

# 鹏华丰盈债券型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36

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 .....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	36
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 .....	37
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 .....	37
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	37
7.11 投资组合报告附注 .....	37
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
8.3 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 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	45
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</b>
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 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华丰盈债券型证券投资基金
基金简称	鹏华丰盈债券
基金主代码	003741
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 22 日
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	1,583,277,035.76 份
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，通过利差分析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，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>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，提高资金流动性和收益率水平，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。</p> <p>1、资产配置策略 在资产配置方面，本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析，比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率，在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。</p> <p>2、久期策略 本基金将主要采取久期策略，通过自上而下的组合久期管理策略，以实现组合利率风险的有效控制。为控制风险，本基金采用以“目标久期”为中心的资产配置方式。目标久期的设定划分为两个层次：战略性配置和战术性配置。“目标久期”的战略性配置由投资决策委员会确定，主要根据对宏观经济和资本市场的预测分析决定组合的目标久期。“目标久期”的战术性配置由基金经理根据市场短期因素的影响在战略性配置预先设定的范围内进行调整。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，直至接近目标久期上限，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，直至目标久期下限，以减小债券价格下降带来的风险。</p> <p>3、收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。</p> <p>4、骑乘策略 本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，</p>

	<p>随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。</p> <p>5、息差策略 本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。</p> <p>6、债券选择策略 根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p> <p>7、中小企业私募债投资策略 本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，与中小企业私募债券承销商紧密合作，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，力求规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。</p> <p>8、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>
业绩比较基准	中债总指数收益率
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。

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95511-3
传真	0755-82021126	0755-82080387
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	518048	518001
法定代表人	何如	谢永林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号 深圳国际商会中心第 43 层
--------	------------	------------------------------------

### § 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(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	11,113,591.84
本期利润	15,026,141.25
加权平均基金份额本期利润	0.0126
本期加权平均净值利润率	1.10%
本期基金份额净值增长率	1.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	149,148,911.13
期末可供分配基金份额利润	0.0942
期末基金资产净值	1,732,425,946.89
期末基金份额净值	1.0942
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	53.50%

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) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。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

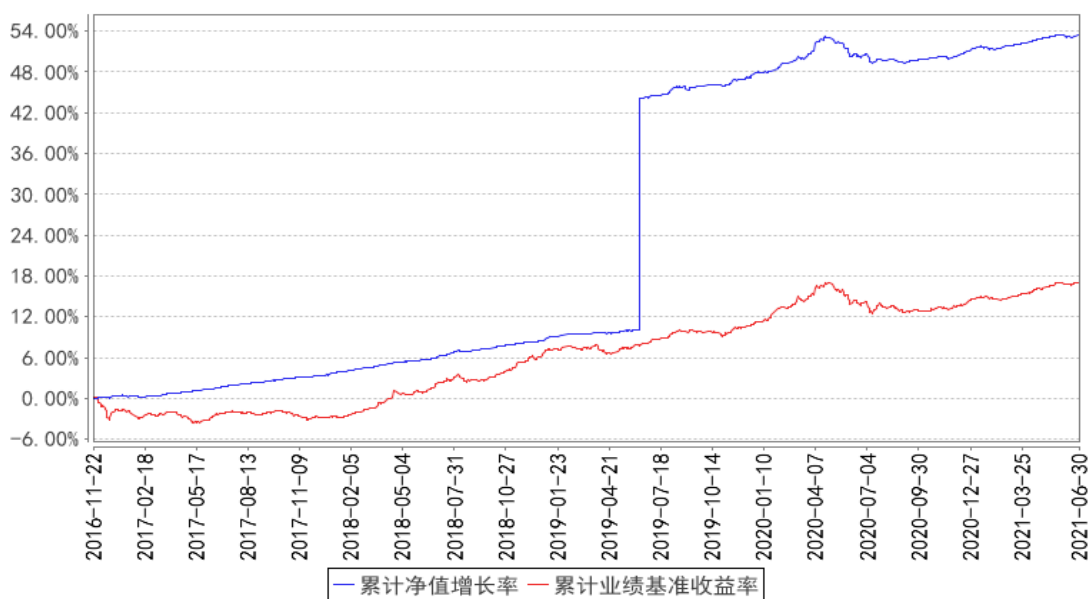
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.06%	0.03%	0.08%	0.07%	-0.02%	-0.04%
过去三个月	0.81%	0.03%	1.39%	0.06%	-0.58%	-0.03%

