

平安添利债券型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 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：2024 年 7 月 18 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 2024 年 07 月 17 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 04 月 01 日起至 06 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	5,519,488,102.96 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	4,495,224,356.82 份	1,024,263,746.14 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 4 月 1 日-2024 年 6 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	43,022,907.34	6,787,009.58
2. 本期利润	75,559,589.48	12,385,153.40
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0197	0.0172
4. 期末基金资产净值	5,075,233,849.07	1,155,880,760.54
5. 期末基金份额净值	1.1290	1.1285

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

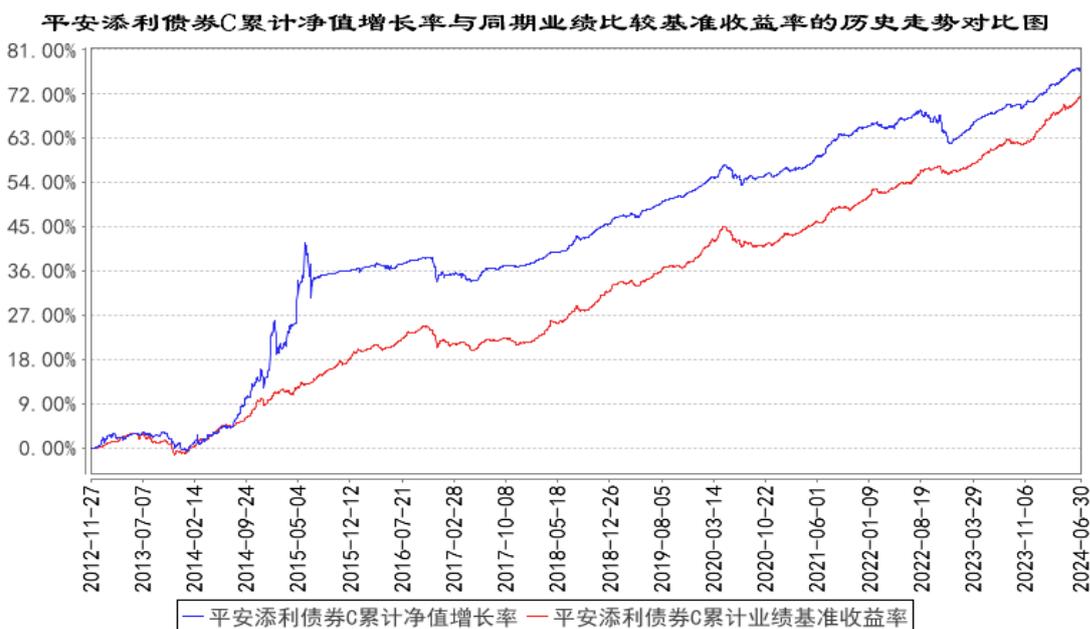
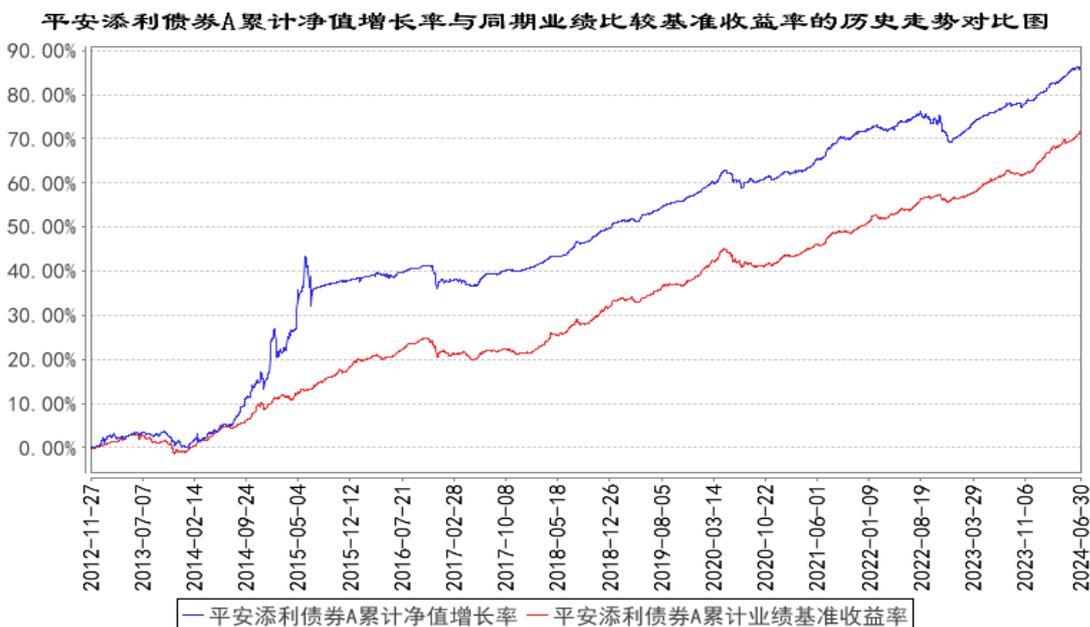
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.86%	0.07%	1.92%	0.08%	-0.06%	-0.01%
过去六个月	3.55%	0.06%	4.31%	0.08%	-0.76%	-0.02%
过去一年	5.90%	0.06%	6.59%	0.07%	-0.69%	-0.01%
过去三年	12.28%	0.08%	17.29%	0.06%	-5.01%	0.02%
过去五年	21.51%	0.08%	27.16%	0.07%	-5.65%	0.01%
自基金合同 生效起至今	86.34%	0.21%	71.58%	0.08%	14.76%	0.13%

