

鹏华丰润债券型证券投资基金 (LOF) 2019 年半年度报告摘要

2019年6月30日

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

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。

基金托管人中国建设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	鹏华丰润债券 (LOF)
场内简称	鹏华丰润
基金主代码	160617
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2010 年 12 月 2 日
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
报告期末基金份额总额	4,165,322,853.39 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 12 月 16 日

2.2 基金产品说明

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,力争为基金持有人创造较高的当期收益。
投资策略	基金管理人将采取积极的投资策略,寻找各种可能的价值增长机会,力争实现超越基准的投资收益。1、资产配置策略 在大类资产配置方面,本基金通过对宏观经济形势及利率变化趋势的重点分析,结合对股票市场趋势的研判及新股申购收益率的预测,比较未来一定时间内债券市场和股票市场的相对预期收益率,在债券、股票一级市场及现金之间进行动态调整。2、资产流动性纵向分配策略 鉴于投资人对投资标的的流动性需求随时间呈递增分布的规律,本基金在成立后初期将在以最小成本确保合理流动性水平的前提下,适当降低资产组合的流动性水平,争取累积较高的投资收益。当预期投资人对流动性的边际需求上升到一定程度(本基金界定为基金合同生效后三年)本基金将调高投资组合的流动性水平并开放基金的申购、赎回,以优化投资回报及流动性给投资人带来的整体收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金,为证券投资基金中的低风险品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096

传真	0755-82021126	010-66275853
----	---------------	--------------

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
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	63,394,559.55
本期利润	68,301,836.23
加权平均基金份额本期利润	0.0195
本期基金份额净值增长率	1.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0505
期末基金资产净值	4,599,537,838.28
期末基金份额净值	1.1042

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.62%	0.04%	0.53%	0.03%	0.09%	0.01%

过去三个月	0.93%	0.06%	0.65%	0.06%	0.28%	0.00%
过去六个月	1.81%	0.05%	1.82%	0.06%	-0.01%	-0.01%
过去一年	6.79%	0.06%	6.08%	0.06%	0.71%	0.00%
过去三年	11.01%	0.10%	10.76%	0.08%	0.25%	0.02%
自基金成立起至今	66.27%	0.22%	46.48%	0.08%	19.79%	0.14%

注：业绩比较基准=中债综合指数收益率

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

鹏华丰润债券 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：注：1、鹏华丰润债券型证券投资基金基金合同于 2010 年 12 月 02 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

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（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8,000万元人民币，后于2001年9月完成增资扩股，增至15,000万元人民币。截止到2019年6月，公司管理资产总规模达到5,644.95亿元，管理159只公募基金、10只全国社保投资组合、4只基本养老保险投资组合。

4.1.2 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）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周恩源	本基金基金经理	2018-12-13	-	7	周恩源先生，国籍中国，经济学博士，7年证券基金从业经验。2012年6月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资研究工作，历任固定收益部基金经理助理/高级债券研究员，现担任公募债券投资部基金经理。2016年02月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理，2016年02月担任鹏华弘泽混合基金基金经理，2016年09月担任鹏华丰饶债券基金基金经理，2016年09月至2018年07月担任鹏华弘康混合基金基金经理，2016年09月至2018年06月担任鹏华弘腾混合基金基金经理，2016年10月至2018年07月担任鹏华弘尚混合基金基金经理，2017年03月担任鹏华丰玉债券基金基金经理，2017年03月担任鹏华丰享债券基金基金经理，2017年05月担任鹏华弘泰混合基金基金经理，2017年07月至2018年03月担任鹏华丰玺债券基金基金经理，2017年07月担任鹏华丰源债券基金基金

					<p>经理, 2018 年 02 月担任鹏华永泽定期开放债券基金基金经理, 2018 年 05 月担任鹏华尊悦发起式定开债券基金基金经理, 2018 年 10 月担任鹏华 3 个月中短债基金基金经理, 2018 年 12 月担任鹏华丰润债券 (LOF) 基金基金经理。周恩来先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 孙柠不再担任本基金基金经理。</p>
祝松	本基金基金经理	2014-02-22	-	13	<p>祝松先生, 国籍中国, 经济学硕士, 13 年证券基金从业经验。曾任职于中国工商银行深圳市分行资金营运部, 从事债券投资及理财产品组合投资管理; 招商银行总行金融市场部, 担任代客理财投资经理, 从事人民币理财产品组合的投资管理工作。2014 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司, 从事债券投资管理工作; 现担任公募债券投资部副总经理、基金经理。2014 年 02 月担任鹏华丰润债券 (LOF) 基金基金经理, 2014 年 02 月至 2018 年 04 月担任鹏华普天债券基金基金经理, 2014 年 03 月担任鹏华产业债基金基金经理, 2015 年 03 月至 2018 年 03 月担任鹏华双债加利债券基金基金经理, 2015 年 12 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰华债券基金基金经理, 2016 年 02 月至 2018 年 04 月担任鹏华弘泰混合基金基金经理, 2016 年 06 月至 2018 年 04 月担任鹏华金城保本混合基金基金经理, 2016 年 06 月担任鹏华丰茂债券基金基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华丰盈债券基金基金经理, 2016 年 12 月担任鹏华丰惠债券基金基金经理, 2016 年 12 月担任鹏华永盛定期开放债券基金基金经理, 2017 年 03 月担任鹏华永安定期开放债券基金基金经理, 2017 年 05 月担任鹏华永泰定期开放债券基金基金经理, 2018 年 01 月担任鹏华永泽定期开放债券基金基金经理,</p>

