

鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF） 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

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

送出日期：2021 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 9 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 11 |
| § 5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 11 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 11 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 13 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 14 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| § 7 投资组合报告 | 37 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 37 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 37 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 38 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 38 |

| | | |
|-------------|-----------------------------------|-----------|
| 7.6 | 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 | 39 |
| 7.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 39 |
| 7.8 | 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贵金属投资明细 | 39 |
| 7.9 | 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 | 39 |
| 7.10 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 39 |
| 7.11 | 投资组合报告附注 | 40 |
| § 8 | 基金份额持有人信息 | 42 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 42 |
| 8.2 | 期末上市基金前十名持有人 | 42 |
| 8.3 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 43 |
| 8.4 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 43 |
| § 9 | 开放式基金份额变动 | 43 |
| § 10 | 重大事件揭示 | 43 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 43 |
| 10.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 43 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 44 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 44 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 44 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 44 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 44 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 47 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 50 |
| 11.1 | 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 | 50 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 50 |
| § 12 | 备查文件目录 | 50 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 50 |
| 12.2 | 存放地点 | 51 |
| 12.3 | 查阅方式 | 51 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|---------------------|
| 基金名称 | 鹏华丰利债券型证券投资基金 (LOF) |
| 基金简称 | 鹏华丰利债券 (LOF) |
| 场内简称 | 鹏华丰利 LOF |
| 基金主代码 | 160622 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 (LOF) |
| 基金合同生效日 | 2013 年 4 月 23 日 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,937,282,912.95 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2016 年 5 月 24 日 |

注：无。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金债券投资将主要采取久期策略，同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略，在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 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。 |

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|--------------------------------|-----------------------|
| 名称 | 鹏华基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张戈 |
| | 联系电话 | 0755-82825720 |
| | 电子邮箱 | zhangge@phfund.com.cn |
| 客户服务电话 | 4006788999 | 95555 |
| 传真 | 0755-82021126 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 办公地址 | 深圳市福田区福华三路 168 号深 | 深圳市深南大道 7088 号招商银 |

| | | |
|-------|---------------|--------|
| | 圳国际商会中心第 43 楼 | 行大厦 |
| 邮政编码 | 518048 | 518040 |
| 法定代表人 | 何如 | 缪建民 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.phfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021年1月1日-2021年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 39,581,849.82 |
| 本期利润 | 59,076,531.68 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0363 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.56% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.52% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 234,236,694.59 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1209 |
| 期末基金资产净值 | 1,996,580,799.40 |
| 期末基金份额净值 | 1.031 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 54.99% |

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) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

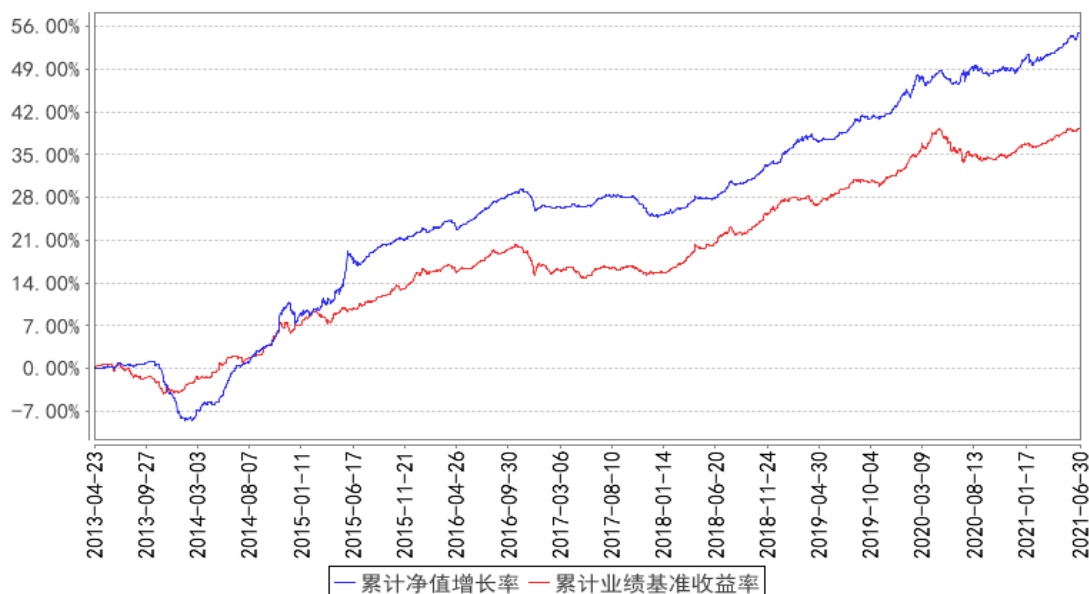
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.49% | 0.10% | 0.08% | 0.07% | 0.41% | 0.03% |
| 过去三个月 | 2.38% | 0.09% | 1.39% | 0.06% | 0.99% | 0.03% |
| 过去六个月 | 3.52% | 0.12% | 2.09% | 0.07% | 1.43% | 0.05% |
| 过去一年 | 5.59% | 0.14% | 2.49% | 0.10% | 3.10% | 0.04% |
| 过去三年 | 20.74% | 0.12% | 14.71% | 0.11% | 6.03% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 54.99% | 0.16% | 39.31% | 0.12% | 15.68% | 0.04% |

