

# 鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金

## 2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 19 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 04 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华丰泰定期开放债券	
基金主代码	000289	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 9 月 24 日	
报告期末基金份额总额	494,349,071.14 份	
投资目标	在有效控制风险的基础上，通过每年定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金债券投资将主要采取久期策略，同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略，在有效控制风险的基础上，通过每年定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。	
业绩比较基准	一年期定期存款税后利率+0.5%	
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，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品种。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏华丰泰定期开放债券 A	鹏华丰泰定期开放债券 B
下属分级基金的交易代码	000289	001950
报告期末下属分级基金的份额总额	494,297,396.34 份	51,674.80 份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上

注：无。

### § 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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）	
	鹏华丰泰定期开放债券 A	鹏华丰泰定期开放债券 B
1. 本期已实现收益	3,425,580.94	314.74
2. 本期利润	4,234,303.11	404.50
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0086	0.0077
4. 期末基金资产净值	567,267,546.08	59,948.25
5. 期末基金份额净值	1.1476	1.1601

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

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 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

鹏华丰泰定期开放债券 A

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	0.75%	0.04%	0.50%	0.01%	0.25%	0.03%
过去六个月	1.39%	0.03%	1.00%	0.01%	0.39%	0.02%
过去一年	2.88%	0.03%	2.01%	0.01%	0.87%	0.02%
过去三年	9.20%	0.05%	6.01%	0.01%	3.19%	0.04%
过去五年	16.29%	0.05%	10.01%	0.01%	6.28%	0.04%
自基金合同生效起至今	64.32%	0.15%	23.55%	0.01%	40.77%	0.14%

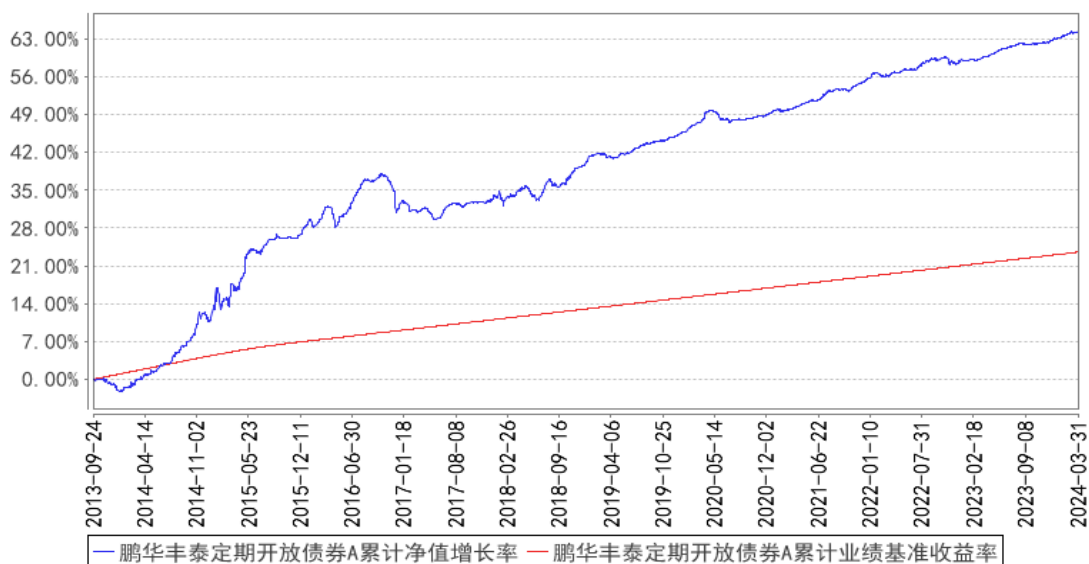
鹏华丰泰定期开放债券 B

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	0.66%	0.03%	0.50%	0.01%	0.16%	0.02%
过去六个月	1.21%	0.03%	1.00%	0.01%	0.21%	0.02%
过去一年	2.52%	0.03%	2.01%	0.01%	0.51%	0.02%
过去三年	8.06%	0.05%	6.01%	0.01%	2.05%	0.04%
过去五年	14.28%	0.05%	10.01%	0.01%	4.27%	0.04%
自基金合同生效起至今	26.19%	0.09%	16.87%	0.01%	9.32%	0.08%