					2018 年 02 月担任鹏华丰达债券基金基金经理, 2019 年 06 月担任鹏华尊晟定期开放发起式债券基金基金经理。祝松先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 孙柠不再担任本基金基金经理。
孙柠	本基金基金经理	2018-02-03	2019-01-04	7	孙柠先生, 国籍中国, 经济学硕士, 7 年证券基金从业经验。曾任中国工商银行总行资产管理部资本市场投资处投资经理, 从事债券投资研究工作; 2016 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任固定收益总部基金经理助理、基金经理。2017 年 02 月至 2018 年 12 月担任鹏华丰华债券基金基金经理, 2017 年 02 月至 2018 年 12 月担任鹏华丰茂债券基金基金经理, 2018 年 02 月至 2019 年 01 月担任鹏华丰达债券基金基金经理, 2018 年 02 月至 2019 年 01 月担任鹏华丰润债券 (LOF) 基金基金经理, 2018 年 03 月至 2019 年 01 月担任鹏华永安定期开放债券基金基金经理, 2018 年 07 月至 2019 年 01 月担任鹏华丰惠债券基金基金经理。孙柠先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 孙柠不再担任本基金基金经理。

注: 1. 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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 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，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，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 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作分析

上半年债市走势较为波折。年初受资金面宽松等因素影响，债市有所表现。2 月-4 月因经济数据改善、资金面宽松出现边际变化以及市场风险偏好提升，债市出现一轮调整。4 月下旬至年中，经济数据再度下滑，货币政策中性偏松，债市走好，收益率呈现下行态势。

在债券资产的配置上，我们主要持仓为中短期品种，并且在 4 月中下旬市场调整过程中增加了仓位、提升了组合久期，上半年基金总体获得稳健收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金的净值增长率为 1.81%，同期业绩比较基准增长率为 1.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济下行态势大概率延续，通胀压力总体处于可控的状态，在此情况下，货币政策有望维持中性偏宽松的态势。在民企违约增加、包商事件等因素影响下，信用加速扩张有较大难度，社融增速在当前水平难有进一步提升，信用分层可能仍会延续。因此，总体信用供需环境仍然对债市有利，预计下半年债市仍有表现。具体而言，对于利率债，下半年供给压力下降，预计收益率尚有下行空间，对于信用债，在非标到期、摊余成本债基发行的背景下，中高等级信用债的需求大概率增强。

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

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、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软件系统进行基金核算及

帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，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同步独立核算、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行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

(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等没有市价的投资品种估值小组，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、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

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。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 210,386,866.45 元，期末基金份额净值 1.1042 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、本基金于 2019 年 7 月 9 日进行利润分配，分配金额为 41,654,269.62 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华丰润债券型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	19,854,746.87	6,984,266.07
结算备付金	-	749,966.23
存出保证金	2,700.62	5,457.52
交易性金融资产	5,887,388,000.00	2,419,841,400.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	5,887,388,000.00	2,419,841,400.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-

衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	106,377,667.42	40,766,255.94
应收股利	-	-
应收申购款	20,173.86	15,546.43
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,013,643,288.77	2,468,362,892.19
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2019年6月30日	2018年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,408,109,427.87	18,000,000.00
应付证券清算款	-	22,561.57
应付赎回款	3,130.28	300.49
应付管理人报酬	740,751.49	281,396.02
应付托管费	370,375.76	140,697.99
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	70,835.39	21,296.55
应交税费	4,248,633.32	4,248,633.32
应付利息	230,021.66	-4,512.33
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	332,274.72	352,000.14
负债合计	1,414,105,450.49	23,062,373.75
所有者权益:		
实收基金	4,165,322,853.39	2,254,627,502.33
未分配利润	434,214,984.89	190,673,016.11
所有者权益合计	4,599,537,838.28	2,445,300,518.44
负债和所有者权益总计	6,013,643,288.77	2,468,362,892.19

