

鹏华丰华债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

成立基金基金经理的、任日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的合意遵从行业协会关于从业人员资格管理的相关规定。

4.2 管理人对于报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定,本着诚实守信、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损害基金份额持有人利益的行为。

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,本基金未发生法律法规及中国证监会禁止的异常交易行为。本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反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度中美贸易摩擦的影响我国市场出现一定的回调,宏观经济企稳,选择在经济企稳、通胀可控的环境下,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损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 报告期内基金的投资组合和资产分布

鹏华改革红利组合净值增长率-1.65%; 业绩比较基准增长率-0.72%; 同期上证综指涨跌幅为-3.198%, 深证成指涨跌幅为-7.3540%, 沪深300指数涨跌幅为-1.2074%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

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(人民币元)

1 权益投资 --

其中:股票 --

2 基金投资 --

3 固定收益投资 522,208,000.00

其中:债券 522,208,000.00

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 4,220,413.45

8 其他资产 9,255,710.02

9 合计 535,954,123.47

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

注:无。

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:无。

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

注:无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:无。

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)

1 136872 16国债16 1,000,000 6,400.00

2 10180058 华泰债 600,000 61,644,900.00

3 122449 15债001 600,000 61,400,000.00

4 101552022 15国债02 500,000 51,490,000.00

5 101800668 MNTN03 500,000 51,320,000.00

6 136576 18国债16 100,000 10,000,000.00

7 139057 万科30A1 300,000 30,000,000.00

8 139285 华城01 250,000 25,000,000.00

9 154291 金隅6A 200,000 20,000,000.00

6 139112 国都16 150,000 15,000,000.00

7 139059 万科22A1 130,000 13,000,000.00

8 156276 18国债16 100,000 10,000,000.00

9 合计 162,057.33

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五名贵金属投资明细

注:无。

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权证投资明细

注: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

注:无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 本期股指期货投资政策

5.9.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.3 本期股指期货投资评价

5.10 股指期货投资合同附注

5.10.1 本基金投资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选择券。

5.10.3 其他资产构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存出保证金 --

2 应收证券清算款 86,517.97

3 应收股利 --

4 应收利息 41,318,001.37

5 其他应收款 --

6 预付款项 --

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 41,425,548.21

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

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

注:无。

5.4 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

注:无。

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权证投资明细

注:无。

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:无。

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: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

注:无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.3 本期股指期货投资评价

5.10 股指期货投资合同附注

5.10.1 本基金投资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选择券。

5.10.3 其他资产构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存出保证金 --

2 应收证券清算款 2,926,778.88

3 应收股利 --

4 应收利息 16,509.25

5 其他应收款 5,731.83

6 预付款项 --

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 3,236,060.16

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五名债券投资明细

注:无。

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资产支持证券投资明细

注: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贵金属投资明细

注:无。

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权证投资明细

注:无。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10.3 本期股指期货投资评价

5.10.4 股指期货投资合同附注

5.10.1 本基金投资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选择券。

5.10.3 其他资产构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存出保证金 --

2 应收证券清算款 2,926,778.88

3 应收股利 --

4 应收利息 16,509.25

5 其他应收款 5,731.83

6 预付款项 --

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 3,236,060.16

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五名债券投资明细

注:无。

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资产支持证券投资明细

注: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贵金属投资明细

注:无。

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权证投资明细

注:无。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10.3 本期股指期货投资评价

5.10.4 股指期货投资合同附注

5.10.1 本基金投资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选择券。

5.10.3 其他资产构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存出保证金 --

2 应收证券清算款 2,926,778.88

3 应收股利 --

4 应收利息 16,509.25

5 其他应收款 5,731.83

6 预付款项 --

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 3,236,060.16

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五名债券投资明细

注:无。

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资产支持证券投资明细

注: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贵金属投资明细

注:无。

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权证投资明细

注:无。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10.3 本期股指期货投资评价

5.10.4 股指期货投资合同附注

5.10.1 本基金投资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选择券。

5.10.3 其他资产构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存出保证金 --

2 应收证券清算款 2,926,778.88

3 应收股利 --

4 应收利息 16,509.25

5 其他应收款 5,731.83

6 预付款项 --

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 3,236,060.16

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五名债券投资明细

注:无。

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资产支持证券投资明细

注: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贵金属投资明细

注:无。

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权证投资明细

注:无。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10.3 本期股指期货投资评价

5.10.4 股指期货投资合同附注

5.10.1 本基金投资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选择券。

5.10.3 其他资产构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存出保证金 --

2 应收证券清算款 2,926,778.88

3 应收股利 --

4 应收利息 16,509.25

5 其他应收款 5,731.83

6 预付款项 --

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 3,236,060.16

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五名债券投资明细

注:无。

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资产支持证券投资明细

注: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贵金属投资明细

注:无。

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权证投资明细

注:无。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10.3 本期股指期货投资评价

5.10.4 股指期货投资合同附注

5.10.1 本基金投资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选择券。

5.10.3 其他资产构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存出保证金 --

2 应收证券清算款 2,926,778.88

3 应收股利 --

4 应收利息 16,509.25

5 其他应收款 5,731.83

6 预付款项 --

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 3,236,060.16

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五名债券投资明细

注:无。

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资产支持证券投资明细

注: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贵金属投资明细

注:无。

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权证投资明细