

平安鼎信债券型证券投资基金

2021 年第 2 季度报告

2021 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 07 月 20 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 2021 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安鼎信债券
基金主代码	002988
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	20,038,817.05 份
投资目标	在谨慎投资的前提下,力争战胜业绩比较基准,追求基金资产的长期、稳健、持续增值。
投资策略	转型为“平安鼎信债券型证券投资基金”后,本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置,把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会,根据宏观经济、基准利率水平等因素,预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平,结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,进行大类资产配置。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险均高于货币市场基金,但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	平安银行股份有限公司

§ 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(2021年4月1日-2021年6月30日)
--------	---------------------------

1. 本期已实现收益	56,916.46
2. 本期利润	170,711.41
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0085
4. 期末基金资产净值	20,390,089.60
5. 期末基金份额净值	1.0175

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；

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。

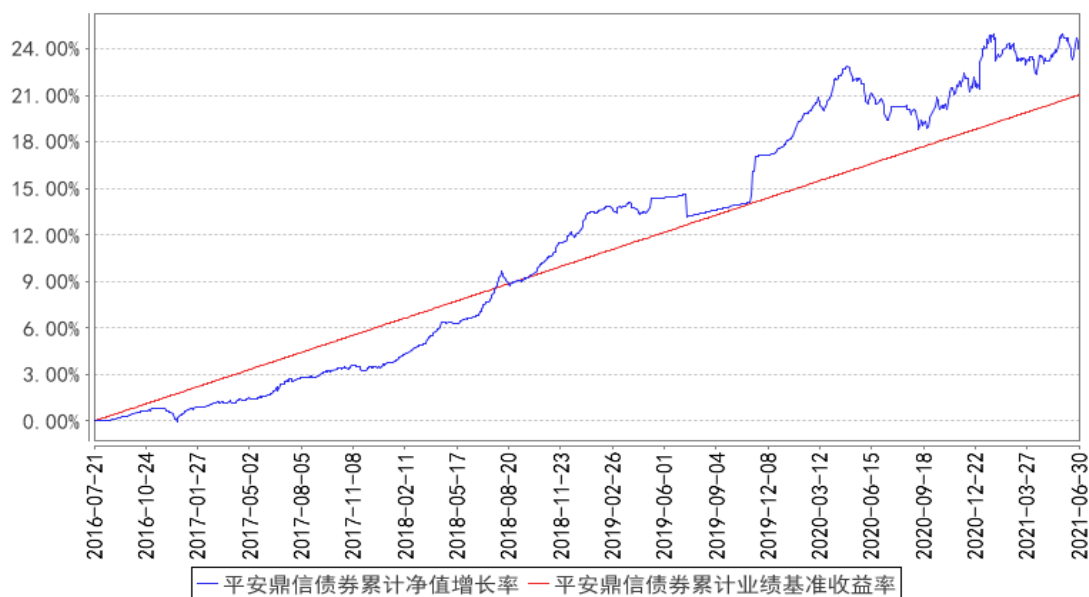
3.2 基金净值表现

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

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	0.84%	0.19%	0.88%	0.01%	-0.04%	0.18%
过去六个月	0.94%	0.20%	1.77%	0.01%	-0.83%	0.19%
过去一年	3.03%	0.20%	3.64%	0.01%	-0.61%	0.19%
过去三年	16.09%	0.15%	11.79%	0.01%	4.30%	0.14%
自基金合同 生效起至今	24.29%	0.12%	21.03%	0.01%	3.26%	0.11%

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

平安鼎信债券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 2016 年 7 月 21 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		
苏宁	平安鼎信债券型证券投资基金基金经理	2021 年 5 月 28 日	-	9 年	苏宁先生，北京大学西方经济学硕士研究生。曾先后担任易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益研究员兼基金经理助理。2019 年 6 月加入平安基金管理有限公司，曾任固定收益投资中心投资经理。现担任平安惠诚纯债债券型证券投资基金、平安元盛超短债债券型证券投资基金、平安鼎弘混合型证券投资基金（LOF）、平安合享 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠润纯债债券型证券投资基金、平安惠享纯债债券型证券投资基金、平安鼎信债券型证券投资基金、平安合悦定期开放债券型发起式证券

					投资基金、平安合泰 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安元丰中短债债券型证券投资基金基金经理。
余斌	平安鼎信债券型证券投资基金基金经理	2017 年 10 月 16 日	2021 年 6 月 11 日	8 年	余斌先生，哈尔滨工业大学硕士。先后担任大公国际资信评估有限公司评级部分析师、华西证券股份有限公司固定收益总部项目经理、长城证券股份有限公司资产管理部信用研究员、华创证券有限责任公司投资银行资本市场部高级副总监。2015 年 10 月加入平安基金管理有限公司，曾任投资研究部固定收益研究员、平安惠享纯债债券型证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、平安惠隆纯债债券型证券投资基金、平安鼎信债券型证券投资基金、平安惠盈纯债债券型证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合慧定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安合悦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、平安惠兴纯债债券型证券投资基金、平安合泰 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、平安惠泽纯债债券型证券投资基金、平安惠涌纯债债券型证券投资基金、平安惠文纯债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

2021 年 2 季度，经济增速向潜在增速回归，制造业投资恢复，失业率有所降低，PPI 如预期走高，核心 CPI 整体水平不高。货币政策以稳为主，资金面整体宽松。债券收益率有所下行，信用利差与级别利差压缩。权益市场整体震荡上涨。本基金 2 季度权益仓位保持稳定。持仓结构方面，权益主要配置高景气行业龙头，债券配置短久期品种。