过去六个月	1.36%	0.04%	2.09%	0.07%	-0.73%	-0.03%
过去一年	1.96%	0.05%	2.49%	0.10%	-0.53%	-0.05%
过去三年	44.81%	1.14%	14.71%	0.11%	30.10%	1.03%
自基金合同生效起至今	53.50%	0.92%	17.10%	0.12%	36.40%	0.80%

注：业绩比较基准=中债总指数收益率

### 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

鹏华丰盈债券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 2016 年 11 月 22 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。截至本报告期末，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，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 9,012.31 亿元，管理 237 只公募基金、13 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富的经验。

#### 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		
李振宇	基金经理	2016-12-28	-	9 年	李振宇先生，国籍中国，经济学硕士，9 年证券从业经验。曾任银华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理，从事债券投资研究工作；2016 年 8 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任固定收益部投资经理，现担任公募债券投资部副总经理/基金经理。2016 年 12 月至今担任鹏华丰盈债券型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华丰惠债券型证券投资基金基金经理，2017 年 02 月至 2018 年 07 月担任鹏华可转债债券型证券投资基金基金经理，2017 年 05 月至今担任鹏华丰康债券型证券投资基金基金经理，2017 年 05 月至 2019 年 06 月担任鹏华金城保本混合型证券投资基金基金经理，2018 年 06 月至 2019 年 10 月担任鹏华尊享 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 06 月至 2019 年 10 月担任鹏华安益增强混合型证券投资基金基金经理，2018 年 12 月至 2019 年 12 月担任鹏华丰华债券型证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，2019 年 05 月至今担任鹏华 9-10 年利率债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 06 月

					至 2019 年 06 月担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 06 月至 2020 年 10 月担任鹏华尊诚 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理, 2019 年 08 月至 2021 年 03 月担任鹏华金利债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 08 月至今担任鹏华中证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 09 月至今担任鹏华丰鑫债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 12 月至今担任鹏华 0-5 年利率债券型发起式证券投资基金基金经理, 2020 年 04 月至今担任鹏华中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理, 2020 年 07 月至今担任鹏华中证 0-4 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2020 年 08 月至今担任鹏华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金基金经理, 2020 年 09 月至今担任鹏华中债-市场隐含评级 AAA 信用债(1-3 年)指数证券投资基金基金经理, 2020 年 09 月至今担任鹏华中债-0-3 年 AA+ 优选信用债指数证券投资基金基金经理, 李振宇先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	---

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。

**4.1.3 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**  
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 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，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% 的交易次数为 2 次，主要原因在于指数基金成分股交易不活跃导致。

## 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

报告期内，国内经济持续修复，货币政策基调以稳为主，强调“灵活精准、合理适度”；财政政策方面，在稳增长压力较小的“窗口期”，专项债发行和投向监管趋严，政府债发行节奏较慢；在政策监管收紧的背景之下，社融增速出现回落。流动性方面，年初至春节前资金面阶段性收紧，节后市场资金面维持平稳偏宽松，5 月底以来，央行持续等额续作 OMO 到期，随着政府债发行有所放量，资金中枢小幅抬升，资金面波动有所加大。在资金面、供需错位等多重因素影响下，债券市场收益率在年初震荡上行后呈现出震荡下行，期间 10 年期国债收益率下行 6.5BP，10 年期国开债收益率下行 4.6BP；信用债市场表现好于利率债，收益率明显下行，其中 3 年期 AAA、AA+ 中票收益率分别下行 14BP、42BP，中低评级品种信用利差收窄 30-50BP。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 1.36%，同期业绩比较基准增长率为 2.09%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年随着出口对于国内经济拉动作用边际趋缓，地产投资高位回落，消费增速恢复面临一定瓶颈，预计经济下行压力或有所加大。下半年以 PPI 为代表的结构性通胀水平将有所缓解，而美联储货币政策收紧节奏预计较慢，政府债供给压力仍存，货币政策整体或维持稳健偏宽松的格局，预计债市仍然机会大于风险。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉

相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 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 149,148,911.13 元，期末基金份额净值 1.0942 元。

