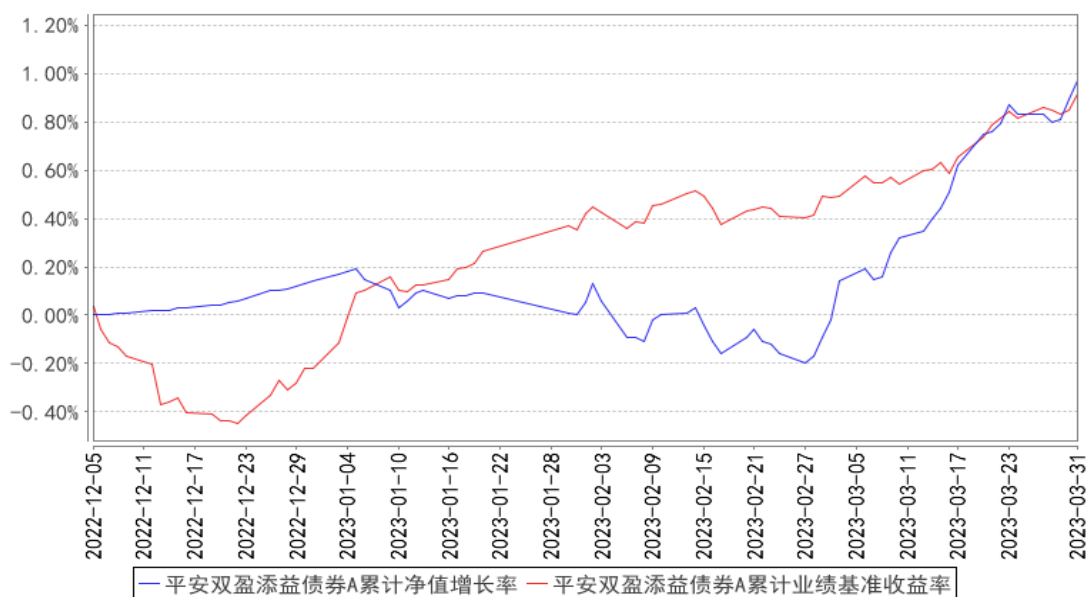
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.83%	0.06%	1.14%	0.04%	-0.31%	0.02%
自基金合同生效起至今	0.97%	0.05%	0.91%	0.05%	0.06%	0.00%

平安双盈添益债券 C

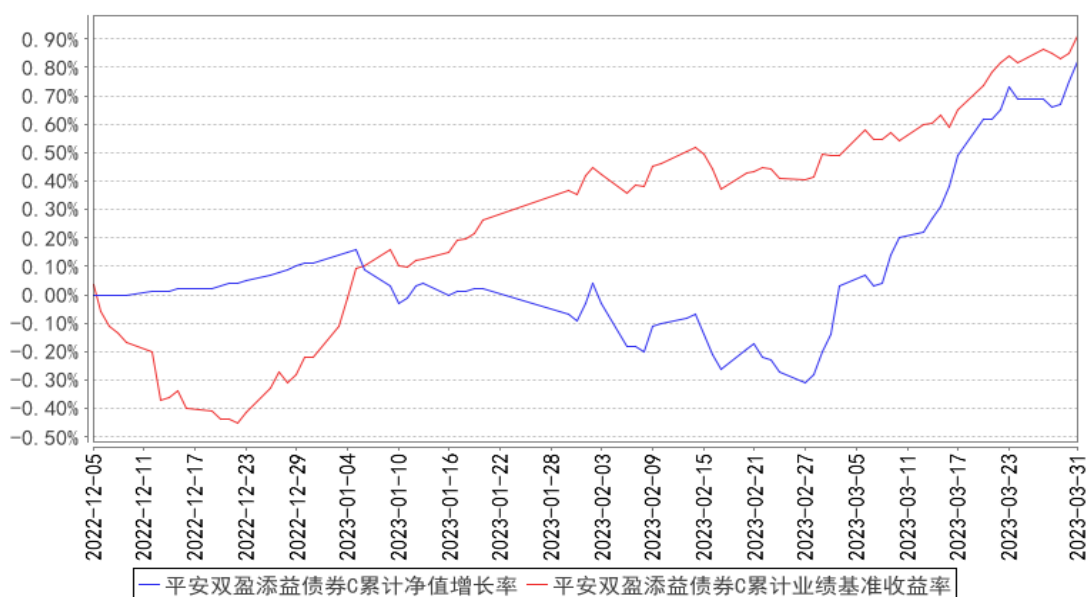
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.71%	0.06%	1.14%	0.04%	-0.43%	0.02%
自基金合同生效起至今	0.82%	0.05%	0.91%	0.05%	-0.09%	0.00%

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

平安双盈添益债券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



平安双盈添益债券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 2022 年 12 月 05 日正式生效，截至报告期末未满半年；

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		
高勇标	固定收益投资中心总监助理，平安双盈添益债券型证券投资基金基金经理	2022 年 12 月 5 日	-	12 年	高勇标先生，西南财经大学硕士。曾先后任职于国海证券股份有限公司自营分公司投资经理助理、深圳市尧山财富管理有限公司投资管理部副总经理、恒大人寿保险有限公司固定收益部投资经理。2017 年 4 月加入平安基金管理有限公司，曾任投资研究部固定收益组投资经理，现任固定收益投资中心总监助理，同时担任平安惠悦纯债债券型证券投资基金、平安中短债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、平安瑞兴一年定期开放混合型证券投资基金、平安合润 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠润纯债债券型证券投资基金、平安惠合纯债债券型证券投资基金、平安双盈添益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