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	1.76%	0.07%	1.92%	0.08%	-0.16%	-0.01%
过去六个月	3.35%	0.06%	4.31%	0.08%	-0.96%	-0.02%

过去一年	5.47%	0.06%	6.59%	0.07%	-1.12%	-0.01%
过去三年	10.92%	0.08%	17.29%	0.06%	-6.37%	0.02%
过去五年	19.09%	0.08%	27.16%	0.07%	-8.07%	0.01%
自基金合同生效起至今	77.34%	0.21%	71.58%	0.08%	5.76%	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



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		
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	-	12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，现任平安双债添益债券型证券投资基金、平安添利债券型证券投资基金、平安添润债券型证券投资基金、平安恒泰1年持有期混合型证券投资基金、平安稳健增长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遵规守信情况的说明

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

2024 年二季度，债券市场收益率总体呈现下行走势。宏观基本面延续弱复苏状态，外需好于内需，国内仍面临有效需求不足的问题。4 月初在宽松预期和配置力量的共同作用下，收益率下行较为顺畅；4 月中旬开始，由于央行多次提示长期利率债风险，市场先经历一轮调整后缓慢修复，之后在禁止“手工补息”的后续影响下，银行存款逐步转移至非银体系内，流动性进一步宽松，债市“资产荒”特征明显，利率曲线再次走陡，短端表现较优，同时多个关键期限的债券收益率突破前低。

股票方面，二季度，新国九条等政策持续发力，叠加年报、一季度报的发布验证，部分高景气行业得到验证，大盘价值相对走强。转债方面，经历年初的 V 型反弹后，指数持续震荡。整体节奏与权益市场类似，区别在于 4 月底开始逐步有理财等增量资金增配的信号出现，溢价率开始有修复迹象。6 月在权益市场走弱的背景下，转债市场因担心信用风险，再次出现了系统性下跌行情，低价转债受影响较大。

二季度本基金主要配置中等期限的中高等级信用债，波段操作长端利率债，可转债部分主要配置低价券和平衡型转债，增配高股息大票。

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 1.1290 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.86%，同期业绩比较基准收益率为 1.92%；截至本报告期末平安添利债券 C 的基金份额净值 1.1285 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.76%，同期业绩比较基准收益率为 1.92%。

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	7,850,344,176.75	98.99
	其中：债券	7,850,344,176.75	98.99
	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	31,733,218.46	0.40
8	其他资产	48,737,525.35	0.61
9	合计	7,930,814,920.56	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	80,902,836.98	1.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,423,948,001.95	22.85
	其中：政策性金融债	501,913,821.92	8.05
4	企业债券	1,016,522,315.05	16.31

5	企业短期融资券	30,519,842.16	0.49
6	中期票据	4,416,381,859.58	70.88
7	可转债（可交换债）	612,602,749.98	9.83
8	同业存单	-	-
9	其他	269,466,571.05	4.32
10	合计	7,850,344,176.75	125.99

