

平安添利债券型证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 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：2026 年 07 月 20 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约定，于 2026 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 2026 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	4,828,471,456.35 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	中债-优选投资级信用债指数收益率*80%+ 银行活期存款利率(税后)*10%+ 中证可转换债券指数收益率*10%		
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	平安添利债券 E
下属分级基金的交易代码	700005	700006	027680
报告期末下属分级基金的份额总额	3,894,712,424.22 份	659,676,368.94 份	274,082,663.19 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（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）		报告期（2026 年 5 月 22 日-2026 年 6 月 30 日）
	平安添利债券 A	平安添利债券 C	平安添利债券 E
1. 本期已实现收益	22,617,088.05	2,938,287.12	-21,674.99
2. 本期利润	39,797,580.92	5,147,501.78	305,655.39
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0103	0.0073	0.0053
4. 期末基金资产净值	4,693,595,942.05	788,293,478.73	330,303,680.29
5. 期末基金份额净值	1.2051	1.1950	1.2051

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	0.88%	0.06%	0.71%	0.09%	0.17%	-0.03%
过去六个月	1.78%	0.06%	1.03%	0.10%	0.75%	-0.04%
过去一年	3.25%	0.06%	1.30%	0.09%	1.95%	-0.03%
过去三年	13.03%	0.07%	13.94%	0.10%	-0.91%	-0.03%
过去五年	19.85%	0.08%	25.38%	0.08%	-5.53%	0.00%
过去七年	29.70%	0.08%	35.93%	0.08%	-6.23%	0.00%
过去十年	42.78%	0.08%	51.06%	0.08%	-8.28%	0.00%
自基金合同	98.90%	0.20%	83.41%	0.08%	15.49%	0.12%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

平安添利债券 C

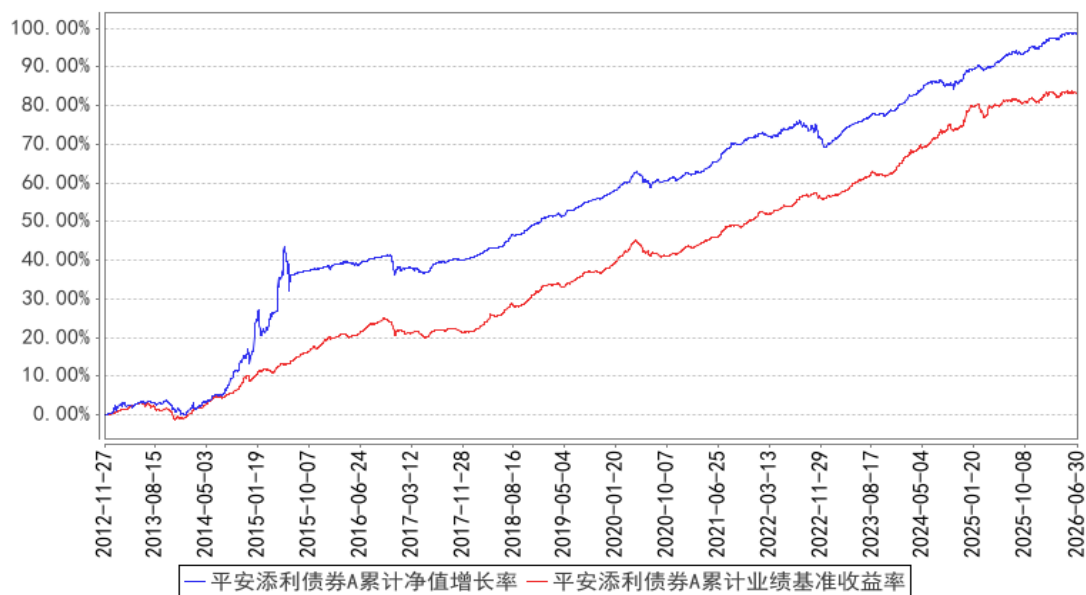
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.78%	0.06%	0.71%	0.09%	0.07%	-0.03%
过去六个月	1.59%	0.06%	1.03%	0.10%	0.56%	-0.04%
过去一年	2.83%	0.06%	1.30%	0.09%	1.53%	-0.03%
过去三年	11.69%	0.07%	13.94%	0.10%	-2.25%	-0.03%
过去五年	17.46%	0.08%	25.38%	0.08%	-7.92%	0.00%
过去七年	26.11%	0.08%	35.93%	0.08%	-9.82%	0.00%
过去十年	36.97%	0.08%	51.06%	0.08%	-14.09%	0.00%
自基金合同 生效起至今	87.79%	0.20%	83.41%	0.08%	4.38%	0.12%

