

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:2019年4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、误导性陈述或者重大遗漏,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2019年4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2019年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

平安鼎信债券型证券投资基金



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》及其各项实施细则、《平安鼎信债券型证券投资基金基金合同》和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运用基金资产,为基金持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金管理人符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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

本基金在本报告期内不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的证券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。在宽松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 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0393元;本基金份额净值净值增长率为1.60%,业绩比较基准收益率为0.95%。

4.6 报告期内基金的净值表现

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量不

满200人,基金资产净值低于6000万元的情形。

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) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 - -

2 固定收益投资 500,000,000.00 93.06

3 金融衍生品 - -

4 买入返售金融资产 61,429,000.00 1.14

5 其他资产 81,429,000.00 1.49

6 负债合计 81,429,000.00 1.49

7 可转换债券 - -

8 其他应收款 98,456,775.00 1.78

9 其他 - -

10 合计 506,002,750.00 100.00

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 100210 100万开10 500,000 51,300,000.00 93.06

2 11190014 100万银行 500,000 48,560,000.00 93.06

3 11190026 100万银行 C020 500,000 48,515,000.00 93.05

4 10146017 14年国债 MT2001 400,000 42,728,000.00 7.80

5 100025 100万国债 400,000 41,722,000.00 7.03

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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期内未持有权证。

5.9 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股票投资政策

本基金本报告期内未持有股票。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 银行监管部门于2018年4月19日做出银保监银罚决字(2018)1号处罚决定,由于兴业银行股份有限公司(以下简称“公司”):(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券买卖出回购业务违规表外;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)未相互通报转让个人资产;(十二)向四证不齐的房地产项目提供融资。根据相关对本公司罚款5870万元。本基金管理人对公司进行了深入的了解和分析,认为该事项有利于公司规范开展业务,对公司的偿债能力不会造成重大不利影响。我们对该项投资的严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。到公开谴责、处罚。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管

部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2 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	540,00
2	应收证券清算款	2,080,000.00
3	应收利息	-
4	应收股利	9,260,096.45
5	应收申购款	-
6	买入返售金融资产	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,341,240.26

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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 报告期末前十名债券中存在流通受限情况的说明

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

报告期初基金份额总额	报告期期间内申购金额	报告期期间内赎回金额	报告期期末基金份额总额
627,393,046.00	627,393,046.00	0.00	627,393,046.00
报告期期间内申购金额	报告期期间内赎回金额	报告期期末基金份额总额	
5,113,60	5,113,60		

报告期期间内申购金额

报告期期间内赎回金额

报告期期末基金份额总额

报告期期间内申购金额

报告期期间内赎回金额

报告期期末基金份额总额