

鹏华丰盛稳固收益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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	鹏华丰盛债券
基金主代码	206008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 25 日
报告期末基金份额总额	6,300,247,353.06 份
投资目标	注重风险控制，力争获取超越存款利率的绝对收益。
投资策略	本基金力争获取超越存款利率的绝对收益，并认为对风险的敏感把握和精准控制是创造绝对收益的关键。在控制风险方面，本基金将通过投资组合保险策略对系统性风险进行管理，通过构建投资组合对非系统性风险进行分散，在此基础上，重视基金管理人自上而下投资能力的发挥，以追求超越基准的绝对收益。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+1.6%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，为证券投资基金中的中低风险品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注：无。

§ 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	41,017,399.67
2. 本期利润	80,810,676.69
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0172
4. 期末基金资产净值	7,281,375,969.26
5. 期末基金份额净值	1.156

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

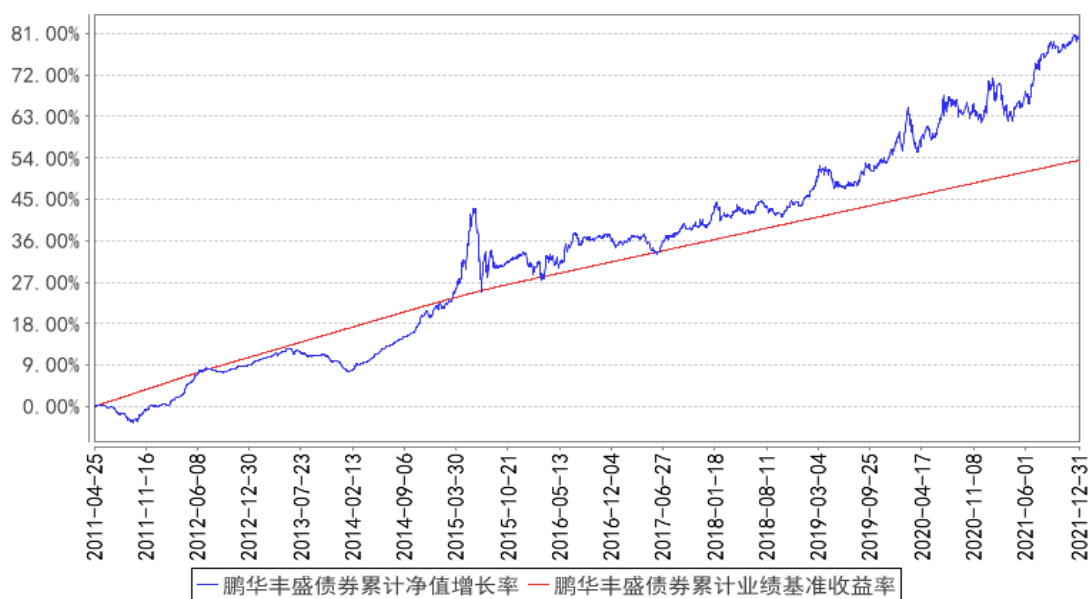
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.23%	0.21%	1.10%	0.01%	0.13%	0.20%
过去六个月	6.09%	0.30%	2.19%	0.01%	3.90%	0.29%
过去一年	8.75%	0.39%	4.35%	0.01%	4.40%	0.38%
过去三年	25.61%	0.38%	13.06%	0.01%	12.55%	0.37%
过去五年	33.75%	0.32%	21.76%	0.01%	11.99%	0.31%
自基金合同 生效起至今	80.62%	0.30%	53.47%	0.02%	27.15%	0.28%

注：业绩比较基准=三年期银行定期存款利率（税后）+1.6%

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

鹏华丰盛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 2011 年 04 月 25 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

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		
范晶伟	基金经理	2021-08-07	-	5 年	范晶伟先生，国籍中国，金融硕士，5 年证券从业经验。2016 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任固定收益部助理债券研究员、债券研究员、固定收益研究部高级债券研究员，现任职于固定收益研究部，从事投研相关工作。2021 年 08 月至今担任鹏华金城灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月至今担任鹏华安源 5 个月持有期混合型证券投资基金基金经理，范晶伟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。

4.1.1 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

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 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