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1042 元，基金份额总额 4,165,322,853.39 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华丰润债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日

		月 30 日	年 6 月 30 日
一、收入		76,675,467.93	31,758,611.91
1. 利息收入		66,641,210.87	23,522,364.80
其中：存款利息收入		409,715.61	116,861.23
债券利息收入		62,535,184.53	23,404,150.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,696,310.73	1,352.88
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,002,083.32	5,147,490.22
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		5,002,083.32	5,147,490.22
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		4,907,276.68	2,579,352.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		124,897.06	509,404.65
减：二、费用		8,373,631.70	3,978,959.81
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	3,787,251.05	904,569.14
2. 托管费	6.4.8.2.2	1,893,625.52	452,284.65
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		41,216.59	26,295.66
5. 利息支出		2,526,927.15	2,273,348.00
其中：卖出回购金融资产支出		2,526,927.15	2,273,348.00
6. 税金及附加		-	58,286.70
7. 其他费用		124,611.39	264,175.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,301,836.23	27,779,652.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,301,836.23	27,779,652.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华丰润债券型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,254,627,502.33	190,673,016.11	2,445,300,518.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	68,301,836.23	68,301,836.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,910,695,351.06	175,240,132.55	2,085,935,483.61
其中：1.基金申购款	2,363,252,171.80	216,097,657.99	2,579,349,829.79
2.基金赎回款	-452,556,820.74	-40,857,525.44	-493,414,346.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,165,322,853.39	434,214,984.89	4,599,537,838.28
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,073,421,963.59	7,765,296.24	2,081,187,259.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,779,652.10	27,779,652.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,002,508,916.58	-33,162,987.91	-2,035,671,904.49
其中：1.基金申购款	268,022.37	5,113.98	273,136.35

2. 基金赎回款	-2,002,776,938.95	-33,168,101.89	-2,035,945,040.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	70,913,047.01	2,381,960.43	73,295,007.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

苏波

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华丰润债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]1378号关于核准《鹏华丰润债券型证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华丰润债券型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型,在基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF),存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,335,072,301.75元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第351号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华丰润债券型证券投资基金合同》于2010年12月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,335,591,800.74份基金份额,其中认购资金利息折合519,498.99份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上【2010】407号文审核同意,本基金595,646,018.00份基金份额于2010年12月16日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过本基金代销机构赎回或通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后进行上市交易。

根据《证券投资基金法》及相关法律法规以及《鹏华丰润债券型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,主要投资于固定收益类品种,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、

债券回购等金融工具以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金也可投资于股票、权证以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他权益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具，但可以参与一级市场股票首次公开发行或新股增发，并可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于分离交易可转债而产生的权证。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的 80%；股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的 20%；基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金将保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

本基金封闭期已于 2013 年 12 月 1 日结束，自 2013 年 12 月 2 日起，本基金的运作方式由“创新型封闭式”转换为“上市契约型开放式”，并开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华丰润债券型证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税

[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	49,690,276.96	63.50

6.4.8.1.3 债券回购交易

无。

6.4.8.1.4 权证交易

无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,787,251.05	904,569.14
其中：支付销售机构的客户维护费	6,169.90	5,074.07

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为0.2%，逐日计提，按月支付。

日管理费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,893,625.52	452,284.65

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为0.1%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资及持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	19,854,746.87	148,748.32	1,484,429.72	113,132.00

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,408,109,427.87 元, 是以如下债券作为抵押:

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
180208	18 国开 08	2019年7月1日	101.76	1,050,000	106,848,000.00
180212	18 国开 12	2019年7月1日	101.12	12,519,000	1,265,921,280.00
180312	18 进出 12	2019年7月1日	100.16	991,000	99,258,560.00
合计				14,560,000	1,472,027,840.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,887,388,000.00	97.90
	其中：债券	5,887,388,000.00	97.90
	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	19,854,746.87	0.33
8	其他各项资产	106,400,541.90	1.77
9	合计	6,013,643,288.77	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	30,054,000.00	0.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,857,334,000.00	127.35
	其中：政策性金融债	5,857,334,000.00	127.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,887,388,000.00	128.00

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	190202	19 国开 02	20,900,000	2,083,103,000.00	45.29
2	180212	18 国开 12	12,700,000	1,284,224,000.00	27.92
3	180312	18 进出 12	4,200,000	420,672,000.00	9.15
4	190205	19 国开 05	3,400,000	333,030,000.00	7.24
5	190303	19 进出 03	3,000,000	297,870,000.00	6.48

7.7 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

无。

7.8 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

无。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,700.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	106,377,667.42
5	应收申购款	20,173.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,400,541.90

