

重要提示

基金管理人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。
基金管理人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年7月15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预示其未来表现，投资者有风险，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。
本报告中所载资料截止日为：
本报告自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes details like 基金名称 (鹏华丰泰定期开放债券), 基金代码 (900289), 基金运作方式 (契约开放式), 基金合同生效日 (2013-09-24), 报告期末基金份额总额 (655,210,347.32), 投资目标 (在有效控制风险的基础上...), 投资策略 (本基金债券投资主要采取久期策略...), 业绩比较基准 (一年定期存款基准利率+0.5%), 基金管理人 (鹏华基金管理有限公司), 基金托管人 (上海浦东发展银行股份有限公司), 下属级基金的名称 (鹏华丰泰A), 下属级基金的场内简称 (鹏华丰泰B), 下属级基金的交易代码 (900289), 报告期末下属级基金的份额总额 (551,669,138.14), 下属级基金的风险收益特征 (风险收益特征同上).

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 主基金(元), 鹏华丰泰A(元), 鹏华丰泰B(元). Includes 本期已实现收益 (4,027,723.12), 本期净利润 (4,150,437.68), 加权平均基金份额本期利润 (0.0073), 期末基金份额净值 (1.0668), 期末基金资产净值 (1,800).

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，开放式基金的申购费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平低于所列数字。

基金净值表现

Table with columns: 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③, 业绩比较基准收益标准差④, ①-③, ②-④. Includes 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, 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, 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.

注：1、本基金合同于2013年09月24日生效。2、截至建仓结束，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。



其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-04-01至2019-06-30), 本报告期 (2019-06-30). Includes 基金份额持有人户数 (Number of Shareholders).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Term as Fund Manager), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Includes 戴毅 (Dai Yi) as the fund manager.

注：1、任职日期和离任日期均以公司公告或中国证监会正式对外公告之日；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制度的相关规定。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，严格控制风险，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，本基金运作规范，不存在违反基金合同和投资管理有关法律法规的行为。

公平交易专项说明

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。

异常交易行为的专项说明
报告期内，本基金未发生法律法规规定可能对基金财产造成影响的异常交易行为。本基金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超过该证券当日成交量的5%的情况。

报告期内基金的业绩表现和运作分析

2019年二季度整体市场震荡，中债财富指数上涨0.38%，随着一季度宏观经济企稳，市场对政策调整的预期开始升温，货币政策边际上有所收紧的可能。此后四月政治局会议的定调，政策面微调的意图明显。这对债券市场形成了较大的冲击，债券市场出现了明显调整。不过进入5月，随着中央政治局的召开，经济形势企稳下行，叠加市场预期利率的持续下行，国内宽信用预期重新抬头。虽然期间仍发生了包商银行事件的冲击，但是随着央行可能的出手，6月资金面宽松超预期，受上述因素影响，债券市场收益率逐步下行。
在组合的配置上，我们对债券市场保持乐观，但担心市场的信用风险，因此在配置上以利率债为主，考虑到资金面的持续宽松，因此维持了一定的利率水平。

报告期内基金的业绩表现

2019年二季度丰泰A基金的净值增长率为0.71%，丰泰B基金的净值增长率为0.62%，同期鹏华丰泰定期开放债券A业绩比较基准增长0.50%，鹏华丰泰定期开放债券B业绩比较基准增长0.50%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

Table with columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Includes 权益类投资 (Equity Investment), 固定收益投资 (Fixed Income Investment), 贵金属投资 (Precious Metals Investment), 买入返售金融资产 (Repurchase Agreements), 银行存款和结算备付金合计 (Total Bank Deposits and Settlement Reserves), 其他资产 (Other Assets).

Table with columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 农、林、牧、渔业 (Agriculture, Forestry, Animal Husbandry, and Fishing), 采矿业 (Mining), 制造业 (Manufacturing), etc.

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 国家债券 (Government Bonds), 央行票据 (Central Bank Bills), 金融债券 (Financial Bonds), etc.

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousand), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metals Code), 贵金属名称 (Precious Metals Name), 数量 (克) (Quantity in Grams), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓数量 (元) (Quantity in Yuan), 公允价值变动 (元) (Change in Fair Value in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金未投资国债期货。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Quantity Buy/Sell), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Change in Fair Value in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

本基金投资国债期货的投资政策

本基金未投资国债期货。

投资组合报告附注

受调查以及处罚情况
本基金投资的前十名证券中本期没有发生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。

申明基金投资的前十名股票没有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约定的证券选择库。

Table with columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in Yuan). Includes 货币资金 (Cash), 应收证券清算款 (Receivable Securities Settlement), etc.

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

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。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 鹏华丰泰定期开放债券, 鹏华丰泰A, 鹏华丰泰B. Includes 报告期初基金份额总额, 报告期末基金份额总额, 报告期内基金份额变动, 报告期末基金份额总额.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目 (Item), 鹏华丰泰定期开放债券, 鹏华丰泰A, 鹏华丰泰B. Includes 报告期末基金管理人持有的本基金份额, 报告期末基金管理人持有的基金份额, 报告期末基金管理人持有的基金份额, 报告期末基金管理人持有的基金份额.

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
Table with columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易数量 (份) (Quantity in Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有份额总额, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额总额, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额承诺持有期限. Includes 基金管理人固有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金经理, 基金管理人基金事务部, 其他, 合计.

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

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval when Holding Share Proportion Reached or Exceeded 20%), 期初份额 (Beginning Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 报告期末持有基金份额 (Ending Shares), 份额占比 (Share Proportion). Includes 机构 (Institution), 个人 (Individual).

基金合同持有人的基金份额所占比例超过了集中时，可能会因单一基金份额持有人大额赎回引起基金份额净值波动，甚至可能引发基金流动性风险。基金管理人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费、基金转换费、场内买入份额、场内卖出份额和赎回费基金份额。
2、赎回份额包含基金赎回费、基金转换费、场内卖出份额和赎回费基金份额。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- (一)《鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金合同》；
(二)《鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
(三)《鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金2019年第三季度报告》（原文）。

存放地点

深圳市福田区福田三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司。

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。
投资者对本报告如有任何疑问，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热线，咨询电话：4006788899。