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份额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

鹏华丰利债券 (LOF) 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 04 月 23 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 9,012.31 亿元，管理 237 只公募基金、13 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富的经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王石千 | 基金经理 | 2018-04-12 | - | 7 年 | 王石千先生，国籍中国，经济学硕士，7 年证券从业经验。2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，曾任固定收益部高级债券研究员，从事债券投资研究工作，现担任公募债券投资部基金经理。2018 年 03 月至今担任鹏华双债加利债券型证券投资基金基金经理，2018 年 04 月至 2020 年 02 月担任鹏华纯债债券型证券投资基金基金经理，2018 年 04 月至今担任鹏华丰利债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2018 年 07 月至今担任鹏华可转债债券型证券投资基金基金经理，2018 年 10 月至 2019 年 11 月担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理，2018 年 11 月至今担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 07 月至今担任鹏华双债保利债券型证券投资基金基金经理，2019 年 09 月至今担任鹏华永泽 18 个月定期开放债券 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 型证券投资基金基金经理, 2019年09月至2020年12月担任鹏华丰饶定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2020年07月至今担任鹏华安惠混合型证券投资基金基金经理, 2020年07月至今担任鹏华安睿两年持有期混合型证券投资基金基金经理, 2021年02月至今担任鹏华安悦一年持有期混合型证券投资基金基金经理, 王石千先生具备基金从业资格。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。

4.1.3 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

注：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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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%的交易次数为 2 次，主要原因在于指数基金成分股交易不活跃导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年上半年债券市场收益率先上后下，整体收益率较年初有所下行，信用债表现好于利率债。年初短端资金利率处于低位，1月中旬流动性开始趋紧，资金利率跳升，债券市场出现调整；

春节之后资金面持续宽松，叠加股市调整，利率债新发行量较少，债券市场收益率转而下行。进入二季度，在资金面持续维持宽松，政府债发行节奏弱于预期，叠加政策监管收紧的背景之下，信用债净融资缩量，非标融资进一步压缩，债券市场收益率震荡回落。

2021 年上半年股票市场整体上涨，在春节后有所回调。创业板指为代表的成长股表现好于沪深 300 为代表的蓝筹股，新能源、半导体、医疗服务等相关板块的个股表现领先。虽然经济同比增速有所回落，但许多行业的盈利能力仍保持了良好的增长势头，叠加通胀预期有所回落、资金面偏宽松，景气度较高的行业和公司的股票在上半年表现突出。

2021 年上半年转债市场表现较好，中证转债指数上涨 4.04%。可转债受益于债券市场收益率下行，整体估值水平有所上升；另外今年中小市值股票的表现相对更强，对应许多转债的正股表现较好，带动了转债市场的表现。

报告期内本基金在债券投资上以持有中高评级信用债为主，维持了中等偏短的久期，并对信用债的个券进行了调整；可转债整体仓位在一季度有所减少，在二季度加仓了正股优质、估值合理的转债。

4.4.2 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 3.52%，同期业绩比较基准增长率为 2.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券市场方面，预计后续债券市场收益率可能会进入震荡格局。随着出口端对于国内经济拉动作用边际趋缓，叠加地产投资高位回落，预计经济下行压力或有所加大，我国货币政策可能维持稳健偏宽松的格局，但美联储货币政策收紧预期不断抬升，叠加政府债供给压力仍存，预计债券收益率可能继续维持震荡格局。

股票市场方面，预计后续企业整体盈利增长动能可能随经济有所下降，但货币政策可能延续当前稳健的基调，预计权益市场仍以结构性机会为主，关注景气度较好的行业和个股的投资机会。

转债市场方面，在转债市场估值有所提升的背景下，预计转债市场整体与股票市场类似，仍以结构性行情为主。当前上市公司积极通过发行可转债融资，转债市场存续个券数量持续增长，为二级市场转债投资者不断提供新的投资机会，后续主要通过自下而上精选估值合理、正股优质的个券进行投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 234,236,694.59 元，期末基金份额净值 1.031 元。

