

平安双盈添益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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	543,141,959.80 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	163,189,465.39 份	379,952,494.41 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）	
	平安双盈添益债券 A	平安双盈添益债券 C
1. 本期已实现收益	1,947,246.88	3,089,219.57
2. 本期利润	3,739,991.37	6,355,001.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0189	0.0173
4. 期末基金资产净值	176,471,066.54	408,258,942.43
5. 期末基金份额净值	1.0814	1.0745

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	1.77%	0.04%	1.51%	0.07%	0.26%	-0.03%
过去六个月	2.97%	0.04%	3.17%	0.06%	-0.20%	-0.02%
过去一年	4.90%	0.05%	4.53%	0.06%	0.37%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	8.14%	0.05%	7.01%	0.05%	1.13%	0.00%

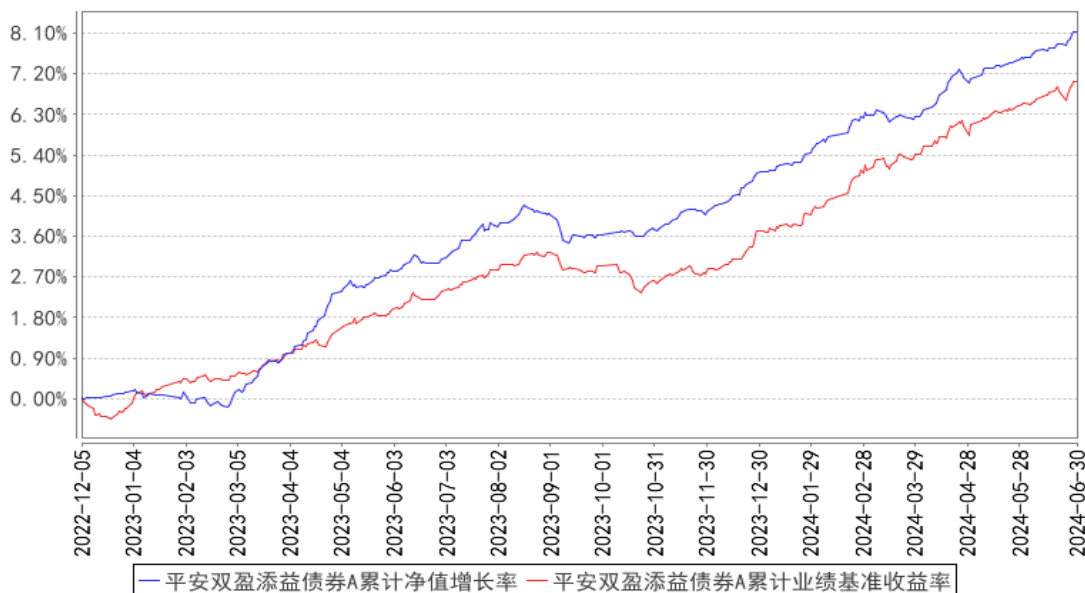
平安双盈添益债券 C

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	1.67%	0.04%	1.51%	0.07%	0.16%	-0.03%
过去六个月	2.77%	0.04%	3.17%	0.06%	-0.40%	-0.02%
过去一年	4.49%	0.05%	4.53%	0.06%	-0.04%	-0.01%

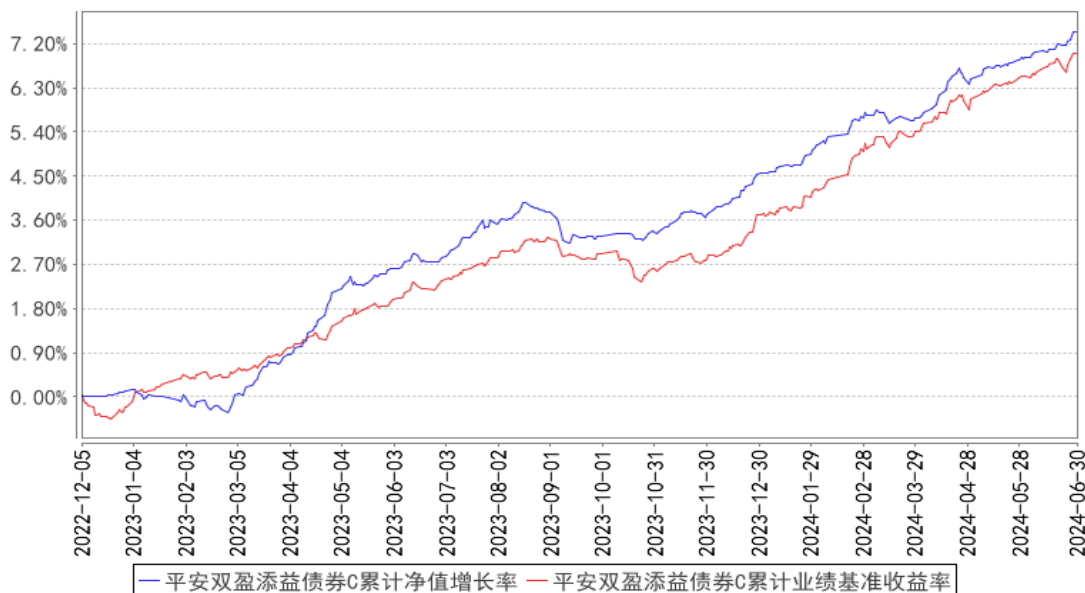
自基金合同 生效起至今	7.45%	0.05%	7.01%	0.05%	0.44%	0.00%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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；