权益市场目前结构性估值偏高，但整体并非未泡沫化。以新能源，军工，科技为主的景气赛道目前估值偏高，交易偏拥挤，会严格控制仓位。宏观环境上，CPI 和 PPI 剪刀差收窄，21 年以来表现偏弱的消费板块存在纠偏可能，积极关注食品饮料，医药，农业在内的消费赛道机会。疫苗加强针和口服新冠药的普及，叠加中央经济工作会议后存在经济托底的可能，我们会逐渐关注经济复苏的潜在受益行业，包括工程机械，银行。政治局和中央经济工作会议上财政和货币政策的定调更加积极，我们认为市场整体风险仍然可控，伴随政策逐步发力，社融有望触底回升，价值股有望进入新一轮重估，后续也会重点关注新老基建的投资机会。

转债方面，我们目前仍严格控制转债仓位，同时优化持仓个券，结合权益的行业配置做互补，提前在部分行业左侧布局了一些转债品种，对持仓转债结构不断进行优化和更新，对于价格和估值指标做严格控制，提高容错率。

债券方面，财政和货币政策的错位导致博弈增加，地产政策松动导致的宽信用以及后续可能的财政政策托底均可能加剧市场波动，因此组合会保持高比例高流动性资产，在久期调整上我们仍以高等级信用和利率为主。

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 1.23%，同期业绩比较基准增长率为 1.10%。

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	1,406,622,776.43	17.13
	其中：股票	1,406,622,776.43	17.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,580,473,848.04	80.13
	其中：债券	6,580,473,848.04	80.13
	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	143,228,556.78	1.74
8	其他资产	81,749,536.58	1.00
9	合计	8,212,074,717.83	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	40,194,000.00	0.55
B	采矿业	22,389,000.00	0.31
C	制造业	814,364,124.19	11.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	183,132,435.20	2.52
E	建筑业	76,450,000.00	1.05
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	32,383,617.04	0.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,658,800.00	0.20
J	金融业	89,250,520.00	1.23
K	房地产业	115,782,000.00	1.59
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	18,018,280.00	0.25
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	1,406,622,776.43	19.32

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 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

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	600519	贵州茅台	19,500	39,975,000.00	0.55
2	600905	三峡能源	5,300,000	39,803,000.00	0.55
3	002459	晶澳科技	380,900	35,309,430.00	0.48
4	600048	保利发展	2,200,000	34,386,000.00	0.47
5	001979	招商蛇口	2,500,000	33,350,000.00	0.46
6	002594	比亚迪	121,000	32,442,520.00	0.45
7	688599	天合光能	390,000	30,771,000.00	0.42
8	000875	吉电股份	3,300,000	29,997,000.00	0.41
9	002271	东方雨虹	540,000	28,447,200.00	0.39
10	300274	阳光电源	189,967	27,697,188.60	0.38

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	137,176,167.50	1.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,978,971,700.00	27.18
	其中：政策性金融债	760,320,000.00	10.44
4	企业债券	1,292,902,381.30	17.76
5	企业短期融资券	193,403,600.00	2.66

6	中期票据	2,243,546,900.00	30.81
7	可转债（可交换债）	315,598,099.24	4.33
8	同业存单	418,875,000.00	5.75
9	其他	-	-
10	合计	6,580,473,848.04	90.37

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	210205	21 国开 05	1,800,000	187,272,000.00	2.57
2	210216	21 国开 16	1,500,000	149,940,000.00	2.06
3	2128033	21 建设银行二级 03	1,400,000	141,932,000.00	1.95
4	2120107	21 浙商银行永续债	1,400,000	141,246,000.00	1.94
5	210211	21 国开 11	1,300,000	129,883,000.00	1.78

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

广发银行股份有限公司

广发银行股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到国家外汇管理局陕西省分局、国家外汇管理局黑龙江省分局、中国银行保险监督管理委员会广东监管局、中国银行保险监督管理委员会北京监管局、中国银行保险监督管理委员会上海监管局等监管机构的行政处罚。

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。

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，。

浙商银行股份有限公司

2021 年 07 月 26 日，国家外汇管理局浙江省分局针对浙商银行股份有限公司的以下违法违规行为：
1. 违规开展外汇批发市场业务；2. 违规办理售汇资金偿还外汇贷款；3. 违规办理资本金结汇；4. 违规办理个人资产变现业务；5. 违规办理个人外币现钞提取业务；6. 结售汇头寸日报表错漏报；
7. 违规开展银行卡相关业务；8. 未按规定办理支付机构跨境收支国际收支申报业务，对公司责令改正，给予警告，合计没收违法所得 560.3 万元，处 267 万元罚款（其中包含对时任金融市场部