2、本基金于 2021 年 03 月 16 日进行利润分配，分配金额为 36,426,171.04 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 16,648,296.10 | 20,425,363.94 |
| 结算备付金 | | 43,684,686.17 | 47,179,956.72 |
| 存出保证金 | | 49,061.17 | 62,971.46 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,330,051,999.38 | 1,625,652,899.67 |
| 其中：股票投资 | | 9,779,245.41 | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,248,272,753.97 | 1,536,652,899.67 |
| 资产支持证券投资 | | 72,000,000.00 | 89,000,000.00 |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 1,900,203.48 | 4,178,810.19 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 35,340,709.70 | 20,650,795.40 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 498,895.65 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,428,173,851.65 | 1,718,150,797.38 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 426,300,000.00 | 344,100,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 3,521,502.39 | 1,904,609.67 |
| 应付赎回款 | | 6,144.67 | 13,977.93 |
| 应付管理人报酬 | | 1,136,194.30 | 808,408.67 |
| 应付托管费 | | 324,626.96 | 230,973.90 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 4,025.00 | 3,975.00 |
| 应交税费 | | 166,644.68 | 171,131.78 |
| 应付利息 | | - | -113,698.66 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 133,914.25 | 270,052.67 |
| 负债合计 | | 431,593,052.25 | 347,389,430.96 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,667,721,322.94 | 1,154,641,881.86 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 328,859,476.46 | 216,119,484.56 |
| 所有者权益合计 | | 1,996,580,799.40 | 1,370,761,366.42 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,428,173,851.65 | 1,718,150,797.38 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.031 元，基金份额总额 1,937,282,912.95 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华丰利债券型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------|------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 70,924,065.29 | 40,951,398.48 |
| 1. 利息收入 | | 31,840,812.79 | 34,164,737.90 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 383,086.91 | 444,869.06 |
| 债券利息收入 | | 29,840,557.75 | 31,527,718.31 |
| 资产支持证券利息收入 | | 1,584,271.33 | 2,176,947.56 |
| 买入返售金融资产收入 | | 32,896.80 | 15,202.97 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 19,383,787.70 | 24,684,888.79 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 180,257.68 | -998,941.11 |
| 基金投资收益 | - | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 19,203,530.02 | 25,683,829.90 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |

| | | | |
|------------------------|------------|---------------|----------------|
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 19,494,681.86 | -18,009,244.07 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 204,782.94 | 111,015.86 |
| 减：二、费用 | | 11,847,533.61 | 12,039,634.11 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 5,752,124.10 | 5,543,828.73 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,643,464.01 | 1,583,950.97 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 40,829.22 | 44,839.13 |
| 5. 利息支出 | | 4,141,061.39 | 4,602,177.70 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 4,141,061.39 | 4,602,177.70 |
| 6. 税金及附加 | | 103,519.42 | 104,130.37 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 166,535.47 | 160,707.21 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 59,076,531.68 | 28,911,764.37 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 59,076,531.68 | 28,911,764.37 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | |
|-----------------------------------|----------------------------|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,154,641,881.86 | 216,119,484.56 | 1,370,761,366.42 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 59,076,531.68 | 59,076,531.68 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 513,079,441.08 | 90,089,631.26 | 603,169,072.34 |
| 其中：1. 基金申购款 | 694,613,202.98 | 125,177,338.27 | 819,790,541.25 |

| | | | |
|--|---------------------------------|----------------|------------------|
| 2. 基金赎回款 | -181,533,761.90 | -35,087,707.01 | -216,621,468.91 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -36,426,171.04 | -36,426,171.04 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,667,721,322.94 | 328,859,476.46 | 1,996,580,799.40 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,200,832,488.08 | 254,848,787.70 | 1,455,681,275.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 28,911,764.37 | 28,911,764.37 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 160,692,132.87 | 39,154,696.57 | 199,846,829.44 |
| 其中：1. 基金申购款 | 413,373,480.93 | 92,022,809.06 | 505,396,289.99 |
| 2. 基金赎回款 | -252,681,348.06 | -52,868,112.49 | -305,549,460.55 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -99,066,409.89 | -99,066,409.89 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,361,524,620.95 | 223,848,838.75 | 1,585,373,459.70 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]154号《关于核准鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型证券投资基金,存续期限不定。本基金自2013年3月25日至2013年4月17日期间公开发售,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,999,052,076.34元,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入582,025.10元,经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第117号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同》于2013年4月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,999,634,101.44份基金份额,其中认购资金利息折合582,025.10份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。另根据中国证监会基金部通知[2012]22号《关于增设发起式基金审核通道有关问题的通知》,鹏华丰利分级债券基金在募集时,使用发起资金认购的本基金份额为20,003,124.00份,且发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金《基金合同》生效之日起3年内,本基金通过基金收益分配的安排,将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别,即丰利债A基金份额(基金份额简称“丰利债A”)和丰利债B基金份额(基金份额简称“丰利债B”)。除收益分配、基金合同终止时的基金清算财产分配和基金转换运作方式时的基金份额折算外,每份丰利债A和每份丰利债B享有同等的权利和义务。丰利债A和丰利债B分别募集并按照基金合同约定的比例进行初始配比,所募集的两级基金的基金资产合并运作。其中,丰利债A根据《基金合同》的规定获取约定收益,并自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,接受申购与赎回,在丰利债A的每次申购开放日,基金管理人将对丰利债A进行基金份额折算,丰利债A的基金份额净值调整为1.000元,基金份额持有人持有的丰利债A份额数按折算比例相应增减;本基金净资产优先分配予丰利债A份额的本金及约定应得收益,剩余净资产分配予丰利债B基金份额;在分级运作期内每次开放时,如本基金净资产等于或低于丰利债A份额的本金及约定应得收益的总额,本基金净资产全部分配予丰利债A份额后,仍存在额外未弥补的丰利债A份额本金及约定收益总额的差额,则不再进行弥补。丰利债B在《基金合同》生效后封闭运作,封闭期为3年。

