

# 鹏华丰恒债券型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司  
基金托管人：中信银行股份有限公司  
送出日期：2019年8月23日

\$1 重要提示

基金管理人的董事、监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的法律责任。本半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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保留在复核后不存在虚假记载、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及其更新。

本半年度报告摘要源自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019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	鹏华丰恒
基金代码	003299
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月22日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	911,896,628.89份
基金合同的存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过利差分析和对利率曲线变动趋势的判断，提供货币流动性及收益水平，力求取得超越业绩比较基准的收益。
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月22日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	911,896,628.89份
基金合同的存续期	不定期

投资策略	本基金将投资于货币市场工具、债券类金融工具、股票类金融工具、商品类金融工具、货币衍生品、商品衍生品等金融工具，通过资产配置和对利率曲线变动趋势的判断，提高资金流动性和收益率水平，力争取得超越业绩比较基准的收益。1.资产配置策略 在资产配置方面，本基金将综合考虑宏观经济环境、资金面、利率期限结构、资金供求状况、资金流动性和收益率水平、力争取得超越业绩比较基准的收益。2.利率策略 在利率期限结构方面，本基金将综合考虑宏观经济环境、资金面、利率期限结构、资金供求状况、资金流动性和收益率水平、力争取得超越业绩比较基准的收益。3.债券类金融工具投资策略 在债券类金融工具投资方面，本基金将综合考虑宏观经济环境、资金面、利率期限结构、资金供求状况、资金流动性和收益率水平、力争取得超越业绩比较基准的收益。4.股票类金融工具投资策略 在股票类金融工具投资方面，本基金将综合考虑宏观经济环境、资金面、利率期限结构、资金供求状况、资金流动性和收益率水平、力争取得超越业绩比较基准的收益。5.商品类金融工具投资策略 在商品类金融工具投资方面，本基金将综合考虑宏观经济环境、资金面、利率期限结构、资金供求状况、资金流动性和收益率水平、力争取得超越业绩比较基准的收益。6.货币衍生品及商品衍生品投资策略 在货币衍生品及商品衍生品投资方面，本基金将综合考虑宏观经济环境、资金面、利率期限结构、资金供求状况、资金流动性和收益率水平、力争取得超越业绩比较基准的收益。
------	---

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	中信银行股份有限公司
姓名	张文	李修旗
信息披露负责人	联系人电话	0400-8816668
电子邮箱	zhangwei@phfunds.com	lizx@icbc.com.cn
客户服务电话	40007789999	
传真	0755-82021126	010-48200024

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址	http://www.phfunds.com.cn
基金年度报告置地点	深圳市福田区福华三路101号深国投国际商会第43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 本期数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	11,571,460.77
本期利润	10,534,096.69
加权平均基金份额利润	0.0177
本期基金份额净值	1.83%
3.1.2 期末未分配利润	报告期(2019年6月30日)
期末基金份额净值	1,001,824,407.70
期末基金份额净值	1,003.99

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将低于所列数字。

(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同期业绩比较基准收益率的比较

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

3.2.3 业绩比较基准-中债总指数收益率

3.2.4 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

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其基金经理的经验

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、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司由中信证券股份有限公司、意大利瑞盛资本管理公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本3,000万元人民币，后于2001年6月完成增资扩股，增至15,000万元人民币，截止到2019年6月，公司管理资产规模达到6,649.6亿元，管理150只公募基金、10只全国社保基金投资组合、4只养老金养老组合投资组合，以及1只专项基金。截至2019年6月，公司管理的基金规模、客户数量、员工人数、资产管理规模、盈利能力、风险管理能力、行业地位、社会责任感等方面均位于行业前列，具有良好的社会影响力。

4.1.2 基金经理

基金经理

4.2 基金管理人对报告期内基金运作总体评价

报告期内，本基金在严格遵守基金合同约定的前提下，通过资产配置和对利率期限结构的判断，较好地实现了投资收益。

4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.4 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 报告期内除报告期内基金的资产配置策略和业绩表现外

4.4.2 公平交易制度的执行情况

4.4.3 报告期内基金投资组合的重大关联交易

4.4.4 投资组合报告

4.4.5 其他需要说明的事项

4.5 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.5.1 参与估值的人员

4.5.2 采用估值技术的类别

4.5.3 参与估值的人员情况

4.5.4 与估值相关的重大事项说明

4.5.5 其他需要说明的事项

4.6 报告期内基金的会计政策、会计估计和差错更正

4.6.1 会计政策

4.6.2 会计估计

4.6.3 差错更正

4.7 报告期内基金的内部控制制度

4.7.1 内部控制制度

4.7.2 内部控制制度的执行情况

4.7.3 内部控制制度存在的问题及改进建议

4.7.4 内部控制制度的评价

4.7.5 其他需要说明的事项

4.8 报告期内基金的外部监督

4.8.1 外部监督

4.8.2 外部监督的报告

4.8.3 其他需要说明的事项

4.9 报告期内基金的税收情况

4.9.1 税收政策

4.9.2 税款计提与缴纳

4.9.3 税收优惠

4.9.4 税收滞纳情况

4.9.5 其他需要说明的事项

4.10 报告期内基金的费用情况

4.10.1 费用种类

4.10.2 费用计提方法

4.10.3 费用用途

4.10.4 费用调整

4.10.5 其他需要说明的事项

4.11 报告期内基金份额持有人交易费用

4.11.1 交易费用

4.11.2 其他费用

4.11.3 其他需要说明的事项

4.12 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理(助理)时间 说明

方锐 聘期 2019-01-25 -

方锐先生，国籍中国，硕士研究生，15年证券基金从业经验，曾任中国工商银行资产管理部投资经理，现担任鹏华基金管理有限公司基金经理。方锐先生具备基金从业经验和良好的职业操守，能够胜任基金经理的岗位职责。

4.13 其他指标

注：无。

§ 5 管理人报告

5.1 基金管理人报告期内基金运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

5.1.1 基金管理人报告期内基金运作遵规守信情况

报告期内，本基金在严格遵守基金合同约定的前提下，通过资产配置和对利率期限结构的判断，较好地实现了投资收益。

5.1.2 基金管理人报告期内基金净值表现

报告期内，本基金份额净值增长率为1.83%，鹏华丰恒债券型证券投资基金的净值表现符合基金合同约定的净值增长率为1.83%