2、本基金于 2021 年 03 月 29 日进行利润分配，分配金额为 47,274,962.88 元；本基金于 2021 年 06 月 28 日进行利润分配，分配金额为 55,412,528.26 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，平安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。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

## § 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：鹏华丰盈债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	16,551,180.73	20,095,445.17
结算备付金		734,765.28	-
存出保证金		9,296.87	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,901,654,500.00	1,849,576,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,901,654,500.00	1,849,576,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	27,283,671.02	35,923,465.81
应收股利		-	-
应收申购款		54,337.95	192,870.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,946,287,751.85	1,905,787,781.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		212,079,562.88	165,489,797.25
应付证券清算款		1,007,232.87	-
应付赎回款		21,753.61	21,235.96
应付管理人报酬		433,391.71	448,065.40
应付托管费		144,463.90	149,355.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	33,859.64	16,646.51
应交税费		29,815.72	-
应付利息		27,409.94	13,652.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,314.69	170,000.82
负债合计		213,861,804.96	166,308,753.67
<b>所有者权益：</b>			

实收基金	6.4.7.9	1,583,277,035.76	1,498,974,415.14
未分配利润	6.4.7.10	149,148,911.13	240,504,612.83
所有者权益合计		1,732,425,946.89	1,739,479,027.97
负债和所有者权益总计		1,946,287,751.85	1,905,787,781.64

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0942 元，基金份额总额 1,583,277,035.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华丰盈债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		20,016,285.24	20,484,938.20
1. 利息收入		25,211,395.05	25,005,442.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	253,548.07	174,559.70
债券利息收入		24,528,395.12	24,005,642.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		429,451.86	825,241.08
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,108,381.19	299,656.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-9,108,381.19	299,656.61
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,912,549.41	-4,833,685.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	721.97	13,524.25
减：二、费用		4,990,143.99	3,586,925.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,003,623.24	2,288,896.79

2. 托管费	6.4.10.2.2	667,874.38	762,965.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	26,820.41	12,233.33
5. 利息支出		2,185,518.54	416,966.43
其中：卖出回购金融资产支出		2,185,518.54	416,966.43
6. 税金及附加		3,404.86	-
7. 其他费用	6.4.7.20	102,902.56	105,863.39
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		15,026,141.25	16,898,012.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		15,026,141.25	16,898,012.67

### 6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	1,498,974,415.14	240,504,612.83	1,739,479,027.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,026,141.25	15,026,141.25
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)	84,302,620.62	-3,694,351.81	80,608,268.81
其中：1. 基金申购款	873,775,845.27	121,234,424.06	995,010,269.33
2. 基金赎回款	-789,473,224.65	-124,928,775.87	-914,402,000.52
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)	-	-102,687,491.14	-102,687,491.14
五、期末所有者	1,583,277,035.76	149,148,911.13	1,732,425,946.89

权益(基金净值)			
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	43,391,110.23	15,568,719.72	58,959,829.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,898,012.67	16,898,012.67
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)	1,612,814,232.13	599,082,517.24	2,211,896,749.37
其中: 1. 基金申购款	1,653,215,361.68	612,036,342.47	2,265,251,704.15
2. 基金赎回款	-40,401,129.55	-12,953,825.23	-53,354,954.78
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)	-	-204,281,906.33	-204,281,906.33
五、期末所有者权益(基金净值)	1,656,205,342.36	427,267,343.30	2,083,472,685.66

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

邢彪

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

鹏华丰盈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[2016]1441号《关于准予鹏华丰盈债券型证券投资基金注册的批复》准予,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《鹏华丰盈债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 3,000,456,257.71 元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字



[2016]01300040 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华丰盈债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,001,018,838.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 562,580.29 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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华丰盈债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、中小企业私募债、次级债、同业存单、债券回购、银行存款等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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为:对债券的投资比例不低于基金资产的 80%,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为:中债总指数收益率。

#### 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<年度报告和中期报告>》、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》、《鹏华丰盈债券型证券投资基金基金合同》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 2021 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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	16,551,180.73
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	16,551,180.73

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	691,157,914.80	687,762,500.00
	银行间市场	1,215,464,832.38	1,213,892,000.00
	合计	1,906,622,747.18	1,901,654,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,906,622,747.18	1,901,654,500.00	-4,968,247.18