本基金分级运作期届满,本基金的两级基金份额将按约定的收益分配规则进行净值计算,并

以各自的基金份额净值为基准转换为同一上市开放式基金(LOF)的份额,并办理基金的申购、赎回业务。经深圳证券交易所深证上[2013]284号文审核同意,丰利债B基金份额于2013年7月19日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据基金合同的规定及本基金的基金管理人发布的《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金分级运作期届满与基金份额转换的公告》,本基金的封闭期自2013年4月23日(基金合同生效日)起至2016年4月24日止。自2016年4月25日起,鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金自动转为上市开放式基金(LOF),并更名为鹏华丰利债券型证券投资基金(LOF)(以下简称“鹏华丰利债券基金(LOF)”)。于2016年4月25日,本基金的基金管理人将根据丰利A和丰利B基金份额转换比例对基金份额持有人基金份额转换日登记在册的基金份额实施转换。以份额转换后1.000元的基金份额净值为基准,丰利A、丰利B按照各自的基金份额净值转换成鹏华丰利债券基金(LOF)份额。丰利A、丰利B的场外份额将转换为鹏华丰利债券基金(LOF)场外份额,丰利B的场内份额将转换为鹏华丰利债券基金(LOF)场内份额。转换后,基金份额持有人持有的基金份额数将按照转换规则相应增加或减少。《鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金合同》中除仅适用于鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金的条款外,继续适用于转换后的鹏华丰利债券基金(LOF)。根据深交所深证上[2016]211号《终止上市同意书》,原鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金于2016年4月25日终止上市权利登记。根据深交所深证上[2016]315号文审核同意,鹏华丰利债券基金(LOF)27,657,952.00份额2016年5月24日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过本基金代销机构赎回或通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接买入股票、权证等权益类金融工具,因所持可转换公司债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证,在其可上市交易后不超过10个交易日的时间内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金对债券等固定收益品种的投资比例不低于基金资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金整体的业绩比较基准为:中债总指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华丰利债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 16,648,296.10 |
| 定期存款 | - |
| 其中:存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 16,648,296.10 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | |
|---------------|-------------------|------------------|------------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 9,779,245.41 | 9,779,245.41 | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 1,172,016,916.54 | 1,188,298,753.97 |
| | 银行间市场 | 1,054,766,329.65 | 1,059,974,000.00 |
| | 合计 | 2,226,783,246.19 | 2,248,272,753.97 |
| 资产支持证券 | 72,000,000.00 | 72,000,000.00 | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 2,308,562,491.60 | 2,330,051,999.38 | 21,489,507.78 |

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,833.84 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 19,658.10 |
| 应收债券利息 | 34,735,302.62 |
| 应收资产支持证券利息 | 583,893.04 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |

| | |
|----------|---------------|
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 22.10 |
| 合计 | 35,340,709.70 |

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 4,025.00 |
| 合计 | 4,025.00 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 23.12 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 133,891.13 |
| 合计 | 133,914.25 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,341,333,058.34 | 1,154,641,881.86 |
| 本期申购 | 806,856,051.99 | 694,613,202.98 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -210,906,197.38 | -181,533,761.90 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 1,937,282,912.95 | 1,667,721,322.94 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 164,922,674.98 | 51,196,809.58 | 216,119,484.56 |
| 本期利润 | 39,581,849.82 | 19,494,681.86 | 59,076,531.68 |
| 本期基金份额交易 | 66,158,340.83 | 23,931,290.43 | 90,089,631.26 |

| | | | |
|----------|----------------|---------------|----------------|
| 产生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 93,096,689.16 | 32,080,649.11 | 125,177,338.27 |
| 基金赎回款 | -26,938,348.33 | -8,149,358.68 | -35,087,707.01 |
| 本期已分配利润 | -36,426,171.04 | - | -36,426,171.04 |
| 本期末 | 234,236,694.59 | 94,622,781.87 | 328,859,476.46 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|-----------|----------------------|------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 活期存款利息收入 | | 53,916.63 |
| 定期存款利息收入 | | - |
| 其他存款利息收入 | | - |
| 结算备付金利息收入 | | 283,819.74 |
| 其他 | | 45,350.54 |
| 合计 | | 383,086.91 |

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------------|----------------------|------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | | 180,257.68 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | | - |
| 合计 | | 180,257.68 |

