

鹏华丰登债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：杭州银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华丰登债券
基金主代码	007681
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 8 月 14 日
报告期末基金份额总额	2,688,979,487.30 份
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,力争获得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、货币、税收、汇率政策等)来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向,在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 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、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略。(1)久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素,本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。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。(2)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一

	<p>个重要依据,本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配,即通过对收益率曲线形状变化的预测,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。(3) 骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略,以达到增强组合的持有期收益的目的。该策略是指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,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。(4) 息差策略 本基金将采用息差策略,以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。该策略是指在回购利率低于债券收益率的情形下,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。(5) 个券选择策略 本基金将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。(6) 信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价。本基金主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响,相应地采用以下两种投资策略: 1) 信用利差曲线变化策略: 首先分析经济周期和相关市场变化情况,其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势,最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势,确定本基金信用债分行业投资比例。 2) 信用变化策略: 信用债信用等级发生变化后,本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。 本基金将根据内、外部信用评级结果,结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。 3、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。 4、国债期货投资策略 本基金根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现委托财产的长期稳定增值。</p>
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	杭州银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	27,434,772.90
2. 本期利润	28,577,589.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0106
4. 期末基金资产净值	2,784,406,178.98
5. 期末基金份额净值	1.0355

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。

3.2 基金净值表现

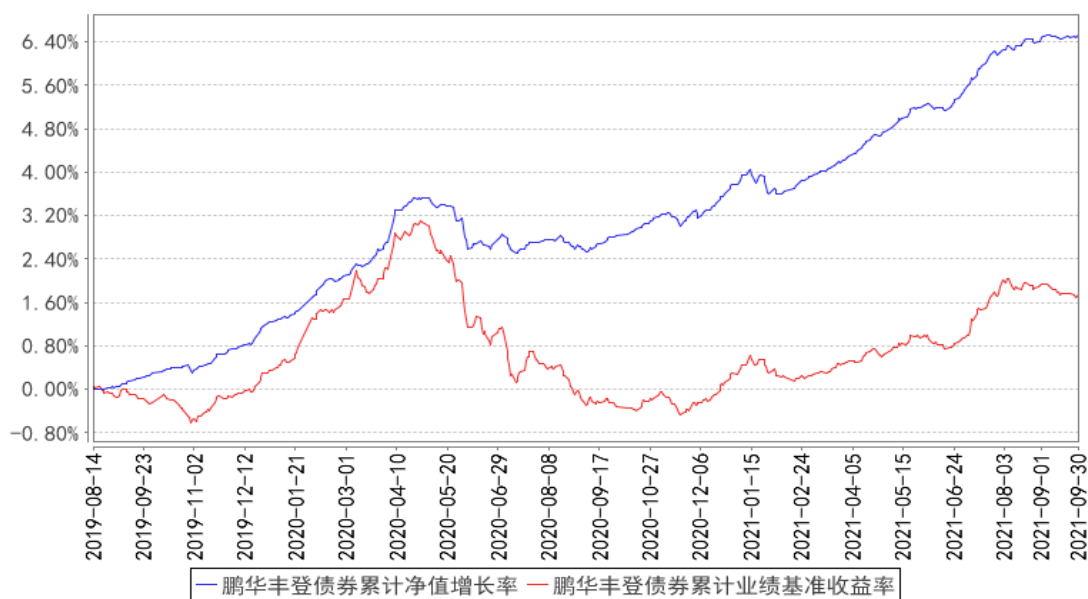
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.03%	0.03%	0.79%	0.05%	0.24%	-0.02%
过去六个月	2.19%	0.03%	1.23%	0.04%	0.96%	-0.01%
过去一年	3.61%	0.03%	2.04%	0.04%	1.57%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	6.53%	0.04%	1.73%	0.07%	4.80%	-0.03%

