

鹏华信用增利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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.11 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华信用增利债券型证券投资基金	
基金简称	鹏华信用增利债券	
基金主代码	206003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 5 月 31 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,738,432,172.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华信用增利债券 A	鹏华信用增利债券 B
下属分级基金的交易代码	206003	206004
报告期末下属分级基金的份额总额	1,716,118,477.73 份	22,313,694.28 份

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险并保持良好流动性的基础上，通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断，在获取当期收益的同时，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1. 资产配置策略 本基金将在对未来宏观经济形势及利率变动趋势进行深入研究的基础上，对固定收益类资产、权益类资产和现金资产的配置比例进行动态调整。 2. 债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、债券选择策略、信用策略等积极投资策略，在控制风险并保持良好流动性的基础上，通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断，在获取当期收益的同时，力争实现基金资产的长期稳健增值。 3. 股票投资策略 本基金股票投资以精选个股为主。在严格控制风险并判断未来股票市场趋势的基础上，考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，精选流动性好，成长性强，估值水平低的股票进行投资。
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，其预期的风险和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。

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	交通银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张戈	陆志俊
	联系电话	0755-82825720	95559
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006788999	95559
传真		0755-82021126	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		518048	200336
法定代表人		何如	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
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)	
	鹏华信用增利债券 A	鹏华信用增利债券 B
本期已实现收益	51,707,311.31	804,125.29
本期利润	38,308,249.36	275,127.24
加权平均基金份额本期利润	0.0181	0.0059
本期加权平均净值利润率	1.37%	0.41%
本期基金份额净值增长率	2.17%	1.96%

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	224,456,408.46	5,043,740.00
期末可供分配基金份额利润	0.1308	0.2260
期末基金资产净值	2,289,326,245.44	31,896,912.67
期末基金份额净值	1.3340	1.4295
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	86.94%	81.67%

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

鹏华信用增利债券 A

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	0.30%	0.26%	0.08%	0.07%	0.22%	0.19%
过去三个月	3.13%	0.23%	1.39%	0.06%	1.74%	0.17%
过去六个月	2.17%	0.34%	2.09%	0.07%	0.08%	0.27%

过去一年	7.74%	0.35%	2.49%	0.10%	5.25%	0.25%
过去三年	27.56%	0.33%	14.71%	0.11%	12.85%	0.22%
自基金合同生效起 至今	86.94%	0.24%	51.32%	0.11%	35.62%	0.13%

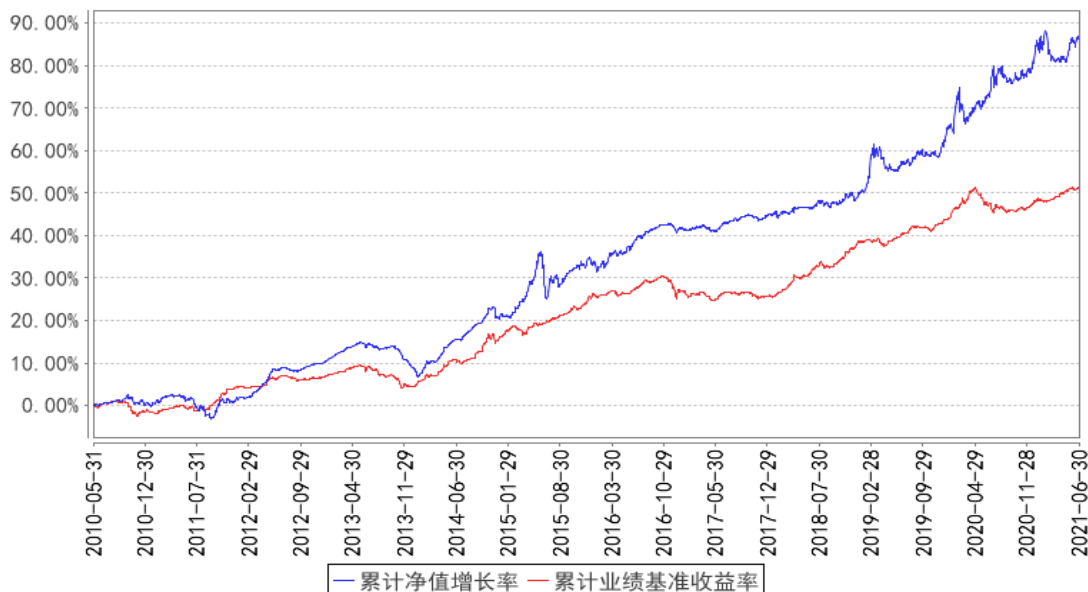
鹏华信用增利债券 B

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	0.27%	0.26%	0.08%	0.07%	0.19%	0.19%
过去三个月	3.03%	0.23%	1.39%	0.06%	1.64%	0.17%
过去六个月	1.96%	0.34%	2.09%	0.07%	-0.13%	0.27%
过去一年	7.31%	0.35%	2.49%	0.10%	4.82%	0.25%
过去三年	26.23%	0.33%	14.71%	0.11%	11.52%	0.22%
自基金合同生效起 至今	81.67%	0.24%	51.32%	0.11%	30.35%	0.13%