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------|----------------------|--------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 卖出股票成交总额 | | 8,667,866.48 |
| 减：卖出股票成本总额 | | 8,487,608.80 |
| 买卖股票差价收入 | | 180,257.68 |

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 19,203,530.02 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 19,203,530.02 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 800,655,990.25 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 771,469,820.01 |
| 减：应收利息总额 | 9,982,640.22 |
| 买卖债券差价收入 | 19,203,530.02 |

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 卖出资产支持证券成交总额 | 92,463,229.90 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 89,000,000.00 |
| 减：应收利息总额 | 3,463,229.90 |
| 资产支持证券投资收益 | - |

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

注：无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 19,494,681.86 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | 19,494,681.86 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |

| | |
|------------------------|---------------|
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 19,494,681.86 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 175,940.84 |
| 基金转换费收入 | 28,633.77 |
| 其他 | 208.33 |
| 合计 | 204,782.94 |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 32,349.22 |
| 银行间市场交易费用 | 8,480.00 |
| 合计 | 40,829.22 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 44,630.98 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 14,644.34 |
| 账户维护费 | 17,400.00 |
| 上市年费 | 29,752.78 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 166,535.47 |

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-----------------------|-----------------|
| 鹏华基金管理有限公司 (“鹏华基金公司”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司 (“招商银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 国信证券股份有限公司 (“国信证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 (%) |
| 国信证券 | 30,639,267.30 | 3.12 | - | - |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|-------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) |
| 国信证券 | 4,337,700,000.00 | 10.39 | - | - |

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6 月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,752,124.10 | 5,543,828.73 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 177,224.23 | 113,474.92 |

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.70%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.70%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6 月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,643,464.01 | 1,583,950.97 |

注：支付基金托管人招商银行的托管费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 16,648,296.10 | 53,916.63 | 21,244,932.74 | 93,677.99 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|------------|-------------|---------------|---------------|---------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2021年3月16日 | 2021年3月17日 | 2021年3月16日 | 0.2630 | 18,881,476.64 | 17,544,694.40 | 36,426,171.04 | - |
| 合计 | - | - | - | 0.2630 | 18,881,476.64 | 17,544,694.40 | 36,426,171.04 | - |

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|-----------|--------|--------|--------|----------|------------|------------|----|
| 113050 | 南银转债 | 2021年6月17日 | 2021年7月1日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 5,610 | 561,000.00 | 561,000.00 | - |

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后6个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金参与摇号配售或比例配售方式获配的创业板股票自发行人股票上市之日起在发行人约定的限售期内不得转让。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年06月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购

证券款余额 426,300,000.00 元，于 2021 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金。本基金主要投资债券等固定收益类金融工具。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 82,462,000.00 | 47,578,100.00 |
| A-1以下 | 40,084,000.00 | 14,988,000.00 |
| 未评级 | 88,000,959.90 | 74,926,506.60 |
| 合计 | 210,546,959.90 | 137,492,606.60 |

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债；A-1以下包含未评级的超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | 72,000,000.00 | 89,000,000.00 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 72,000,000.00 | 89,000,000.00 |

注：A-1以下包含发行期限小于1年的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 1,183,239,877.34 | 860,105,395.33 |
| AAA以下 | 783,582,916.73 | 460,150,897.74 |
| 未评级 | 70,903,000.00 | 78,904,000.00 |
| 合计 | 2,037,725,794.07 | 1,399,160,293.07 |

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 426,300,000.00 元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|----------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 16,648,296.10 | - | - | - | 16,648,296.10 |
| 结算备付金 | 43,684,686.17 | - | - | - | 43,684,686.17 |
| 存出保证金 | 49,061.17 | - | - | - | 49,061.17 |
| 交易性金融资产 | 732,283,023.90 | 1,354,297,960.09 | 233,691,769.98 | 9,779,245.41 | 2,330,051,999.38 |
| 应收利息 | - | - | - | 35,340,709.70 | 35,340,709.70 |
| 应收申购款 | - | - | - | 498,895.65 | 498,895.65 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,900,203.48 | 1,900,203.48 |
| 资产总计 | 792,665,067.34 | 1,354,297,960.09 | 233,691,769.98 | 47,519,054.24 | 2,428,173,851.65 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 6,144.67 | 6,144.67 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,136,194.30 | 1,136,194.30 |
| 应付托管费 | - | - | - | 324,626.96 | 324,626.96 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 3,521,502.39 | 3,521,502.39 |
| 卖出回购金融资产款 | 426,300,000.00 | - | - | - | 426,300,000.00 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 4,025.00 | 4,025.00 |
| 应交税费 | - | - | - | 166,644.68 | 166,644.68 |
| 其他负债 | - | - | - | 133,914.25 | 133,914.25 |
| 负债总计 | 426,300,000.00 | - | - | 5,293,052.25 | 431,593,052.25 |
| 利率敏感度缺口 | 366,365,067.34 | 1,354,297,960.09 | 233,691,769.98 | 42,226,001.99 | 1,996,580,799.40 |
| 上年度末 2020年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 20,425,363.94 | - | - | - | 20,425,363.94 |
| 结算备付金 | 47,179,956.72 | - | - | - | 47,179,956.72 |
| 存出保证金 | 62,971.46 | - | - | - | 62,971.46 |
| 交易性金融资产 | 518,514,856.60 | 909,345,693.20 | 197,792,349.87 | - | 1,625,652,899.67 |
| 应收利息 | - | - | - | 20,650,795.40 | 20,650,795.40 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 4,178,810.19 | 4,178,810.19 |
| 资产总计 | 586,183,148.72 | 909,345,693.20 | 197,792,349.87 | 24,829,605.59 | 1,718,150,797.38 |
| 负债 | | | | | |

