

平安双盈添益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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	512,498,514.84 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	62,840,507.47 份	449,658,007.37 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）	
	平安双盈添益债券 A	平安双盈添益债券 C
1. 本期已实现收益	224, 979. 46	306, 758. 95
2. 本期利润	-54, 960. 34	-1, 890, 413. 52
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0010	-0. 0062
4. 期末基金资产净值	65, 127, 909. 92	464, 421, 113. 18
5. 期末基金份额净值	1. 0364	1. 0328

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

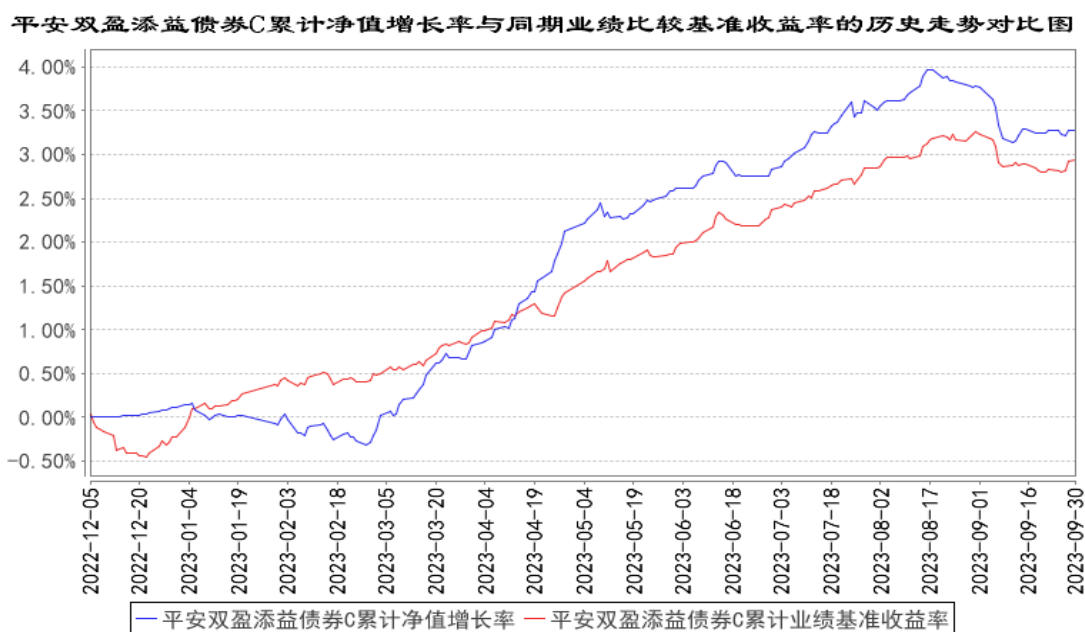
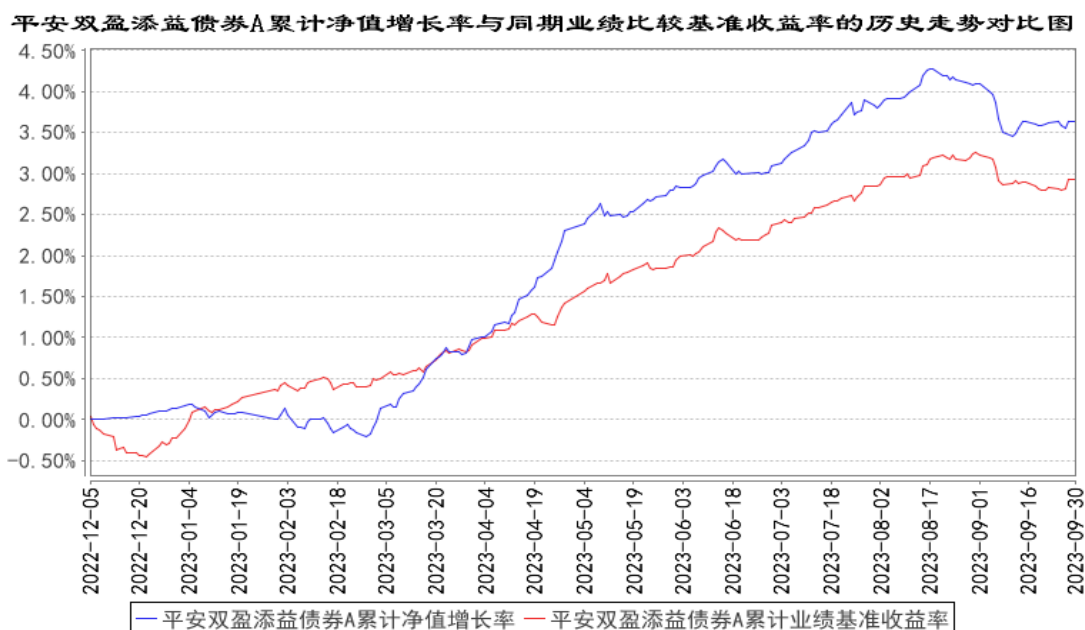
平安双盈添益债券 A

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. 53%	0. 06%	0. 54%	0. 04%	-0. 01%	0. 02%
过去六个月	2. 64%	0. 06%	2. 00%	0. 05%	0. 64%	0. 01%
自基金合同生效起至今	3. 64%	0. 06%	2. 93%	0. 05%	0. 71%	0. 01%