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	242480003	24 广州农商行 永续债 01	1,800,000	183,288,900.82	2.94
2	102481609	24 晋能煤业 MTN007	1,660,000	168,778,176.00	2.71
3	240205	24 国开 05	1,500,000	155,906,270.49	2.50
4	2128016	21 民生银行永 续债 01	1,269,000	132,761,702.21	2.13
5	230211	23 国开 11	1,200,000	121,918,622.95	1.96

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。

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

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，中国民生银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、广州农村商业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	86,571.19
2	应收证券清算款	42,333,493.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,317,460.57
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	48,737,525.35

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	113065	齐鲁转债	25,729,262.03	0.41
2	113050	南银转债	25,713,239.21	0.41
3	113052	兴业转债	24,331,661.20	0.39
4	110079	杭银转债	17,280,583.35	0.28
5	113055	成银转债	15,008,759.54	0.24
6	132026	G 三峡 EB2	9,155,169.01	0.15
7	127027	能化转债	8,967,246.18	0.14
8	123185	能辉转债	8,963,600.53	0.14
9	118011	银微转债	8,167,312.17	0.13
10	118031	天 23 转债	7,883,069.67	0.13
11	111010	立昂转债	7,746,967.12	0.12
12	113639	华正转债	7,499,580.82	0.12
13	113046	金田转债	7,289,243.84	0.12
14	118036	XD 力合转	6,750,797.26	0.11
15	113059	福莱转债	6,735,568.18	0.11
16	113654	永 02 转债	6,657,266.92	0.11

17	111017	蓝天转债	6,450,416.44	0.10
18	127056	中特转债	6,444,414.02	0.10
19	111003	聚合转债	6,375,789.01	0.10
20	118012	微芯转债	6,297,738.50	0.10
21	113068	金铜转债	6,274,912.04	0.10
22	127101	豪鹏转债	6,217,827.63	0.10
23	118035	国力转债	6,203,802.78	0.10
24	113062	常银转债	6,156,821.57	0.10
25	123182	广联转债	6,077,921.57	0.10
26	123197	光力转债	5,909,907.29	0.09
27	118034	晶能转债	5,857,387.40	0.09
28	123173	恒锋转债	5,661,987.33	0.09
29	113662	豪能转债	5,642,054.06	0.09
30	118043	福立转债	5,606,096.78	0.09
31	123190	道氏转 02	5,538,189.04	0.09
32	110086	精工转债	5,348,005.48	0.09
33	123217	富仕转债	5,323,843.92	0.09
34	123178	花园转债	5,020,017.79	0.08
35	123085	万顺转 2	5,006,011.64	0.08
36	123174	精锻转债	4,983,010.55	0.08
37	123231	信测转债	4,977,532.94	0.08
38	110089	兴发转债	4,951,420.55	0.08
39	127068	顺博转债	4,947,575.30	0.08
40	123100	朗科转债	4,917,143.21	0.08
41	118009	华锐转债	4,849,440.41	0.08
42	127090	兴瑞转债	4,811,219.68	0.08
43	113679	芯能转债	4,673,815.01	0.08
44	118028	会通转债	4,669,865.17	0.07
45	111013	新港转债	4,631,410.03	0.07
46	123152	润禾转债	4,622,147.95	0.07
47	113672	福蓉转债	4,611,809.80	0.07
48	113061	拓普转债	4,510,546.90	0.07
49	123163	金沃转债	4,467,685.32	0.07
50	127031	洋丰转债	4,459,586.88	0.07
51	127084	柳工转 2	4,435,788.56	0.07
52	113069	博 23 转债	4,414,395.62	0.07
53	127078	优彩转债	4,262,450.77	0.07
54	123234	中能转债	4,256,488.42	0.07
55	123193	海能转债	4,218,663.01	0.07
56	128105	长集转债	4,177,112.07	0.07
57	127075	百川转 2	4,128,937.82	0.07
58	123159	崧盛转债	4,081,686.98	0.07