| | | | | | |
|-----------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 应付赎回款 | - | - | - | 13,977.93 | 13,977.93 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 808,408.67 | 808,408.67 |
| 应付托管费 | - | - | - | 230,973.90 | 230,973.90 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,904,609.67 | 1,904,609.67 |
| 卖出回购金融资产款 | 344,100,000.00 | - | - | - | 344,100,000.00 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 3,975.00 | 3,975.00 |
| 应付利息 | - | - | - | -113,698.66 | -113,698.66 |
| 应交税费 | - | - | - | 171,131.78 | 171,131.78 |
| 其他负债 | - | - | - | 270,052.67 | 270,052.67 |
| 负债总计 | 344,100,000.00 | - | - | 3,289,430.96 | 347,389,430.96 |
| 利率敏感度缺口 | 242,083,148.72 | 909,345,693.20 | 197,792,349.87 | 21,540,174.63 | 1,370,761,366.42 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。 | | |
| | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。 | | |
| | 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2021年6月30日） | 上年度末（2020年12月31日） |
| 分析 | 市场利率下降 25 个基点 | 7,744,101.38 | 5,495,518.41 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -7,666,525.76 | -5,431,510.18 |

注：无。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | 上年度末 2020年12月31日 | |
|---------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 9,779,245.41 | 0.49 | — | — |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 345,494,244.07 | 17.30 | 272,871,443.07 | 19.91 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | — | — | — | — |
| 衍生金融资产—权证投资 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 355,273,489.48 | 17.79 | 272,871,443.07 | 19.91 |

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于2021年6月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值比例为17.79%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 9,779,245.41 | 0.40 |
| | 其中：股票 | 9,779,245.41 | 0.40 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,320,272,753.97 | 95.56 |
| | 其中：债券 | 2,248,272,753.97 | 92.59 |
| | 资产支持证券 | 72,000,000.00 | 2.97 |
| 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 | 60,332,982.27 | 2.48 |
| 8 | 其他各项资产 | 37,788,870.00 | 1.56 |
| 9 | 合计 | 2,428,173,851.65 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 9,779,245.41 | 0.49 |
| C | 制造业 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 9,779,245.41 | 0.49 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 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 | 600985 | 淮北矿业 | 800,921 | 9,779,245.41 | 0.49 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 600985 | 淮北矿业 | 9,779,245.41 | 0.71 |
| 2 | 601233 | 桐昆股份 | 6,069,384.00 | 0.44 |
| 3 | 603939 | 益丰药房 | 2,418,224.80 | 0.18 |

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 601233 | 桐昆股份 | 6,462,493.48 | 0.47 |
| 2 | 603939 | 益丰药房 | 2,205,373.00 | 0.16 |

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 18,266,854.21 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 8,667,866.48 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 88,000,959.90 | 4.41 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 139,911,300.00 | 7.01 |
| | 其中：政策性金融债 | 70,903,000.00 | 3.55 |
| 4 | 企业债券 | 717,382,250.00 | 35.93 |
| 5 | 企业短期融资券 | 122,546,000.00 | 6.14 |
| 6 | 中期票据 | 834,938,000.00 | 41.82 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 345,494,244.07 | 17.30 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,248,272,753.97 | 112.61 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019645 | 20 国债 15 | 877,290 | 88,000,959.90 | 4.41 |
| 2 | 132100019 | 21 电网 GN001 | 800,000 | 80,360,000.00 | 4.02 |
| 3 | 102001718 | 20 大唐集 MTN002 | 600,000 | 61,452,000.00 | 3.08 |
| 4 | 155855 | 19 铁建 Y3 | 600,000 | 60,666,000.00 | 3.04 |
| 5 | 102100432 | 21 首开 MTN001 | 600,000 | 60,594,000.00 | 3.03 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 137835 | 东裕 02A | 250,000 | 25,000,000.00 | 1.25 |
| 2 | 179840 | 荣茂 11 优 | 240,000 | 24,000,000.00 | 1.20 |
| 3 | 179913 | 21 信易 1A | 230,000 | 23,000,000.00 | 1.15 |