2023 年开年经济数据总体亮眼但仍有瑕疵，消费报复性修复但工业生产恢复偏弱。通胀继续维持紧缩，证明经济内生的活力还未被彻底激活。复苏的方向是确定的，信贷开门红，总量结构都有改善。不过由于 1-2 月处于数据真空期，市场对宏观经济的预期也不断出现调整，并影响着债券市场的走势。年初随着疫情影响的淡化，市场预期经济“强复苏”；但春节之后，市场分歧加大，不少机构倾向于认为“强预期弱现实”；两会定调经济目标为 5%后，市场不再期待政策“强刺激”，再次调整了对复苏高度的判断，不过由于 2 月 PMI 数据亮眼，信贷放量，再加上新领导班子上台，市场似乎又对经济改善增加了一些信心。总体来看，一季度利率债收益率呈倒 V 型走势，信用债得益于流动性偏宽松，以及配置需求旺盛，收益率出现明显修复。

在此期间，本基金保持了投资组合的流动性，债券资产主要配置中短期限的中高等级信用债，波段操作高等级信用债和中长端利率债，重点参与了部分估值溢价率尚可的可转债标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安双盈添益债券 A 的基金份额净值 1.0097 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.83%，同期业绩比较基准收益率为 1.14%；截至本报告期末平安双盈添益债券 C 的基金份额净值 1.0082 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.71%，同期业绩比较基准收益率为 1.14%。

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 人的情形。本基金本报告期内出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末，以上情况未消除。

§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	42,129,458.60	73.34
	其中：债券	42,129,458.60	73.34
	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	15,312,243.26	26.66
8	其他资产	4,100.33	0.01
9	合计	57,445,802.19	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	3,021,008.22	6.72
	其中：政策性金融债	3,021,008.22	6.72
4	企业债券	23,388,793.70	52.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	8,061,868.85	17.92
7	可转债（可交换债）	7,657,787.83	17.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,129,458.60	93.67

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	138971	23 济城 G4	40,000	4,103,582.47	9.12
2	185783	22 陕煤 Y3	40,000	4,088,738.63	9.09

3	138960	23 穗高 Y2	40,000	4,067,519.34	9.04
4	102380410	23 江津华信 MTN001B	40,000	4,046,780.33	9.00
5	115048	23 渝富 02	40,000	4,038,612.16	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

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

上海市市场监督管理局于 2022 年 8 月 17 日作出沪市监总处（2022）322021000345 号处罚决定，由于上海浦东发展银行股份有限公司将奥林匹克标志用于广告宣传、商业展览、营业性演出以及其他商业活动中，根据相关规定给予合计 0.5 万元罚款的处罚。

国家外汇管理局上海市分局于 2022 年 9 月 2 日作出上海汇管罚字（2022）3111220601 号处罚决定，由于上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）1、违规办理远期结汇业务；2、违规办理期权交易；3、违规办理内保外贷业务；4、违规办理房产佣金收、结汇业务；5、结售汇统计数据错报，根据相关规定，责令公司改正，给予警告、并对其处以 933 万元人民币的罚款，

没收违法所得 334.69 万元人民币。

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，对公司的经营情况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	4,100.33
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	4,100.33

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	110059	浦发转债	2,568,335.14	5.71
2	113042	上银转债	2,115,162.22	4.70
3	113024	核建转债	349,992.02	0.78
4	113639	华正转债	295,950.69	0.66
5	110062	烽火转债	246,009.27	0.55
6	127030	盛虹转债	228,678.36	0.51
7	127058	科伦转债	227,811.98	0.51
8	113047	旗滨转债	226,798.35	0.50
9	113046	金田转债	171,605.93	0.38
10	127024	盈峰转债	165,390.45	0.37
11	132018	G 三峡 EB1	136,571.23	0.30
12	110045	海澜转债	121,196.49	0.27
13	127020	中金转债	118,821.58	0.26
14	113053	隆 22 转债	116,842.25	0.26
15	127028	英特转债	116,079.47	0.26
16	127038	国微转债	115,406.55	0.26

17	110053	苏银转债	115,026.00	0.26
18	113044	大秦转债	112,916.71	0.25
19	127039	北港转债	109,193.14	0.24

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	平安双盈添益债券 A	平安双盈添益债券 C
报告期期初基金份额总额	118,599,654.41	178,173,201.30
报告期期间基金总申购份额	25,315,085.24	4,004,270.11
减：报告期期间基金总赎回份额	118,131,144.74	163,387,117.50
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	25,783,594.91	18,790,353.91

§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

单位：份

项目	平安双盈添益债券 A	平安双盈添益债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	2,999,700.03
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	2,999,700.03
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	15.96

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2023-01-18	2,999,700.03	3,000,000.00	-
合计			2,999,700.03	3,000,000.00	

§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	2023/01/10--2023/01/18; 2023/02/15--2023/03/31	9,440,000.00	-	-	9,440,000.00	21.18
	2	2023/01/19--2023/03/31	-	24,980,015.99	-	24,980,015.99	56.04
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) 中国证监会准予平安双盈添益债券型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安双盈添益债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安双盈添益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

2023 年 4 月 21 日