

# 平安可转债债券型证券投资基金

## 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 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 10 月 23 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	43,766,924.15 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	23,073,712.06 份	20,693,212.09 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）	
	平安可转债 A	平安可转债 C
1. 本期已实现收益	-2,078,960.44	-1,825,597.29
2. 本期利润	-376,151.17	-338,841.88
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0160	-0.0163
4. 期末基金资产净值	25,136,904.13	22,087,732.15
5. 期末基金份额净值	1.0894	1.0674

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	-1.24%	1.18%	2.16%	0.61%	-3.40%	0.57%
过去六个月	1.78%	0.94%	2.85%	0.50%	-1.07%	0.44%
过去一年	-2.56%	0.87%	0.24%	0.45%	-2.80%	0.42%
过去三年	-20.18%	1.06%	-1.37%	0.46%	-18.81%	0.60%
过去五年	8.94%	1.04%	19.94%	0.50%	-11.00%	0.54%
自基金合同生效起至今	8.94%	1.03%	23.08%	0.50%	-14.14%	0.53%

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

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	-1.34%	1.18%	2.16%	0.61%	-3.50%	0.57%
过去六个月	1.59%	0.94%	2.85%	0.50%	-1.26%	0.44%
过去一年	-2.94%	0.87%	0.24%	0.45%	-3.18%	0.42%
过去三年	-21.13%	1.06%	-1.37%	0.46%	-19.76%	0.60%
过去五年	6.80%	1.04%	19.94%	0.50%	-13.14%	0.54%
自基金合同 生效起至今	6.74%	1.03%	23.08%	0.50%	-16.34%	0.53%

### 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		
陈浩宇	平安可转债债券型证券投资基金基金经理	2023 年 9 月 22 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师、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 3 季度，经济内部分化持续，“外需”仍然偏强，但“内需”相关的部分仍然继续下滑。经济基本面延续了 2 季度以来的态势，4-5 月出台的政策并未对经济基本面带来明显改善。各类金融资产对基本面的定价也延续了 2 季度的态势，债券收益率下行，权益市场继续下跌。前期盈利稳定的公司股价在 3 季度也出现了明显的下跌，在 9 月中下旬 A 股成交量一度收缩至 6000 亿左右。这种格局直到 9 月 24 日央行推出稳定权益市场流动性工具后才得到扭转，而 9 月政治局会议则指向了修复居民部门和地方政府资产负债表的方向。这两个重要的会议彻底的扭转了金融市场的预期，各类金融资产对这两个重要会议也进行了“重定价”。组合保持“哑铃型”结构，估值稳定的大盘价值转债和行业景气度较高的医药、通信和电子类标的。组合在 9 月末净值显著反弹。

债券市场，利率债方面，7 月的变盘点来自央行超预期降息，利率突破前低。8 月初开始，央行提示长债风险，通过卖债和自律调查开展压力测试，债市成交缩量，利率上行，其后卖债扰动逐渐弱化、利率下行。9 月下旬，政治局会议的政策风险转变，虽然货币宽松力度较大，但增量政策预期叠加股市大涨带来的赎回，利率调整明显。

信用债方面，今年整体是下行，8 月调整开始且信用利差走阔，长期限、低等级信用债表现更弱。季末回表、SPV 超标乃至股市上涨等因素导致赎回担忧至今仍未消解，信用债持续处于情绪偏弱状态。

权益和可转债市场，央行提供的政策工具解决了权益市场流动性差的问题，9 月末权益市场的急速上涨已经使得市场估值水平明显修复，我们持有的标的在市场修复过程中表现仍然良好，但短期快速的上涨已经将标的的估值水平显著推升。在市场情绪高涨的阶段更需要平衡标的估值潜在的提升空间和业绩的持续性，对权益敞口进行调整来应对市场变化。

#### 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 1.0894 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.24%，同期业绩比较基准收益率为 2.16%；截至本报告期末平安可转债 C 的基金份额净值 1.0674 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.34%，同期业绩比较基准收益率为 2.16%。

#### 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	7,798,327.47	12.04
	其中：股票	7,798,327.47	12.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,827,685.15	84.66
	其中：债券	54,827,685.15	84.66
	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	1,636,730.58	2.53
8	其他资产	495,999.86	0.77
9	合计	64,758,743.06	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	676,702.00	1.43
C	制造业	5,547,750.92	11.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	286,025.00	0.61
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	-	-
J	金融业	752,200.00	1.59
K	房地产业	367,500.00	0.78
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	168,149.55	0.36
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	7,798,327.47	16.51

### 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	300750	宁德时代	3,000	755,670.00	1.60
2	600036	招商银行	20,000	752,200.00	1.59

3	688169	石头科技	2,691	747,882.72	1.58
4	000333	美的集团	9,000	684,540.00	1.45
5	000338	潍柴动力	40,000	634,800.00	1.34
6	600276	恒瑞医药	10,500	549,150.00	1.16
7	603605	珀莱雅	4,800	528,432.00	1.12
8	002032	苏泊尔	8,400	491,568.00	1.04
9	600690	海尔智家	15,000	482,250.00	1.02
10	601899	紫金矿业	23,300	422,662.00	0.90

#### 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	2,419,263.12	5.12
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）	52,408,422.03	110.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,827,685.15	116.10

