

平安可转债债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告

2021 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 月 20 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 2021 年 04 月 19 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 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安可转债	
基金主代码	007032	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 8 月 7 日	
报告期末基金份额总额	21,677,933.31 份	
投资目标	本基金通过对可转债的积极投资，在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。	
业绩比较基准	70%×中证可转换债券指数收益率+20%×中债综合财富（总值）指数收益率+10%×沪深 300 指数收益率	
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，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，低于混合型基金、股票型基金。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。	
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	平安可转债 A	平安可转债 C
下属分级基金的交易代码	007032	007033

报告期末下属分级基金的份额总额	18,420,460.95 份	3,257,472.36 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 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日）	
	平安可转债 A	平安可转债 C
1. 本期已实现收益	376,908.09	32,849.37
2. 本期利润	-474,753.83	-91,681.62
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0250	-0.0313
4. 期末基金资产净值	21,097,169.71	3,706,624.47
5. 期末基金份额净值	1.1453	1.1379

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

平安可转债 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	-2.69%	1.00%	-0.36%	0.58%	-2.33%	0.42%
过去六个月	2.72%	0.81%	2.99%	0.51%	-0.27%	0.30%
过去一年	9.62%	0.96%	7.13%	0.58%	2.49%	0.38%
自基金合同生效起至今	14.53%	0.92%	15.59%	0.58%	-1.06%	0.34%

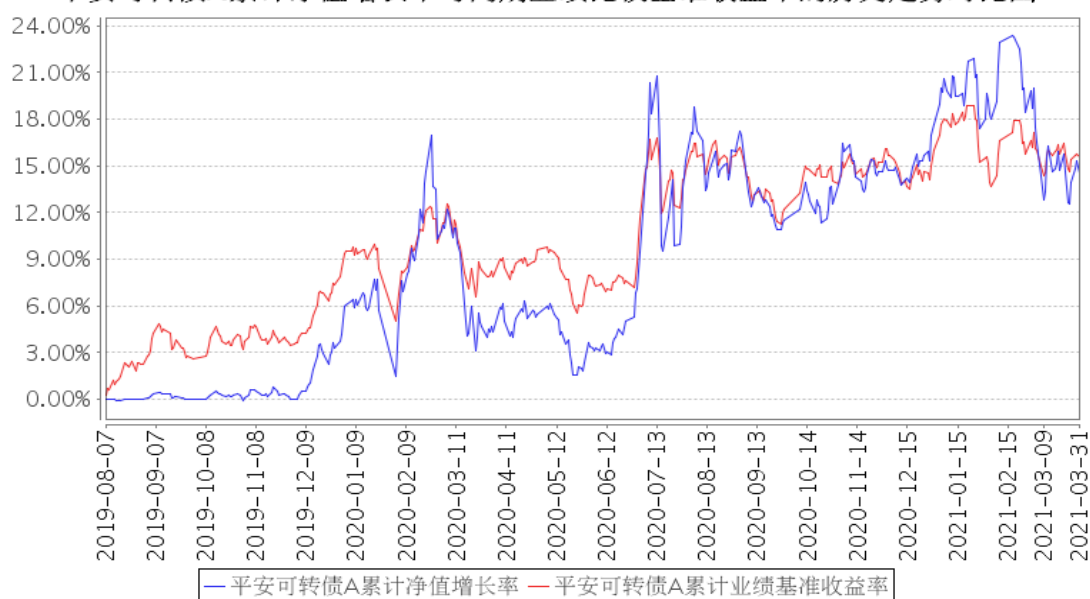
平安可转债 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

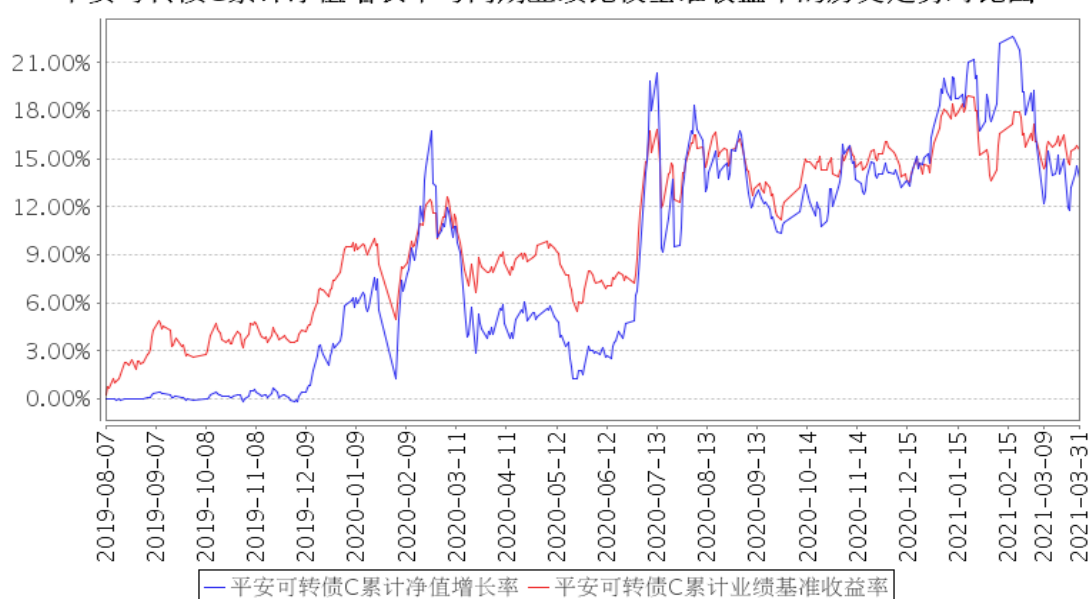
过去三个月	-2.79%	1.00%	-0.36%	0.58%	-2.43%	0.42%
过去六个月	2.51%	0.81%	2.99%	0.51%	-0.48%	0.30%
过去一年	9.18%	0.96%	7.13%	0.58%	2.05%	0.38%
自基金合同生效起至今	13.79%	0.92%	15.59%	0.58%	-1.80%	0.34%