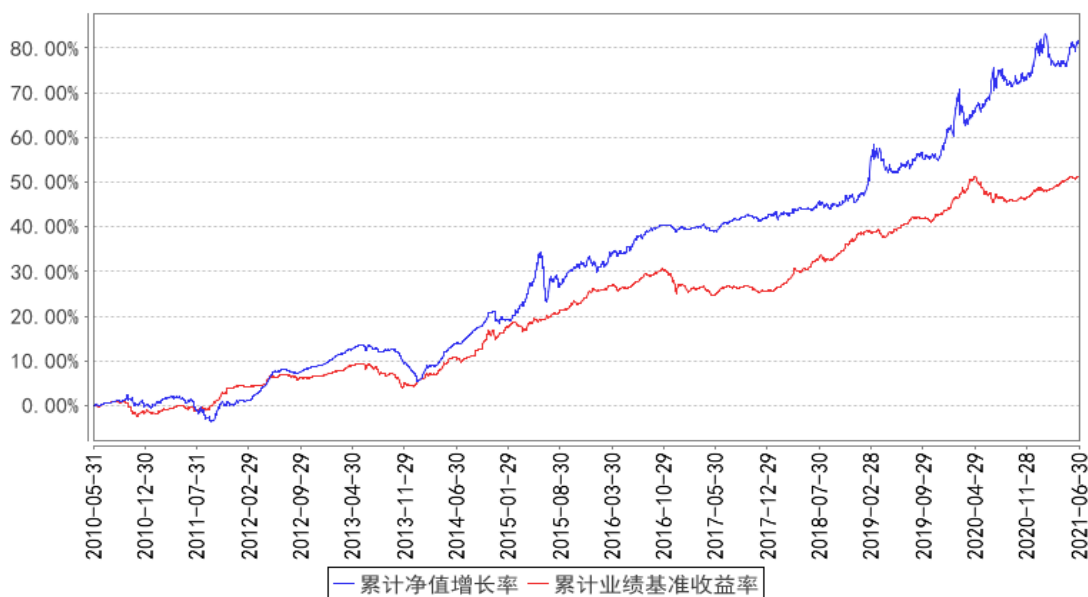
注：业绩比较基准=中债总指数收益率

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

鹏华信用增利债券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



鹏华信用增利债券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 2010 年 05 月 31 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		
方昶	基金经理	2018-10-10	-	7 年	方昶先生，国籍中国，经济学硕士，7 年证券从业经验。曾任中国工商银行资产管理部投资经理；2016 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任公募债券投资部基金经理。2018 年 07 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰腾债券型证券投资基金基金经理，2018 年 10 月至今担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理，2018 年 12 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰华债券型证券投资基金基金经理，2019 年 01 月至今担任鹏华丰恒债券型证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华安益增强混合型证券投资基金基金经理，2019 年 06 月至今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 09 月至今担任鹏华丰享债券型证券投资基金基金经理，2019 年 09 月至 2021 年 01 月担任鹏华中短债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月至今担任鹏华安润混合型证券投资基金基金经理，2021 年 06 月至今担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，方昶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

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，因市场波动等被动原因存在在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，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

2021 年以来，债券市场在资金面、供需错位等多种因素的共同影响之下，收益率整体呈现震荡向下格局。从具体节奏来看：2020 年 11 月-2021 年 1 月初，为应对信用风险事件的冲击，金融委定调“维稳”，央行加大流动性投放，资金面维持宽松，收益率小幅回落；1 月下旬-2 月中旬，信用市场情绪修复，权益市场、房地产市场价格快速上涨，进而引发监管层警惕，央行阶段性收紧流动性，市场紧缩预期升温，现券收益率快速上行；2 月中旬-5 月底，资金面持续维持宽松，政府债发行节奏弱于预期，叠加政策监管收紧的背景之下，信用债净融资缩量，非标融资进一步压缩，市场形成阶段性“资产荒”，现券收益率震荡回落；6 月初，政府债供给担忧增加，叠加资金中枢小幅抬升，现券收益率小幅上行；6 月中下旬，基本面数据边际趋弱，叠加美联储议息会议靴子落地，政府债供给边际缩量，现券收益率小幅回落。权益市场方面，2021 年上半年呈现出

了较大的市场波动，市场分化严重。春节前，以消费医药为代表的核心资产持续上涨；春节后在美债收益率上行和货币政策趋紧预期带动下，市场出现巨幅回调；4、5 月份，随着流动性收紧预期边际弱化，市场出现较大幅度反弹；6 月以来，市场在新能源车、光伏发电、半导体等高景气成长方向带动下，走出了较强的结构性行情。

本组合上半年债券投资方面，整体以高等级优质信用债投资为主，适度拉长久期参与利率债波段交易；权益投资方面，在春节后市场回调过程中做出来了防守动作，在 4 到 6 月份市场反弹过程中，对于成长方向做出了加仓，结构上均衡配置，努力为投资者创造持续稳健回报。

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 A 类份额净值增长率为 2.17%，同期业绩比较基准增长率为 2.09%，B 类份额净值增长率为 1.96%，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

展望 2021 年下半年，宏观经济层面，在疫情内外部反复的大背景下，宏观经济略有边际下行压力，但总体仍然维持韧性。外需层面，随着海外财政补贴的退坡、产能的逐步修复，出口端对于国内经济拉动作用边际趋缓；内需层面，在地产三条红线背景下投资数据高位回落确定性较高，叠加消费增速恢复面临一定瓶颈，预计经济可能面临一定的下行压力。在此背景下，货币政策整体或维持稳健偏宽松的格局。

整体来看，稳货币紧信用是全年宏观经济主题，作用到债券市场，稳健偏松的流动性环境对债券市场形成支撑，而严防信用风险仍然是债券投资的核心关注点；权益市场方面，考虑到经济基本面整体仍然维持韧性，叠加市场流动性相对宽松，且市场层面除少数行业外估值整体合理，下半年权益市场仍然存在较好的结构性机会；但与此同时，也要认识到，基本面和流动性的持续拉锯、极度分化的市场环境对权益投资带来了更大的挑战。下半年操作上，本组合将更加注重投资的安全边际和风险收益比、更加敬畏市场，在管控好组合回撤的基础上争取为投资者创造持续稳健回报。

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，本基金鹏华信用增利债券 A 期末可供分配利润为 224,456,408.46 元，期末基金份额净值 1.3340 元；鹏华信用增利债券 B 期末可供分配利润为 5,043,740.00 元，期末基金份额净值 1.4295 元。

2、本基金于 2021 年 03 月 16 日进行利润分配，A 类分配金额为 107,320,870.30 元，B 类分配金额为 2,910,818.72 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

本报告期内，基金托管人在鹏华信用增利债券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，鹏华基金管理有限公司在鹏华信用增利债券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。个别工作日，托管人发现个别监督指标不符合基金合同的约定，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人根据规定进行了调整。

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

本报告期内，由鹏华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关鹏华信用增利债券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：鹏华信用增利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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	17,284,790.60	11,356,978.78
结算备付金		114,093,724.41	68,428,839.99
存出保证金		1,501,028.49	1,521,884.80
交易性金融资产	6.4.7.2	2,837,909,648.65	2,608,512,695.03
其中：股票投资		468,275,742.29	415,236,103.46
基金投资		-	-
债券投资		2,234,633,906.36	1,981,308,791.58
资产支持证券投资		135,000,000.00	211,967,799.99
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	-	7,900,000.00
应收证券清算款		51,793,025.72	93,616,354.16
应收利息	6.4.7.5	39,938,539.11	25,357,739.78
应收股利		-	-
应收申购款		41,606.32	468,235.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,062,562,363.30	2,817,162,727.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
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		682,000,000.00	638,000,000.00
应付证券清算款		52,196,481.79	94,780,681.58
应付赎回款		150,157.50	58,771.57
应付管理人报酬		1,264,354.58	1,083,229.53
应付托管费		421,451.51	361,076.52
应付销售服务费		11,477.00	28,059.92
应付交易费用	6.4.7.7	4,866,583.45	5,047,767.21
应交税费		324,495.33	385,433.62
应付利息		-	-231,841.90

