

鹏华普悦债券型证券投资基金(原鹏华丰信分级债券型证券投资基金)2018年第2季度报告

2018年06月30日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2018年7月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 7 月 13 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。

本基金系原鹏华丰信分级债券型证券投资基金转型而来。鹏华丰信分级债券型证券投资基金份额持有人大会于 2018 年 4 月 11 日表决通过了《关于鹏华丰信分级债券型证券投资基金转型的议案》，鹏华基金管理有限公司决定对鹏华丰信分级债券型证券投资基金进行基金份额折算和变更登记，转型为鹏华普悦债券型证券投资基金，基金份额折算基准日为 2018 年 5 月 14 日。根据《关于鹏华丰信分级债券型证券投资基金转型的议案》、《鹏华丰信分级债券型证券投资基金份额折算和变更登记的提示性公告》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人上海银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金合同》、《鹏华丰信分级债券型证券投资基金托管协议》分别修订为《鹏华普悦债券型证券投资基金基金合同》、《鹏华普悦债券型证券投资基金托管协议》，并据此编制《鹏华普悦债券型证券投资基金招募说明书》。鹏华丰信分级债券型证券投资基金根据中国证监会《关于准予鹏华丰信分级债券型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2018]129 号）准予变更注册。《鹏华普悦债券型证券投资基金基金合同》、《鹏华普悦债券型证券投资基金托管协议》将自鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金份额折算基准日的次一工作日起生效。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原鹏华丰信分级债券型证券投资基金报告期自 2018 年 4 月 1 日至 2018 年 5 月 14 日止，鹏华普悦债券型证券投资基金基金报告期自 2018 年 5 月 15 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	鹏华普悦债券
场内简称	—
基金主代码	000291
前端交易代码	—
后端交易代码	—
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 05 月 15 日
报告期末基金份额总额	163,896,539.77 份
投资目标	通过对宏观经济和固定收益市场的研究分析，在严格控制风险的基础上采取积极主动的投资策略，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	基金管理人将采取积极的投资策略，寻找各种可能的价值增长机会，力争实现超越基准的投资收益。在大类资产配置方面，本基金通过对宏观经济形势及利率变化趋势的重点分析，结合对股票市场趋势的研判及新股申购收益率的预测，比较未来一定时间内债券市场和股票市场的相对预期收益率，在债券、股票一级市场及现金类资产之间进行动态调整。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、利差策略等积极投资策略，在追求本金长期安全的基础上，力争为投资人创造更高的总回报。
业绩比较基准	中债总指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，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	上海银行股份有限公司

注：无。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	鹏华丰信分级债券
场内简称	—
基金主代码	000291
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 10 月 22 日
报告期末基金份额总额	173,402,140.00 份
投资目标	通过对宏观经济和固定收益市场的研究分析，在严格控制风险的基础

	上采取积极主动的投资策略，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。	
投资策略	基金管理人将采取积极的投资策略，寻找各种可能的价值增长机会，力争实现超越基准的投资收益。在大类资产配置方面，本基金通过对宏观经济形势及利率变化趋势的重点分析，结合对股票市场趋势的研判及新股申购收益率的预测，比较未来一定时间内债券市场和股票市场的相对预期收益率，在债券、股票一级市场及现金类资产之间进行动态调整。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、利差策略等积极投资策略，在追求本金长期安全的基础上，力争为投资人创造更高的总回报。	
业绩比较基准	中债总指数收益率	
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，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	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏华丰信分级债券 A	鹏华丰信分级债券 B
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	000292	000293
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	13,775,722.78 份	159,626,417.22 份
下属分级基金的风险收益特征	丰信 A 份额表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额。	丰信 B 份额表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

注:无。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年05月15日 -2018年06月30日)
1. 本期已实现收益	-832,032.63
2. 本期利润	-5,394,805.13
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0314
4. 期末基金资产净值	158,819,270.88
5. 期末基金份额净值	0.9690

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年04月01日 -2018年05月14日)
1. 本期已实现收益	968,439.79
2. 本期利润	3,050,955.99
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0171
4. 期末基金资产净值	173,402,139.43
5. 期末基金份额净值	1.0000

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，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（转型后）