注：业绩比较基准=中债综合全价（总值）指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华丰登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 2019 年 08 月 14 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张丽娟	基金经理	2021-04-16	-	10 年	张丽娟女士，国籍中国，金融学硕士，10 年证券从业经验。2011 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任营销策划部营销策划助理、高级营销策划经理，2015 年 6 月任职于固定收益部，历任研究员、高级研究员从事研究分析工作，现担任债券投资一部基金经理。2020 年 02 月至 2021 年 04 月担任鹏华丰华债券型证券投资基金基金经理，2020 年 02 月至今担任鹏华丰瑞债券型证券投资基金基金经理，2020 年 02 月至今担任鹏华纯债债券型证券投资基金基金经理，2020 年 02 月至今担任鹏华丰腾债券型证券投资基金基金经理，2020 年 08 月至 2021 年 09 月担任鹏华招华一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2020 年 11 月至今担任鹏华丰

					<p>颐债券型证券投资基金基金经理, 2021 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, 2021 年 03 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, 2021 年 04 月至今担任鹏华丰登债券型证券投资基金基金经理, 张丽娟女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

7 月份以来，在疫情、汛情等因素影响之下，工业生产、固定资产投资和消费增速持续回落，经济短期下行压力有所加大。7 月初央行全面降准，在政策宽松的预期下债市收益率快速下行；8 月至 9 月，市场在“宽货币”与“宽信用”博弈中窄幅震荡。流动性方面，随着 8 月政府债券供

给增加，大量 MLF 到期，银行超储率处于低位，资金面波动增大，资金利率小幅抬升，短端利率出现上行。报告期内 10 年期国债收益率下行 20BP，10 年期国开债收益率下行 29BP；信用债收益率在 7 月份大幅下行后，8 月以来受资管新规过渡期银行理财整改的影响收益率出现上行，报告期内 3 年期 AAA、AA+ 中票收益率分别下行 22BP、23BP，3 年、5 年期品种信用利差、期限利差明显走扩。

报告期内组合整体维持中性偏长的久期水平，类属方面以利率债及中高等级信用债为主，并保持一定杠杆操作，取得了良好的收益回报。

4.5 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 1.03%，同期业绩比较基准增长率为 0.79%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,436,708,000.00	98.28
	其中：债券	3,436,708,000.00	98.28
	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	16,632,742.36	0.48
8	其他资产	43,380,556.25	1.24
9	合计	3,496,721,298.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

无。

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,560,000.00	0.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,109,351,000.00	111.67
	其中：政策性金融债	977,845,000.00	35.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,147,000.00	1.08
6	中期票据	92,230,000.00	3.31
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	194,420,000.00	6.98
9	其他	-	-
10	合计	3,436,708,000.00	123.43

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	2128012	21 浦发银行 01	2,100,000	213,297,000.00	7.66
2	2120071	21 上海银行	2,000,000	200,060,000.00	7.19
3	200303	20 进出 03	2,000,000	198,680,000.00	7.14
4	2028030	20 兴业银行 小微债 05	1,800,000	181,980,000.00	6.54
5	2028028	20 华夏银行 小微债 01	1,800,000	181,134,000.00	6.51

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

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

国家开发银行

国家开发银行旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会大连监管局、陕西监管局、浙江监管局、国家外汇管理局广西壮族自治区分局、海南省分局和中国人民银行南宁中心支行的行政处罚。

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。

兴业银行股份有限公司

兴业银行股份有限公司在报告期内受到中国人民银行的行政处罚。

兴业银行股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会湖北监管局、新疆监管局、湖北监管局、江苏监管局、陕西监管局、天津监管局、青岛监管局、北京监管局、福建监管局、内蒙古监管局、宜昌监管分局、马鞍山监管分局、驻马店监管分局、泰州监管分局、南充监管分局、国家税务总局奇台县税务局和国家外汇管理局黑龙江省分局、福建省分局、北海市中心支局的行政处罚。

