

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7月15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，并对其中内容的真实性、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7月12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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	平安鼎信债券
场内简称	-
交易代码	000298
前庭交易代码	-
后庭交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月21日
报告期末基金份额总额	22,312,948.00

在谨慎投资的前提下，力求基金业绩比较基准，追求基金资产的长期稳定增值。

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7月12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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

## § 3 基金产品概况

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	8,081,897.00
2.本期利润	-3,118,007.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0165
4.期末基金资产净值	23,274.12
5.期末基金份额净值	1.0431

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；扣除相关费用后的余额，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 本报告期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

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 0.07% 0.08% 0.01% -0.06% -0.07%

业绩比较基准:三年期银行定期存款收益率(税后)+1.5%

注:2.本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

## 平安鼎信债券型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

## 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、信守承诺、取信于市场、取信于社会的原则管理基金，为基金持有人谋求最大利益。本基金报告期内运用基金资产，为基金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，没有损害基金持有人利益的行为。

## 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，本基金管理人严格按照《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 报告期内基金投资策略的运用分析

二季度债券整体波动较大，前期受经济数据超预期影响，各类债券收益率大幅上行，后续经济数据、贸易战加剧影响，收益率有所下行，但各类主要债券整体依然上行。整个季度支持债市整体走牛的两大逻辑：基本面趋弱，资金面宽松(仍在)、主要是受事件性冲击，导致债市小幅上行，整体保持震荡态势。报告期内本基金未参与权益类投资，因申赎原因，使得基金净值有所波动。

## 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1.0431元；本报告期基金份额净值增长率0.37%，业绩比较基准收益率0.95%。

## 4.6 报告期内基金净值增长率预告说明

本基金报告期内出现连续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5,000万元的情形。

## 4.7 投资组合报告

本基金报告期末未持有股票。

## 4.8 报告期内按行业分类的境内股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

## 4.9 报告期内按行业分类的境外股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

## 4.10 报告期内基金的资产配置

本基金报告期末未持有股票。

## 4.11 报告期内基金的组合类金融产品投资

本基金报告期末未持有股票。

## 4.12 报告期内基金的其他投资

本基金报告期末未持有股票。

## 4.13 报告期内其他重要信息

本基金报告期内未发生其他重要信息。

## 4.14 报告期内基金的利润分配情况

本基金报告期内未发生利润分配情况。

## 4.15 报告期内基金的费用情况

本基金报告期内未发生费用情况。

## 4.16 报告期内基金的税收情况

本基金报告期内未发生税收情况。

## 4.17 报告期内基金的关联交易

本基金报告期内未发生关联交易。

## 4.18 报告期内信息披露费的列支情况

本基金报告期内未发生信息披露费的列支情况。

## 4.19 报告期内基金的其他费用

本基金报告期内未发生其他费用。

## 4.20 报告期内其他重要信息

本基金报告期内未发生其他重要信息。

## 4.21 报告期内基金的利润分配情况

本基金报告期内未发生利润分配情况。

## 4.22 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通股票。

## 4.23 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

本基金报告期末未持有股票。

## 4.24 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

本基金报告期末未持有债券。

## 4.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

## 4.26 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贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属。

## 4.27 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权证及金融衍生品投资明细

本基金报告期末未持有权证及金融衍生品。

## 4.28 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资产组合投资明细

本基金报告期末未持有资产组合。

## 4.29 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基金投资明细

本基金报告期末未持有基金。

## 4.30 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组合

本基金报告期末未持有股票。

## 4.31 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债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

## 4.32 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资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

## 4.33 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贵金属投资组合

本基金报告期末未持有贵金属。

## 4.34 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及金融衍生品投资组合

本基金报告期末未持有权证及金融衍生品。

## 4.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资组合

本基金报告期末未持有基金。

## 4.36 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股票投资组合

本基金报告期末未持有股票。

## 4.37 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债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

## 4.38 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资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

## 4.39 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贵金属投资组合

本基金报告期末未持有贵金属。

## 4.40 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及金融衍生品投资组合

本基金报告期末未持有权证及金融衍生品。

## 4.41 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基金投资组合

本基金报告期末未持有基金。

## 4.42 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组合

本基金报告期末未持有股票。

## 4.43 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债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

## 4.44 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资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

## 4.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

本基金报告期末未持有贵金属。

## 4.46 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及金融衍生品投资组合

本基金报告期末未持有权证及金融衍生品。

## 4.47 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基金投资组合

本基金报告期末未持有基金。

## 4.48 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组合

本基金报告期末未持有股票。

## 4.49 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债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

## 4.50 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资产支持证券投资组合

本基金报告期末未持有资产支持证券。

## 4.51 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贵金属投资组合

本基金报告期末未