

平安元福短债债券型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 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 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安元福短债发起式	
基金主代码	016662	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 8 日	
报告期末基金份额总额	279,327,091.79 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，综合考虑基金资产的收益性、安全性、流动性，通过积极主动地投资管理，追求持续、稳定的收益，力争实现基金资产的稳健增值。	
投资策略	1、资产配置策略；2、债券投资策略：（1）组合久期配置策略、（2）类属资产配置策略、（3）息差策略、（4）个券选择策略、（5）信用债投资策略；3、现金头寸管理；4、国债期货投资策略；5、信用衍生品投资策略	
业绩比较基准	中债综合财富（1 年以下）指数收益率*90%+一年期定期存款基准利率（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	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安元福短债发起式 A	平安元福短债发起式 C
下属分级基金的交易代码	016662	016663
报告期末下属分级基金的份额总额	134,032,291.91 份	145,294,799.88 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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	平安元福短债发起式 A	平安元福短债发起式 C
1. 本期已实现收益	480,217.79	1,034,023.54
2. 本期利润	327,477.93	740,492.45
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0046	0.0048
4. 期末基金资产净值	142,215,038.67	153,230,543.11
5. 期末基金份额净值	1.0611	1.0546

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

平安元福短债发起式 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	0.56%	0.04%	0.43%	0.01%	0.13%	0.03%
过去六个月	1.25%	0.03%	1.02%	0.01%	0.23%	0.02%
过去一年	2.77%	0.02%	2.42%	0.01%	0.35%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.11%	0.03%	4.50%	0.01%	1.61%	0.02%

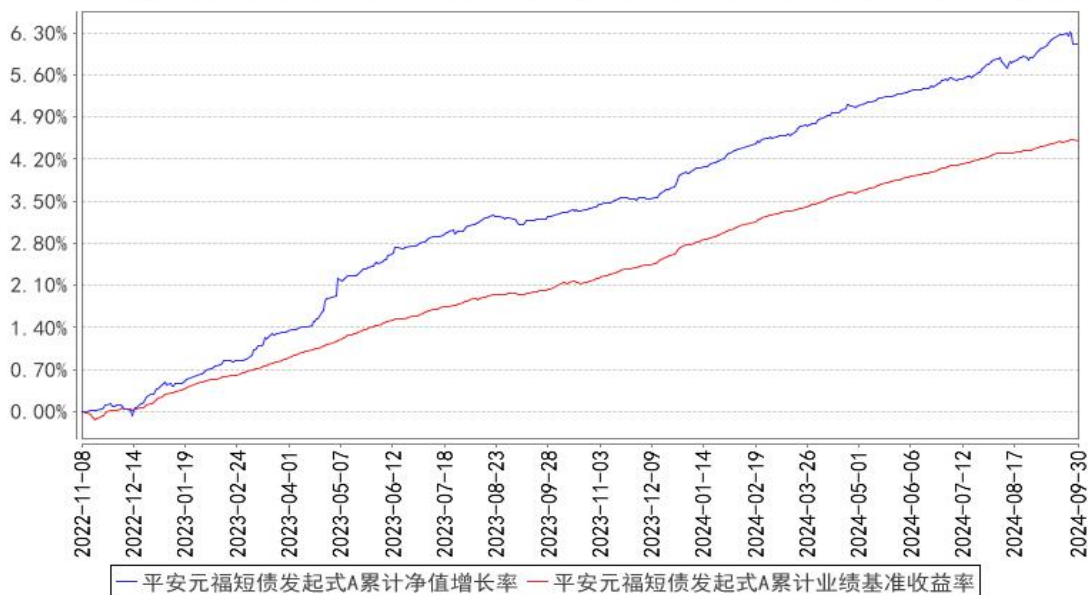
平安元福短债发起式 C

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	0.49%	0.04%	0.43%	0.01%	0.06%	0.03%
过去六个月	1.10%	0.03%	1.02%	0.01%	0.08%	0.02%
过去一年	2.43%	0.02%	2.42%	0.01%	0.01%	0.01%