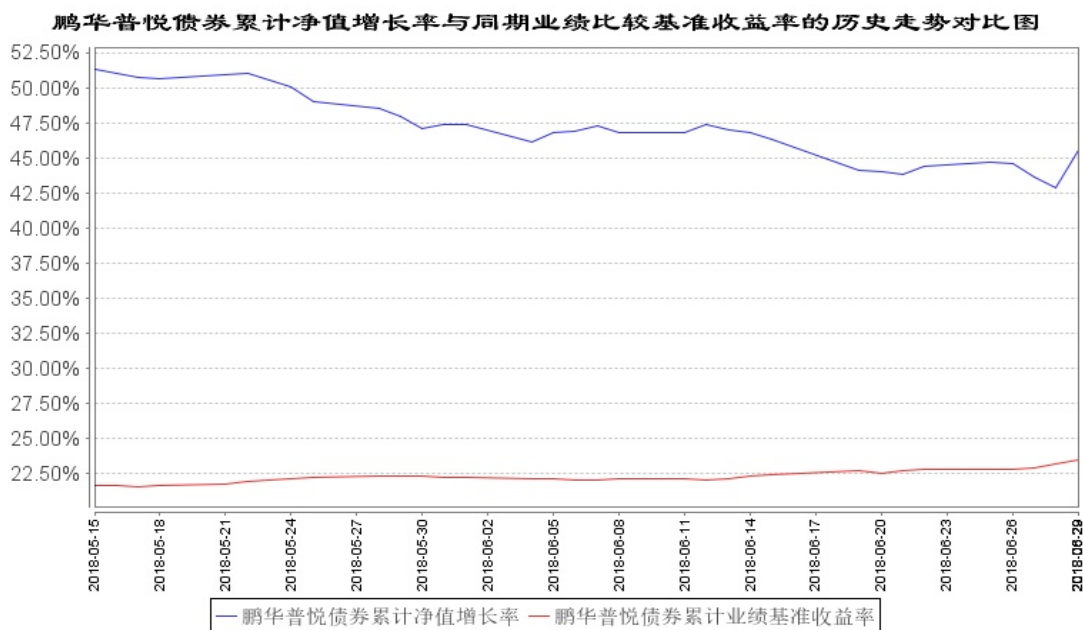
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	①—③	②—④
----	------	-------	-------	---------	-----	-----

	率①	标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去三个月	-3.10%	0.55%	1.45%	0.09%	-4.55%	0.46%

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



注：1、本基金基金合同于 2018 年 5 月 15 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。

3.2 基金净值表现（转型前）

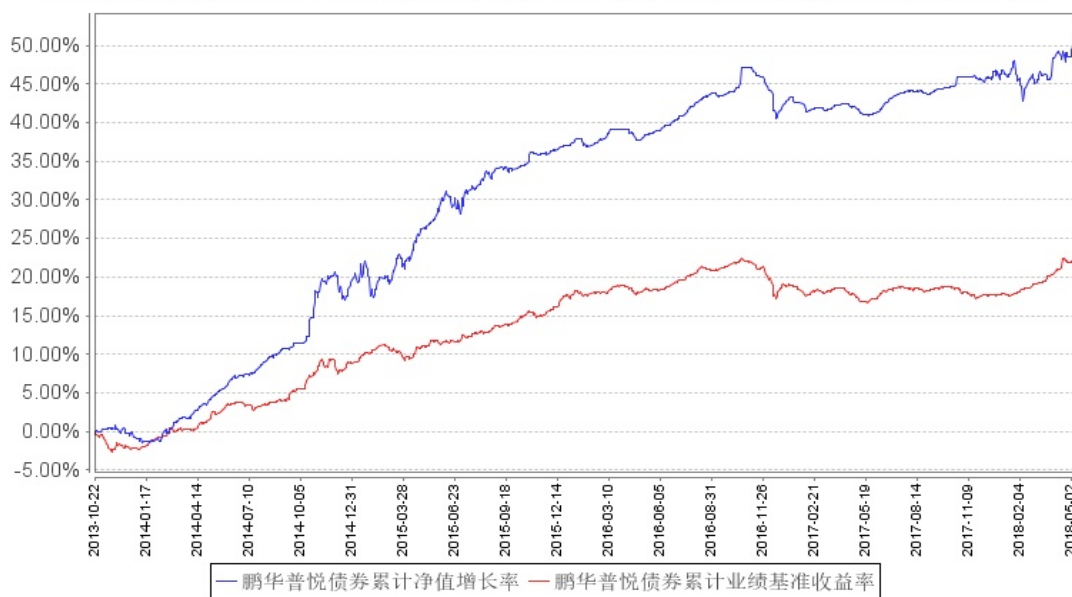
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.62%	0.35%	1.26%	0.21%	0.36%	0.14%