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	104,204.03	210,044.12
负债合计		741,339,205.19	739,723,222.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,738,432,172.01	1,531,126,243.62
未分配利润	6.4.7.10	582,790,986.10	546,313,262.16
所有者权益合计		2,321,223,158.11	2,077,439,505.78
负债和所有者权益总计		3,062,562,363.30	2,817,162,727.95

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额为 1,738,432,172.01 份，其中鹏华信用增利债券 A 基金份额总额为 1,716,118,477.73 份，基金份额净值 1.3340 元；鹏华信用增利债券 B 基金份额总额为 22,313,694.28 份，基金份额净值 1.4295 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华信用增利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		77,284,819.61	100,945,728.10
1. 利息收入		51,008,058.82	32,419,218.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	888,453.76	590,427.56
债券利息收入		46,345,542.99	29,439,317.03
资产支持证券利息收入		3,388,163.44	2,316,239.64
买入返售金融资产收入		385,898.63	73,234.60
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		40,067,132.38	72,975,252.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	31,385,591.55	59,569,528.37
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,212,000.99	11,402,894.91
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	219,917.27	-
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	1,249,622.57	2,002,829.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-13,928,060.00	-4,535,833.33

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	137,688.41	87,089.70
减：二、费用		38,701,443.01	22,026,364.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,575,222.50	4,545,799.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,858,407.50	1,515,266.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	133,805.54	161,957.56
4. 交易费用	6.4.7.19	18,461,211.02	10,477,702.61
5. 利息支出		8,395,700.91	5,101,475.10
其中：卖出回购金融资产支出		8,395,700.91	5,101,475.10
6. 税金及附加		146,572.48	101,686.17
7. 其他费用	6.4.7.20	130,523.06	122,476.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,583,376.60	78,919,363.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,583,376.60	78,919,363.77

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华信用增利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）	1,531,126,243.62	546,313,262.16	2,077,439,505.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,583,376.60	38,583,376.60
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）	207,305,928.39	108,126,036.36	315,431,964.75
其中：1. 基金申购款	937,530,470.33	343,426,853.07	1,280,957,323.40
2. 基金赎回款	-730,224,541.94	-235,300,816.71	-965,525,358.65
四、本期向基金	-	-110,231,689.02	-110,231,689.02

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）	1,738,432,172.01	582,790,986.10	2,321,223,158.11
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）	744,820,673.94	232,199,873.76	977,020,547.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	78,919,363.77	78,919,363.77
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）	835,894,760.79	280,537,831.97	1,116,432,592.76
其中：1. 基金申购款	959,281,979.64	324,318,707.84	1,283,600,687.48
2. 基金赎回款	-123,387,218.85	-43,780,875.87	-167,168,094.72
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）	-	-135,259,953.78	-135,259,953.78
五、期末所有者权益（基金净值）	1,580,715,434.73	456,397,115.72	2,037,112,550.45

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

鹏华信用增利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]478号《关于核准鹏华信用增利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《鹏华信用增利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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,170,993,030.42元,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136号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华信用增利债券型证券投资基金基金合同》于2010年5月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,171,614,892.66份基金份额,其中认购资金利息折合621,862.24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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《鹏华信用增利债券型证券投资基金基金合同》和《鹏华信用增利债券型证券投资基金招募说明书》,本基金自募集期起根据认购、申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用而不计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为B类基金份额。本基金A类、B类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和B类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华信用增利债券型证券投资基金基金合同》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,同时投资于股票、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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%;其中对金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券等非国家信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的80%;股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的20%;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%,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》、《鹏华信用增利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	17,284,790.60
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	17,284,790.60

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	454,004,766.93	468,275,742.29	14,270,975.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	1,506,507,157.65	1,507,924,106.36	1,416,948.71
	银行间市场	730,941,778.98	726,709,800.00	-4,231,978.98
	合计	2,237,448,936.63	2,234,633,906.36	-2,815,030.27
资产支持证券		135,000,000.00	135,000,000.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,826,453,703.56	2,837,909,648.65	11,455,945.09

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

注：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

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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	3,549.53
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	46,207.89
应收债券利息	37,228,232.91
应收资产支持证券利息	2,659,940.83
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	607.95
合计	39,938,539.11

6.4.7.6 其他资产

注：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	4,857,359.96
银行间市场应付交易费用	9,223.49
合计	4,866,583.45

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	65.68
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,138.35
合计	104,204.03

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华信用增利债券 A

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	1,474,040,292.45	1,474,040,292.45
本期申购	931,927,172.37	931,927,172.37
本期赎回 (以“-”号填列)	-689,848,987.09	-689,848,987.09
-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	1,716,118,477.73	1,716,118,477.73

鹏华信用增利债券 B

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	57,085,951.17	57,085,951.17
本期申购	5,603,297.96	5,603,297.96
本期赎回 (以“-”号填列)	-40,375,554.85	-40,375,554.85
-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	22,313,694.28	22,313,694.28

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

鹏华信用增利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	213,531,540.31	306,844,764.81	520,376,305.12
本期利润	51,707,311.31	-13,399,061.95	38,308,249.36
本期基金份额交易产生的变动数	66,538,427.14	55,305,656.39	121,844,083.53
其中：基金申购款	149,659,138.83	191,311,930.87	340,971,069.70
基金赎回款	-83,120,711.69	-136,006,274.48	-219,126,986.17
本期已分配利润	-107,320,870.30	-	-107,320,870.30
本期末	224,456,408.46	348,751,359.25	573,207,767.71

鹏华信用增利债券 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,018,513.67	11,918,443.37	25,936,957.04
本期利润	804,125.29	-528,998.05	275,127.24
本期基金份额交易产生的变动数	-6,868,080.24	-6,849,966.93	-13,718,047.17
其中：基金申购款	1,331,333.56	1,124,449.81	2,455,783.37
基金赎回款	-8,199,413.80	-7,974,416.74	-16,173,830.54
本期已分配利润	-2,910,818.72	-	-2,910,818.72
本期末	5,043,740.00	4,539,478.39	9,583,218.39