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
660	6,311,095.23	4,154,850,730.64	99.75	10,472,122.75	0.25

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	北京艾迪尔建筑装饰工程股份有限公司	1,000,000.00	32.99
2	黄贤民	240,856.00	7.95
3	云南能源投资股份有限公司企业年金计划—中国光大银行股份有限公司	184,400.00	6.08
4	周宇峰	110,024.00	3.63
5	陈玉萍	106,260.00	3.51
6	施建新	90,000.00	2.97
7	詹康林	87,621.00	2.89
8	陈佩莉	70,003.00	2.31
9	单莉英	60,005.00	1.98
10	蒋乾浩	60,000.00	1.98

注:持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,580.54	0.0001

注:截至本报告期末,本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

截止本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日 (2010 年 12 月 2 日)	1,335,591,800.74
---------------------------	------------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	2,254,627,502.33
本报告期基金总申购份额	2,363,252,171.80
减：本报告期基金总赎回份额	452,556,820.74
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	4,165,322,853.39

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

鹏华丰润债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会基金份额持有人大会已通过通讯方式召开，大会表决投票时间自2019年5月24日起，至2019年6月18日17:00止。本基金基金份额持有人大会于2019年6月20日分别表决通过了《关于鹏华丰润债券型证券投资基金（LOF）调整基金场外赎回费率的议案》以及《关于鹏华丰润债券型证券投资基金（LOF）修改基金合同相关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

1、根据相关法律法规的规定，经本次基金份额持有人大会表决通过，本基金管理人自2019年6月20日起对鹏华丰润债券型证券投资基金（LOF）实施调整后的场外赎回费率：

持有期限（Y） 场外赎回费率

Y < 7 天 1.50%

7 天 ≤ Y < 30 天 0.10%

Y ≥ 30 天 0

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担，其持有期不满30天的，赎回费全额计入基金财产；持有期等于或高于30天的，不收取赎回费。

2、本基金管理人自2019年6月20日起修改本基金基金合同相关事项，调整方案要点如下：

九、基金份额持有人大会

修改前内容：

3. 基金合同生效后, 当出现下述情形之一时, 基金管理人应当召集召开基金份额持有人大会审议基金合同终止或与其他基金合并事项:

- (1) 连续 90 个工作日基金份额持有人少于 200 人;
- (2) 连续 90 个工作日基金资产规模少于 3000 万人民币;
- (3) 连续 90 个工作日本基金前十大基金份额持有人持有本基金 90%以上的基金份额。

发生上述情形之一时, 基金份额持有人大会应按照本基金合同的规定程序召开, 并就因上述情形的发生是否终止本基金合同的事项或与其他基金合并的事项以特别决议方式进行表决。

修改后内容:

删除此表述

十八、基金的收益与分配

修改前内容:

2. 本基金封闭期满并转换为上市开放式基金(LOF)后, 或者封闭期内经持有人大会通过提前转为上市开放式基金(LOF)后, 本基金收益分配应遵循下列原则:

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金每年收益分配次数最多为 12 次, 每次收益分配比例不得低于期末(即收益分配基准日)可供分配利润的 60%;

修改后内容:

2. 本基金封闭期满并转换为上市开放式基金(LOF)后, 或者封闭期内经持有人大会通过提前转为上市开放式基金(LOF)后, 本基金收益分配应遵循下列原则:

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金收益每季度最少分配 1 次, 每年收益分配次数最多为 12 次, 每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%, 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

修改前内容:

基金合同生效后, 当出现下述情形之一时, 基金管理人应当召集召开基金份额持有人大会审议基金合同终止或与其他基金合并事项:

- (1) 连续 90 个工作日基金份额持有人少于 200 人;
- (2) 连续 90 个工作日基金资产规模少于 3000 万人民币;
- (3) 连续 90 个工作日本基金前十大基金份额持有人持有本基金 90%以上的基金份额。

发生上述情形之一时, 基金份额持有人大会应按照本基金合同的规定程序召开, 并就因上述情形的发生是否终止本基金合同的事项或与其他基金合并的事项以特别决议方式进行表决。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

报告期内，基金托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-

东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	16,002,200.00	100.00%	18,483,700,000.00	100.00%	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20190101~20190103, 20190108~20190109	462,533,765.03	-	-	462,533,765.03	11.10
	2	20190101~20190103, 20190108~20190109	464,985,585.42	-	-	464,985,585.42	11.16
	3	20190228~20190312	277,878,919.99	366,693,519.88	-	644,572,439.87	15.47
	4	20190110~20190408	278,990,979.26	459,346,807.53	-	738,337,786.79	17.73
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注:1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

鹏华基金管理有限公司

2019年8月23日