总经理助理兼外汇交易中心总经理的直接责任人员黄某某给予警告，处 9 万元罚款；对时任即期交易高级交易员的直接责任人员韩某给予警告，处 9 万元罚款）。

2021 年 10 月 29 日，中国人民银行针对浙商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规行为，对公司罚款 65 万元。

中国建设银行股份有限公司

2021 年 8 月 13 日，中国人民银行针对中国建设银行股份有限公司占压财政存款或者资金、违反账户管理规定的违法违规行为，处警告，并处罚款 388 万元。

中国建设银行股份有限公司上海市分行

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中国建设银行股份有限公司上海市分行的主要违法违规事实：2018 年 7 月至 2019 年 5 月，该分行未按规定取消部分基础金融服务收费，依据《中华人民共和国商业银行法》第七十三条第(四)项责令改正，并处罚款 20 万元。

中国邮政储蓄银行股份有限公司

2021 年 8 月 13 日，中国人民银行针对中国邮政储蓄银行股份有限公司违反账户管理相关规定的违法违规行为，对公司警告，并处罚款 600 万元。

2021 年 11 月 9 日，国家外汇管理局北京外汇管理部针对中国邮政储蓄银行股份有限公司办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查的；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理结汇、售汇业务；违反外汇市场交易管理；未按照规定进行国际收支统计申报；未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料的违法违规行为，对公司给予警告，没收违法所得 673625.55 元人民币，并处 444 万元人民币罚款。

2021 年 6 月 22 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国邮政储蓄银行股份有限公司一、违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费二、未经客户同意违规办理短信收费业务三、信息系统相关功能在开发、投产、维护、后评估等方面存在缺陷及不足四、向监管机构报送材料内容不实五、未在监管要求时限内报送材料六、未按监管要求提供保存业务办理相关凭证的违法违规行为，对公司没收违法所得 11.401116 万元，罚款 437.677425 万元，罚没合计 449.078541 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	895,447.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	80,486,026.44
5	应收申购款	368,062.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	81,749,536.58

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	110073	国投转债	17,496,018.60	0.24
2	110053	苏银转债	14,203,200.00	0.20
3	113026	核能转债	13,709,491.80	0.19
4	123111	东财转3	13,454,400.00	0.18
5	113050	南银转债	13,351,228.80	0.18
6	113044	大秦转债	12,127,046.40	0.17
7	132018	G 三峡 EB1	11,329,102.00	0.16
8	113622	杭叉转债	10,673,148.40	0.15
9	113623	凤 21 转债	9,984,008.40	0.14
10	110079	杭银转债	9,963,200.00	0.14
11	113045	环旭转债	9,958,900.00	0.14
12	123107	温氏转债	9,448,600.00	0.13
13	110038	济川转债	8,936,550.00	0.12
14	128035	大族转债	8,059,800.00	0.11
15	128141	旺能转债	7,768,800.00	0.11
16	127005	长证转债	7,536,741.30	0.10
17	128081	海亮转债	7,408,972.48	0.10
18	127033	中装转 2	7,365,600.00	0.10
19	113608	威派转债	6,997,096.80	0.10
20	127024	盈峰转债	6,172,339.80	0.08
21	110070	凌钢转债	6,102,133.80	0.08
22	128145	日丰转债	6,057,954.90	0.08
23	110068	龙净转债	5,920,220.50	0.08
24	127036	三花转债	5,677,200.00	0.08
25	113046	金田转债	4,793,600.00	0.07

26	123096	思创转债	4,736,309.20	0.07
27	110062	烽火转债	4,622,000.00	0.06
28	128128	齐翔转 2	4,151,007.80	0.06
29	127035	濮耐转债	3,897,010.00	0.05
30	110058	永鼎转债	3,781,200.00	0.05
31	113009	广汽转债	3,232,200.00	0.04
32	113605	大参转债	1,176,100.00	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

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,461,809,428.55
报告期期间基金总申购份额	3,189,164,599.26
减：报告期期间基金总赎回份额	350,726,674.75
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	6,300,247,353.06

§ 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

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

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	1	20211001~20211231	1,431,378,400.38	73,958,743.36	-	1,505,337,143.74	23.89

构						
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) 《鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华丰盛稳固收益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