鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019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：交通银行股份有限公司
送出日期：2019年8月23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。本半年度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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	鹏华尊享定期开放发起式债券
基金主代码	006029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月20日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,010,000,000.00份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力求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，在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。1、资产配置策略 在资产配置方面，本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析，比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率，在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种，及债券与现金类资产之间进行动态调整。2、久期策略 本基金将主要采取久期策略，通过自上而下的组合久期管理策略，以实现对组合利率风险的严格控制。为控制风险，本基金采用以"目标久期"为中心的资产配置方式。目标久期的设定划分为两个层次：战略性配置和战术性配置。"目标久期"的战略性配置由投资决策委员会确定，主要根据对宏观经济和资本市场的预测分析决定组合的目标久期。"目标久期"的战术性配置由基金经理根据市场短期因素的影响在战略性配置预先设定的范围内进行调整。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，直至接近目标久期上限，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，直至目标久期下限，以减小债券价格下降带来的风险。3、收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。4、骑乘策略 本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。5、息差策略 本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。6、债券选择策略 根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。7、中小企业私募债投资策略 本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，与中小企业私募债券承销券商紧密合作，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，力求规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。8、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。
业绩比较基准	中债总指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	陆志俊
	联系电话	0755-82825720	95559
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006788999	95559
传真		0755-82021126	021-62701216

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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

§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(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	14,335,518.24
本期利润	16,895,556.36
加权平均基金份额本期利润	0.0167
本期基金份额净值增长率	1.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0094
期末基金资产净值	1,020,639,368.59
期末基金份额净值	1.0105

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)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。

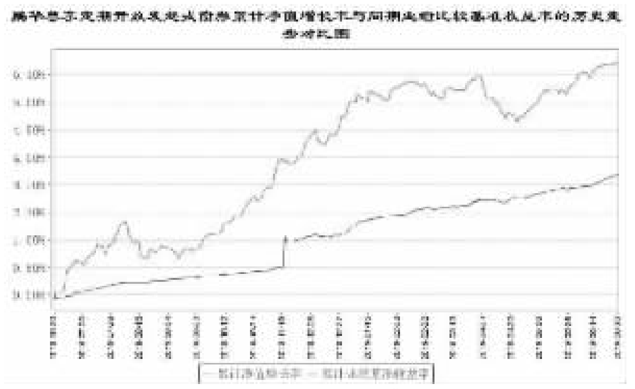
3.2基金净值表现

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	0.36%	0.02%	0.64%	0.06%	-0.28%	-0.04%
过去三个月	0.70%	0.02%	0.38%	0.10%	0.32%	-0.08%
过去六个月	1.66%	0.03%	1.49%	0.09%	0.17%	-0.06%
过去一年	3.51%	0.06%	6.03%	0.10%	-2.52%	-0.04%
自基金成立起至今	3.47%	0.06%	6.77%	0.10%	-3.30%	-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



注：1、本基金基金合同于 2018年06月20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。截止本报告期末，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。公司原注册资本8,000 万元人民币，后于2001年9月完成增资扩股，增至15,000万元人民币。截止到2019年6月，公司管理资产总规模达到5,644.95亿元，管理159只公募基金、10只全国社保投资组合、4只基本养老保险投资组合。

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		
李振宇	本基金基金经理	2018-06-20	-	7	李振宇先生，国籍中国，经济学硕士，7年证券基金从业经验。曾任银华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理，从事债券投资研究工作；2016年8月加盟鹏华基金管理有限公司，历任固定收益部投资经理，现担任公募债券投资部基金经理。2016年12月担任鹏华丰盈债券基金基金经理，2016年12月至2018年07月担任鹏华丰惠债券基金基金经理，2017年02月至2018年07月担任鹏华可转债基金基金经理，2017年05月担任鹏华丰康债券基金基金经理，2017年05月至2019年06月担任鹏华金城保本混合基金基金经理，2018年06月担任鹏华尊享定期开放发起式债券基金基金经理，2018年06月担任鹏华安盈增强混合基金基金经理，2018年12月担任鹏华丰华债券基金基金经理，2019年03月担任鹏华中债1-3年国开行债券指数基金基金经理，2019年05月担任鹏华9-10年利率发起式债券基金基金经理，2019年06月至2019年06月担任鹏华金城混合基金基金经理，2019年06月担任鹏华尊诚定期开放发起式债券基金基金经理。李振宇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。

4.2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

报告期间债市走势总体震荡。今年年初受资金面宽松等因素影响，债市走势较好。一季度至二季度初，由于货币政策边际收紧，且经济上升预期有所回升，导致债市收益率出现了上升。其后，4月政治局会议之后，经济预期有所下行，货币政策总体也略为宽松，利率重回下行态势。

在债券资产的配置上，我们主要持仓为中短期品种，并且在4月中下旬市场调整过程中增加了仓位、提升了组合久期，上半年基金总体获得稳健收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