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	4,273.20
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	330.60
应收债券利息	27,279,063.02
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	4.20
合计	27,283,671.02

## 6.4.7.6 其他资产

无。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	33,859.64
合计	33,859.64

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.13
应付证券出借违约金	-

预提费用	84,302.56
合计	84,314.69

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,498,974,415.14	1,498,974,415.14
本期申购	873,775,845.27	873,775,845.27
本期赎回（以“-”号填列）	-789,473,224.65	-789,473,224.65
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,583,277,035.76	1,583,277,035.76

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,169,054,523.99	-22,928,549,911.16	240,504,612.83
本期利润	11,113,591.84	3,912,549.41	15,026,141.25
本期基金份额交易产生的变动数	1,277,714,974.49	-1,281,409,326.30	-3,694,351.81
其中：基金申购款	13,480,974,607.86	-13,359,740,183.80	121,234,424.06
基金赎回款	-12,203,259,633.37	12,078,330,857.50	-124,928,775.87
本期已分配利润	-102,687,491.14	-	-102,687,491.14
本期末	24,355,195,599.18	-24,206,046,688.05	149,148,911.13

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	活期存款利息收入	35,512.14
定期存款利息收入	171,222.22	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	958.82	
其他	45,854.89	
合计	253,548.07	

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

## 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

## 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,108,381.19
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-9,108,381.19

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,820,953,868.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,800,469,094.63
减：应收利息总额	29,593,154.93
买卖债券差价收入	-9,108,381.19

## 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

## 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.16 股利收益

无。

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	3,912,549.41
股票投资	-

债券投资	3,912,549.41
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,912,549.41

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	632.16
基金转换费收入	89.81
合计	721.97

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	545.41
银行间市场交易费用	26,275.00
合计	26,820.41

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	102,902.56

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。



**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 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。

**6.4.9.2 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、基金注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,003,623.24	2,288,896.79
其中:支付销售机构的客户维护费	12,384.16	15,270.66

注: 1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.30%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.30%÷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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	667,874.38	762,965.59

注：支付基金托管人平安银行的托管费年费率为 0.10%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行	-	-	-	-	430,119,000.00	150,413.59
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

注：与关联方之间通过银行间同业市场进行的债券（含回购）交易，该类交易均在正常业务中按一般商业条款而订立。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.5.2 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没有投资及持有本基金份额。

## 6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
平安银行	16,551,180.73	35,512.14	22,406,274.79	61,025.28

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年3月29	-	2021年3月29	0.4650	46,982,547.51	292,415.37	47,274,962.88	-

	日		日					
2	2021 年 6 月 28 日	-	2021 年 6 月 28 日	0.3500	55,128,602.46	283,925.80	55,412,528.26	-
合计	-	-	-	0.8150	102,111,149.97	576,341.17	102,687,491.14	-

#### 6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 158,079,562.88 元, 是以如下债券作为质押:

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
190207	19 国开 07	2021 年 7 月 6 日	100.60	1,400,000	140,840,000.00
210212	21 国开 12	2021 年 7 月 6 日	100.35	264,000	26,492,400.00
合计				1,664,000	167,332,400.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 54,000,000.00 元, 于 2021 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金。本基金主要投资债券等固定收益类金融工具。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	99,600,000.00
合计	-	99,600,000.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债；A-1 以下包含未评级的超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	291,485,000.00	-
未评级	-	-
合计	291,485,000.00	-

注：A-1 以下包含发行期限小于 1 年的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	1,097,705,500.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	512,464,000.00	1,749,976,000.00
合计	1,610,169,500.00	1,749,976,000.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 212,079,562.88 元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公

