

鹏华丰盈债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：鹏华基金管理有限公司 基金托管人：平安银行股份有限公司 报告送出日期：2019年04月19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2019年4月18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预示其未来表现，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2019年3月31日止。	
2 基金基本情况	
基金名称	鹏华丰盈债券
场内简称	-
基金代码	003741
基金交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月22日
报告期末基金份额总额	1,981,726,075.51份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动和多元化的投资实现基金资产的长期增值，力争取得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要采取久期策略、期限结构以及信用策略。在债券投资方面，本基金采取自上而下的投资策略，通过利率预期和信用分析，确定债券组合的久期和期限结构，并在此基础上进行个券选择。在股票投资方面，本基金采取自下而上的投资策略，通过基本面分析和估值分析，选择具有成长性的股票进行投资。在衍生品投资方面，本基金采取套期保值策略，主要用于对冲利率风险和信用风险。在固定收益资产投资方面，本基金采取买入并持有策略，并在此基础上进行波段操作。在权益类资产投资方面，本基金采取分散投资，并在此基础上进行波段操作。在衍生品投资方面，本基金采取套期保值策略，主要用于对冲利率风险和信用风险。在固定收益资产投资方面，本基金采取买入并持有策略，并在此基础上进行波段操作。在权益类资产投资方面，本基金采取分散投资，并在此基础上进行波段操作。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，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基金。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

鹏华

§ 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(2019年01月01日至2019年03月31日)
1.本期已实现收益	19,746,834.45
2.本期利润	22,207,966.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0112
4.期末基金资产净值	2,094,011,200.00
5.期末基金份额净值	1.0571

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。

3.2 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	4.07%	0.03%	3.11%	0.09%	-0.04%	-0.06%

注:业绩比较基准=中证综合债指数收益率

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

鹏华丰盈债券基金自成立以来的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.本基金基金合同于2016年11月22日生效,2.截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 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	任职日期	解任日期	说明
李宇飞	基金经理	2016-12-28	-	鹏华基金,国籍:中国,学历:硕士研究生,证券从业年限:10年,曾任鹏华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理,鹏华基金管理有限公司固定收益部基金经理,鹏

鹏华安盈宝货币市场基金

2019年第一季度报告

基金管理人：鹏华基金管理有限公司 基金托管人：平安银行股份有限公司 报告送出日期：2019年04月19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2019年4月18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预示其未来表现，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2019年3月31日止。	
2 基金基本情况	
基金名称	鹏华安盈宝货币
场内简称	-
基金代码	000905
基金交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年07月27日
报告期末基金份额总额	26,396,231,107.10份
投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上，力争取得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要采取久期策略、期限结构以及信用策略。在债券投资方面，本基金采取自上而下的投资策略，通过利率预期和信用分析，确定债券组合的久期和期限结构，并在此基础上进行个券选择。在股票投资方面，本基金采取自下而上的投资策略，通过基本面分析和估值分析，选择具有成长性的股票进行投资。在衍生品投资方面，本基金采取套期保值策略，主要用于对冲利率风险和信用风险。在固定收益资产投资方面，本基金采取买入并持有策略，并在此基础上进行波段操作。在权益类资产投资方面，本基金采取分散投资，并在此基础上进行波段操作。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于货币市场基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，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基金。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

鹏华安盈宝货币市场基金 2019 年第一季度报告主要数据和指标图

日期	基金净值增长率	业绩比较基准收益率
2019-01-01	0.0000%	0.0863%
2019-03-31	0.8300%	0.0863%

注：1. 基金净值增长率=（期末基金净值-期初基金净值）/期初基金净值

注：1. 本基金基金合同于 2015 年 01 月 27 日生效，2. 截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

4.2 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任职日期	解任日期	说明
李宇飞	基金经理	2015-01-27	-	注：1. 在任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。
李宇飞	基金经理	2015-01-27	-	注：1. 在任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