鹏华尊享6个月定开债券组合净值增长率1.66%，鹏华尊享6个月定开债券业绩比较基准增长率1.49%

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，国内经济仍然存在一定的下行压力，财政由于上半年提前发力较为明显，叠加隐性债务控制并没有明显的放松，基建明显上行可能性较低；此外，房住不炒背景下，房地产投资将保持稳中有下的格局；而制造业、出口等仍然面临一定下行压力。货币政策未来大概率将保持稳健偏宽松的态势，因此，利率未来仍然面临较好的环境。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

（1）日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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9,453,133.85元，期末基金份额净值1.0105元。

2、本基金于2019年03月26日进行利润分配，分配金额为24,240,000.00元。

3、本基金于2019年07月10日进行利润分配，分配金额为9,292,000.00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

2019年上半年度，基金托管人在鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2019年上半年度，鹏华基金管理有限公司在鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了1次收益分配，分配金额为24,240,000.00元，符合基金合同的规定。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2019年上半年度，由鹏华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：		
银行存款	8,004,760.10	9,347,639.45
结算备付金	-	4,576,981.79
存出保证金	5,333.45	80,385.92
交易性金融资产	1,025,465,000.00	1,002,467,868.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,025,465,000.00	1,002,467,868.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	491,124.74	-
应收利息	19,305,824.35	12,167,941.21
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,053,272,042.64	1,028,640,816.37
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	32,000,000.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	251,113.85	261,709.01
应付托管费	83,704.59	87,236.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,172.69	650.00
应交税费	72,807.43	67,408.75
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	218,875.49	240,000.00
负债合计	32,632,674.05	657,004.14
所有者权益：		
实收基金	1,010,000,000.00	1,010,000,000.00
未分配利润	10,639,368.59	17,983,812.23
所有者权益合计	1,020,639,368.59	1,027,983,812.23
负债和所有者权益总计	1,053,272,042.64	1,028,640,816.37

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0105元，基金份额总额1,010,000,000.00份。

6.2利润表

会计主体：鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月20日（基金合同生效日）至2018年6月30日
一、收入		19,742,176.36	-296,247.23
1.利息收入		18,160,670.70	498,306.21
其中：存款利息收入		77,719.28	369,704.02
债券利息收入		18,044,078.55	128,602.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		38,872.87	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		-978,532.46	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-978,532.46	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		2,560,038.12	-794,553.44
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）		-	-
减：二、费用		2,846,620.00	125,013.68
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	1,523,743.48	82,957.85
2. 托管费	6.4.8.2.2	507,914.44	27,652.63
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		873.36	201.76
5. 利息支出		632,087.57	-
其中：卖出回购金融资产支出		632,087.57	-
6. 税金及附加		46,435.66	462.97
7. 其他费用		135,565.49	13,738.47
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		16,895,556.36	-421,260.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		16,895,556.36	-421,260.91

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	1,010,000,000.00	17,983,812.23	1,027,983,812.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,895,556.36	16,895,556.36
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-24,240,000.00	-24,240,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	1,010,000,000.00	10,639,368.59	1,020,639,368.59

项目	上年度可比期间 2018年6月20日（基金合同生效日）至2018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）	1,010,000,000.00	-	1,010,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-421,260.91	-421,260.91
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,010,000,000.00	-421,260.91	1,009,578,739.09

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	苏波	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

鹏华尊享6个月定期开放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[2017]2184号《关于准予鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》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《鹏华尊享6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金，采用封闭运作和开放运作交替循环的方式，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,010,000,000.00元，业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(2018)第0436号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华尊享6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年06月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,010,000,000.00份基金份额，无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,000,000.00基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

本基金自基金合同生效之日（含）起或自每一开放期结束之日次日（含）起至6 个月后的对应日的前一日止的期间封闭运作。自封闭期结束之后第一个工作日(含)起进入开放期，每个开放期原则上不少于五个工作日、不超过二十个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、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、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、中小企业私募债、次级债、同业存单、债券回购、银行存款等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）。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，但在每次开放期前一个月、开放期内及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内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。封闭期不受上述5%的限制。本基金业绩比较基准为：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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《鹏华尊享6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》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2019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2019年6月30日的财务状况以及2019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[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费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关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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
交通银行股份有限公司("交通银行")	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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于2018年6月20日生效，截止本报告期末不满一年。无上年度可比期间和数据。

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

注：无。

6.4.8.1.2债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年6月20日（基金合同生效日）至2018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	145,683,000.00	100.00	197,295,000.00	100.00

6.4.8.1.3债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年6月20日（基金合同生效日）至2018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	314,000,000.00	100.00	-	-

6.4.8.1.4权证交易

注：无。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月20日（基金合同生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,523,743.48	82,957.85
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为0.30%，逐日计提，按月支付。日管理费＝前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月20日（基金合同生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	507,914.44	27,652.63