平安添利债券 E

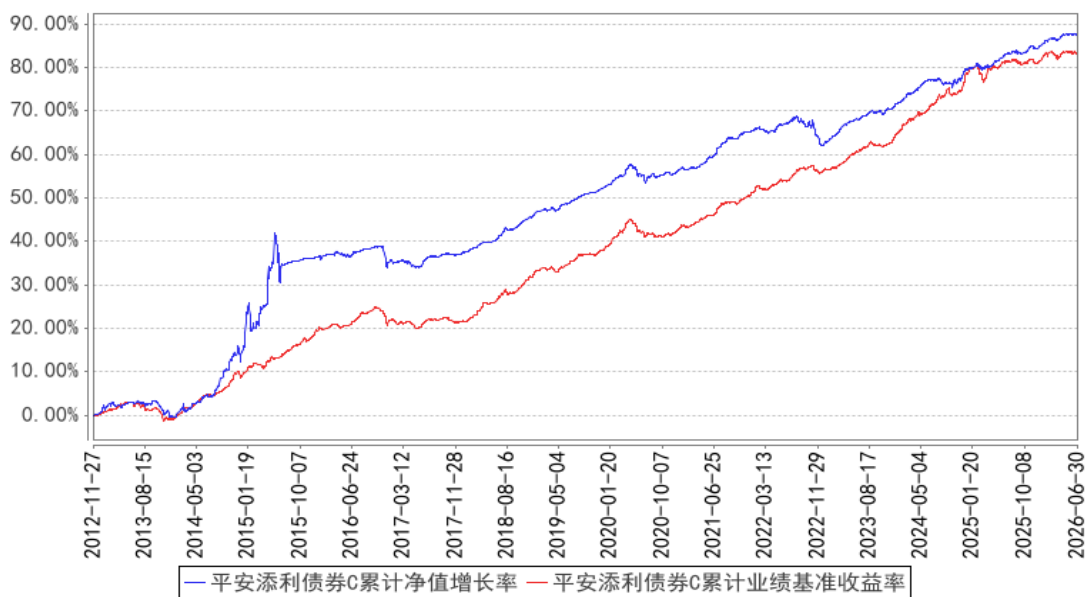
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
自基金合同 生效起至今	0.02%	0.06%	-0.14%	0.08%	0.16%	-0.02%

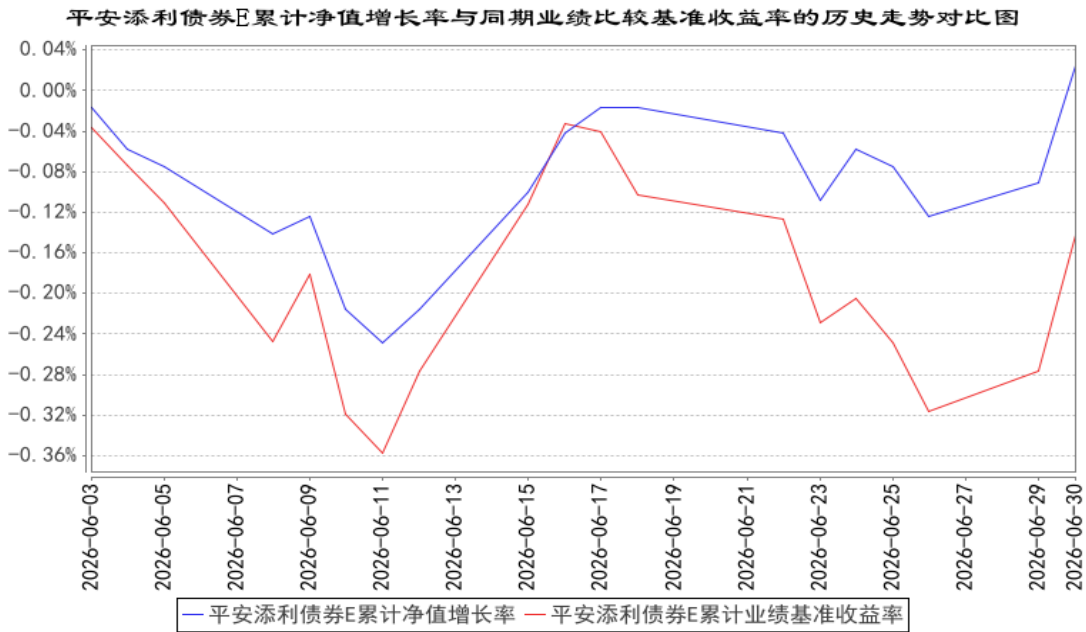
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收
率变动的比较

