

平安双季增享 6 个月持有期债券型证券投资
基金
2024 年第 1 季度报告

2024 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 19 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 04 月 18 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 2024 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安双季增享 6 个月持有债券	
基金主代码	010651	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 5 日	
报告期末基金份额总额	1,039,747,503.69 份	
投资目标	在谨慎控制组合净值波动率的前提下，本基金追求基金产品的长期、持续增值，并力争获得超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4 国债期货投资策略；5、资产支持证券投资策略	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*10%+中证全债指数收益率*90%	
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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安双季增享 6 个月持有债券 A	平安双季增享 6 个月持有债券 C
下属分级基金的交易代码	010651	010652
报告期末下属分级基金的份额总额	944,252,167.16 份	95,495,336.53 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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）	
	平安双季增享 6 个月持有债券 A	平安双季增享 6 个月持有债券 C
1. 本期已实现收益	-5,605,713.17	-642,827.36
2. 本期利润	2,396,368.69	143,320.32
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0024	0.0014
4. 期末基金资产净值	901,116,544.52	90,104,388.95
5. 期末基金份额净值	0.9543	0.9435

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

平安双季增享 6 个月持有债券 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	0.39%	0.23%	2.44%	0.12%	-2.05%	0.11%
过去六个月	0.05%	0.19%	3.04%	0.11%	-2.99%	0.08%
过去一年	-0.68%	0.16%	4.63%	0.10%	-5.31%	0.06%
过去三年	-4.02%	0.26%	11.22%	0.11%	-15.24%	0.15%
自基金合同 生效起至今	-4.57%	0.25%	11.84%	0.12%	-16.41%	0.13%

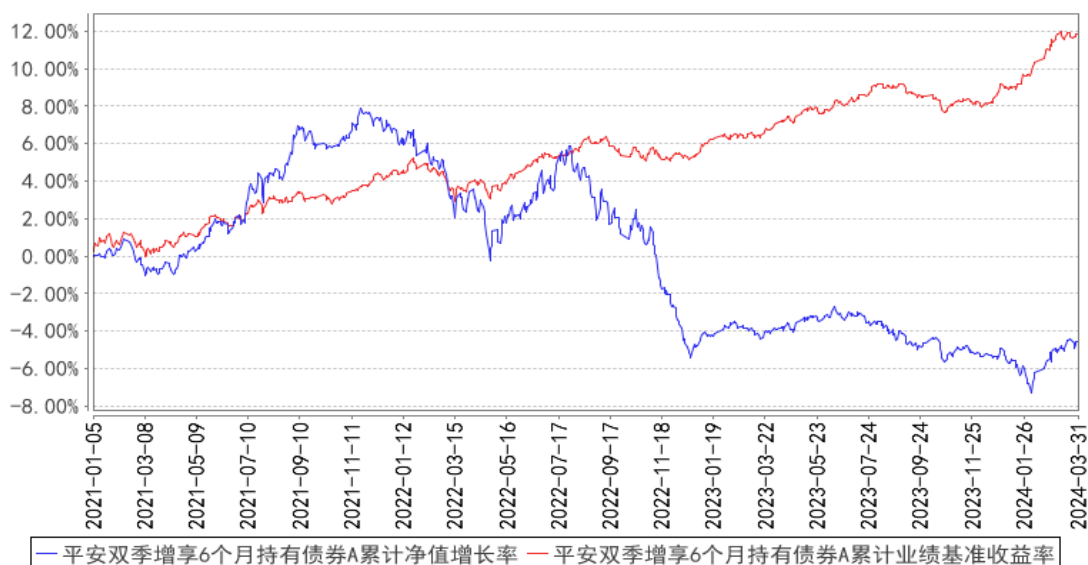
平安双季增享 6 个月持有债券 C

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	0.30%	0.23%	2.44%	0.12%	-2.14%	0.11%
过去六个月	-0.13%	0.19%	3.04%	0.11%	-3.17%	0.08%
过去一年	-1.03%	0.16%	4.63%	0.10%	-5.66%	0.06%