司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----



2021 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	16,551,180.73	-	-	-	16,551,180.73
结算备付金	734,765.28	-	-	-	734,765.28
存出保证金	9,296.87	-	-	-	9,296.87
交易性金融资产	432,325,000.00	1,263,762,500.00	205,567,000.00	-	1,901,654,500.00
应收利息	-	-	-	27,283,671.02	27,283,671.02
应收申购款	-	-	-	54,337.95	54,337.95
资产总计	449,620,242.88	1,263,762,500.00	205,567,000.00	27,338,008.97	1,946,287,751.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,753.61	21,753.61
应付管理人报酬	-	-	-	433,391.71	433,391.71
应付托管费	-	-	-	144,463.90	144,463.90
应付证券清算款	-	-	-	1,007,232.87	1,007,232.87
卖出回购金融资产款	212,079,562.88	-	-	-	212,079,562.88
应付交易费用	-	-	-	33,859.64	33,859.64
应付利息	-	-	-	27,409.94	27,409.94
应交税费	-	-	-	29,815.72	29,815.72
其他负债	-	-	-	84,314.69	84,314.69
负债总计	212,079,562.88	-	-	1,782,242.08	213,861,804.96
利率敏感度缺口	237,540,680.00	1,263,762,500.00	205,567,000.00	25,555,766.89	1,732,425,946.89
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,095,445.17	-	-	-	20,095,445.17
交易性金融资产	119,772,000.00	1,689,260,000.00	40,544,000.00	-	1,849,576,000.00
应收利息	-	-	-	35,923,465.81	35,923,465.81
应收申购款	-	-	-	192,870.66	192,870.66
资产总计	139,867,445.17	1,689,260,000.00	40,544,000.00	36,116,336.47	1,905,787,781.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,235.96	21,235.96
应付管理人报酬	-	-	-	448,065.40	448,065.40
应付托管费	-	-	-	149,355.12	149,355.12
卖出回购金融资产款	165,489,797.25	-	-	-	165,489,797.25
应付交易费用	-	-	-	16,646.51	16,646.51
应付利息	-	-	-	13,652.61	13,652.61
其他负债	-	-	-	170,000.82	170,000.82
负债总计	165,489,797.25	-	-	818,956.42	166,308,753.67
利率敏感度缺口	-25,622,352.08	1,689,260,000.00	40,544,000.00	35,297,380.05	1,739,479,027.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	7,691,789.31	6,428,758.87
	市场利率上升 25 个基点	-7,636,029.94	-6,376,574.27

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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%，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外币汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 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	1,901,654,500.00	97.71
	其中：债券	1,901,654,500.00	97.71
	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	17,285,946.01	0.89
8	其他各项资产	27,347,305.84	1.41
9	合计	1,946,287,751.85	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所有股票投资明细

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,313,684,000.00	75.83
	其中：政策性金融债	512,464,000.00	29.58
4	企业债券	246,555,500.00	14.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	49,930,000.00	2.88
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	291,485,000.00	16.83
9	其他	-	-
10	合计	1,901,654,500.00	109.77

## 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	190407	19 农发 07	1,600,000	160,880,000.00	9.29
2	190207	19 国开 07	1,400,000	140,840,000.00	8.13
3	210212	21 国开 12	1,300,000	130,455,000.00	7.53
4	112108006	21 中信银行 CD006	1,000,000	97,240,000.00	5.61
5	112115070	21 民生银行 CD070	1,000,000	97,070,000.00	5.60

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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

国家开发银行

2020 年 12 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会对国家开发银行的以下违法违规行为一、为违规的政府购买服务项目提供融资，二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况，三、违规变相发放土地储备贷款，四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款，五、贷款风险分类不准确，六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产，七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量，八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品，九、扶贫贷款存贷挂钩，十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁，十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求，十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理，十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理，十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务，十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况，十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务，十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表，十八、违规收取小微企业贷款承诺费，十九、收取财务顾问费质价不符，二十、利用银团贷款承诺费浮利分费，二十一、向检查组提供虚假整改说明材料，二十二、未如实提供信贷资产转让台账，二十三、案件信息迟报、瞒报，二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位，对公司处以罚款 4880 万元。

2020 年 10 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对国家开发银行违反银行交易记录管理规定的违法违规行为，对国家开发银行处以 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员

和其他直接责任人员给予处分。

#### 华夏银行

2020 年 12 月 10 日，中国银行保险监督管理委员会苏州监管分局针对华夏银行股份有限公司苏州分行监管报表错报且责令改正逾期未改的违法违规行为，对公司罚款人民币 15 万元。