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	193,372.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	627,390.32
其他	67,690.63
合计	888,453.76

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	31,385,591.55
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	31,385,591.55

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	6,131,429,941.57
减：卖出股票成本总额	6,100,044,350.02
买卖股票差价收入	31,385,591.55

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：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	7,212,000.99
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	7,212,000.99

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	2,023,032,592.25
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,985,122,984.88
减：应收利息总额	30,697,606.38
买卖债券差价收入	7,212,000.99

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	79,066,342.19
减：卖出资产支持证券成本总额	76,967,799.99
减：应收利息总额	1,878,624.93
资产支持证券投资收益	219,917.27

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

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：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

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,249,622.57
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,249,622.57

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	-13,928,060.00
股票投资	-22,186,039.97
债券投资	8,257,979.97
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	-13,928,060.00

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	130,084.21
基金转换费收入	7,604.20
合计	137,688.41

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	18,443,486.02
银行间市场交易费用	17,725.00
合计	18,461,211.02

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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	7,934.71
账户维护费	17,850.00
其他	600.00
合计	130,523.06

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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。

6.4.10 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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	12,306,699,970.39	100.00	7,026,063,570.74	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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	
	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	1,698,600,971.03	100.00	1,614,924,844.44	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	84,504,750,000.00	100.00	57,478,911,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	11,215,085.38	100.00	4,857,359.96	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	6,402,852.93	100.00	3,033,629.96	100.00

注：（1）佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买（卖）成交金额×佣金比率-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和约定的佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

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 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管理费	8,575,222.50	4,545,799.68
其中：支付销售机构的客户维护费	237,806.13	130,864.95

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0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷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	2,858,407.50	1,515,266.56

注：支付基金托管人交通银行的托管费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华信用增利债券 A	鹏华信用增利债券 B	合计
国信证券	-	10.06	10.06
交通银行	-	6,427.68	6,427.68
鹏华基金公司	-	53,440.89	53,440.89
合计	-	59,878.63	59,878.63
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	鹏华信用增利债券 A	鹏华信用增利债券 B	合计
国信证券	-	37.09	37.09
交通银行	-	7,071.93	7,071.93
鹏华基金公司	-	127,312.72	127,312.72
合计	-	134,421.74	134,421.74

注：鹏华信用增利债券 A 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华信用增利债券 B 基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.40%÷当年天数。

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

注：无。

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

注：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

注：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自有资金投资本基金的情况

注：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

注：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
交通银行	17,284,790.60	193,372.81	14,059,220.91	114,869.83

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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

鹏华信用增利债券 A								
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16日	-	2021年3月16日	0.470	56,362,005.44	50,958,864.86	107,320,870.30	-
合计	-	-	-	0.470	56,362,005.44	50,958,864.86	107,320,870.30	-
鹏华信用增利债券 B								
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16日	-	2021年3月16日	0.520	2,673,635.65	237,183.07	2,910,818.72	-

合计	-	-	-	0.520	2,673,635.65	237,183.07	2,910,818.72	-
----	---	---	---	-------	--------------	------------	--------------	---

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

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

无。

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 682,000,000.00 元，于 2021 年 07 月 07 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

注：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。本基金投资的金融工具主要包括债券投资和少部分的股票投资。

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，将风险控制可在承受的范围之内。

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交通银行股份有限公司，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	34,171,400.00	29,846,000.00
A-1 以下	146,591,300.00	-
未评级	118,577,929.90	116,159,165.10
合计	299,340,629.90	146,005,165.10

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

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	-	74,967,799.99
未评级	-	-
合计	-	74,967,799.99

注：A-1 以下包含发行期限小于 1 年的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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	1,599,982,739.20	1,262,611,034.90
AAA 以下	335,310,537.26	322,142,491.58
未评级	-	250,550,100.00
合计	1,935,293,276.46	1,835,303,626.48

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

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	135,000,000.00	107,000,000.00
AAA 以下	-	30,000,000.00
未评级	-	-
合计	135,000,000.00	137,000,000.00

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：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、组合在短时间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 682,000,000.00 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

注：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票不得超过该上市公司可流通股票的 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 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,284,790.60	-	-	-	17,284,790.60
结算备付金	114,093,724.41	-	-	-	114,093,724.41
存出保证金	1,501,028.49	-	-	-	1,501,028.49
交易性金融资产	1,096,235,329.90	1,162,259,978.73	111,138,597.73	468,275,742.29	2,837,909,648.65

应收利息	-	-	-	39,938,539.11	39,938,539.11
应收申购款	-	-	-	41,606.32	41,606.32
应收证券清算款	-	-	-	51,793,025.72	51,793,025.72
资产总计	1,229,114,873.40	1,162,259,978.73	111,138,597.73	560,048,913.44	3,062,562,363.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	150,157.50	150,157.50
应付管理人报酬	-	-	-	1,264,354.58	1,264,354.58
应付托管费	-	-	-	421,451.51	421,451.51
应付证券清算款	-	-	-	52,196,481.79	52,196,481.79
卖出回购金融资产款	682,000,000.00	-	-	-	682,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	11,477.00	11,477.00
应付交易费用	-	-	-	4,866,583.45	4,866,583.45
应交税费	-	-	-	324,495.33	324,495.33
其他负债	-	-	-	104,204.03	104,204.03
负债总计	682,000,000.00	-	-	59,339,205.19	741,339,205.19
利率敏感度缺口	547,114,873.40	1,162,259,978.73	111,138,597.73	500,709,708.25	2,321,223,158.11
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	11,356,978.78	-	-	-	11,356,978.78
结算备付金	68,428,839.99	-	-	-	68,428,839.99
存出保证金	1,521,884.80	-	-	-	1,521,884.80
交易性金融资产	937,507,865.09	1,085,215,657.41	170,553,069.07	415,236,103.46	2,608,512,695.03
买入返售金融资产	7,900,000.00	-	-	-	7,900,000.00
应收利息	-	-	-	25,357,739.78	25,357,739.78
应收申购款	-	-	-	468,235.41	468,235.41
应收证券清算款	-	-	-	93,616,354.16	93,616,354.16
资产总计	1,026,715,568.66	1,085,215,657.41	170,553,069.07	534,678,432.81	2,817,162,727.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	58,771.57	58,771.57
应付管理人报酬	-	-	-	1,083,229.53	1,083,229.53
应付托管费	-	-	-	361,076.52	361,076.52
应付证券清算款	-	-	-	94,780,681.58	94,780,681.58
卖出回购金融资产款	638,000,000.00	-	-	-	638,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	28,059.92	28,059.92
应付交易费用	-	-	-	5,047,767.21	5,047,767.21
应付利息	-	-	-	-231,841.90	-231,841.90
应交税费	-	-	-	385,433.62	385,433.62
其他负债	-	-	-	210,044.12	210,044.12
负债总计	638,000,000.00	-	-	101,723,222.17	739,723,222.17
利率敏感度缺口	388,715,568.66	1,085,215,657.41	170,553,069.07	432,955,210.64	2,077,439,505.78