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

平安可转债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



平安可转债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 2019 年 08 月 07 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		
韩克	平安可转债债券型证券投资基金基金经理	2019年9月16日	-	9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、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、平安惠轩纯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、平安元丰中短债债券型证券投资基金、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、平安中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、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

一季度国内经济景气度依旧较高，虽然从数据层面存在基数效应，但我们剔除相应影响后，得出经济仍偏强的结论，出口维持强势，内需稳步恢复，海外在疫苗接种下，经济开始恢复。一季度前半程货币策略偏鹰，主要是对前期阶段性宽松政策的修正，但去年底中央经济工作会议对于货币政策定调“不急转弯”，一季度政策没有进一步收紧。在此背景下，债券市场和权益市场在一季度都是震荡行情，但权益和转债市场在估值较高的背景下振幅相对较大。基金在一季度仓位有所变化，市场下跌后增加了整体仓位，并通过精选个券提升组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安可转债 A 的基金份额净值为 1.1453 元，本报告期基金份额净值增长率为 -2.69%，截至本报告期末平安可转债 C 的基金份额净值为 1.1379 元，本报告期基金份额净值增长率为 -2.79%，同期业绩比较基准收益率为 -0.36%。

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 60 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。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

§ 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	4,138,828.00	12.01
	其中：股票	4,138,828.00	12.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	27,731,534.02	80.48
	其中：债券	27,731,534.02	80.48
	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	1,275,076.23	3.70
8	其他资产	1,312,626.65	3.81
9	合计	34,458,064.90	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	3,759,527.00	15.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,800.00	0.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	152,261.00	0.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	168,240.00	0.68
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	4,138,828.00	16.69

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 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	600741	华域汽车	15,000	413,550.00	1.67
2	600519	贵州茅台	200	401,800.00	1.62
3	300760	迈瑞医疗	1,000	399,110.00	1.61
4	000568	泸州老窖	1,500	337,530.00	1.36
5	002311	海大集团	3,600	280,800.00	1.13
6	000550	江铃汽车	9,200	264,132.00	1.06
7	300750	宁德时代	700	225,519.00	0.91
8	601877	正泰电器	5,000	181,500.00	0.73
9	000157	中联重科	13,700	174,127.00	0.70
10	603259	药明康德	1,200	168,240.00	0.68

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	1,299,480.00	5.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	26,432,054.02	106.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	27,731,534.02	111.80

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	132009	17 中油 EB	32,400	3,306,420.00	13.33
2	127005	长证转债	18,130	2,080,054.90	8.39
3	132018	G 三峡 EB1	15,860	1,936,188.80	7.81
4	110053	苏银转债	16,740	1,887,267.60	7.61

5	113043	财通转债	12,420	1,352,289.60	5.45
---	--------	------	--------	--------------	------

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：本基金本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：本基金本报告期末无权证投资。

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：本基金本报告期末未持有国债期货。

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

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	10,024.86
2	应收证券清算款	1,223,606.52
3	应收股利	-
4	应收利息	75,423.08

5	应收申购款	3,572.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,312,626.65

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	132009	17 中油 EB	3,306,420.00	13.33
2	127005	长证转债	2,080,054.90	8.39
3	132018	G 三峡 EB1	1,936,188.80	7.81
4	110053	苏银转债	1,887,267.60	7.61
5	113543	欧派转债	1,074,029.80	4.33
6	132020	19 蓝星 EB	1,067,640.00	4.30
7	113013	国君转债	845,972.40	3.41
8	132011	17 浙报 EB	657,616.10	2.65
9	113011	光大转债	609,500.00	2.46
10	110063	鹰 19 转债	549,985.90	2.22
11	127017	万青转债	492,433.60	1.99
12	113509	新泉转债	466,752.00	1.88
13	113025	明泰转债	448,816.80	1.81
14	128046	利尔转债	434,655.00	1.75
15	123025	精测转债	408,717.30	1.65
16	113577	春秋转债	371,913.60	1.50
17	113012	骆驼转债	367,599.60	1.48
18	123060	苏试转债	322,468.20	1.30
19	128119	龙大转债	297,921.13	1.20
20	113579	健友转债	286,382.80	1.15
21	128096	奥瑞转债	253,870.00	1.02
22	123066	赛意转债	253,344.00	1.02
23	110069	瀚蓝转债	241,941.60	0.98
24	128095	恩捷转债	221,957.40	0.89
25	127020	中金转债	170,172.30	0.69
26	128097	奥佳转债	149,971.80	0.60
27	113572	三祥转债	110,945.80	0.45

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。

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	平安可转债 A	平安可转债 C
报告期期初基金份额总额	23,332,131.11	3,191,273.71
报告期期间基金总申购份额	2,320,004.05	1,239,257.52
减：报告期期间基金总赎回份额	7,231,674.21	1,173,058.87
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	18,420,460.95	3,257,472.36

§ 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可转债债券型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安可转债债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安可转债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

2021 年 4 月 20 日