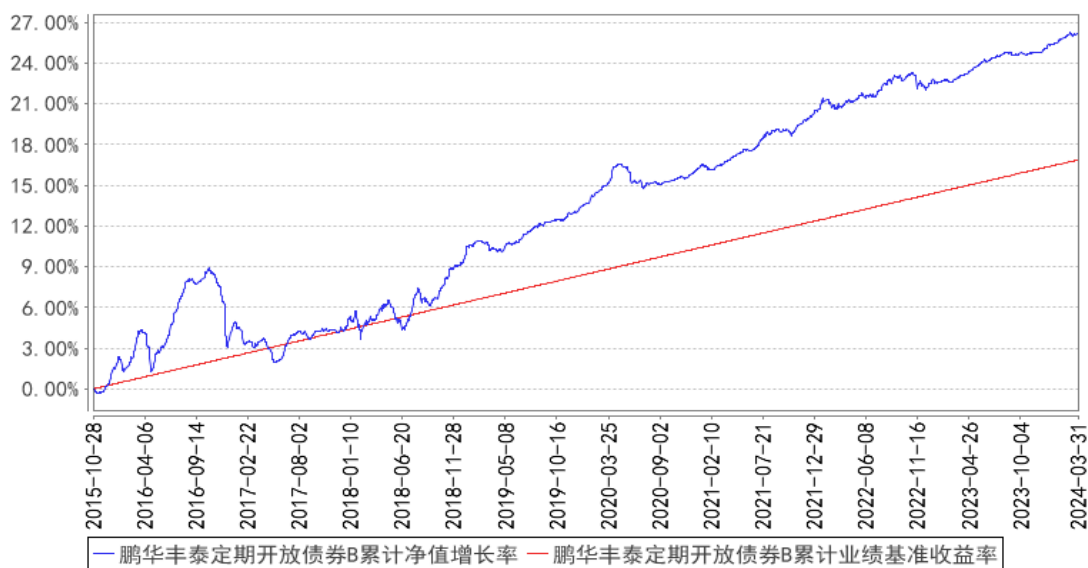
注：业绩比较基准=一年期定期存款税后利率+0.5%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

鹏华丰泰定期开放债券A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



鹏华丰泰定期开放债券B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：1、本基金基金合同于 2013 年 09 月 24 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

注：无。

## § 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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戴钢	基金经理	2013-09-24	-	22 年	戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，22 年证券从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部，担任研究员；2005 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任债券研究员、专户投资经理，现担任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2011 年 12 月至 2014 年 12 月担任鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金经理，2012 年 06 月至 2018 年 07 月担任鹏华金刚保本混合型证券投资基金基金经理，2012 年 11 月至 2015 年 11 月担任鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2013 年 09 月至 2023 年 02 月担任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理，2013 年 09 月至今担任鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基

					金基金经理, 2013 年 10 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金经理, 2014 年 12 月至 2016 年 02 月担任鹏华丰泽债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2015 年 11 月至 2023 年 02 月担任鹏华丰和债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2016 年 03 月至 2022 年 12 月担任鹏华丰尚定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2016 年 04 月至 2018 年 10 月担任鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 08 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰饶定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2018 年 05 月至 2018 年 12 月担任鹏华普悦债券型证券投资基金基金经理, 2018 年 07 月至 2023 年 02 月担任鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 09 月至 2023 年 09 月担任鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 10 月至 2023 年 08 月担任鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 09 月至 2021 年 03 月担任鹏华锦利两年定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2022 年 10 月至今担任鹏华弘尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 10 月至今担任鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 戴钢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, 增聘杨雅洁为本基金基金经理。
杨雅洁	基金经理	2024-01-31	-	15 年	杨雅洁女士, 国籍中国, 经济学硕士, 15 年证券从业经验。曾任大成基金管理有限公司固定收益部研究员/基金经理, 招商银行股份有限公司私人银行部投资经理。2018 年 01 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任固定收益部投资经理、债券投资二部副总经理/投资经理, 混合资产投资部副总经理/基金经理, 现担任稳定收益投资部副总经理/基金经理。2021 年 10 月至今担任鹏华招华一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 10 月至今担任鹏华双债增利债券型证券投资基金基金经理, 2022 年 03 月至今担任鹏华安裕 5 个月持有期混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 04 月至今担任鹏华浙华一年持有期混合型证券投资基金基金