平安添利债券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



平安添利债券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 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、本基金于 2026 年 05 月 22 日增设 E 类份额，E 类份额从 2026 年 06 月 03 日开始有份额，所以以上 E 类份额走势图从 2026 年 06 月 03 日开始。

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	-	14 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、平安添裕债券型证券投资基金、平安瑞和 6 个月持有期混合

					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《基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，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的规定及基金合同的约定。

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

2026 年二季度债券市场整体呈现震荡走强、利多共振态势。4 月初超长期特别国债供给扰动，10 年期国债收益率一度在 1.81%-1.82%高位震荡；4 月中旬后，资金面转向极度宽松、地缘冲突缓和，长端震荡下行至 1.75%下方。5 月初央行大额净回笼曾引发短端阶段性调整，5 月中下旬受基本面偏弱及 MLF 超额投放推动，收益率重回下行，10 年期国债一度下探至 1.70%附近。6 月受资金波动加大影响，10Y 国债区间窄幅震荡。

权益市场二季度先抑后扬、结构极致分化。4 月初受地缘冲突余波及外需担忧影响出现快速调整；4 月中旬后随伊朗局势阶段性缓和及国内流动性宽松，风险偏好持续修复，AI 算力硬件与

高端制造引领反弹，光模块、PCB、光纤光缆等方向受益于 AI 资本开支强劲，业绩与估值双升，6 月中下旬部分科技细分板块因拥挤度过高出现调整并向上游涨价链扩散，而红利价值和顺周期板块由于资金流出压力加速下跌。

转债市场二季度整体跟随权益市场震荡，4 月伊朗冲突余波中高价位转债估值承压，5 月后随正股回暖有所修复，偏股型转债表现强势，平衡型转债凭借攻守兼备特性亦获得资金青睐，6 月转债市场走弱，呈现跟权益市场一样的极致分化。

报告期内，本基金整体维持中等久期和杠杆，以获取票息收益和骑乘收益为主，随着 5 月油价回落及国内资金宽松，逐步适度拉长久期和提高杠杆。转债以增强组合收益为目标，品种上以平衡型转债为主，并适度参与了 AI 相关板块的偏股型转债，同时保留了部分高等级偏债型转债作为底仓防御。

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 1.2051 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.88%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%；截至本报告期末平安添利债券 C 的基金份额净值 1.1950 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.78%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%；截至本报告期末平安添利债券 E 的基金份额净值 1.2051 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.02%，同期业绩比较基准收益率为-0.14%。

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	7,350,379,167.09	99.59
	其中：债券	7,350,379,167.09	99.59
	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	23,015,950.71	0.31
8	其他资产	7,072,785.40	0.10
9	合计	7,380,467,903.20	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境内股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,220,539,227.14	21.00
	其中：政策性金融债	455,107,879.19	7.83
4	企业债券	730,285,754.32	12.56
5	企业短期融资券	20,203,360.00	0.35
6	中期票据	4,033,033,350.87	69.39
7	可转债（可交换债）	221,171,075.58	3.81
8	同业存单	-	-
9	其他	1,125,146,399.18	19.36
10	合计	7,350,379,167.09	126.46

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	232380076	23 建行二级资本债 03A	1,260,000	133,549,747.40	2.30
2	232580006	25 民生银行二级资本债 01	1,100,000	112,524,605.48	1.94
3	250431	25 农发 31	1,110,000	112,408,696.44	1.93
4	210208	21 国开 08	950,000	97,450,531.51	1.68
5	232380052	23 农行二级资本债 02A	900,000	95,549,178.08	1.64