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会对华夏银行股份有限公司的以下违法违规行为：一、违规使用自营资金、理财资金购买本行转让的信贷资产，二、贷前审查及贷后管理不严，三、同业投资投前审查、投后管理不严，四、通过同业投资向企业提供融资用于收购银行股权，五、违规向土地储备项目提供融资，六、违规开立同业账户，七、通过投资底层资产为本行信贷资产的信托计划，少计风险资产，八、同业资金协助他行增加一般性存款，且部分期限超过监管要求，九、会计核算不准确，将同业存款计入一般性存款，十、部分理财产品相互交易、风险隔离不到位，十一、违规销售无真实投资、无测算依据、无充分信息披露的理财产品，十二、策略保本型理财产品销售文件未充分揭示风险，十三、出具的理财投资清单与事实不符或未全面反映真实风险，十四、理财资金违规投资权益类资产，十五、理财资金违规投资信托次级类高风险资产，十六、理财资金投资非标准化债权资产超过监管要求，十七、非标资产非洁净转让，十八、自营业务与代客业务未有效分离，十九、部分理财产品信息披露不合规，对接本行信贷资产，二十、部分理财资金违规投向土地储备项目，二十一、部分理财资金投向不符合政府购买服务规定的项目，二十二、部分理财投资投前调查不尽职，二十三、委托贷款资金来源不合规，二十四、与未备案理财投资合作机构开展业务，二十五、漏报错报监管标准化数据且逾期未改正，二十六、提供与事实不符的材料，二十七、部分理财资金未托管，对公司处以罚款 9830 万元。

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会针对华夏银行股份有限公司的（一）内控制度执行不到位，严重违反审慎经营规则，（二）生产系统存在重大风险隐患，严重违反审慎经营规则，（三）账务管理工作存在重大错漏，长期未发现异常挂账情况，严重违反审慎经营规则，（四）长期未处置风险监控预警信息，严重违反审慎经营规则的违法违规行为，对公司处以罚款 110 万元。

2020 年 8 月 25 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对华夏银行股份有限公司办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查、违反规定办理结汇、售汇业务等违法违规行为，对公司给予警告，没收违法所得 344694.85 元人民币，并处 300 万元人民币罚款。

#### 中国工商银行

2020 年 11 月 06 日，中国人民银行衡水市中心支行针对中国工商银行股份有限公司违反反洗

钱法的行为，对中国工商银行股份有限公司处以 21 万元罚款，对高管及直接责任人各处 1 万元罚款，共计 23 万元。

2021 年 5 月 14 日，北京市市场监督管理局针对工商银行股份有限公司牡丹卡中心在“工银 e 生活”APP 发起的“端午爱家专场”促销活动中，虚构西屋电饭煲 WRC-0424 的原价的违法违规行为，责令当事人改正价格违法行为，对公司给予警告，并处罚款 8 万元。

2020 年 8 月 27 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对中国工商银行股份有限公司贵金属业务部的黄金租赁业务管理不严，违反审慎经营规则的违法违规行为，对公司处以罚款 50 万元。

2020 年 12 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国工商银行股份有限公司的以下违法违规行为，一、未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告，二、关键岗位未进行实质性轮岗，三、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞，四、为同业投资业务提供隐性担保，五、理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益，六、非标准化债权资产限额测算不准确，七、理财资金通过投资集合资金信托计划优先级的方式变相放大劣后级受益人的杠杆比例，八、部分重点领域业务未向监管部门真实反映，九、为违规的政府购买服务项目提供融资，十、理财资金违规用于缴纳或置换土地款，十一、通过转让分级互投实现不良资产虚假出表，十二、理财资金投资本行不良资产或不良资产收益权，十三、面向一般个人客户发行的理财产品投资权益性资产，十四、理财资金投资他行信贷资产收益权或非标资产收益权，十五、全权委托业务不规范，十六、用其他资金支付结构性存款收益，十七、自营贷款承接本行理财融资、贷款用途管理不尽职，十八、理财资金承接本行自营贷款，十九、封闭式理财产品相互交易调节收益，二十、滚动发行产品承接风险资产，且按原价交易调节收益，二十一、高净值客户认定不审慎，二十二、理财产品信息披露不到位，二十三、部分理财产品在全国银行业理财信息登记系统中未登记或超时限登记，对公司处以罚款 5470 万元

2020 年 10 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部针对中国工商银行股份有限公司的违规开展外汇掉期业务、外汇远期业务和外汇期权业务的违法违规行为，对公司处 100 万元人民币罚款，并要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