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	5,559,515.26	10,444,934.47
	市场利率上升 25 个基点	-5,523,303.33	-10,248,292.49

注：无。

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。

本基金投资于债券等固定收益类品种的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类品种的比例为基金资产的 0~20%，投资于可转换公司债券的比例不超过基金资产净值的 30%。

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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	468,275,742.29	20.17	415,236,103.46	19.99
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	254,796,876.46	10.98	150,252,826.48	7.23
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	723,072,618.75	31.15	565,488,929.94	27.22

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
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	业绩比较基准上升 5%	24,734,116.64	22,444,765.31
	业绩比较基准下降 5%	-24,734,116.64	-22,444,765.31

注：无。

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	468,275,742.29	15.29
	其中：股票	468,275,742.29	15.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,369,633,906.36	77.37
	其中：债券	2,234,633,906.36	72.97
	资产支持证券	135,000,000.00	4.41
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	131,378,515.01	4.29
8	其他各项资产	93,274,199.64	3.05
9	合计	3,062,562,363.30	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,640,791.44	0.20
B	采矿业	4,200.66	0.00
C	制造业	336,979,116.74	14.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,440,546.16	0.41
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,809.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	5,483,115.13	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,869,298.73	0.64
J	金融业	84,412,982.60	3.64
K	房地产业	2,381.00	0.00

L	租赁和商务服务业	434,377.33	0.02
M	科学研究和技术服务业	4,497,319.60	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	2,754,504.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,719,050.40	0.20
R	文化、体育和娱乐业	16,249.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	468,275,742.29	20.17

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	646,100	35,012,159.00	1.51
2	300750	宁德时代	49,823	26,645,340.40	1.15
3	688169	石头科技	19,428	24,498,708.00	1.06
4	000001	平安银行	840,100	19,003,062.00	0.82
5	600519	贵州茅台	7,914	16,276,723.80	0.70
6	603806	福斯特	135,040	14,196,755.20	0.61
7	601009	南京银行	1,321,700	13,904,284.00	0.60
8	002511	中顺洁柔	500,925	13,800,483.75	0.59
9	002008	大族激光	313,103	12,646,230.17	0.54
10	688029	南微医学	39,171	12,209,208.99	0.53
11	603345	安井食品	47,500	12,065,950.00	0.52
12	000858	五粮液	38,400	11,438,976.00	0.49
13	002271	东方雨虹	206,203	11,407,149.96	0.49
14	300894	火星人	163,800	11,138,400.00	0.48
15	600309	万华化学	87,600	9,532,632.00	0.41
16	600900	长江电力	457,300	9,438,672.00	0.41
17	002142	宁波银行	238,700	9,302,139.00	0.40
18	002475	立讯精密	196,116	9,021,336.00	0.39
19	002304	洋河股份	43,400	8,992,480.00	0.39
20	300014	亿纬锂能	79,944	8,308,579.92	0.36
21	000799	酒鬼酒	28,016	7,160,889.60	0.31
22	300059	东方财富	217,152	7,120,414.08	0.31
23	603317	天味食品	224,198	6,598,147.14	0.28
24	688518	联赢激光	347,246	6,517,807.42	0.28
25	600406	国电南瑞	237,600	5,521,824.00	0.24

26	002352	顺丰控股	80,600	5,456,620.00	0.24
27	300777	中简科技	119,200	5,385,456.00	0.23
28	300207	欣旺达	157,100	5,115,176.00	0.22
29	300601	康泰生物	33,700	5,021,300.00	0.22
30	002311	海大集团	61,418	5,011,708.80	0.22
31	300408	三环集团	118,100	5,009,802.00	0.22
32	002600	领益智造	525,600	4,830,264.00	0.21
33	002459	晶澳科技	97,700	4,787,300.00	0.21
34	601012	隆基股份	53,480	4,751,163.20	0.20
35	002299	圣农发展	194,338	4,640,791.44	0.20
36	688696	极米科技	5,547	4,615,104.00	0.20
37	002414	高德红外	149,740	4,129,829.20	0.18
38	000661	长春高新	10,000	3,870,000.00	0.17
39	002179	中航光电	44,400	3,508,488.00	0.15
40	603259	药明康德	22,040	3,451,243.60	0.15
41	600703	三安光电	89,400	2,865,270.00	0.12
42	000888	峨眉山 A	428,700	2,747,967.00	0.12
43	002049	紫光国微	17,200	2,652,068.00	0.11
44	300009	安科生物	177,900	2,650,710.00	0.11
45	002007	华兰生物	71,500	2,622,620.00	0.11
46	600161	天坛生物	73,640	2,522,170.00	0.11
47	300015	爱尔眼科	35,065	2,488,913.70	0.11
48	603027	千禾味业	94,280	2,478,621.20	0.11
49	603659	璞泰来	18,100	2,472,460.00	0.11
50	300957	贝泰妮	8,700	2,363,703.00	0.10
51	300782	卓胜微	4,118	2,213,425.00	0.10
52	300866	安克创新	13,200	2,210,604.00	0.10
53	600872	中炬高新	51,500	2,164,030.00	0.09
54	300496	中科创达	12,421	1,950,842.26	0.08
55	300682	朗新科技	109,500	1,841,790.00	0.08
56	300369	绿盟科技	115,300	1,839,035.00	0.08
57	600436	片仔癀	3,800	1,703,540.00	0.07
58	300595	欧普康视	15,820	1,638,161.00	0.07
59	600763	通策医疗	3,900	1,602,900.00	0.07
60	300888	稳健医疗	12,900	1,594,698.00	0.07
61	688005	容百科技	12,802	1,551,602.40	0.07
62	002568	百润股份	16,000	1,516,640.00	0.07
63	002555	三七互娱	61,255	1,471,345.10	0.06
64	600399	抚顺特钢	79,999	1,451,181.86	0.06
65	603486	科沃斯	5,900	1,345,672.00	0.06
66	002594	比亚迪	5,200	1,305,200.00	0.06
67	600570	恒生电子	13,772	1,284,239.00	0.06