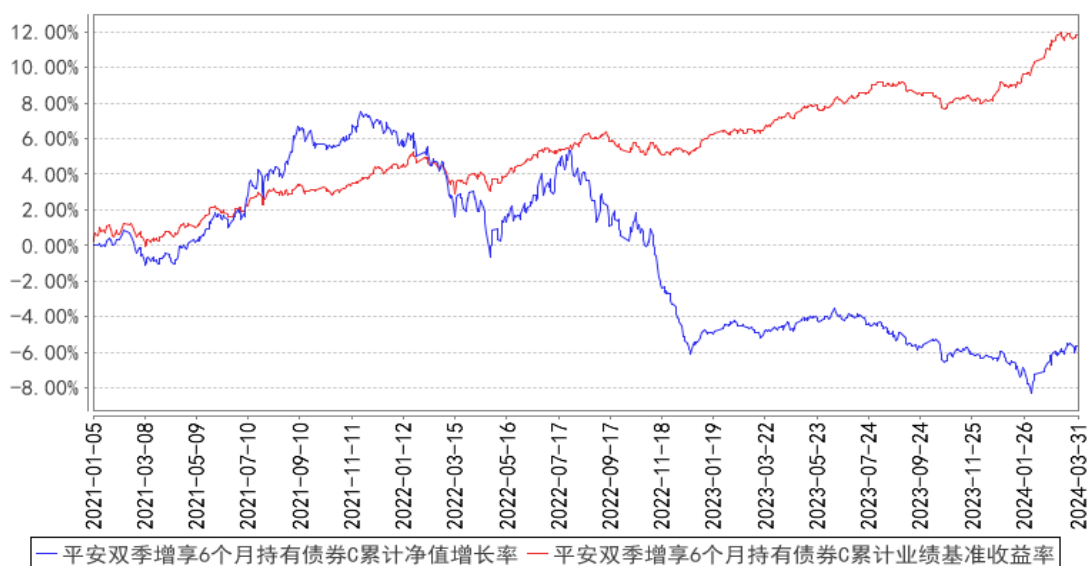
过去三年	-5.03%	0.26%	11.22%	0.11%	-16.25%	0.15%
自基金合同生效起至今	-5.65%	0.25%	11.84%	0.12%	-17.49%	0.13%

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

平安双季增享6个月持有债券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



平安双季增享6个月持有债券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2021年01月05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		
俞瑶	平安双季增享6个月持有期债券型证券投资基金基金经理	2022年12月20日	-	12年	俞瑶女士，香港科技大学投资管理专业硕士，曾先后担任南京证券股份有限公司投资顾问、深圳市万博汇投资控股有限公司运营风险管理经理、天风证券股份有限公司项目经理。2015年9月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资经理，现任平安深证300指数增强型证券投资基金、平安沪深300指数量化增强证券投资基金、平安中证500指数增强型发起式证券投资基金、平安双季增享6个月持有期债券型证券投资基金、平安兴鑫回报一年定期开放混合型证券投资基金、平安中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
唐煜	平安双季增享6个月持有期债券型证券投资基金基金经理	2023年12月11日	-	8年	唐煜先生，南开大学世界经济专业硕士研究生。曾先后担任广发银行股份有限公司资产管理部固定收益处投资经理，太平洋资产管理有限公司固定收益部固定收益经理、西部利得基金管理有限公司公募投资部基金经理。2022年6月加入平安基金管理有限公司，现任平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安瑞尚六个月持有期混合型证券投资基金、平安合锦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合庆1年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安双季增享6个月持有期债券型证券投资基金、平安合轩1年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠泽纯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

报告期内，国内维持偏松的流动性环境和有定力的政策环境。经济的结构特征突出，传统投资领域复工节奏偏缓，以新质生产力为代表的新兴领域在产业化进展、鼓励性政策有持续催化。市场方面，债券在偏松的货币环境下维持偏强运行。1-2 月，“大行放贷、小行买债”局面持续上演，城投债继续收缩，叠加非银欠配，票息资产荒愈演愈烈，利率在 LPR 降息和降准预期下有所下行。3 月份，债券面临资产荒持续和收益低的两难，利率品种波动频率加大，波段交易的难度也明显提高；权益市场年初出现恐慌性的下跌，随后在流动性注入、政策呵护下基本修复。在此期间红利股整体表现相对稳定，节后市场风险偏好修复，风格切换，小盘、成长股成交额回升，涨幅居前，机会集中于两会政策利好板块与新质生产力方面；转债整体跟随权益，溢价率压缩导致阶段性跟涨偏弱。

报告期内，基金适当参与中长期国债的波段交易，较好地把握了利率品种资本利得的机会。权益组合仓位相对年初水平基本持平微降，主要提升了红利股的配置，降低了偏成长的配置，最终组合结构呈现红利及价值成长相对均衡的特征。主要增持的行业包括基础化工、银行、煤炭等，减持的行业包括电子、医药生物、计算机、汽车等。转债在年初市场下跌中增加了仓位，主要以低价品种为主，春节后调整了结构，减持了持续反弹较好的弹性品种，增持了医药、环保公用事业等转债。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安双季增享 6 个月持有债券 A 的基金份额净值 0.9543 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.39%，同期业绩比较基准收益率为 2.44%；截至本报告期末平安双季增享 6 个月持有债券 C 的基金份额净值 0.9435 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准收益率为 2.44%。