2020 年 7 月 17 日，中国人民银行上海分行对兴业银行股份有限公司上海分行 1. 未执行金融统计制度，错报统计数据，2. 未按规定报备人民币结算账户开户资料，3. 国库经收业务未使用规定科目核算，4. 未按照规定履行客户身份识别义务，5. 发布引人误解的营销宣传信息的违法违规行为，给予警告，并罚款 123.5 万元。

2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司 1. 为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2. 为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3. 违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4. 违反银行卡收单外包管理规定；5. 未按规定履行客户身份识别义务的违法违规行为，给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司福州分行允许外包服务机构以特约商户名义入网并接收其发送的银行卡交易信息的违法违规行为，给予警告，没收违

法所得 34.38 元，处 50 万元罚款。

2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规行为，没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。

2021 年 7 月 21 日，国家外汇管理局福建省分局针对兴业银行股份有限公司的以下违规行为 1. 违规办理内保外贷业务 2. 未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料 3. 违反外汇市场交易管理规定 4. 未按规定保存交易通讯记录 5. 违规办理银行卡业务，对公司责令改正、给予警告、没收违法所得和罚款合计 300.10537 万元人民币、责令对相关责任人进行处分。

2021 年 8 月 13 日，中国人民银行针对兴业银行股份有限公司违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违规行为，对公司处以罚款 5 万元。

中国工商银行股份有限公司

中国工商银行股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会天津监管局、上海监管局、云南监管局、宁夏监管局、江西监管局、重庆监管局、安徽监管局、吉林监管局、陕西监管局、承德监管分局、潍坊监管分局、邯郸监管分局、九江监管分局、韶关监管分局、西双版纳监管分局、包头监管分局、阜阳监管分局、吉林监管分局、鄂州监管分局、咸阳监管分局、本溪监管分局、鞍山监管分局、红河监管分局、孝感监管分局、菏泽监管分局、宿州监管分局、长治监管分局、昭通监管分局、滨州监管分局、包头监管分局、金华监管分局、呼伦贝尔监管分局、兴安监管分局、衢州监管分局、上饶监管分局、金华监管分局、涪陵监管分局、濮阳监管分局、驻马店监管分局、六安监管分局、松原监管分局、克拉玛依监管分局、双鸭山监管分局、荆门监管分局、白城监管分局、景德镇监管分局、枣庄监管分局、孝感监管分局、铜川监管分局、新余监管分局、国家税务总局湖南郴州经济开发区税务局、泸溪县税务局、喀什地区税务局、安仁县税务局、疏附县税务局、国家外汇管理局安徽省分局、云南省分局、深圳市分局、天津市分局、漳州市中心支局、淮安市中心支局、乐清市支局、临海市支局、衢州市中心支局、焦作市中心支局、廊坊市中心支局、宿迁市中心支局和中国人民银行西安分行、广州分行、成都分行、天津分行、石家庄中心支行、聊城市中心支行、淄博市中心支行、合肥中心支行、菏泽市中心支行、济宁市中心支行、长沙中心支行、华蓥市支行、滨州市中心支行、青岛市中心支行和四川省财政局的行政处罚。

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如下的违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第三十三条、第四十六

条和相关审慎经营规则，对公司做出行政处罚决定：罚款 5470 万元。

主要违法行为：

- 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

中国农业银行股份有限公司

中国农业银行股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会安徽监管局、上海监管局、西藏监管局、云南监管局、浙江监管局、北京监管局、山东监管局、辽宁监管局、新疆监管局、青海监管局、贵州监管局、迪庆监管分局、包头监管分局、保山监管分局、南平监管分局、吐鲁番监管分局、中卫监管分局、阜阳监管分局、东营监管分局、丽江监管分局、

