

# 鹏华丰登债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 1 月 21 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 2022 年 01 月 20 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 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 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	2,688,979,417.37 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。(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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	24,403,832.72
2. 本期利润	26,154,419.36
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0097
4. 期末基金资产净值	2,810,560,525.76
5. 期末基金份额净值	1.0452

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等未实现收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

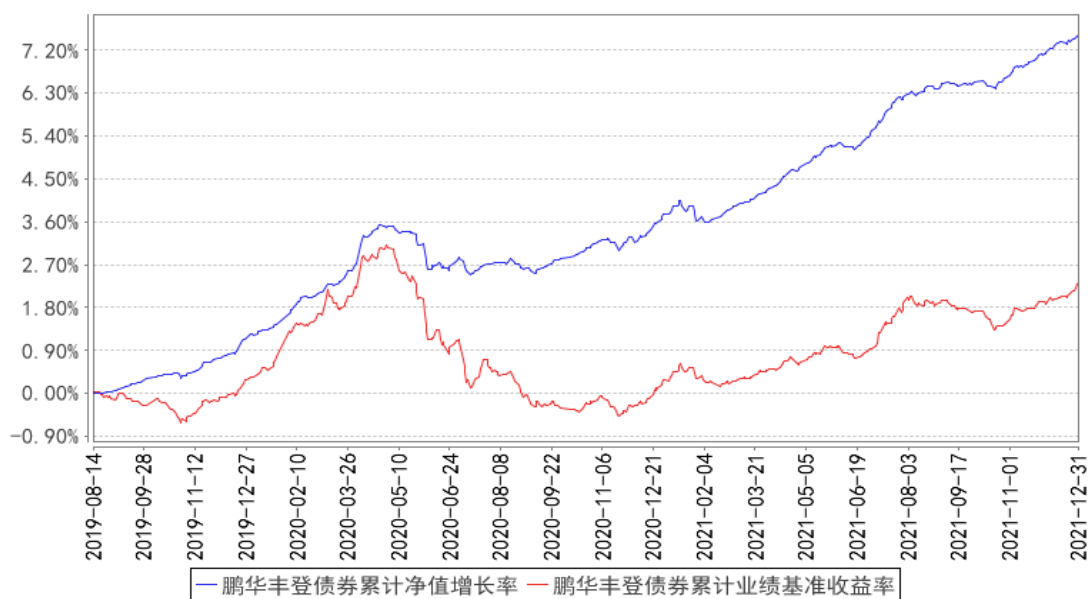
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.94%	0.03%	0.58%	0.05%	0.36%	-0.02%
过去六个月	1.98%	0.03%	1.38%	0.05%	0.60%	-0.02%
过去一年	3.62%	0.03%	2.01%	0.04%	1.61%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	7.53%	0.04%	2.32%	0.06%	5.21%	-0.02%

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

报告期内，国内经济延续走弱趋势，10 月中上旬国内外大宗商品价格暴涨推动 PPI 快速上行，滞涨预期发酵，债券收益率出现明显上行；10 月中旬以来随着煤炭限价保供政策出台，动力煤等大宗商品价格下跌，通胀担忧有所缓解，债券收益率明显下行。11 月央行货币执行报告删除“不

搞大水漫灌”、“总闸门”等表述，货币政策整体维持宽松态势，市场做多情绪较浓，债券收益率小幅下行。12月央行再次全面降准，中央经济工作会议指出“国内经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力”，明确“稳字当头，稳中求进”的政策基调，市场在降准降息的预期下收益率震荡下行，期间10年期国债收益率突破2.8%。报告期内10年期国债收益率下行10BP，10年期国开债收益率下行11BP；信用债表现好于利率债，报告期内3年期AAA、AA+中票收益率分别下行28BP、23BP，3年期品种信用利差、期限利差明显压缩。

报告期内组合整体维持中性的久期水平，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0.94%，同期业绩比较基准增长率为0.58%。

#### 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	2,741,976,000.00	97.52
	其中：债券	2,741,976,000.00	97.52
	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	30,845,613.96	1.10
8	其他资产	38,837,229.13	1.38
9	合计	2,811,658,843.09	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。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,618,794,000.00	93.18
	其中：政策性金融债	331,705,000.00	11.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	123,182,000.00	4.38
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,741,976,000.00	97.56

## 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	2,700,000	275,427,000.00	9.80
2	2120071	21 上海银行	2,700,000	271,674,000.00	9.67
3	2028030	20 兴业银行 小微债 05	2,500,000	253,300,000.00	9.01
4	2021008	20 重庆农商 债	2,500,000	251,425,000.00	8.95
5	2028028	20 华夏银行 小微债 01	1,800,000	181,620,000.00	6.46

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

2021 年 3 月 3 日，国家外汇管理局海南省分局针对国家开发银行海南省分行擅自提供对外担保的违法违规行为，对其给予警告并处罚款 4266.16 万元。

华夏银行股份有限公司

2021 年 05 月 17 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，对公司罚款 9830 万元。

2021 年 08 月 13 日，中国人民银行针对华夏银行股份有限公司的违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违法违规行为，对公司罚款 486 万元。

交通银行股份有限公司

2021 年 1 月 11 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对交通银行股份有限公司私人银行部代理销售业务管理严重违反审慎经营规则的违法违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项责令改正，并处罚款人民币 50 万元。