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 1 年持有期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员、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、平安增利六个月定期开放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

2024 年二季度，国内经济继续弱复苏，其中工业生产和出口增速较好，但投资和消费增速弱于预期；多地陆续优化地产政策，房地产销售整体有所恢复，但总体仍然较弱；基建等实物工作量未见明显起色，物价水平总体也保持低位。政策方面，财政政策适度加力、提质增效，适度扩大财政支出规模；稳健的货币政策灵活适度、精准有效。流动性方面，二季度央行在跨季期间总体适度加大 OMO 投放，助力跨季平稳，政策力度日益精准。总体来看，二季度债市收益率总体呈下行走势。具体来看，二季度初至 4 月底，“稳地产”宽松预期、超长债供给冲击预期，叠加机构行为扰动等，债市出现短暂调整，但总体收益率仍为震荡下行，中短端表现更优。4 月底至二季度末，由于央行多次提示长债风险，市场先经历一轮调整后缓慢修复，之后在“手工补息”被禁背景下，银行存款逐步转移至非银体系内，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 30 年国债收益率向下突破 2.5% 关键点位。权益和可转债市场方面，在稳定市场的政策出台、地产政策调整和经济基本面显现出一些改善的迹象共同作用下，权益资产在

4-5 月出现强劲反弹。在市场消化掉利好后，经济数据在 6 月再度走弱，市场再度出现大幅调整。

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，重点参与了部分中高等级的可转债标的。

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 1.0814 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.77%，同期业绩比较基准收益率为 1.51%；截至本报告期末平安双盈添益债券 C 的基金份额净值 1.0745 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.67%，同期业绩比较基准收益率为 1.51%。

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	699,317,826.77	90.23
	其中：债券	699,317,826.77	90.23
	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	60,013,808.22	7.74
	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	10,796,327.36	1.39
8	其他资产	4,931,911.08	0.64
9	合计	775,059,873.43	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	7,024,708.49	1.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	164,279,151.13	28.09
	其中：政策性金融债	30,461,766.21	5.21
4	企业债券	220,785,018.34	37.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	238,736,435.32	40.83
7	可转债（可交换债）	15,306,183.58	2.62
8	同业存单	-	-
9	其他	53,186,329.91	9.10
10	合计	699,317,826.77	119.60

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	242480004	24 华夏银行永续债 01	450,000	45,341,026.03	7.75
2	2280219	22 开福集团债 01	400,000	42,063,892.60	7.19
3	102400616	24 晋能电力 MTN002	400,000	41,135,003.28	7.03
4	188721	21 金坛 03	400,000	41,088,265.20	7.03
5	148473	23 科城 Y4	300,000	31,626,575.34	5.41

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
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-252,819.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

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，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	36,473.12
2	应收证券清算款	384,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,511,437.96
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	4,931,911.08

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	110075	南航转债	2,456,125.75	0.42
2	113055	成银转债	2,387,900.32	0.41
3	110079	杭银转债	1,626,734.63	0.28
4	113065	齐鲁转债	1,277,913.28	0.22
5	113049	长汽转债	1,084,526.17	0.19
6	113631	皖天转债	1,053,220.82	0.18
7	110083	苏租转债	1,039,679.24	0.18
8	113061	拓普转债	1,038,612.77	0.18
9	110048	福能转债	852,527.99	0.15
10	113044	大秦转债	667,471.28	0.11
11	127032	苏行转债	437,446.49	0.07
12	113050	南银转债	420,130.48	0.07
13	132026	G 三峡 EB2	388,369.73	0.07
14	127039	北港转债	348,268.54	0.06
15	128136	立讯转债	227,256.09	0.04

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	222,721,239.64	374,798,254.78
报告期期间基金总申购份额	102,356,086.56	241,363,040.06
减：报告期期间基金总赎回份额	161,887,860.81	236,208,800.43
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	163,189,465.39	379,952,494.41

§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份额比例 (%)	-	0.79

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

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

2024 年 7 月 18 日