扬州监管分局、德州监管分局、芜湖监管分局、临沂监管分局、宿州监管分局、嘉兴监管分局、石河子监管分局、伊犁监管分局、孝感监管分局、防城监管分局、苏州监管分局、无锡监管分局、呼伦贝尔监管分局、安康监管分局、濮阳监管分局、青岛监管分局、运城监管分局、吉林监管分局、泉州监管分局、佛山监管分局、牡丹江监管分局、吴忠监管分局、黄山监管分局、三亚监管分局、咸阳监管分局、新余监管分局、国家税务总局安徽省税务局、淮南市毛集社会发展综合实验区税务局、宜春市税务局第一税务分局、长丰县税务局、永兴县税务局、六安市叶集区税务局、衡阳市石鼓区税务局第二税务所、国家外汇管理局青海省分局、甘肃省分局、江西省分局、黑龙江省分局、新疆维吾尔自治区分局、深圳市分局、重庆外汇管理部、绍兴市中心支局、金华市中心支局、呼伦贝尔市中心支局、大庆市中心支局、锡林郭勒盟中心支局、巴彦淖尔市中心支局、乌海市中心支局、阿拉善盟中心支局、金昌市中心支局、丽水市中心支局、宿迁市中心支局、常州市中心支局和中国人民银行太原中心支行、深圳市中心支行、东营市中心支行、南昌中心支行、绵阳市中心支行、海口中心支行、蚌埠市中心支行、亳州市中心支行、吉林市中心支行、泸州市中心支行的行政处罚。

2021 年 1 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国农业银行股份有限公司的如下的违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第五项和相关审慎经营规则，对公司做出行政处罚决定：罚款 420 万元。

主要违法行为：

- （一）发生重要信息系统突发事件未报告
- （二）制卡数据违规明文留存
- （三）生产网络、分行无线互联网络保护不当
- （四）数据安全较粗放，存在数据泄露风险
- （五）网络信息系统存在较多漏洞
- （六）互联网门户网站泄露敏感信息

招商银行股份有限公司

2021 年 5 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司：

- 一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产
- 二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品
- 三、理财产品之间风险隔离不到位
- 四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准

- 五、同业投资接受第三方金融机构信用担保
 - 六、理财资金池化运作
 - 七、利用理财产品准备金调节收益
 - 八、高净值客户认定不审慎
 - 九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛
 - 十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准
 - 十一、投资集合资金信托计划人数超限
 - 十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品
 - 十三、信贷资产非真实转让
 - 十四、全权委托业务不规范
 - 十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务
 - 十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权
 - 十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失
 - 十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯
 - 十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目
 - 二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保
 - 二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目
 - 二十二、理财资金认购商业银行增发的股票
 - 二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产
 - 二十四、为定制公募基金提供投资顾问
 - 二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持
 - 二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券
 - 二十七、瞒报案件信息
- 以上违法违规行为，对公司罚款 7170 万元。

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。

2021 年 8 月 13 日，中国人民银行针对华夏银行股份有限公司违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违规行为，对公司处以罚款 486 万元。

中国建设银行

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国建设银行股份有限公司的以下违法违规行为（一）内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件，（二）理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资，（三）逆流程

开展业务操作，（四）本行理财产品之间风险隔离不到位，（五）未做到理财业务与自营业务风险隔离，（六）个人理财资金违规投资，（七）违规为理财产品提供隐性担保，（八）同业投资违规接受担保，对公司处以罚款合计 3920 万元。

2021 年 8 月 13 日，中国人民银行针对中国建设银行股份有限公司占压财政存款或者资金，违反账户管理规定的违规行为，对公司给予警告，并处罚款 388 万元。

上海浦东发展银行股份有限公司

2021 年 4 月 23 日，上海银保监局针对上海浦东发展银行股份有限公司的如下的违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中国银监会关于规范商业银行代理销售业务的通知》（银监发〔2016〕24 号）（三十九），对公司做出行政处罚决定：责令改正，并处罚款共计 760 万元。

主要违法行为：2016 年 5 月至 2019 年 1 月，该行未按规定开展代销业务

2021 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会针对上海浦东发展银行股份有限公司的如下的违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对公司做出行政处罚决定：罚款 6920 万元。