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

鹏华普悦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 2013 年 10 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

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戴钢	本基金基金经理	2013-10-22	-	16	戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，16 年证券从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部，担任研究员；2005 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任债券研究员、专户投资经理等职；

				<p>2011 年 12 月至 2016 年 02 月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理，</p> <p>2012 年 06 月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，</p> <p>2012 年 11 月至 2015 年 11 月担任鹏华中小企债基金基金经理，</p> <p>2013 年 09 月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理，</p> <p>2013 年 09 月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理，</p> <p>2013 年 10 月担任鹏华丰信分级债券基金基金经理，</p> <p>2015 年 11 月担任鹏华丰和基金基金经理，</p> <p>2016 年 03 月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理，</p> <p>2016 年 04 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，</p> <p>2016 年 09 月担任鹏华丰饶债券基金基金经理，现同时担任绝对收益投资部副总经理。戴钢先生</p>
--	--	--	--	---

					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 基金经理(或基金经理小组)简介(转型前)

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戴钢	本基金基金经理	2013-10-22	-	16	戴钢先生,国籍中国,经济学硕士,16年证券从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部,担任研究员;2005年9月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,历任债券研究员、专户投资经理等职;2011年12月至2016年02月担任鹏华丰泽债券(LOF)基金经理,2012年06月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理,2012年11月至2015年11月担任鹏华中小企债基金基金经理,

					<p>2013 年 09 月担任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理，</p> <p>2013 年 09 月担任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理，</p> <p>2013 年 10 月担任鹏华丰信分级债券基金基金经理，</p> <p>2015 年 11 月担任鹏华丰和基金基金经理，</p> <p>2016 年 03 月担任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理，</p> <p>2016 年 04 月担任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，</p> <p>2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰饶债券基金基金经理，</p> <p>现同时担任绝对收益投资部副总经理。戴钢先生具备基金从业资格。</p> <p>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。

4.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年二季度债券市场持续上涨，中债总财富指数上涨 2.73%。信用市场出现了连续的违约事件使得市场的信用开始整体收缩。社融增速持续下滑，而宏观指标也开始出现走弱，尤其是投资数据下滑明显。叠加中美贸易战的紧张氛围，市场开始对经济前景较为悲观。而此时的货币政策也开始转向。分别在 4 月和 6 月实施了两次降准。这无疑对债券市场形成了强力支持，呈现出牛市格局。而对于权益市场明显不利。二季度的权益市场整体下跌，沪深 300 下跌了 9.94%。

在组合的资产配置上，我们对债券资产仍然维持了信用债为主的投资策略。品种上以 3 年左右的高评级信用债为主。经过前期的下跌，我们认为权益市场已经具有明显配置价值，因此对加大了对权益资产的配置力度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2018 年二季度本基金的转型前、转型后净值增长率分别为 1.62%、-3.1%，同期业绩基准转型前、转型后增长率分别为 1.26%，1.45%。

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（转型后）

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	31,930,885.00	14.65
	其中：股票	31,930,885.00	14.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	165,397,517.04	75.88
	其中：债券	165,397,517.04	75.88
	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	6,886,432.17	3.16
8	其他资产	13,748,701.22	6.31
9	合计	217,963,535.43	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

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	2,884,578.00	1.82
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,740,683.00	14.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,200,384.00	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,105,240.00	1.96
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	31,930,885.00	20.11

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

5.3 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

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	002327	富安娜	551,900	5,982,596.00	3.77
2	002050	三花智控	258,400	4,870,840.00	3.07
3	600867	通化东宝	194,000	4,650,180.00	2.93
4	002024	苏宁易购	227,300	3,200,384.00	2.02
5	002044	美年健康	137,400	3,105,240.00	1.96
6	002234	民和股份	249,100	2,884,578.00	1.82
7	600771	广誉远	27,600	1,516,896.00	0.96
8	600196	复星医药	34,900	1,444,511.00	0.91
9	600673	东阳光科	138,000	1,425,540.00	0.90
10	300558	贝达药业	25,500	1,419,585.00	0.89

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	19,935,000.00	12.55
	其中：政策性金融债	10,003,000.00	6.30
4	企业债券	82,055,000.80	51.67
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	63,407,516.24	39.92
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	165,397,517.04	104.14