注：支付基金托管人交通银行的托管费年费率为0.10%，逐日计提，按月支付。日托管费＝前一日基金资产净值× 0.10%/ 当年天数。

6.4.8.2.3销售服务费

注：无。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年6月20日（基金合同生效日）至2018年6月30日
基金合同生效日（2018年6月20日）持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.9901%	0.9901%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.8.4.2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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
交通银行	1,000,000,000.00	99.01	1,000,000,000.00	99.01

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.8.5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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年6月20日（基金合同生效日）至2018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
交通银行	8,004,760.10	71,053.55	613,252,031.11	134,620.72

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6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32,000,000.00元，于2019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。

6.4.10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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,025,465,000.00	97.36
	其中：债券	1,025,465,000.00	97.36
	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	8,004,760.10	0.76
8	其他各项资产	19,802,282.54	1.88
9	合计	1,053,272,042.64	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

注：无。

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前十名股票投资明细

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

7.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：无。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	301,975,000.00	29.59
	其中：政策性金融债	49,955,000.00	4.89
4	企业债券	643,074,000.00	63.01
5	企业短期融资券	80,416,000.00	7.88
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,025,465,000.00	100.47

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	136053	15南航01	1,000,000	100,960,000.00	9.89
2	1928002	19民生银行二级01	1,000,000	100,520,000.00	9.85
3	143193	17电投09	1,000,000	100,230,000.00	9.82
4	122015	09长电债	1,000,000	100,130,000.00	9.81
5	136826	16国网01	1,000,000	100,040,000.00	9.80

7.7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。

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

光大证券 光大证券股份有限公司（以下简称"公司"）于2019年3月19日收到上海证券交易所《关于对光大证券股份有限公司相关投资项目处置事项的监管工作函》（上证公函【2019】0354号），具体内容如下：3月19日，公司披露公告称，全资子公司投资项目出现风险，拟计提预计负债及资产减值准备合计15.2亿元，预计公司2018年净利润约为1.03亿元，同比减少96.6%。根据本所《股票上市规则》第17.1条的规定，就有关事项要求如下。一、你公司应当全面核查前期光大浸辉下设基金对外投资项目损失及差额补足义务等事项，查明是否已履行必要的信息披露和决策程序，并核实相关责任人员。二、你公司应当就前述投资事项涉及的差额补足义务，采取有效措施，妥善化解相关风险，挽回公司损失，积极维护公司和全体股东的合法权益。三、你公司应当全面自查造成本次投资损失的内控管理缺陷，梳理公司日常经营风险，完善内部控制程序，健全风险防控机制。四、你公司应当与年审会计师事务所充分沟通，依法依规做好上述事项的会计处理，按规定编制和披露年报，确保年报信息披露的真实、准确、完整。上述事项对公司及投资者影响重大。请你公司及全体董事、监事和高级管理人员本着对投资者负责的态度，认真落实本工作函要求，及时披露相关事项重大进展。公司全体董事、监事和高级管理人员应当勤勉尽责，规范运作，维护公司生产经营稳定，切实采取有效措施，保护公司和全体股东的合法权益。随后，3月23日，光大证券股份有限公司（以下简称"公司"）全资子公司光大资本投资有限公司（以下简称"光大资本"）于近日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对光大资本投资有限公司采取责令改正监管措施的决定》（沪证监决〔2019〕25号）。上海证监局根据《私募投资基金监督管理暂行办法》（证监会令第105号）决定对光大资本采取责令改正的行政监管措施。公司将进一步加强对子公司内控管理，督促光大资本增强合规风控意识，完善公司治理，强化内部控制，切实提升规范运作水平。对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为子公司投资失败导致大额减值给利润带来影响较大，但仍能实现盈利，考虑到公司股东背景雄厚、资本实力强，上述通告对该公司债券的投资价值不产生重大影响。该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

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	5,333.45
2	应收证券清算款	491,124.74
3	应收股利	-
4	应收利息	19,305,824.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,802,282.54

7.11.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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（%）
2	505,000,000.00	1,010,000,000.00	100.00	-	-

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.3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。

8.4发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.99	10,000,000.00	0.99	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.99	10,000,000.00	0.99	三年

注：1、本基金自2018年5月28日至2018年6月19日止期间公开发售，于2018年6月20日基金合同正式生效。

2、本基金管理人在募集期间认购本基金份额10,000,000.00份。

3、本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

§9开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年6月20日）基金份额总额	1,010,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,010,000,000.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
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	1,010,000,000.00

§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

报告期内，基金管理人无重大人事变动。 报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：无。

10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4基金投资策略的改变

无

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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

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	
国信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内没有通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付。

2、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
国信证券	145,683,000.00	100.00%	314,000,000.00	100.00%	-	-

§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	20190101~20190630	1,000,000,000.00	-	-	1,000,000,000.00	99.01
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、强制调增份额、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、强制调减份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无。

鹏华基金管理有限公司
2019年8月23日