中国民生银行

2020 年 11 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国民生银行股份有限公司违反规定办理售汇业务等违法违规行为，对中国民生银行股份有限公司处以没收违法所得 1910822.20 元人民币，并处 80 万元人民币罚款，给予警告。

2020 年 7 月 14 日，中国银行保险监督管理委员会对中国民生银行股份有限公司的以下违法

违规行为（一）违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资，（二）为“四证”不全的房地产项目提供融资，（三）违规为土地储备中心提供融资，（四）违规为地方政府提供融资，接受地方政府担保或承诺，（五）多名股东在已派出董事的情况下，以推荐代替提名方式推荐独立董事及监事，（六）多名股东在股权质押超比例的情况下违规在股东大会上行使表决权，派出董事在董事会上的表决权也未受限，（七）股东持股份额发生重大变化未向监管部门报告，（八）多名拟任高管人员及董事未经核准即履职，（九）关联交易不合规，（十）理财产品风险信息披露不合规，（十一）年报信息披露不真实，（十二）贷款资金被挪用，虚增贷款，（十三）以贷转存，虚增存款，（十四）贸易背景审查不尽职，（十五）向关系人发放信用贷款，（十六）违规转让正常类信贷资产，（十七）违规转让不良资产，（十八）同业投资他行非保本理财产品审查不到位，接受对方机构违规担保，少计风险加权资产，（十九）同业投资未穿透底层资产计提资本拨备，少计风险加权资产，（二十）同业存放业务期限超过一年，（二十一）违规开展票据转贴现交易，（二十二）个别理财产品管理费长期未入账，（二十三）理财业务风险隔离不充分，（二十四）违规向非高净值客户销售投向股权类资产的理财产品，（二十五）非标准化资产纳入标准化资产统计，实际非标债权资产比例超监管要求，（二十六）违规出具补充协议及与事实不符的投资说明，（二十七）以代销名义变相向本行授信客户融资，并承担兜底风险，（二十八）向不符合条件的借款人办理收益权转让再融资业务，（二十九）代理福费廷业务违规承担风险，会计处理不规范，（三十）迟报瞒报多起案件（风险）信息，对中国民生银行股份有限公司处以没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元。

2021 年 01 月 25 日，北京市市场监督管理局对中国民生银行股份有限公司违反《中华人民共和国价格法》第十四条第一款第四项的行为，责令公司改正，给予警告，并处罚款 40 万元。

#### 中国银行

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国银行股份有限公司的以下违法违规行为一、向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款，二、违规向关系人发放信用贷款，三、向无资金缺口企业发放流动资金贷款，四、存款月末冲时点，五、为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票，六、贷款管理不严，信贷资金被挪用，七、票据贴现资金直接回流至出票人或其关联人账户，八、理财产品质押贸易融资业务风险控制有效性不足，九、超比例发放并购贷款，十、向未经备案的跨境并购业务提供并购贷款，十一、违规为私募股权基金收购境内企业发放并购贷款，十二、超授权期限办理汇出汇款融资业务，十三、与名单外交易对手开展同业业务，十四、违规为他行开立投融资性同业账户，十五、以同业返存方式不当吸收存款，十六、自营和代客理财业务未能实现风险隔离，十七、面向一般客户销售的理财产品投资二级市场股票，十八、未按



规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权风险状况，十九、违规向四证不全房地产项目提供融资，二十、理财资金违规用于支付土地款或置换股东购地借款，二十一、理财资金违规用于土地储备项目，二十二、理财非标融资入股商业银行，二十三、理财非标融资用于商业银行注册验资，二十四、超授信额度提供理财非标融资，二十五、买入返售业务标的资产不合规，二十六、个人住房贷款业务搭售保险产品，二十七、单家分支行代销 3 家以上保险公司保险产品，二十八、主承销债券包销余券未通过风险处置专户处置，二十九、通过平移贷款延缓风险暴露，三十、债券投资业务未分类，表内人民币债券未计提减值准备，三十一、与资产管理公司合作设立有限合伙基金，不洁净转让不良资产，三十二、迟报案件信息，三十三、案件问责不到位，三十四、提供质价不符的服务，三十五、违规收取福费廷风险承担费，三十六、违规向部分已签约代发工资客户收取年费，对公司处以罚款 8761.355 万元

2020 年 12 月 1 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国银行股份有限公司“原油宝”产品风险事件相关的产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等的违法违规行为，对公司处以罚款 5050 万元。