注：1. 在任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对本报告期内基金运作遵守情况的说明
报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的法规规定及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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，本基金运作合规，不存在违反基金合同和投资损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易事项说明
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公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的有价证券投资参与的交易对手方净价同反向交易成交较多的异常交易超过该证券当日成交量 30% 的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2019 年一季度以来，随着政策对地产的力度加大，金融数据出现企稳迹象，积极的财政政策注重减税降费，基建投资增速有所回升，消费增速较为平稳，但房地产投资、出口增速仍有一定的下降压力。市场对经济增速的预期出现好转，风险偏好上升，股市一季报表现良好。CPI 和 PPI 增速维持低位，CPI 受猪周期影响，涨幅有所回落，但整体通胀风险可控。货币政策保持稳健，1 月降准个百分点，流动性环境充裕，央行注重解决经济增长中的问题，货币信用向信用的传导仍在途中。美国与欧洲经济增速趋缓，全球货币政策边际趋紧，为国内进一步宽松打开空间。资金面整体宽松，配分时间上出现流动性分层现象，造成一定波动。一季度报告期内 7 天质押式回购加权平均利率为 2.66%，

鹏华丰润价值股票型证券投资基金(LOF)

2019年第一季度报告

基金管理人：鹏华基金管理有限公司 基金托管人：中国建设银行股份有限公司 报告送出日期：2019年04月19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。 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18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预示其未来表现，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2019年3月31日止。	
2 基金基本情况	
基金名称	鹏华丰润价值股票(LOF)
场内简称	鹏华丰润
基金代码	160617
基金交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月22日
报告期末基金份额总额	3,572,827,396.04份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过积极的投资策略，力争为基金份额持有人取得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要采取久期策略、期限结构以及信用策略。在债券投资方面，本基金采取自上而下的投资策略，通过利率预期和信用分析，确定债券组合的久期和期限结构，并在此基础上进行个券选择。在股票投资方面，本基金采取自下而上的投资策略，通过基本面分析和估值分析，选择具有成长性的股票进行投资。在衍生品投资方面，本基金采取套期保值策略，主要用于对冲利率风险和信用风险。在固定收益资产投资方面，本基金采取买入并持有策略，并在此基础上进行波段操作。在权益类资产投资方面，本基金采取分散投资，并在此基础上进行波段操作。
业绩比较基准	中证综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金，为证券投资基金中具有中等风险收益特征的基金。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

鹏华丰润

图 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：1、本基金基金合同于 2010 年 12 月 02 日生效。

2、截至建仓期末结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 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	任职日期	解任日期	说明
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-11	-	7%
周应波	基金经理	2010-12-1		

鹏华丰盈债券型证券投资基金(LOF)

2019年第一季度报告

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：平安银行股份有限公司
报告送出日期：2019年04月19日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：平安银行股份有限公司
报告送出日期：2019年04月19日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：平安银行股份有限公司
报告送出日期：2019年04月19日

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					
无。					
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	央行票据	--	--		
3	金融债券	1,213,434,000.00	57.93		
其中:政策性金融债		197,220,000.00	9.41		
4	企业债券	119,960,000.00	5.73		
5	企业短期融资券	--	--		
6	中期票据	685,222,000.00	32.61		
7	待购期(可交换债)	--	--		
8	资产支持券	--	--		
9	其他	--	--		
10	合计	2,016,632,000.00	96.27		
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	1728006	17中债国开行 02	2,000,000	203,980,000.00	9.74
2	1728008	17浦发银行 02	2,000,000	203,960,000.00	9.74
3	1728009	17招商银行 01	2,000,000	203,940,000.00	9.74
4	1728004	17民生银行 01	2,000,000	203,940,000.00	9.64
5	101751041	17T金 MTN001	1,500,000	154,300,000.00	7.37
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					
序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889020	18元(3+6M)	2,000,000	135,160,000.00	6.45
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					
无。					
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					
无。					
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					
本基金基金合同约定的投资范围尚未包含国债期货投资。					
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细					
本基金基金合同约定的投资范围尚未包含国债期货投资。					
5.9.3 本期国债期货投资评价					
本基金基金合同约定的投资范围尚未包含国债期货投资。					
5.10 投资组合报告附注					
5.10.1					
报告期末的前十名证券中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					
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。					
5.10.3 其他资产构成					