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. 44%	0. 06%	0. 54%	0. 04%	-0. 10%	0. 02%
过去六个月	2. 44%	0. 06%	2. 00%	0. 05%	0. 44%	0. 01%
自基金合同生效起至今	3. 28%	0. 06%	2. 93%	0. 05%	0. 35%	0. 01%

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率变动的比较



注：1、本基金基金合同于 2022 年 12 月 05 日正式生效，截至报告期末未满一年；

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	-	13 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、平安惠智纯债债券型证券投资基金基金经理。
陈浩宇	平安双盈添益债券型证券投资基金基金经理	2023 年 8 月 9 日	-	8 年	陈浩宇先生，兰州大学企业管理专业硕士研究生。曾担任深圳航空有限公司营销部市场分析师、鹏元资信评估有限公司债券评级部分析师、生命保险资产管理有限公司信用评估部研究员、安信基金管理有限责任公司投资经理。2023 年 1 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金、平安双盈添益债券型证券投资基金、平安鼎弘混合型证券投资基金 (LOF)、平安可转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

三季度宏观经济有所修复，其中 7、8 月经济内生动能走弱，9 月随着房地产优化政策密集出台，使得地产销售跌幅也有所收窄。在稳增长政策加码支持下，经济整体在小幅恢复。通胀方面，能源和食品价格低位震荡，物价整体表现平稳。货币政策方面，央行基本维持中性偏宽松基调，多次强调发挥好货币政策总量和结构双重功能，通过降准、降息和 MLF 加量方式向市场投放长期资金，使流动性保持相对宽松，并提出坚决防范汇率超调风险，释放稳汇率信号。总体来看，三季度债市收益率呈先下后上走势。具体来看，7 月由于经济基本面走弱，稳增长政策预期降温，叠加银行理财规模大幅增加，债市配置力量较强，收益率出现较大幅度下行；8 月公布的信贷、通胀和经济数据均低于市场预期，而稳增长政策仍然没有出台落地，债市收益率再度下行。其中央行于 8 月 15 日超预期降息，促使 10 年期国债快速下行至 2.54% 的年内低点；9 月随着房地产优化政策密集出台，市场预期和信心有所变化，地方债加大发行的同时，资金面边际收敛，导致债市收益率震荡上行。权益市场方面，三季度主要指数震荡下行，仅在 7 月末和 8 月末因政策利好出现两轮小幅反弹，但动能持续时间不长，9 月重新开始震荡下行。转债市场在三季度同样呈现震荡下行走势。

三季度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

段操作长端利率债和高等级信用债，小仓位参与了部分高信用等级的平衡型转债标的。

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 1.0364 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 0.54%；截至本报告期末平安双盈添益债券 C 的基金份额净值 1.0328 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.44%，同期业绩比较基准收益率为 0.54%。

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	639,678,982.38	95.03
	其中：债券	639,678,982.38	95.03
	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	17,377,556.08	2.58
8	其他资产	16,096,471.18	2.39
9	合计	673,153,009.64	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	6,525,582.46	1.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	116,187,277.73	21.94
	其中：政策性金融债	45,811,034.23	8.65
4	企业债券	282,089,225.46	53.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	179,356,216.47	33.87
7	可转债（可交换债）	16,441,317.64	3.10
8	同业存单	39,079,362.62	7.38
9	其他	-	-
10	合计	639,678,982.38	120.80

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	185157	21 铁投 Y1	400,000	40,893,041.10	7.72
2	2128013	21 交通银行小微债	400,000	40,839,191.26	7.71
3	210409	21 农发 09	400,000	40,082,373.63	7.57
4	112303205	23 农业银行 CD205	400,000	39,079,362.62	7.38
5	175379	20 建集 Y9	300,000	31,003,643.84	5.85

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

本基金以套期保值为目的开展国债期货投资，选择流动性好、交易活跃的主力合约进行交易。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
TL2312	TL2312	-2	-1,975,800.00	-10,400.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-10,400.00
国债期货投资本期收益（元）					469,725.32
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-10,400.00

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

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，中国农业银行股份有限公司、交通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。

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	135,811.18
2	应收证券清算款	13,062,515.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,898,144.16
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	16,096,471.18

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	113044	大秦转债	2,682,067.27	0.51
2	110061	川投转债	1,763,526.72	0.33
3	132018	G 三峡 EB1	1,473,017.81	0.28
4	127012	招路转债	1,341,333.71	0.25

5	127058	科伦转债	839,508.37	0.16
6	110048	福能转债	806,395.68	0.15
7	127030	盛虹转债	799,203.32	0.15
8	113024	核建转债	798,342.32	0.15
9	113021	中信转债	549,832.28	0.10
10	110062	烽火转债	548,500.57	0.10
11	127020	中金转债	538,245.60	0.10
12	113047	旗滨转债	533,110.61	0.10
13	110077	洪城转债	531,261.11	0.10
14	110045	海澜转债	526,559.14	0.10
15	110091	合力转债	414,155.94	0.08
16	123107	温氏转债	409,786.32	0.08
17	113061	拓普转债	277,870.45	0.05

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	32,826,636.39	86,434,346.31
报告期期间基金总申购份额	56,808,389.11	648,077,454.89
减：报告期期间基金总赎回份额	26,794,518.03	284,853,793.83
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	62,840,507.47	449,658,007.37

§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	-	2,999,700.03
报告期期间买入/申购总份额	-	-
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	-	0.67

份额比例（%）		
---------	--	--

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

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	2023/07/01--2023/07/11	24,980,015.99	-	-	24,980,015.99	4.87
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

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