68	603986	兆易创新	6,600	1,240,140.00	0.05
69	300274	阳光电源	10,700	1,231,142.00	0.05
70	002985	北摩高科	11,800	1,150,500.00	0.05
71	300919	中伟股份	6,600	1,075,800.00	0.05
72	300395	菲利华	19,828	956,106.16	0.04
73	603444	吉比特	1,700	901,000.00	0.04
74	605089	味知香	9,855	857,582.10	0.04
75	300558	贝达药业	7,000	757,680.00	0.03
76	300861	美畅股份	8,700	733,497.00	0.03
77	600893	航发动力	12,300	654,237.00	0.03
78	603185	上机数控	3,500	626,325.00	0.03
79	300012	华测检测	19,200	612,096.00	0.03
80	002223	鱼跃医疗	15,900	606,267.00	0.03
81	300463	迈克生物	14,400	606,096.00	0.03
82	300285	国瓷材料	10,913	532,008.75	0.02
83	300776	帝尔激光	3,500	522,760.00	0.02
84	688526	科前生物	13,936	504,761.92	0.02
85	300298	三诺生物	15,400	482,328.00	0.02
86	003022	联泓新科	15,700	481,990.00	0.02
87	300759	康龙化成	2,000	433,980.00	0.02
88	601888	中国中免	1,400	420,140.00	0.02
89	688390	固德威	1,249	417,166.00	0.02
90	603501	韦尔股份	1,200	386,400.00	0.02
91	300628	亿联网络	4,600	385,480.00	0.02
92	300363	博腾股份	4,400	370,128.00	0.02
93	300529	健帆生物	4,100	354,076.00	0.02
94	300760	迈瑞医疗	707	339,395.35	0.01
95	002044	美年健康	35,270	321,309.70	0.01
96	688516	奥特维	2,165	320,420.00	0.01
97	002241	歌尔股份	7,398	316,190.52	0.01
98	300347	泰格医药	1,500	289,950.00	0.01
99	300122	智飞生物	1,500	280,095.00	0.01
100	002821	凯莱英	700	260,820.00	0.01
101	000893	亚钾国际	15,524	259,250.80	0.01
102	688050	爱博医疗	684	258,401.52	0.01
103	000012	南玻 A	24,610	252,006.40	0.01
104	603313	梦百合	7,800	234,390.00	0.01
105	603218	日月股份	8,600	232,888.00	0.01
106	300910	瑞丰新材	2,200	230,010.00	0.01
107	688116	天奈科技	1,442	170,156.00	0.01
108	600426	华鲁恒升	5,417	167,656.15	0.01
109	300896	爱美客	100	78,888.00	0.00

110	002028	思源电气	2,500	76,975.00	0.00
111	688063	派能科技	368	72,422.40	0.00
112	601318	中国平安	889	57,144.92	0.00
113	002709	天赐材料	500	53,290.00	0.00
114	300630	普利制药	1,000	52,400.00	0.00
115	601100	恒立液压	600	51,552.00	0.00
116	600809	山西汾酒	100	44,800.00	0.00
117	300674	宇信科技	1,761	32,913.09	0.00
118	300763	锦浪科技	170	30,702.00	0.00
119	300390	天华超净	500	24,015.00	0.00
120	002460	赣锋锂业	155	18,768.95	0.00
121	300568	星源材质	421	17,416.77	0.00
122	002439	启明星辰	586	16,999.86	0.00
123	603882	金域医学	100	15,977.00	0.00
124	002129	中环股份	400	15,440.00	0.00
125	603179	新泉股份	468	15,387.84	0.00
126	002507	涪陵榨菜	400	15,064.00	0.00
127	000887	中鼎股份	1,228	14,834.24	0.00
128	603883	老百姓	280	14,750.40	0.00
129	002027	分众传媒	1,513	14,237.33	0.00
130	603893	瑞芯微	100	13,946.00	0.00
131	002158	汉钟精机	500	13,425.00	0.00
132	002705	新宝股份	500	13,125.00	0.00
133	603516	淳中科技	560	11,928.00	0.00
134	300724	捷佳伟创	100	11,601.00	0.00
135	300124	汇川技术	150	11,139.00	0.00
136	600029	南方航空	1,800	10,836.00	0.00
137	603713	密尔克卫	100	10,798.00	0.00
138	002531	天顺风能	1,240	10,726.00	0.00
139	601222	林洋能源	1,264	10,478.56	0.00
140	605288	凯迪股份	100	10,448.00	0.00
141	603601	再升科技	900	10,413.00	0.00
142	603103	横店影视	700	10,304.00	0.00
143	002508	老板电器	208	9,672.00	0.00
144	300394	天孚通信	360	9,115.20	0.00
145	601658	邮储银行	1,800	9,036.00	0.00
146	300457	赢合科技	450	8,937.00	0.00
147	603496	恒为科技	593	8,829.77	0.00
148	300196	长海股份	500	8,580.00	0.00
149	300308	中际旭创	200	7,704.00	0.00
150	603583	捷昌驱动	140	7,086.80	0.00
151	300726	宏达电子	100	7,049.00	0.00