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	136140	16 富力 01	150,000	14,760,000.00	9.29
2	112548	17 兴森 01	150,000	14,676,000.00	9.24
3	110032	三一转债	117,730	14,450,180.20	9.10
4	113505	杭电转债	109,100	10,276,129.00	6.47
5	170410	17 农发 10	100,000	10,003,000.00	6.30

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

注:无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2

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	25,855.67
2	应收证券清算款	10,608,893.16
3	应收股利	-
4	应收利息	3,112,876.64
5	应收申购款	1,075.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,748,701.22

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110032	三一转债	14,450,180.20	9.10
2	123006	东财转债	9,621,600.00	6.06
3	113014	林洋转债	8,700,940.80	5.48
4	123002	国祯转债	6,096,497.40	3.84
5	128013	洪涛转债	29,365.80	0.02

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 5 投资组合报告（转型前）

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	212,450,750.75	91.51
	其中：债券	212,450,750.75	91.51
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,274,813.28	1.84

8	其他资产	15,429,196.81	6.65
9	合计	232,154,760.84	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沪港通投资股票投资组合

注:无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,936,000.00	11.50
	其中:政策性金融债	10,014,000.00	5.78
4	企业债券	112,203,987.50	64.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	80,310,763.25	46.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	212,450,750.75	122.52

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	136140	16 富力 01	150,000	14,853,000.00	8.57
2	112548	17 兴森 01	150,000	14,788,500.00	8.53
3	112044	11 中泰 01	145,000	14,646,450.00	8.45
4	110032	三一转债	117,730	14,363,060.00	8.28
5	113505	杭电转债	109,100	11,558,054.00	6.67

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

注:无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.9.1 本期国债期货投资政策**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注**5.10.1**

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2

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	29,448.12
2	应收证券清算款	11,700,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,699,748.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,429,196.81

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	---------	--------------

1	110032	三一转债	14,363,060.00	8.28
2	113014	林洋转债	10,015,145.40	5.78
3	128013	洪涛转债	30,919.60	0.02

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动 (转型后)

单位:份

基金合同生效日(2018年5月15日)持有的基金份额	173,402,140.00
报告期期间基金总申购份额	197,323.56
减:报告期期间基金总赎回份额	9,702,923.79
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	163,896,539.77

§ 6 开放式基金份额变动 (转型前)

单位:份

项目	鹏华丰信分级债券 A	鹏华丰信分级债券 B
报告期期初基金份额总额	14,326,530.91	166,663,021.16
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	885,994.02	12,976,427.86
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	335,185.89	5,939,823.92
报告期期末基金份额总额	13,775,722.78	159,626,417.22

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 (转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:无。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 (转型前)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）

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	-	20180515~20180630	0.00	91,104,033.59	0.00	91,104,033.59	55.59
个人	-	-	-	-	-	-	-
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、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投； 2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

鹏华丰信分级债券型证券投资基金份额持有人大会于 2018 年 4 月 11 日表决通过了《关于鹏华丰信分级债券型证券投资基金转型的议案》，鹏华基金管理有限公司决定对鹏华丰信分级债券型证券投资基金进行基金份额折算和变更登记，转型为鹏华普悦债券型证券投资基金，基金份额折算基准日为 2018 年 5 月 14 日。根据《关于鹏华丰信分级债券型证券投资基金转型的议案》、

《鹏华丰信分级债券型证券投资基金份额折算和变更登记的提示性公告》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人上海银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金合同》、《鹏华丰信分级债券型证券投资基金托管协议》分别修订为《鹏华普悦债券型证券投资基金基金合同》、《鹏华普悦债券型证券投资基金托管协议》，并据此编制《鹏华普悦债券型证券投资基金招募说明书》。鹏华丰信分级债券型证券投资基金根据中国证监会《关于准予鹏华丰信分级债券型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2018]129号）准予变更注册。《鹏华普悦债券型证券投资基金基金合同》、《鹏华普悦债券型证券投资基金托管协议》将自鹏华丰信分级债券型证券投资基金基金份额折算基准日的次一工作日起生效。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

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	20180401~20180515	87,713,981.19	0.00	87,713,981.19	0.00	0.00
个人	-	-	-	-	-	-	-
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、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投； 2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

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)《鹏华普悦债券型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华普悦债券型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华普悦债券型证券投资基金 2018 年第 2 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>）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

2018 年 7 月 18 日