59	123200	海泰转债	4,032,966.50	0.06
60	113597	佳力转债	4,004,235.93	0.06
61	123211	阳谷转债	3,875,908.63	0.06
62	127085	韵达转债	3,704,899.11	0.06
63	127088	赫达转债	3,686,575.78	0.06
64	127074	麦米转 2	3,627,157.33	0.06
65	110062	烽火转债	3,610,849.93	0.06
66	111015	东亚转债	3,556,042.77	0.06
67	127099	盛航转债	3,533,277.35	0.06
68	123218	宏昌转债	3,530,602.12	0.06
69	128137	洁美转债	3,517,072.60	0.06
70	128083	新北转债	3,514,753.47	0.06
71	123195	蓝晓转 02	3,357,058.21	0.05
72	111009	盛泰转债	3,341,052.05	0.05
73	123222	博俊转债	3,272,493.84	0.05
74	123202	祥源转债	3,252,285.49	0.05
75	123233	凯盛转债	3,251,814.25	0.05
76	113677	华懋转债	3,246,020.55	0.05
77	113674	华设转债	3,238,850.83	0.05
78	123226	中富转债	3,231,827.40	0.05
79	111012	福新转债	3,094,352.05	0.05
80	123076	强力转债	3,088,717.35	0.05
81	110081	闻泰转债	3,039,465.90	0.05
82	113030	东风转债	3,037,074.96	0.05
83	127072	博实转债	2,989,476.03	0.05
84	123166	蒙泰转债	2,981,307.95	0.05
85	118044	赛特转债	2,956,409.62	0.05
86	123219	宇瞳转债	2,949,832.47	0.05
87	127054	双箭转债	2,914,792.66	0.05
88	113621	彤程转债	2,703,617.12	0.04
89	113644	艾迪转债	2,691,469.18	0.04
90	118013	道通转债	2,687,180.80	0.04
91	111005	富春转债	2,672,188.36	0.04
92	127061	美锦转债	2,554,452.95	0.04
93	127094	红墙转债	2,487,809.85	0.04
94	110090	爱迪转债	2,374,923.46	0.04
95	113664	大元转债	2,338,270.69	0.04
96	127079	华亚转债	2,329,660.12	0.04
97	127087	星帅转 2	2,271,577.44	0.04
98	127093	章鼓转债	2,269,216.44	0.04
99	113651	松霖转债	2,238,316.14	0.04
100	113656	嘉诚转债	2,231,912.88	0.04

101	123160	泰福转债	2,160,069.04	0.03
102	128121	宏川转债	2,156,747.95	0.03
103	113659	莱克转债	2,100,849.17	0.03
104	113663	新化转债	2,060,967.66	0.03
105	113064	东材转债	1,937,492.26	0.03
106	113661	福 22 转债	1,909,077.91	0.03
107	123184	天阳转债	1,868,965.07	0.03
108	113673	岱美转债	1,855,482.33	0.03
109	123176	精测转 2	1,823,704.73	0.03
110	123191	智尚转债	1,789,316.46	0.03
111	118025	奕瑞转债	1,785,437.67	0.03
112	113043	财通转债	1,714,009.04	0.03
113	118041	星球转债	1,690,902.74	0.03
114	123168	惠云转债	1,588,189.73	0.03
115	113653	永 22 转债	1,545,667.40	0.02
116	118022	锂科转债	1,488,123.29	0.02
117	113678	中贝转债	1,447,821.37	0.02
118	113048	晶科转债	1,417,602.74	0.02
119	127095	广泰转债	1,297,781.70	0.02
120	123180	浙矿转债	1,260,376.74	0.02
121	118003	华兴转债	1,247,436.39	0.02
122	113549	白电转债	1,242,638.88	0.02
123	113067	燃 23 转债	1,235,786.03	0.02
124	127064	杭氧转债	1,191,090.58	0.02
125	123235	亿田转债	1,187,862.47	0.02
126	113675	新 23 转债	1,168,605.05	0.02
127	123120	隆华转债	1,165,587.81	0.02
128	113033	利群转债	1,016,590.14	0.02
129	113623	凤 21 转债	990,769.32	0.02
130	127041	弘亚转债	855,979.77	0.01
131	113565	宏辉转债	834,679.45	0.01
132	118006	阿拉转债	654,744.33	0.01
133	113640	苏利转债	602,356.01	0.01
134	127071	天箭转债	599,317.99	0.01
135	110093	神马转债	552,519.04	0.01
136	127042	嘉美转债	528,072.60	0.01
137	123171	共同转债	491,513.70	0.01
138	123221	力诺转债	1,289.05	0.00
139	128129	青农转债	319.28	0.00

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	平安添利债券 A	平安添利债券 C
报告期期初基金份额总额	3,218,528,765.74	508,872,997.61
报告期期间基金总申购份额	1,455,473,992.72	738,159,382.69
减：报告期期间基金总赎回份额	178,778,401.64	222,768,634.16
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	4,495,224,356.82	1,024,263,746.14

§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

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