7.8 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贵金属投资明细

注：无。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

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。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。

7.11.2 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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 49,061.17 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,900,203.48 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 35,340,709.70 |
| 5 | 应收申购款 | 498,895.65 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 37,788,870.00 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------------|------------------|
| 1 | 120002 | 18 中原 EB | 36,064,802.50 | 1.81 |
| 2 | 128109 | 楚江转债 | 11,499,665.80 | 0.58 |
| 3 | 110048 | 福能转债 | 11,367,658.00 | 0.57 |
| 4 | 132017 | 19 新钢 EB | 10,648,618.00 | 0.53 |
| 5 | 113025 | 明泰转债 | 10,145,585.90 | 0.51 |
| 6 | 123083 | 朗新转债 | 9,681,910.26 | 0.48 |
| 7 | 113599 | 嘉友转债 | 9,420,643.80 | 0.47 |
| 8 | 132014 | 18 中化 EB | 8,464,994.40 | 0.42 |
| 9 | 110074 | 精达转债 | 8,218,450.00 | 0.41 |
| 10 | 110047 | 山鹰转债 | 8,053,730.10 | 0.40 |
| 11 | 113607 | 伟 20 转债 | 7,801,066.40 | 0.39 |
| 12 | 123035 | 利德转债 | 7,371,924.00 | 0.37 |
| 13 | 110063 | 鹰 19 转债 | 7,246,945.80 | 0.36 |
| 14 | 113612 | 永冠转债 | 7,215,998.60 | 0.36 |
| 15 | 110051 | 中天转债 | 7,094,197.40 | 0.36 |
| 16 | 113615 | 金诚转债 | 6,567,638.40 | 0.33 |
| 17 | 128128 | 齐翔转 2 | 6,526,142.88 | 0.33 |
| 18 | 113603 | 东缆转债 | 6,228,864.80 | 0.31 |
| 19 | 113508 | 新风转债 | 6,145,205.40 | 0.31 |
| 20 | 128134 | 鸿路转债 | 5,886,902.91 | 0.29 |
| 21 | 128081 | 海亮转债 | 5,689,025.01 | 0.28 |
| 22 | 128029 | 太阳转债 | 5,530,060.50 | 0.28 |
| 23 | 110077 | 洪城转债 | 5,490,772.50 | 0.28 |
| 24 | 128095 | 恩捷转债 | 5,485,030.20 | 0.27 |
| 25 | 113569 | 科达转债 | 5,043,030.00 | 0.25 |
| 26 | 128096 | 奥瑞转债 | 4,929,271.75 | 0.25 |
| 27 | 113596 | 城地转债 | 4,835,572.20 | 0.24 |
| 28 | 113040 | 星宇转债 | 4,056,012.10 | 0.20 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 29 | 123090 | 三诺转债 | 3,717,931.50 | 0.19 |
| 30 | 128119 | 龙大转债 | 3,627,380.30 | 0.18 |
| 31 | 128097 | 奥佳转债 | 3,493,795.89 | 0.17 |
| 32 | 128108 | 蓝帆转债 | 3,385,278.00 | 0.17 |
| 33 | 128125 | 华阳转债 | 3,364,490.00 | 0.17 |
| 34 | 113611 | 福 20 转债 | 3,316,174.30 | 0.17 |
| 35 | 128032 | 双环转债 | 3,242,743.70 | 0.16 |
| 36 | 113602 | 景 20 转债 | 2,969,250.00 | 0.15 |
| 37 | 113033 | 利群转债 | 2,832,654.00 | 0.14 |
| 38 | 132020 | 19 蓝星 EB | 2,519,510.40 | 0.13 |
| 39 | 128035 | 大族转债 | 2,488,500.00 | 0.12 |
| 40 | 128066 | 亚泰转债 | 2,452,342.00 | 0.12 |
| 41 | 128139 | 祥鑫转债 | 2,430,270.36 | 0.12 |
| 42 | 123075 | 贝斯转债 | 2,322,770.90 | 0.12 |
| 43 | 113614 | 健 20 转债 | 1,760,476.90 | 0.09 |
| 44 | 123059 | 银信转债 | 969,799.68 | 0.05 |
| 45 | 113579 | 健友转债 | 311,110.80 | 0.02 |
| 46 | 128121 | 宏川转债 | 181,231.26 | 0.01 |

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.11.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|-----------|--------------|------------------|------------|---------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 (%) | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 1,924 | 1,006,903.80 | 1,907,995,345.43 | 98.49 | 29,287,567.52 | 1.51 |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额 (份) | 占上市总份额比例 (%) |
|----|-------------|------------|--------------|
| 1 | 全国社保基金二一三组合 | 326,770.00 | 46.75 |
| 2 | 黄贤民 | 77,095.00 | 11.03 |
| 3 | 胥永健 | 50,992.00 | 7.30 |
| 4 | 石军祥 | 33,717.00 | 4.82 |
| 5 | 郭文彬 | 26,302.00 | 3.76 |

| | | | |
|----|-----|-----------|------|
| 6 | 钱中明 | 22,400.00 | 3.20 |
| 7 | 马金凤 | 19,452.00 | 2.78 |
| 8 | 陈绍杰 | 19,417.00 | 2.78 |
| 9 | 奚正舟 | 19,319.00 | 2.76 |
| 10 | 李有塘 | 13,952.00 | 2.00 |

