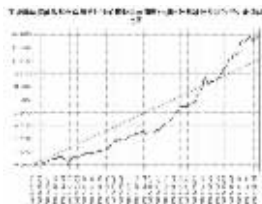


信息披露

平安鼎信债券型证券投资基金

2019年第一季度报告



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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金份额持有人的利益的行为。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
一季度货币政策强调“不搞大水漫灌”,防止“流动性幻觉”,整体宽松,但进一步宽松的可能性不大。在宽信用政策不断推进的情况下,社融逐步企稳回升,融资需求改善,市场风险偏好逐步提升。债市小幅下行,整体维持震荡态势。报告期内本基金未参与权益类投资,以中高等级信用债为主,使得基金净值保持了稳步增长。

4.5 报告期内基金的投资业绩
截至本报告期末本基金份额净值为1.0393元;本报告期基金份额净值增长率为1.63%,业绩比较基准收益率为0.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本基金本报告期末未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人、基金资产净值低于5000万元的情形。

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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	1,000,000.00	97.90
3	买入返售	500,000.00	48.95
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	其他金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,071,789.61	3.00
8	其他资产	11,241,749.28	1.09
9	合计	4,571,739.61	44.84

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.3 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

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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	81,420,000.00	14.86
4	企业债券	81,420,000.00	14.86
5	中期票据	58,456,775.00	17.36
6	地方政府债	219,882,000.00	40.82
7	可转债(可交换债)	-	-
8	其他债	97,006,000.00	17.71
9	其他	-	-
10	合计	580,682,775.00	108.89

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	1808210	18国债01	500,000	51,380,000.00	9.36
2	11100004	18国债发行	500,000	48,560,000.00	8.96
3	11101009	18国债发行	500,000	48,510,000.00	8.96
4	101450017	18国债发行	400,000	42,728,000.00	7.88
5	1808036	18国债发行	400,000	41,732,000.00	7.61

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

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

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

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

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.9.3 本期国债期货投资评价

5.10 投资组合报告附注

6.1.2 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。

6.1.3 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.4 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.5 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贵金属投资明细

6.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

6.1.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.8 本期国债期货投资政策

6.1.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.10 本期国债期货投资评价

6.1.11 投资组合报告附注

6.1.12 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。

6.1.13 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.14 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.15 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

6.1.16 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

6.1.17 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.18 本期国债期货投资政策

6.1.19 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.20 本期国债期货投资评价

6.1.21 投资组合报告附注

6.1.22 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。

6.1.23 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.24 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.25 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

6.1.26 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

6.1.27 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.28 本期国债期货投资政策

6.1.29 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.30 本期国债期货投资评价

6.1.31 投资组合报告附注

6.1.32 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。

6.1.33 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.34 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.35 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

6.1.36 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

6.1.37 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.38 本期国债期货投资政策

6.1.39 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.40 本期国债期货投资评价

6.1.41 投资组合报告附注

6.1.42 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。

6.1.43 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.44 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.45 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

6.1.46 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

6.1.47 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.48 本期国债期货投资政策

6.1.49 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.50 本期国债期货投资评价

6.1.51 投资组合报告附注

6.1.52 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。

6.1.53 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.54 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.55 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

6.1.56 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

6.1.57 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.58 本期国债期货投资政策

6.1.59 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.60 本期国债期货投资评价

6.1.61 投资组合报告附注

6.1.62 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。

6.1.63 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.64 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.65 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

6.1.66 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

6.1.67 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.68 本期国债期货投资政策

6.1.69 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.70 本期国债期货投资评价

6.1.71 投资组合报告附注

6.1.72 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。

6.1.73 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.74 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.75 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

6.1.76 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

6.1.77 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.78 本期国债期货投资政策

6.1.79 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.80 本期国债期货投资评价

6.1.81 投资组合报告附注

6.1.82 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。

6.1.83 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.84 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.85 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

6.1.86 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

6.1.87 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.88 本期国债期货投资政策

6.1.89 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.90 本期国债期货投资评价

6.1.91 投资组合报告附注

6.1.92 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。

6.1.93 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.94 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.95 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

6.1.96 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

6.1.97 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.98 本期国债期货投资政策

6.1.99 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.100 本期国债期货投资评价

6.1.101 投资组合报告附注

6.1.102 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。

6.1.103 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.104 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.105 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

6.1.106 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

6.1.107 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.108 本期国债期货投资政策

6.1.109 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.110 本期国债期货投资评价

6.1.111 投资组合报告附注

6.1.112 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。

6.1.113 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.114 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.115 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

6.1.116 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

6.1.117 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.118 本期国债期货投资政策

6.1.119 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.120 本期国债期货投资评价

6.1.121 投资组合报告附注

6.1.122 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。

6.1.123 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.124 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.125 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

6.1.126 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

6.1.127 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.128 本期国债期货投资政策

6.1.129 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.130 本期国债期货投资评价

6.1.131 投资组合报告附注

6.1.132 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。

6.1.133 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.134 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.135 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

6.1.136 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

6.1.137 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.138 本期国债期货投资政策

6.1.139 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.140 本期国债期货投资评价

6.1.141 投资组合报告附注

6.1.142 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。

6.1.143 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.144 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.145 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

6.1.146 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

6.1.147 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.148 本期国债期货投资政策

6.1.149 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.150 本期国债期货投资评价

6.1.151 投资组合报告附注

6.1.152 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。

6.1.153 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.154 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.155 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

6.1.156 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

6.1.157 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.1.158 本期国债期货投资政策

6.1.159 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

6.1.160 本期国债期货投资评价

6.1.161 投资组合报告附注

6.1.162 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。

6.1.163 本基金本报告期末未持有股票。

6.1.164 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.1.165 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