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	105,220,816.05	8.48
	其中：股票	105,220,816.05	8.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,117,733,178.61	90.06
	其中：债券	1,117,733,178.61	90.06
	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	11,911,348.28	0.96
8	其他资产	6,283,312.74	0.51
9	合计	1,241,148,655.68	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	4,955,200.00	0.50
B	采矿业	5,890,146.00	0.59
C	制造业	62,169,934.05	6.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,939,945.00	0.40
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,245,978.00	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,386,110.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,360,015.00	0.64
J	金融业	3,903,797.00	0.39
K	房地产业	2,836,691.00	0.29
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,533,000.00	0.26
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	105,220,816.05	10.62

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	600346	恒力石化	511,622	7,137,126.90	0.72
2	603596	伯特利	94,131	5,252,509.80	0.53
3	000625	长安汽车	300,700	5,051,760.00	0.51
4	300442	润泽科技	161,100	4,995,711.00	0.50
5	002475	立讯精密	169,700	4,990,877.00	0.50
6	300498	温氏股份	260,800	4,955,200.00	0.50
7	000034	神州数码	156,900	4,631,688.00	0.47
8	000333	美的集团	66,300	4,257,786.00	0.43
9	601689	拓普集团	65,900	4,164,221.00	0.42

10	600027	华电国际	573,500	3,939,945.00	0.40
----	--------	------	---------	--------------	------

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	101,646,393.44	10.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	399,513,393.43	40.31
	其中：政策性金融债	389,196,918.02	39.26
4	企业债券	220,160,243.56	22.21
5	企业短期融资券	50,289,508.20	5.07
6	中期票据	259,957,474.91	26.23
7	可转债（可交换债）	86,166,165.07	8.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,117,733,178.61	112.76

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	190208	19 国开 08	1,500,000	154,470,491.80	15.58
2	230020	23 附息国债 20	1,000,000	101,646,393.44	10.25
3	240241	23 财券 G5	900,000	91,370,958.90	9.22
4	230306	23 进出 06	900,000	91,050,639.34	9.19
5	102383020	23 晋能煤业 MTN009	600,000	61,451,213.11	6.20

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：本基金本报告期内无国债期货投资。

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

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库以外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	144,436.26
2	应收证券清算款	6,137,085.10
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,791.38
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,283,312.74

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	127020	中金转债	6,135,381.56	0.62
2	123090	三诺转债	4,043,281.85	0.41
3	123221	力诺转债	4,037,360.97	0.41
4	123107	温氏转债	3,790,659.98	0.38
5	113637	华翔转债	3,786,533.70	0.38
6	123172	漱玉转债	3,660,157.71	0.37
7	128141	旺能转债	3,337,389.67	0.34
8	111017	蓝天转债	3,088,086.81	0.31
9	113563	柳药转债	2,916,051.02	0.29
10	113661	福22转债	2,205,367.82	0.22
11	113061	拓普转债	2,153,633.72	0.22
12	118025	奕瑞转债	2,129,403.98	0.21

13	113663	新化转债	2,111,723.97	0.21
14	118038	金宏转债	2,090,975.39	0.21
15	123219	宇瞳转债	2,087,476.70	0.21
16	110058	永鼎转债	2,056,855.13	0.21
17	127090	兴瑞转债	2,048,389.29	0.21
18	113621	彤程转债	1,992,052.99	0.20
19	128049	华源转债	1,990,274.15	0.20
20	123202	祥源转债	1,982,268.04	0.20
21	113524	奇精转债	1,965,467.42	0.20
22	123197	光力转债	1,943,329.50	0.20
23	127073	天赐转债	1,931,647.48	0.19
24	123213	天源转债	1,929,511.77	0.19
25	113549	白电转债	1,924,606.06	0.19
26	123212	立中转债	1,905,231.73	0.19
27	123133	佩蒂转债	1,318,444.77	0.13
28	123150	九强转债	1,060,512.52	0.11
29	123104	卫宁转债	66,984.24	0.01

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	平安双季增享 6 个月持有 债券 A	平安双季增享 6 个月持有 债券 C
报告期期初基金份额总额	1,079,688,239.05	109,327,534.34
报告期期间基金总申购份额	82,200.74	41,009.06
减：报告期期间基金总赎回份额	135,518,272.63	13,873,206.87
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	944,252,167.16	95,495,336.53

§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双季增享 6 个月持有期债券型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安双季增享 6 个月持有期债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安双季增享 6 个月持有期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

2024 年 4 月 19 日