主要违法行为：

- 一、监管发现的问题屡查屡犯
- 二、配合现场检查不力
- 三、内部控制制度修订不及时
- 四、信息系统管控有效性不足
- 五、未向监管部门真实反映业务数据
- 六、净值型理财产品估值方法使用不准确
- 七、未严格执行理财投资合作机构名单制管理
- 八、理财产品相互交易调节收益
- 九、使用理财资金偿还本行贷款
- 十、理财产品发行审批管理不到位
- 十一、权益类理财产品投资非权益类资产超比例
- 十二、公募理财产品持有单只证券市值超比例
- 十三、投资集合资金信托计划人数超限
- 十四、面向非机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券
- 十五、出具与事实不符的理财产品投资清单

- 十六、私募理财产品销售文件未约定投资者冷静期
- 十七、投资者投资私募理财产品金额不符合监管要求
- 十八、理财产品资产配置与产品说明书约定不符
- 十九、理财产品信息披露不合规
- 二十、理财产品信息登记不规范
- 二十一、理财业务流动性风险管理不审慎
- 二十二、理财投资股票类业务管理不审慎
- 二十三、同业存款记入其他企业存款核算
- 二十四、同业投资投后检查流于形式
- 二十五、风险加权资产计量不准确
- 二十六、为无衍生品交易资格的机构发行结构性存款提供通道
- 二十七、结构性存款未实际嵌入金融衍生品
- 二十八、未落实委托贷款专户管理要求
- 二十九、借助通道违规发放委托贷款，承担实质性风险
- 三十、委托贷款投向不合规
- 三十一、违规向委托贷款借款人收取手续费

上海银行股份有限公司

2021 年 4 月 23 日，上海银保监局针对上海银行股份有限公司的如下的违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（四）项，对公司做出行政处罚决定：责令改正，并处罚款 30 万元

主要违法行为：未按照规定进行信息披露

2020 年 11 月 18 日，中国银行保险监督管理委员会针对上海银行股份有限公司的如下的违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中国银行业监督管理委员会关于印发银行业金融机构绩效考评监管指引的通知》（银监发〔2012〕34 号）第三十二条、《商业银行稳健薪酬监管指引》（银监发〔2010〕14 号）第二十五条，对公司做出行政处罚决定：责令改正，并处罚款共计 80 万元。

主要违法行为：

1. 2014 年至 2018 年，该行绩效考评管理严重违反审慎经营规则。
2. 2018 年，该行未按规定延期支付 2017 年度绩效薪酬。

2021 年 7 月 2 日，上海银保监局针对上海银行股份有限公司的如下的违法违规行为，依据《中

《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中华人民共和国商业银行法》第七十四条第（三），《个人贷款管理暂行办法》第四十二条第（八）项，对公司做出行政处罚决定：责令改正，并处罚款共计 460 万元。

主要违法行为：

1. 2018 年 12 月，该行某笔同业投资房地产企业合规审查严重违反审慎经营规则。
2. 2019 年 11 月，该行某笔经营性物业贷款授信后管理严重违反审慎经营规则。
3. 2019 年 2 月至 4 月，该行部分个人贷款违规用于购房。
4. 2020 年 5 月至 7 月，该行对部分个人住房贷款借款人偿债能力审查不审慎。
5. 2020 年 7 月，该行在助贷环节对第三方机构收费管理严重违反审慎经营规则。6. 2020 年 6 月至 12 月，该行部分业务以贷收费。

中国进出口银行

中国进出口银行旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会天津监管局、新疆监管局、海南监管局、福建监管局的行政处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,961.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,371,594.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,380,556.25

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,688,979,566.22
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	78.92
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,688,979,487.30

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210701~20210930	2,688,974,205.76	-	-	2,688,974,205.76	100.00
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华丰登债券型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华丰登债券型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华丰登债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告》（原文）。

9.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

9.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2021 年 10 月 26 日