

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
送出日期:2019年8月23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，并对其中内容的真实性、准确性、完整性承担责任，由董事签名并连带的法律责任。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。

基金管理人平安银行股份有限公司根据基金合同规定，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、投资组合报告等信息，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及其更新。

本半年度报告摘要须自半年度报告正文发布之日起，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 | 鹏华丰盈债券 |
| 基金代码 | 000741 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016/11/22 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,108,174,609 |
| 基金合同存续期 | 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，通过深入分析和对利率曲线变动趋势的判断，提高资金流动性及收益率水平，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

本基金投资的主要采取久期策略，同时辅之以信用和利率策略，通过长短债品种和利率曲线变动策略，在严控信用风险的基础上，通过长短债品种和利率曲线变动策略，提高资金流动性及收益率水平，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

1. 资产配置策略：在资产配置方面，坚持资产配置以绝对收益为原则，通过资产配置策略，提高资金流动性及收益率水平，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

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 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

报告期内，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运作本基金，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，不存在违法基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，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、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人未发生违法违规行为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笔申报量超净值该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的证券投资和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.2 报告期内基金净值表现

4.4.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华丰盈债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

投资策略

本基金投资的主要采取久期策略，通过长短债品种和利率曲线变动策略，提高资金流动性及收益率水平，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

1. 资产配置策略：在资产配置方面，坚持资产配置以绝对收益为原则，通过资产配置策略，提高资金流动性及收益率水平，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，国内经济仍然存在一定的下行压力，财政由于上半年提前发力较为明显，流动性风险控制没有明显的放松，宽松明显上行可能性较低。此外，房市不炒背景下，房地产投资将保持稳中有下的格局；而制造业、出口等仍然面临一定下行压力。货币政策未来大概率将保持稳健偏宽松的态势，因此，利率未来仍然面临较好的环境。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 日常估值流程

基金的估值由基金管理人负责，基金管理公司所管理的基金以基金会计核算

算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账簿设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算系统进行核算核对及财务处理，每日报告核对收入费用及权

益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人独立

核算，相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；

每日估值结果必须与托管银行对一致后才能对外公告。基金会计核算除设有专职基金

会计核算岗位外，还设有基金会计核算岗位，负责基金会计核算的日常事后核算工

作，确保基金净值核算无误。

配对的基金会计具备会汁资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握

对基金的估值方法、估值政策和会计核算的规章制度的执行情况，熟悉了解及掌握基金估值方法、估值政策和会计核算的规章制度。

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票没有市价的证券投资品种估值小组，成

员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2. 基础业务参与决定估值的程度

基金经理不参与决定估值的日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值

小组成员共同商定估值原则和政策。

4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1. 截至报告期末，本基金利润分配情况为定期利润分配。

2. 本期利润

3.1.2 利润和利润分配

报告期利润

3.1.3 利润分配

3.2.2 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

份额净值增长率

业绩比较基准收益率

差额百分比

差额百分比

①-②

②-③

③-④

过去一个月

31.32%

6.91%

0.64%

0.00%

30.68%

6.85%

过去二个月

31.60%

3.96%

0.38%

0.10%

31.22%

3.86%

0.27%

过去三个月

33.01%

2.82%

1.49%

0.09%

31.25%

2.73%

过去一年

36.24%

1.97%

6.03%

0.10%

30.21%

1.87%

自基金成立

44.42%

1.22%

8.23%

0.11%

36.19%

1.11%

过去一年

36.19%

1.11%