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 1.0175 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.84%，业绩比较基准收益率为 0.88%。

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	3,520,635.25	15.05
	其中：股票	3,520,635.25	15.05
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	18,795,842.80	80.35
	其中：债券	18,795,842.80	80.35
	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	600,583.12	2.57
8	其他资产	475,134.23	2.03
9	合计	23,392,195.40	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	148,018.00	0.73
C	制造业	1,703,924.00	8.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	155,682.00	0.76
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	69,531.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	140,775.00	0.69
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	865,783.00	4.25
K	房地产业	382,992.00	1.88
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	53,930.25	0.26
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	3,520,635.25	17.27

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	601012	隆基股份	2,800	248,752.00	1.22
2	601600	中国铝业	37,400	198,220.00	0.97
3	601688	华泰证券	12,100	191,180.00	0.94
4	600048	保利地产	14,700	176,988.00	0.87
5	600886	国投电力	16,200	155,682.00	0.76
6	300699	光威复材	1,600	121,520.00	0.60
7	601319	中国人保	19,700	116,821.00	0.57
8	601601	中国太保	4,000	115,880.00	0.57
9	002353	杰瑞股份	2,500	111,750.00	0.55
10	000069	华侨城 A	14,100	104,904.00	0.51

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	2,417,559.50	11.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	583,571.40	2.86
	其中：政策性金融债	583,571.40	2.86
4	企业债券	1,000,000.00	4.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	14,794,711.90	72.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,795,842.80	92.18

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	019547	16 国债 19	15,050	1,417,559.50	6.95
2	113044	大秦转债	9,840	1,012,634.40	4.97
3	110059	浦发转债	9,850	1,008,935.50	4.95
4	132015	18 中油 EB	9,800	1,002,050.00	4.91
5	132009	17 中油 EB	9,720	1,000,188.00	4.91

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：本基金本报告期末无权证投资。

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配进行灵活操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-150.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

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

上海银保监局于 2020 年 8 月 10 日做出沪银保监银罚决字〔2020〕12 号处罚决定，由于上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）：1. 未按专营部门制规定开展同业业务；2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3. 延迟支付同业投资资金吸收存款；4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制；6. 个人消费贷款贷后管理未尽职；7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模；8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；9. 办理无真实贸易背景的贴现业务；10. 委托贷款资金来源审查未尽职；11. 未按

权限和程序办理委托贷款业务；12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务。根据相关规定对公司罚款 2100 万元。

上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 5 月至 2019 年 1 月期间，未按规定开展代销业务，中国银行保险监督管理委员会上海监管局根据相关规定作出沪银保监罚决字（2021）29 号处罚决定，要求公司责令改正，并处罚款共计 760 万元。

本基金管理人对上述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，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资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。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,065.04
2	应收证券清算款	338,338.08
3	应收股利	-
4	应收利息	126,501.30
5	应收申购款	229.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	475,134.23

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	113044	大秦转债	1,012,634.40	4.97
2	110059	浦发转债	1,008,935.50	4.95
3	132015	18 中油 EB	1,002,050.00	4.91
4	132009	17 中油 EB	1,000,188.00	4.91
5	132004	15 国盛 EB	991,287.00	4.86
6	132007	16 凤凰 EB	987,056.40	4.84
7	132008	17 山高 EB	984,474.20	4.83
8	110052	贵广转债	673,046.50	3.30
9	132022	20 广版 EB	404,088.10	1.98

10	128129	青农转债	395,382.00	1.94
11	123077	汉得转债	331,226.28	1.62
12	113569	科达转债	316,220.00	1.55
13	113584	家悦转债	301,440.60	1.48
14	113011	光大转债	288,950.00	1.42
15	110051	中天转债	287,075.00	1.41
16	113593	沪工转债	269,862.00	1.32
17	128135	洽洽转债	228,400.00	1.12
18	123074	隆利转债	220,750.20	1.08
19	128018	时达转债	216,847.00	1.06
20	127027	靖远转债	209,083.60	1.03
21	128083	新北转债	207,813.90	1.02
22	123053	宝通转债	207,483.00	1.02
23	123076	强力转债	205,774.80	1.01
24	127020	中金转债	202,945.00	1.00
25	127006	敖东转债	200,910.60	0.99
26	128048	张行转债	191,800.00	0.94
27	110043	无锡转债	148,737.60	0.73
28	110077	洪城转债	148,337.10	0.73
29	128078	太极转债	142,972.00	0.70
30	128137	洁美转债	130,345.80	0.64
31	123083	朗新转债	121,641.30	0.60
32	110063	鹰 19 转债	117,990.00	0.58
33	123066	赛意转债	117,610.00	0.58
34	110048	福能转债	102,856.60	0.50
35	113550	常汽转债	102,819.30	0.50
36	113611	福 20 转债	101,533.10	0.50
37	128141	旺能转债	73,726.80	0.36
38	123078	飞凯转债	40,296.30	0.20
39	110047	山鹰转债	38,501.10	0.19
40	132011	17 浙报 EB	10,050.00	0.05

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：本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	20,039,690.34
报告期期间基金总申购份额	7,011.47
减：报告期期间基金总赎回份额	7,884.76
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	20,038,817.05

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	17,962,279.21
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	17,962,279.21
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	89.64

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2021/04/01--2021/06/30	17,962,279.21	-	-	17,962,279.21	89.64
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

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鼎信债券型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安鼎信债券型证券投资基金基金合同
- (3) 平安鼎信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

基金管理人、基金托管人住所

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：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日