				<p>经理, 2022 年 06 月至今担任鹏华鑫华一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 07 月至今担任鹏华稳享一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华兴鹏一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 10 月至今担任鹏华创兴增利债券型证券投资基金基金经理, 2023 年 01 月至今担任鹏华稳健增利债券型证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华招润一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华民丰盈和 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华安康一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华安诚混合型证券投资基金基金经理, 2024 年 01 月至今担任鹏华宁华一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2024 年 01 月至今担任鹏华上华一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2024 年 01 月至今担任鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2024 年 03 月至今担任鹏华悦享一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 杨雅洁女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 增聘杨雅洁为本基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 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 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、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

美国一季度 PMI、就业等数据持续好于预期，通胀回升，年初对于降息的乐观预期快速回摆。中期供给受限的铜、原油、黄金等商品出现明显上涨。实体经济需求与金融条件还会反复拉锯，大选年和财政压力下，美联储降息的意愿也值得关注，加剧二次通胀风险。国内方面，2024 年一季度内、外需分化较大，国内政策的重心仍是结构而非总量，以“新质生产力”为代表的科技产业政策与投入显著发力，地产、地方政府债务问题等仍是防风险为主。财政政策仍强调“过紧日子”，货币政策强调“精准有效”，在一季度经济数据表现较好的背景下，预计总量货币政策相对克制，结构性工具继续发力。

组合在一季度进行提高了久期及杠杆，增配高等级信用债提高静态票息，长端利率债进行了波段操作。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准增长率为 0.50%；B 类份额净值增长率为 0.66%，同期业绩比较基准增长率为 0.50%。

### 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（元）	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	745,894,343.57	99.37
	其中：债券	745,894,343.57	99.37
	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	4,750,796.43	0.63
8	其他资产	-	-
9	合计	750,645,140.00	100.00

## 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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

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	648,049,334.91	114.23
	其中：政策性金融债	228,945,399.85	40.36
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	97,845,008.66	17.25
9	其他	-	-
10	合计	745,894,343.57	131.48

**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	112412041	24 北京银行 CD041	800,000	78,277,974.14	13.80
2	200208	20 国开 08	600,000	61,999,508.20	10.93
3	188383	21 光证 G5	500,000	52,009,232.88	9.17
4	230208	23 国开 08	500,000	51,604,098.36	9.10
5	115679	23 安信 G1	500,000	51,136,857.54	9.01

**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**

注：本基金基金合同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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

北京银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局北京监管局、中国银行保险监督管理委员会北京监管局的处罚。

南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局江苏省分局的处罚。

重庆银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局重庆监管局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

#### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

注：无。

#### 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。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 5.10.6 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华丰泰定期开放债券 A	鹏华丰泰定期开放债券 B
报告期期初基金份额总额	495,150,615.23	54,324.49
报告期期间基金总申购份额	138,124.84	171.17
减：报告期期间基金总赎回份额	991,343.73	2,820.86
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	494,297,396.34	51,674.80

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 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	20240101~20240331	479,155,725.92	0.00	0.00	479,155,725.92	96.93
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、场内买入份额和红利再投资份额；

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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告》（原文）。

### 9.2 存放地点

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。

### 9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2024 年 4 月 19 日