#### 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	110085	通 22 转债	38,900	4,005,844.20	8.48
2	132026	G 三峡 EB2	30,000	3,875,602.19	8.21
3	113044	大秦转债	27,080	3,215,968.12	6.81
4	113053	隆 22 转债	28,840	2,936,825.40	6.22
5	110075	南航转债	21,880	2,683,263.69	5.68

#### 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。

#### 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	8,649.68
2	应收证券清算款	332,909.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	153,188.44
6	其他应收款	1,252.44
7	其他	-
8	合计	495,999.86

### 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	110085	通 22 转债	4,005,844.20	8.48
2	132026	G 三峡 EB2	3,875,602.19	8.21
3	113044	大秦转债	3,215,968.12	6.81
4	113053	隆 22 转债	2,936,825.40	6.22
5	110075	南航转债	2,683,263.69	5.68
6	127056	中特转债	2,427,198.91	5.14
7	113066	平煤转债	2,275,676.31	4.82

8	127039	北港转债	2,177,360.76	4.61
9	110083	苏租转债	2,063,472.99	4.37
10	113067	燃 23 转债	2,040,620.72	4.32
11	127084	柳工转 2	1,498,162.17	3.17
12	123221	力诺转债	1,239,305.20	2.62
13	118046	诺泰转债	1,143,373.98	2.42
14	123107	温氏转债	1,000,733.95	2.12
15	123178	花园转债	941,408.45	1.99
16	127088	赫达转债	929,868.90	1.97
17	127086	恒邦转债	889,137.50	1.88
18	113049	长汽转债	735,509.05	1.56
19	113621	彤程转债	718,884.12	1.52
20	113060	浙 22 转债	547,571.30	1.16
21	127095	广泰转债	539,203.97	1.14
22	123194	百洋转债	529,982.47	1.12
23	118039	煜邦转债	450,557.20	0.95
24	128082	华锋转债	443,090.63	0.94
25	110093	神马转债	381,499.67	0.81
26	113668	鹿山转债	377,105.66	0.80
27	123222	博俊转债	376,519.74	0.80
28	113615	金诚转债	358,677.73	0.76
29	123227	雅创转债	357,987.94	0.76
30	123182	广联转债	341,971.93	0.72
31	127091	科数转债	339,908.22	0.72
32	118034	晶能转债	339,268.57	0.72
33	113588	润达转债	328,555.99	0.70
34	127052	西子转债	324,131.20	0.69
35	127079	华亚转债	322,624.16	0.68
36	113058	友发转债	320,730.78	0.68
37	113534	鼎胜转债	292,712.75	0.62
38	123226	中富转债	289,771.78	0.61
39	123184	天阳转债	288,596.29	0.61
40	123025	精测转债	277,978.36	0.59
41	127081	中旗转债	276,899.89	0.59
42	113061	拓普转债	273,355.91	0.58
43	123213	天源转债	270,030.58	0.57
44	127027	能化转债	252,406.91	0.53
45	110074	精达转债	248,703.43	0.53
46	123170	南电转债	240,724.70	0.51
47	118037	上声转债	240,323.18	0.51
48	128083	新北转债	237,551.00	0.50
49	113549	白电转债	237,363.78	0.50

50	127014	北方转债	234,989.74	0.50
51	111015	东亚转债	233,785.18	0.50
52	123085	万顺转 2	233,227.50	0.49
53	118038	金宏转债	231,739.51	0.49
54	123089	九洲转 2	231,135.77	0.49
55	127103	东南转债	230,606.78	0.49
56	113632	鹤 21 转债	228,474.21	0.48
57	110090	爱迪转债	224,323.19	0.48
58	113651	松霖转债	190,214.70	0.40
59	128081	海亮转债	187,989.97	0.40
60	113546	迪贝转债	185,808.33	0.39
61	128129	青农转债	176,181.19	0.37
62	123225	翔丰转债	162,425.03	0.34
63	123198	金埔转债	145,670.57	0.31
64	123207	冠中转债	144,546.18	0.31
65	123237	佳禾转债	141,013.04	0.30
66	113033	利群转债	136,996.21	0.29
67	123228	震裕转债	136,531.86	0.29
68	111012	福新转债	136,064.78	0.29
69	111016	神通转债	135,537.72	0.29
70	127041	弘亚转债	131,225.93	0.28
71	123232	金现转债	130,909.07	0.28
72	113662	豪能转债	129,907.87	0.28
73	123218	宏昌转债	127,071.53	0.27
74	123199	山河转债	125,214.81	0.27
75	113669	景 23 转债	46,626.21	0.10
76	128122	兴森转债	34,007.39	0.07
77	110058	永鼎转债	24,481.29	0.05
78	128087	孚日转债	6,405.81	0.01
79	118042	奥维转债	5,121.78	0.01
80	127031	洋丰转债	4,520.19	0.01
81	123050	聚飞转债	3,908.75	0.01
82	123210	信服转债	3,143.94	0.01
83	113059	福莱转债	3,081.41	0.01
84	113646	永吉转债	2,676.65	0.01
85	113637	华翔转债	2,499.61	0.01
86	123234	中能转债	2,325.38	0.00
87	127074	麦米转 2	1,204.67	0.00
88	123117	健帆转债	1,158.89	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	平安可转债 A	平安可转债 C
报告期期初基金份额总额	23,719,164.92	21,066,119.34
报告期期间基金总申购份额	259,470.61	872,892.62
减：报告期期间基金总赎回份额	904,923.47	1,245,799.87
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	23,073,712.06	20,693,212.09

## §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

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 10 月 24 日