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 6,319.59 | 0.0003 |

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2013 年 4 月 23 日) 基金份额总额 | 2,999,634,101.44 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,341,333,058.34 |
| 本报告期基金总申购份额 | 806,856,051.99 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 210,906,197.38 |
| 本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,937,282,912.95 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理高阳先生辞去公司副总经理职务，经公司董事会审议通过，于 2021 年 1 月 16 日离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，聘任王宗合先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 1 月 28 日起；聘任梁浩先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 1 月 28 日起。

本公司已将上述变更事项报相关监管部门备案。

报告期内，经公司股东会审议通过，史际春先生不再担任公司独立董事，于 2021 年 4 月 22 日离任；聘任蒋毅刚先生担任公司独立董事，任职日期自 2021 年 4 月 22 日起。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------|--------|--------------|--------------|-----------|------------|------------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东北证券 | 1 | 8,667,866.48 | 100.00% | 7,899.39 | 100.00% | - |
| 爱建证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | 本报告期新增 1 个 |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|--------------------------------------|
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | 本 报 告 期 新 增 |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | 本 报 告 期 新 增 1 个 |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | 本 报 告 期 新 增 |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | 本 报 告 期 新 增 |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证 券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中原证券 | 1 | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性以及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东北证券 | 455,090,928.00 | 46.31% | 36,965,400,000.00 | 88.58% | - | - |
| 爱建证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|------------|----------------|--------|------------------|--------|---|
| 方正证券 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 30,639,267.30 | 3.12% | 4,337,700,000.00 | 10.39% | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 336,544,479.00 | 34.24% | 430,000,000.00 | 1.03% | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 100,610,300.00 | 10.24% | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 59,885,200.00 | 6.09% | - | - | - |
| 中信建投 证券 | - | - | - | - | - |
| 中原证券 | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|------------------------------|-------------|
| 1 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月04日 |
| 2 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月04日 |
| 3 | 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月16日 |
| 4 | 鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）2020年第4季度报告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月22日 |
| 5 | 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月28日 |
| 6 | 鹏华基金管理有限公司高级管理人员 | 《证券时报》、基金管理 | 2021年01月28日 |

| | | | |
|----|---|------------------------------|-------------|
| | 变更公告 | 人网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 7 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年02月06日 |
| 8 | 鹏华基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年02月08日 |
| 9 | 鹏华丰利债券型证券投资基金(LOF)暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月09日 |
| 10 | 鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月09日 |
| 11 | 鹏华基金管理有限公司关于鹏华丰利债券型证券投资基金(LOF)2021年第1次分红公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月12日 |
| 12 | 鹏华基金管理有限公司关于直销渠道相关业务费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月22日 |
| 13 | 鹏华丰利债券型证券投资基金(LOF)2020年年度报告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月30日 |
| 14 | 鹏华基金管理有限公司旗下基金2020年年度报告提示性公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月30日 |
| 15 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米基金销售有限公司基金转换业务申购补差费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月30日 |
| 16 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月01日 |
| 17 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月10日 |
| 18 | 鹏华丰利债券型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月14日 |
| 19 | 鹏华丰利债券型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要(更新) | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月14日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------|------------------|
| 20 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天风证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 16 日 |
| 21 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商银行股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 17 日 |
| 22 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京展恒基金销售股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 19 日 |
| 23 | 鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 19 日 |
| 24 | 鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）2021 年第 1 季度报告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 21 日 |
| 25 | 鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 21 日 |
| 26 | 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购瑞华泰首次公开发行 A 股的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 23 日 |
| 27 | 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购志特新材首次公开发行 A 股的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 23 日 |
| 28 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 26 日 |
| 29 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司申购（不含定期定额投资）费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 30 日 |
| 30 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 05 月 14 日 |
| 31 | 鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）基金合同 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 05 月 25 日 |
| 32 | 鹏华丰利债券型证券投资基金（LOF）托管协议 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 05 月 25 日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------|-------------|
| 33 | 鹏华基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年05月25日 |
| 34 | 鹏华丰利债券型证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书 (2021 年第 1 号) | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年05月28日 |
| 35 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年06月04日 |

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 | 20210101~20210630 | 579,324,828.06 | 15,160,440.78 | - | 594,485,268.84 | 30.69 |
| 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华丰利债券型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- (二)《鹏华丰利债券型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- (三)《鹏华丰利债券型证券投资基金 (LOF) 2021 年中期报告》(原文)。

12.2 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。

12.3 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 8 月 30 日