#### 中信银行

2020 年 8 月 25 日，国家外汇管理局针对中信银行股份有限公司违规办理内保外贷业务；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理售汇业务；违反外汇账户管理规定的违法违规行为，对公司给予警告，没收违法所得 14857527.66 元人民币，并处 1177.04 万元人民币罚款。

2021 年 3 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对中信银行股份有限公司的以下违法违规行为一、客户信息保护体制机制不健全；柜面非密查询客户账户明细缺乏规范、统一的业务操作流程与必要的内部控制措施，乱象整治自查不力；二、客户信息收集环节管理不规范；客户数据访问控制管理不符合业务“必须知道”和“最小授权”原则；查询客户账户明细事由不真实；未经客户本人授权查询并向第三方提供其个人银行账户交易信息；三、对客户敏感信息管理不善，致其流出至互联网；违规存储客户敏感信息；四、系统权限管理存在漏洞，重要岗位及外包机构管理存在缺陷，对公司处以罚款 450 万元。

2021 年 2 月 5 日, 中国人民银行对中信银行股份有限公司的以下违法违规行为 1. 未按规定履行客户身份识别义务; 2. 未按规定保存客户身份资料和交易记录; 3. 未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告; 4. 与身份不明的客户进行交易, 对公司处以罚款 2890 万元。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。

### 7.11.2 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

### 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	9,296.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,283,671.02
5	应收申购款	54,337.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,347,305.84

### 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 (%)
1,537	1,030,108.68	1,568,962,892.60	99.10	14,314,143.16	0.90

### 8.2 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	10,905.50	0.0007
------------------	-----------	--------

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。

### 8.3 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（2016年11月22日） 基金份额总额	3,001,018,838.00
本报告期期初基金份额总额	1,498,974,415.14
本报告期基金总申购份额	873,775,845.27
减：本报告期基金总赎回份额	789,473,224.65
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	1,583,277,035.76

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理高阳先生辞去公司副总经理职务，经公司董事会审议通过，于2021年1月16日离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，聘任王宗合先生担任公司副总经理，任职日期自2021年1月28日起；聘任梁浩先生担任公司副总经理，任职日期自2021年1月28日起。本公司已将上述变更事项报相关监管部门备案。

报告期内，经公司股东会审议通过，史际春先生不再担任公司独立董事，于2021年4月22日离任；聘任蒋毅刚先生担任公司独立董事，任职日期自2021年4月22日起。

基金托管人的重大人事变动：

2021年1月26日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021年2月26日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副

总裁（主持工作）。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 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

无。

### 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	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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 & 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
国泰君安	533,844,300.00	100.00%	4,748,000,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月04日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月04日
3	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月16日
4	鹏华丰盈债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月22日
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月28日
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月28日

7	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 06 日
8	鹏华基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 08 日
9	鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 09 日
10	鹏华基金管理有限公司关于直销渠道相关业务费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 22 日
11	鹏华基金管理有限公司关于鹏华丰盈债券型证券投资基金 2021 年第 1 次分红公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 25 日
12	鹏华丰盈债券型证券投资基金 2020 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
13	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米基金销售有限公司基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 01 日
16	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 10 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京展恒基金销售股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 19 日
18	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 19 日
19	鹏华丰盈债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日

20	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日
21	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购瑞华泰首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
22	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购志特新材首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
23	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 26 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司申购（不含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 30 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 14 日
26	鹏华丰盈债券型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 25 日
27	鹏华丰盈债券型证券投资基金托管协议	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 25 日
28	鹏华基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 25 日
29	鹏华丰盈债券型证券投资基金更新的招募说明书（2021 年第 1 号）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 28 日
30	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 06 月 04 日
31	鹏华基金管理有限公司关于鹏华丰盈债券型证券投资基金 2021 年第 2 次分红公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 06 月 25 日

## § 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	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	20210101~20210203	744,276,992.23	-	744,276,992.23	-	-
	2	20210101~20210630	744,276,992.23	-	-	744,276,992.23	47.01
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；  
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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华丰盈债券型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华丰盈债券型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华丰盈债券型证券投资基金 2021 年中期报告》(原文)。

### 12.2 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。

### 12.3 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。



2021 年 8 月 30 日