152	300316	晶盛机电	139	7,019.50	0.00
153	002597	金禾实业	200	6,940.00	0.00
154	300253	卫宁健康	426	6,931.02	0.00
155	002838	道恩股份	380	6,741.20	0.00
156	600690	海尔智家	256	6,632.96	0.00
157	603214	爱婴室	280	6,585.60	0.00
158	600323	瀚蓝环境	300	6,537.00	0.00
159	002616	长青集团	870	6,264.00	0.00
160	000400	许继电气	485	6,140.10	0.00
161	300567	精测电子	100	6,140.00	0.00
162	002202	金风科技	500	6,080.00	0.00
163	300251	光线传媒	550	5,945.50	0.00
164	603338	浙江鼎力	100	5,869.00	0.00
165	002648	卫星石化	140	5,486.60	0.00
166	002612	朗姿股份	100	5,402.00	0.00
167	603983	丸美股份	100	5,211.00	0.00
168	600019	宝钢股份	680	5,195.20	0.00
169	300034	钢研高纳	156	5,024.76	0.00
170	600009	上海机场	101	4,861.13	0.00
171	603679	华体科技	282	4,816.56	0.00
172	300584	海辰药业	240	4,725.60	0.00
173	688002	睿创微纳	46	4,592.18	0.00
174	600438	通威股份	100	4,327.00	0.00
175	300577	开润股份	200	4,286.00	0.00
176	600887	伊利股份	100	3,683.00	0.00
177	600867	通化东宝	300	3,582.00	0.00
178	688036	传音控股	16	3,352.00	0.00
179	601162	天风证券	650	3,159.00	0.00
180	600984	建设机械	293	3,138.03	0.00
181	603993	洛阳钼业	600	3,096.00	0.00
182	002463	沪电股份	200	3,094.00	0.00
183	000636	风华高科	100	3,022.00	0.00
184	002050	三花智控	114	2,733.72	0.00
185	300079	数码视讯	353	2,718.10	0.00
186	002815	崇达技术	200	2,496.00	0.00
187	002156	通富微电	100	2,404.00	0.00
188	000002	万科 A	100	2,381.00	0.00
189	002851	麦格米特	74	2,311.02	0.00
190	600104	上汽集团	100	2,197.00	0.00
191	600674	川投能源	152	1,874.16	0.00
192	002643	万润股份	100	1,778.00	0.00
193	603158	腾龙股份	140	1,638.00	0.00

194	601555	东吴证券	190	1,584.60	0.00
195	600845	宝信软件	26	1,323.40	0.00
196	601899	紫金矿业	114	1,104.66	0.00
197	600556	天下秀	100	1,056.00	0.00
198	601933	永辉超市	100	473.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	216,154,388.72	10.40
2	002493	荣盛石化	200,204,268.84	9.64
3	601166	兴业银行	177,868,272.49	8.56
4	600519	贵州茅台	176,799,366.52	8.51
5	601012	隆基股份	167,362,104.28	8.06
6	600036	招商银行	162,202,757.16	7.81
7	601601	中国太保	145,757,218.59	7.02
8	300014	亿纬锂能	130,894,266.76	6.30
9	600486	扬农化工	125,835,789.28	6.06
10	002044	美年健康	108,388,165.18	5.22
11	002352	顺丰控股	107,570,832.62	5.18
12	600660	福耀玻璃	101,056,161.72	4.86
13	600702	舍得酒业	94,585,252.00	4.55
14	600893	航发动力	91,872,934.78	4.42
15	603313	梦百合	88,930,370.21	4.28
16	688029	南微医学	79,496,760.35	3.83
17	002624	完美世界	79,408,587.74	3.82
18	000012	南玻 A	79,073,110.25	3.81
19	601658	邮储银行	78,880,243.43	3.80
20	002555	三七互娱	75,505,633.44	3.63
21	000001	平安银行	74,399,902.73	3.58
22	002271	东方雨虹	70,376,765.63	3.39
23	300059	东方财富	69,931,702.94	3.37
24	300750	宁德时代	69,581,181.57	3.35
25	603218	日月股份	67,677,840.99	3.26
26	600309	万华化学	64,426,110.36	3.10
27	300274	阳光电源	64,218,872.00	3.09
28	600399	抚顺特钢	63,010,635.00	3.03
29	000547	航天发展	62,871,735.10	3.03
30	002304	洋河股份	60,384,802.20	2.91
31	000893	亚钾国际	56,922,185.48	2.74
32	601888	中国中免	54,552,240.86	2.63

33	603259	药明康德	53,315,633.32	2.57
34	600763	通策医疗	52,926,481.67	2.55
35	000333	美的集团	51,808,208.98	2.49
36	300601	康泰生物	47,719,588.44	2.30
37	002475	立讯精密	46,851,716.80	2.26
38	603806	福斯特	46,435,503.26	2.24
39	600426	华鲁恒升	45,803,378.75	2.20
40	601899	紫金矿业	45,790,278.00	2.20
41	600176	中国巨石	44,122,266.34	2.12
42	002798	帝欧家居	42,564,796.70	2.05
43	300015	爱尔眼科	41,799,581.22	2.01
44	300759	康龙化成	41,588,731.07	2.00

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	230,494,628.31	11.10
2	002493	荣盛石化	190,058,392.07	9.15
3	601601	中国太保	178,956,176.70	8.61
4	601166	兴业银行	176,800,199.36	8.51
5	601012	隆基股份	171,244,938.53	8.24
6	600519	贵州茅台	153,267,993.87	7.38
7	300014	亿纬锂能	152,232,074.93	7.33
8	600036	招商银行	128,886,906.20	6.20
9	600702	舍得酒业	120,390,105.83	5.80
10	600486	扬农化工	118,545,295.71	5.71
11	002044	美年健康	106,564,803.81	5.13
12	600893	航发动力	102,915,449.27	4.95
13	600660	福耀玻璃	99,667,301.96	4.80
14	002352	顺丰控股	97,838,001.36	4.71
15	000012	南玻 A	95,060,196.38	4.58
16	603313	梦百合	83,900,734.19	4.04
17	002624	完美世界	82,060,325.56	3.95
18	601658	邮储银行	76,811,455.78	3.70
19	688029	南微医学	76,391,716.51	3.68
20	300274	阳光电源	74,773,140.68	3.60
21	002555	三七互娱	73,257,748.50	3.53
22	601888	中国中免	67,879,058.63	3.27
23	300059	东方财富	67,550,163.09	3.25
24	600399	抚顺特钢	66,547,896.57	3.20
25	603218	日月股份	64,683,159.40	3.11

26	000547	航天发展	59,974,392.28	2.89
27	002271	东方雨虹	59,607,764.57	2.87
28	000893	亚钾国际	59,566,070.39	2.87
29	603259	药明康德	59,486,531.18	2.86
30	600309	万华化学	58,559,402.44	2.82
31	601899	紫金矿业	56,042,512.88	2.70
32	000001	平安银行	53,276,583.61	2.56
33	300750	宁德时代	52,050,811.40	2.51
34	000333	美的集团	50,859,928.40	2.45
35	600031	三一重工	50,053,648.36	2.41
36	600763	通策医疗	49,505,121.45	2.38
37	603799	华友钴业	49,263,844.71	2.37
38	603678	火炬电子	48,677,193.85	2.34
39	002304	洋河股份	46,573,351.56	2.24
40	002049	紫光国微	46,035,574.30	2.22
41	300253	卫宁健康	43,805,692.86	2.11
42	600426	华鲁恒升	42,988,584.86	2.07
43	600176	中国巨石	42,223,836.08	2.03
44	601398	工商银行	41,624,076.00	2.00

