鹏华丰登债券型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-06-30

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019-07-18

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。

本报告摘自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

项目	数据
基金简称	鹏华丰登债券
场内简称	-
基金主代码	161208
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011-01-06
报告期末基金份额总额	292,992,334.13
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过对经济形势和证券市场走向的精细研判，通过资金流动性管理和个券选择，力争每期超额业绩目标获得的收益。
投资策略	本基金投资策略主要采取大策略、同时配以定量分析的方法。具体策略包括：资金管理策略、资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、息差策略、债券品种策略、信用债策略、可转债策略、证券选择策略、中期票据策略、资产支持证券策略、股指期货策略、国债期货策略、股票投资策略、权证投资策略、股票增发策略、股票一级市场投资策略、股票二级市场投资策略、股票指数增强策略、股票期权策略、融资融券策略、股票质押回购策略、其他品种投资策略。
业绩比较基准	一年期定期存款利率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的长期风险和预期收益低于股票型基金，属于较低风险、较低预期收益品种。本基金可投资一定比例的可转债，可转债具有较高的风险，其预期收益高于债券型基金。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-04-01 至 2019-06-30）
本期已实现收益	3,100,389.50
本期利润	3,737,231.32
加权平均基金份额本期利润	0.0120
期末基金资产净值	351,195,191.70
期末基金份额净值	1.1985

注：1、本期已实现收益是指本期利息收入、投资收益、公允价值变动损益扣除本期应计入损益的费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

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：申购费、赎回费等）。计入费用后实际收益或净值会低于所列示数字。

基金净值表现

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	1.20 %	0.06 %	0.38 %	0.10 %	0.82 %	-0.04 %

注：业绩比较基准=一年期定期存款利率

过去自合同生效日本基金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2011年01月06日生效。

2、截至报告期末，本基金自合同成立日起已达到基金合同中规定的各项比例。

其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-04-01至2019-06-30）
其他指标	报告期（2019-04-01）

注：无。

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		
刘思钰	本基金基金经理	2017-02-22	-	5	刘思钰先生，硕士学位，5年证券从业经验。2012年5月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投研工作，投资经验较丰富的债券投研团队。2016年6月至今担任鹏华丰登债券基金基金经理；2016年9月至今担任鹏华增益债券基金基金经理；2016年9月至2018年6月担任鹏华丰利债券基金基金经理；2016年9月至2018年6月担任鹏华丰盛债券基金基金经理；2016年9月至2018年6月担任鹏华丰润债券基金基金经理；2017年02月至今担任鹏华丰登债券基金基金经理；2017年02月至2018年06月担任鹏华丰利债券基金基金经理；2017年02月至2018年06月担任鹏华丰盛债券基金基金经理；2017年02月至2018年06月担任鹏华丰润债券基金基金经理；2018年02月至今担任鹏华丰利债券基金基金经理；2018年06月至今担任鹏华丰盛债券基金基金经理；2018年06月至今担任鹏华丰润债券基金基金经理；2019年03月至今担任鹏华丰宁中短债基金基金经理。刘思钰先生具有证券从业资格，具有基金从业资格，其任职期间曾担任公募基金经理，其任职期间曾担任公募基金经理期间，其管理的公募基金投资业绩指标为：2017年02月至2018年06月鹏华丰利债券基金基金经理，2017年02月至2018年06月鹏华丰盛债券基金基金经理，2017年02月至2018年06月鹏华丰润债券基金基金经理，2018年02月至2018年06月鹏华丰利债券基金基金经理，2018年06月至2018年06月鹏华丰盛债券基金基金经理，2018年06月至2018年06月鹏华丰润债券基金基金经理，2019年03月至2019年06月鹏华丰宁中短债基金基金经理。

注：1、首期募集期或封闭期内担任该基金的基金经理的，任期日期为基金合同生效日。 2、证券从业年限是指从事证券相关业务的年限。

管理人对报告期内本基金运作遵守情况的说明

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及基金合同的约定。本报告期内，管理人在投资决策、投资交易、资产估值等环节的内控制度执行情况良好，不存在违反基金合同和侵害基金持有人利益的行为。

公平交易专项说明

公平交易制度执行情况

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。

异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违反法规及可能损害广大基金持有人利益的异常交易行为。本报告期内未发生整个投资组合日内反向交易或交易对手单笔交易量超过证券当日成交量的5%的情况。

报告期内基金投资策略和业绩表现说明

一季度债券市场震荡上涨，二季度经济复苏一季度经济数据偏弱预期更新增，债市震荡一度调整，经过反复的博弈再次走强，长期利率再创新低。

**在债券资产的配置上，通过主要指标为预期利率、长端利率和信用利差等指标的研究，在久期、收益率曲线、息差等方面进行积极的主动管理，在个券选择上，以信用风险为核心，通过内部信用评级体系的建设