2021 年 8 月 13 日，中国人民银行针对其违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定。罚款 62 万元。

2021 年 10 月 20 日，国家外汇管理局上海市分局针对其主要违法行为：未按规定办理内存外贷业务，未按规定办理服务贸易项下海运费支出业务，未经登记办理外国投资者投资资金汇出业务，违规办理个人境内银行卡境外年度超额提现，违规向非居民销售外汇理财产品，违反外汇市场交易管理规定，未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料，违反外汇账户管理规定，依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十三条、《中华人民共和国外汇管理条例》第四十七条，责令改正，给予警告，处罚款 340 万元人民币，没收违法所得 823,166.01 元人民币。

2021 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会针对其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行政处罚决定罚款 4100 万元。

主要违法行为：

- 一、理财业务和同业业务制度不健全
- 二、理财业务数据与事实不符
- 三、部分理财业务发展与监管导向不符
- 四、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资
- 五、理财资金违规投向土地储备项目
- 六、理财产品相互交易调节收益

- 七、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
- 八、公募理财产品投资单只证券超限额
- 九、理财资金违规投向交易所上市交易的股票
- 十、理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位
- 十一、私募理财产品销售文件未约定冷静期
- 十二、开放式公募理财产品资产配置未达到流动性管理监管比例要求
- 十三、理财产品信息登记不及时
- 十四、理财产品信息披露不合规
- 十五、同业业务交易对手名单调整不及时
- 十六、将同业存款纳入一般性存款核算
- 十七、同业账户管理不规范
- 十八、违规增加政府性债务，且同业投资抵质押物风险管理有效性不足
- 十九、结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为
- 二十、未严格审查委托贷款资金来源
- 二十一、违规向委托贷款借款人收取手续费
- 二十二、利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表
- 二十三、监管检查发现问题屡查屡犯

#### 交通银行股份有限公司上海市分行

2021 年 10 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对其主要违法行为：转让不良资产严重违反审慎经营规则，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项做出行政处罚决定

责令改正，并处罚款 50 万元。

#### 上海浦东发展银行股份有限公司

2021 年 5 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心的主要违法违规事实：信用卡资金流向管控严重违反审慎经营规则，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项责令改正，并处罚款人民币 40 万元。

2021 年 10 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心的主要违法违规事实：2018 年 5 月至 2019 年 2 月，该中心信息安全和员工行为管理严重违反审慎经营规则，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项责令改正，并处罚款 50 万元。

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主要违法违规事实，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

2021 年 4 月 23 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对上海浦东发展银行股份有限公司的主要违法违规事实：2016 年 5 月至 2019 年 1 月，该行未按规定开展代销业务，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）责令改正，并处罚款共计 760 万元。

2021 年 11 月 15 日，国家外汇管理局上海市分局针对其的如下的违法违规行为，依据《中华人民共和国外汇管理条例》第四十八条第（二）项，责令改正，给予警告、处 6 万元人民币的罚款

主要违法行为：

银行卡境外交易信息报送错误。

上海银行股份有限公司

2021 年 11 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对上海银行股份有限公司的主要违法违规事实：未按规定报送统计报表，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条、《中华人民共和国商业银行法》第八十条、《银行业监管统计管理暂行办法》第三十六条，处罚款 20 万元。

2021 年 7 月 2 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对上海银行股份有限公司的主要违法违规事实：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，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、《中华人民共和国商业银行法》第七十四条第（三）项、《个人贷款管理暂行办法》第四十二条第（八）项责令改正，并处罚款 460 万元。

2021 年 4 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对上海银行股份有限公司的主要违法行为：未按照规定进行信息披露，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（四）项责令改正，并处罚款 30 万元。

#### 兴业银行股份有限公司

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法违规行为，对公司罚款 5 万元。

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 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的违法违规行为，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。

#### 招商银行股份有限公司

2021 年 5 月 17 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、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，处罚款 7170 万元。 主要违法行为： 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

2021 年 11 月 18 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行信用卡中心的主要违法违规事实：未按照保险公司提供的销售合同条款全面、客观揭示所代销保险产品风险，依据《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）第二十四条、《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条及第四十六条责令改正，并处罚款 20 万元。

#### 招商银行股份有限公司上海分行

2021 年 8 月 23 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司上海分行的主要违法违规事实：2020 年 7 月至 10 月，该分行及长阳支行部分个人贷款变相用于购房，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、《个人贷款管理暂行办法》第四十二条第（七）项责令改正，并处罚款 75 万元。

2021 年 7 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司上海分行的主要违法违规事实：2019 年 12 月，该分行部分流动资金贷款违规流入房地产市场，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、《流动资金贷款管理暂行办法》第三十九条第（四）项责令改正，并处罚款 100 万元。

#### 中信银行股份有限公司

2021 年 03 月 19 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，对公司罚款 450 万元。

2021 年 11 月 20 日，国家市场监督管理总局针对中信银行股份有限公司的以下违法行为：未依法申报违法实施的经营者集中；不具有排除、限制竞争的效果，对公司处以 50 万元罚款的行政处罚。

2021 年 02 月 05 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以下违法违规行为：（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，罚款 420 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。

### 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	14,989.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,822,239.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,837,229.13

### 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	2,688,979,487.30
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	69.93

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	2,688,979,417.37

## § 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	20211001~20211231	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 4 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

2022 年 1 月 21 日