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,175,270,028.82
卖出股票收入（成交）总额	6,131,429,941.57

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	118,577,929.90	5.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	261,801,000.00	11.28
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	936,984,300.00	40.37
5	企业短期融资券	180,762,700.00	7.79
6	中期票据	481,711,100.00	20.75
7	可转债（可交换债）	254,796,876.46	10.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,234,633,906.36	96.27

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	132018	G 三峡 EB1	1,314,070	157,846,088.40	6.80
2	019640	20 国债 10	1,006,560	100,656,000.00	4.34
3	163470	20 华能 Y3	700,000	69,629,000.00	3.00
4	101801121	18 中建四局 MTN001	600,000	60,912,000.00	2.62
5	012100697	21 渝保税 SCP001	600,000	60,234,000.00	2.59

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	137104	中借 04A	470,000	47,000,000.00	2.02
2	169041	滇中优 1	300,000	30,000,000.00	1.29
3	169231	建借 3A	300,000	30,000,000.00	1.29
4	137172	世武 01	280,000	28,000,000.00	1.21

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

注：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

注：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

注：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**

招商证券股份有限公司

2021 年 5 月 26 日，中国人民银行深圳市中心支行针对招商证券股份有限公司的以下行为：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，对招商证券股

份有限公司处以罚款人民币 173 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	1,501,028.49
2	应收证券清算款	51,793,025.72
3	应收股利	-
4	应收利息	39,938,539.11
5	应收申购款	41,606.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,274,199.64

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132018	G 三峡 EB1	157,846,088.40	6.80
2	113044	大秦转债	39,089,334.40	1.68
3	113601	塞力转债	14,566,018.50	0.63
4	123086	海兰转债	12,532,809.60	0.54
5	123082	北陆转债	5,166,108.15	0.22
6	128076	金轮转债	4,170,289.53	0.18
7	113603	东缆转债	2,451,860.00	0.11
8	128071	合兴转债	1,805,900.80	0.08
9	123083	朗新转债	255,569.60	0.01

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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

份额级别	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(%)
鹏华信用增利债券 A	3,572	480,436.30	1,671,165,680.77	97.38	44,952,796.96	2.62
鹏华信用增利债券 B	949	23,512.85	8,002,540.79	35.86	14,311,153.49	64.14
合计	4,521	384,523.82	1,679,168,221.56	96.59	59,263,950.45	3.41

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	鹏华信用增利债券 A	23,751.81	0.0014
	鹏华信用增利债券 B	1,575.73	0.0071
	合计	25,327.54	0.0015

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	鹏华信用增利债券 A	-
	鹏华信用增利债券 B	-

	合计	-
本基金基金经理持有 本开放式基金	鹏华信用增利债券 A	0~10
	鹏华信用增利债券 B	-
	合计	0~10

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额。

2、截至本报告期末，本基金的基金经理投资、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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华信用增利债券 A	鹏华信用增利债券 B
基金合同生效日 (2010年5月31日) 基金份额总额	960,810,918.16	1,210,803,974.50
本报告期期初基金份 额总额	1,474,040,292.45	57,085,951.17
本报告期基金总申购 份额	931,927,172.37	5,603,297.96
减：本报告期基金总 赎回份额	689,848,987.09	40,375,554.85
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	1,716,118,477.73	22,313,694.28

§ 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。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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	
国信证券	2	12,306,699,970.39	100.00%	11,215,085.38	100.00%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	本报告期新增

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
国信证券	1,698,600,971.03	100.00%	84,504,750,000.00	100.00%	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

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中国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	《上海证券报》、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长城华西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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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
4	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	《上海证券报》、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

	费率优惠活动的公告		
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、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
6	鹏华信用增利债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	《上海证券报》、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
7	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、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
8	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、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
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商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	《上海证券报》、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 02 日
10	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、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
11	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	《上海证券报》、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
12	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	《上海证券报》、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
13	鹏华信用增利债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、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 10 日
14	鹏华基金管理有限公司关于鹏华信用增利债券型证券投资基金 2021 年第 1 次分红公告	《上海证券报》、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 13 日
15	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	《上海证券报》、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
16	鹏华信用增利债券型证券投资基金 2020 年年度报告	《上海证券报》、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
17	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	《上海证券报》、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
18	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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2021 年 03 月 30 日

	基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告	基金电子披露网站	
19	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申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、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
20	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	《上海证券报》、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
21	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、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
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、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 13 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天风证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、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 16 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商银行股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、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 17 日
25	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	《上海证券报》、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
26	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	《上海证券报》、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
27	鹏华信用增利债券型证券投资基金 2021 年 1 季度报告	《上海证券报》、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
28	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	《上海证券报》、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
29	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	《上海证券报》、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
30	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2021 年 04 月 26 日

		基金电子披露网站	
31	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	《上海证券报》、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
32	鹏华信用增利债券型证券投资基金更新的招募说明书	《上海证券报》、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
33	鹏华信用增利债券型证券投资基金（A 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、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
34	鹏华信用增利债券型证券投资基金（B 类基金份额）基金产品资料概要（更新）	《上海证券报》、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
35	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	《上海证券报》、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
36	鹏华信用增利债券型证券投资基金基金合同	《上海证券报》、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
37	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	《上海证券报》、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
38	鹏华信用增利债券型证券投资基金托管协议	《上海证券报》、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
39	鹏华信用增利债券型证券投资基金更新的招募说明书（2021 年第 1 号）	《上海证券报》、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
40	鹏华信用增利债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、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 03 日
41	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、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

注：无。

§ 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	20210101~20210114, 20210517~20210630	413,940,924.40	14,972,466.87	-	428,913,391.27	24.67
	2	20210107~20210208, 20210427~20210630	78,508,859.36	381,224,336.80	-	459,733,196.16	26.45
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)《鹏华信用增利债券型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华信用增利债券型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华信用增利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。

鹏华基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日