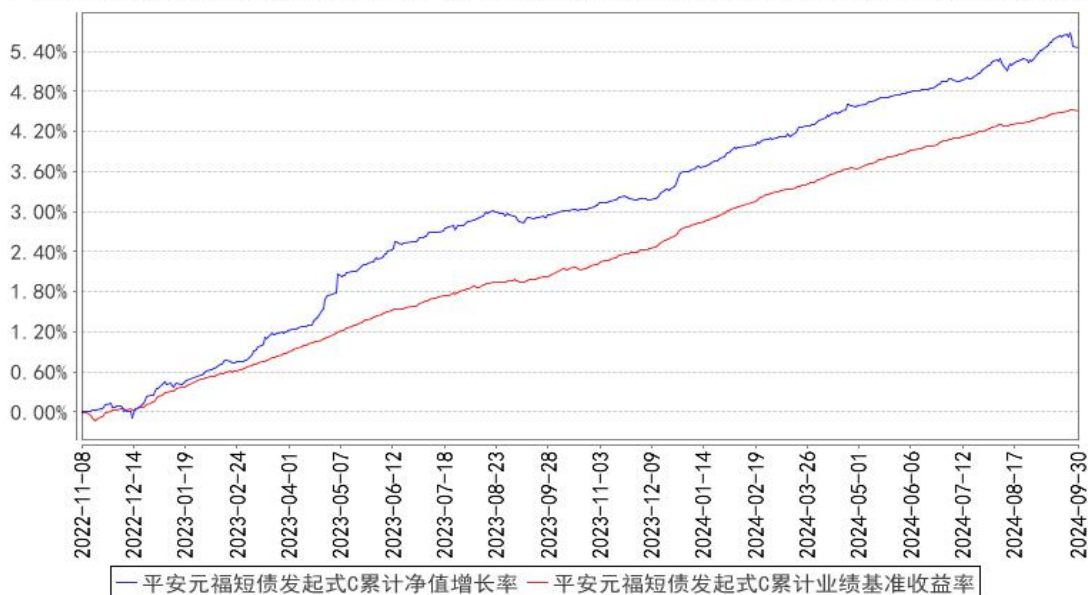
自基金合同 生效起至今	5.46%	0.03%	4.50%	0.01%	0.96%	0.02%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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

平安元福短债发起式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



平安元福短债发起式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 11 月 08 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		
苏宁	平安元福短债债券型发起式证券投资基金基金经理	2022年11月8日	-	13年	苏宁先生,北京大学西方经济学硕士研究生。曾先后担任易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益研究员兼基金经理助理。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。现担任平安惠诚纯债债券型证券投资基金、平安元盛超短债债券型证券投资基金、平安惠享纯债债券型证券投资基金、平安合悦定期开放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、平安惠韵纯债债券型证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安元鑫120天滚动持有中短债债券型证券投资基金、平安元福短债债券型发起式证券投资基金、平安3-5年期政策性金融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

2024 年 3 季度，经济运行整体平稳，同时也面临有效需求不足，社会预期偏弱等挑战。政策层面，宏观调控力度加大，强化逆周期调节，货币政策综合使用利率、准备金、再贷款、国债买卖等工具。债券市场，7 月利率下行，之后有所调整。信用方面，信用利差低位反弹。本基金主要配置短久期限债券品种，根据基本面与资金面的演变，调整久期和杠杆的水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安元福短债发起式 A 的基金份额净值 1.0611 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.56%，同期业绩比较基准收益率为 0.43%；截至本报告期末平安元福短债发起式 C 的基金份额净值 1.0546 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

§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	294,814,901.83	96.40
	其中：债券	294,814,901.83	96.40
	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	10,002,836.16	3.27
	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	470,924.52	0.15
8	其他资产	521,832.57	0.17
9	合计	305,810,495.08	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	35,827,763.88	12.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	74,379,649.40	25.18
	其中：政策性金融债	23,346,865.35	7.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,209,294.25	6.84
6	中期票据	164,398,194.30	55.64
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	294,814,901.83	99.79

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	102103046	21 南航股 MTN003	200,000	20,579,256.83	6.97
2	102102257	21 华润 MTN003	200,000	20,578,568.31	6.97
3	102102307	21 国能江苏 MTN001(碳中和 债)	200,000	20,572,655.74	6.96
4	132100167	21 京能洁能	200,000	20,560,590.16	6.96

		GN002			
5	240006	24 付息国债 06	200,000	20,495,369.86	6.94

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，中国建设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	22,775.87
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	499,056.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	521,832.57

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	平安元福短债发起式 A	平安元福短债发起式 C
报告期期初基金份额总额	45,613,598.56	209,872,594.85
报告期期间基金总申购份额	120,635,646.28	51,970,093.30
减：报告期期间基金总赎回份额	32,216,952.93	116,547,888.27
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	134,032,291.91	145,294,799.88

§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	平安元福短债发起式 A	平安元福短债发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,450.05	-
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	10,000,450.05	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	7.46	-

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总 份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总 份额比例(%)	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固 有资金	10,000,450.05	3.58	10,000,000.00	3.58	3 年
基金管理人高 级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人 员	-	-	-	-	-
基金管理人股 东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,450.05	3.58	10,000,000.00	3.58	3 年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安元福短债债券型发起式证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安元福短债债券型发起式证券投资基金基金合同
- (3) 平安元福短债债券型发起式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

10.2 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

10.3 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 10 月 25 日