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

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，国家开发银行、中国农业发展银行、中国建设银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国农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约定的备选股票库

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	48,615.75
2	应收证券清算款	1,901,043.46
3	应收股利	—

4	应收利息	-
5	应收申购款	5,123,126.19
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,072,785.40

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	113052	兴业转债	35,349,169.81	0.61
2	123176	精测转 2	10,476,917.26	0.18
3	118024	冠宇转债	9,766,777.98	0.17
4	113697	应流转债	8,481,128.43	0.15
5	123195	蓝晓转 02	6,385,808.45	0.11
6	118060	瑞可转债	6,173,786.56	0.11
7	118058	微导转债	5,973,928.20	0.10
8	113694	清源转债	5,796,120.49	0.10
9	118031	天 23 转债	5,561,936.75	0.10
10	123165	回天转债	5,325,834.42	0.09
11	123215	铭利转债	5,085,861.52	0.09
12	127089	晶澳转债	4,816,036.40	0.08
13	123253	永贵转债	4,680,265.61	0.08
14	118030	睿创转债	4,570,409.15	0.08
15	123193	海能转债	4,398,406.72	0.08
16	118062	天准转债	4,302,729.73	0.07
17	128136	立讯转债	4,242,751.83	0.07
18	118013	道通转债	4,165,594.38	0.07
19	123258	胜蓝转 02	3,958,212.76	0.07
20	118035	国力转债	3,937,843.05	0.07
21	111018	华康转债	3,860,495.77	0.07
22	118056	路维转债	3,777,015.12	0.06
23	123158	宙邦转债	3,605,727.07	0.06
24	123255	鼎龙转债	3,562,202.21	0.06
25	113693	志邦转债	3,162,228.12	0.05
26	113070	渝水转债	3,109,897.98	0.05
27	118059	顾中转债	3,057,780.45	0.05
28	127111	金威转债	2,557,905.95	0.04
29	127037	银轮转债	2,553,789.37	0.04
30	127083	山路转债	2,420,654.84	0.04
31	127102	浙建转债	2,382,577.15	0.04
32	123192	科思转债	2,224,503.23	0.04
33	127084	柳工转 2	2,220,715.71	0.04
34	113695	华辰转债	2,050,210.40	0.04

35	127055	精装转债	2,035,437.76	0.04
36	127108	太能转债	1,945,213.42	0.03
37	118051	皓元转债	1,893,112.25	0.03
38	113066	平煤转债	1,556,169.09	0.03
39	123216	科顺转债	1,545,423.46	0.03
40	127082	亚科转债	1,522,152.83	0.03
41	123259	锦浪转 02	1,430,570.33	0.02
42	118012	微芯转债	1,322,139.56	0.02
43	113652	伟 22 转债	1,292,339.14	0.02
44	113632	鹤 21 转债	1,175,559.67	0.02
45	123209	聚隆转债	1,120,708.62	0.02
46	132026	G 三峡 EB2	773,887.12	0.01
47	118022	锂科转债	642,750.48	0.01
48	123252	银邦转债	595,518.92	0.01
49	111021	奥锐转债	573,218.88	0.01
50	113067	燃 23 转债	522,081.79	0.01
51	127110	广核转债	447,768.08	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：本基金本报告期末未持有股票。

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	平安添利债券 E
报告期期初基金份额总额	3,730,589,244.51	476,159,079.51	—
报告期期间基金总申购份额	292,968,126.56	552,197,251.97	274,090,960.83
减：报告期期间基金总赎回份额	128,844,946.85	368,679,962.54	8,297.64
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	3,894,712,424.22	659,676,368.94	274,082,663.19

§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

为更好地满足投资者的投资理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等法律法规的规定及平安添利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同的约定，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）在与本基金基金托管人中国银行股份有限公司协商一致的基础上，决定自 2026 年 5 月 22 日起在现有基金份额的基础上增设 E 类基金份额。为此，本公司对本基金的基金合同、托管协议的相关内容进行了相应修订，并更新基金管理人、托管人信息。详细内容请阅读本基金管理人于 2026 年 5 月 22 日发布的《平安基金管理有限公司关于平安添利债券型证券投资基金增设 E 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》。

§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

2026 年 07 月 20 日