

# 鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金

基金管理人:鹏华基金管理有限公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司  
送出日期:2018年08月27日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会、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责任，但不对法律负责。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年08月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务计划报告、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。

基金管理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及其更新。

本年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华丰融定期开放债券
基金代码	000346
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月10日
基金托管人	鹏华基金管理有限公司
报告期末基金份额总额	77,637,920,677份
基金合同延续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 在有效控制风险的基础上，通过每年定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金基准比较基准的收益。

投资策略 本基金将投资于短期利率债、货币市场工具、银行间资金回购、同业存单、信用债、债券回购、债券质押回购等，在有效控制风险的前提下，通过定期开放的形式保持适度流动性，力求获得超越基金基准比较基准的收益。

业绩比较基准 一年期定期存款利率+0.05%

风险收益特征 本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。

注:无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
姓名	张文	陆志忠
负责人	0756-82362710	956659
电子邮箱	zhangwe@phfund.com.cn	luzh@bankcomm.com
客户服务电话	40067-88999	956659
传真	0756-82021216	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.phfund.com.cn  
基金半年度报告置地地点: 深圳市福田区福华二路10号深国国际商务中心A座33层鹏华基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1 利润数据和费用		报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)	
本期实现收益	3,776,703.99	本期利润	3,899,101.26
加权平均基金份额本期利润	0.0473		
本期基金份额净值增长率	3.88%		
3.1.2 期末未到期摊余类理财产品	报告期(2018年06月30日)		
期末可供分配利润	0.2033		
期末基金净值	98,467,154.29		
期末基金总份额	1,281		

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(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3)表中的“期末”均指报告期最后一日,即6月30日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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	份额增长(%)	份额净值增长率(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去一个月	0.24	0.14	0.16	0.01	0.08
过去三个月	1.20	0.33	0.50	0.01	0.70
过去六个月	3.05	0.10	0.09	0.01	2.96
过去一年	6.05	0.08	2.00	0.01	4.55
过去三年	15.59	0.08	6.12	0.01	9.47
自基金成立	34.90	0.11	11.60	0.01	23.40
起至今					

注:业绩比较基准=一年期定期存款税后利率+0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日,业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理以及中国证监会许可的其他业务,截至本报告期末,公司股东由国信证券股份有限公司,意大利利欧盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.),深圳市深财智投基金管理有限公司组成,公司性质为中外合资企业。公司原注册资本8,000万元人民币,后于2001年6月完成增资扩股,增至15,000万元人民币。截止2018年6月,公司管理资产总规模达105.2323亿元,管理152只公募基金,10只全国社保投资基金,3只基本养老保险投资基金,经过近20年投资管经验,在基金投资、风险管理等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理(或基金经理助理)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	说明
刘涛	本基金基金经理	2016-06-27~	5
刘涛	本基金基金经理	2016-06-27~	5

注:报告截止日2018年06月30日,基金份额净值1.268元,基金份额总额77,637,920.67份。

6.2 利润表

会计主体:鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金

报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

金额单位:人民币元

项目	期初数	本期数	上年度可比期间数
一、收入	5,732,707.52	3,692,436.30	
其中:利息收入	5,666,506.36	4,727,986.42	
其中:应收利息收入	27,051,176.00	210,312.50	
资产支持证券利息收入	5,622,712.42	4,512,408.93	
买入返售金融资产收入	15,138,128.00	20,404.00	
手续费及佣金收入	43,884,893.00	-1,156,975.90	
二、支出	43,884,893.00	-1,156,975.90	
其中:利息支出	43,884,893.00	-1,156,975.90	
其中:卖出回购金融资产支付的现金	43,884,893.00	-1,156,975.90	
手续费及佣金支出	43,884,893.00	-1,156,975.90	
三、汇兑损益	123,317.27	121,422.10	
四、汇兑损益(差额以“-”号填列)	3,776,703.99	3,899,101.26	
五、净利润	1,200,000.00	2,379,984.96	

注:报告截止日2018年06月30日,基金份额净值1.268元,基金份额总额77,637,920.67份。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金

报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

金额单位:人民币元

序号	项目	本期数	上年度可比期间数
1	国家储备	1,200,000.00	1,200,000.00
2	央行票据	0.00	0.00
3	金融债券	0.00	0.00
4	企业债券	0.00	0.00
5	企业短期融资券	0.00	0.00
6	中期票据	0.00	0.00
7	可转债(可交换债)	0.00	0.00
8	同业存单	0.00	0.00
9	其他	0.00	0.00
10	合计	1,200,000.00	1,200,000.00

注:报告截止日2018年06月30日,基金份额净值1.268元,基金份额总额77,637,920.67份。

6.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运行动分析

报告期内,本基金未发生违法违纪且对基金财产造成损失的异常交易行为。本基金报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日买卖股票的情况。

4.4.2 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金严格执行公平交易制度,确保不同投资组合在获益机会、交易安排等方面得到公平对待。

4.4.4 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违纪且对基金财产造成损失的异常交易行为。本基金报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日买卖股票的情况。

4.4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.6 报告期内基金投资策略和运行动分析

报告期内,本基金未发生违法违纪且对基金财产造成损失的异常交易行为。本基金报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日买卖股票的情况。

4.4.7 一季度资产负债表、月度资产负债表、半年度资产负债表、季度资产负债表、年度资产负债表

报告期内,本基金未发生违法违纪且对基金财产造成损失的异常交易行为。本基金报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日买卖股票的情况。