鹏华普天债券证券投资基金2019年第2季度报告

2019年06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

报告送出日期：2019年07月16日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金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 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华普天债券
场内简称	-
基金主代码	160602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 07 月 12 日
报告期末基金份额总额	2,919,862,300.34 份
投资目标	以分享中国经济成长和资本长期稳定增值为宗旨，主要投资于债券及新股配售和增发，在充分控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	债券管理的风险因素依据其对超额收益的贡献大小依次分为久期、期限结构、类属配置和个券选择，我们针对每一类别的风险因素设计相应的管理方法即形成投资策略，依次为久期配置策略、期限结构策略、类属配置策略和个券选择策略。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金。

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	
下属分级基金的基金简称	鹏华普天债券 A	鹏华普天债券 B
下属分级基金的交易代码	160602	160608
报告期末下属分级基金的份额总额	1,839,179,705.71 份	1,080,682,594.63 份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

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(2019 年 04 月 01 日 - 2019 年 06 月 30 日)	
	鹏华普天债券 A	鹏华普天债券 B
1.本期已实现收益	24,999,090.23	14,296,242.35
2.本期利润	23,541,776.40	10,599,875.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0145	0.0113
4.期末基金资产净值	2,399,705,898.67	1,366,685,038.87
5.期末基金份额净值	1.305	1.265

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

鹏华普天债券 A

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	1.16%	0.06%	0.64%	0.06%	0.52%	0.00%

鹏华普天债券 B

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	1.04%	0.07%	0.64%	0.06%	0.40%	0.01%

注：业绩比较基准=中证综合债指数收益率

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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 2003 年 07 月 12 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		
刘涛	本基金基金经理	2017-05-24	-	6 年	刘涛先生，国籍中国，金融学硕士，6 年证券基金从业经验。2013 年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资研究工作，担任固定收益部债券研究员，现担任公募债券投资部基金经理。2016 年 05 月担任鹏华丰融定期开放债券基金基金经理，2016 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华国企债债券基金基金经理，2016 年 11 月担任鹏华丰禄债券基金基金经理，2017 年 02 月至 2017 年 09 月担任鹏华丰安债

					券基金基金经理，2017年 02 月至2018年06月担任鹏华丰达债券基金基金经理，2017年02月至2019年02月担任鹏华丰恒债券基金基金经理，2017年02月担任鹏华丰腾债券基金基金经理，2017年05月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理，2017年05月担任鹏华普天债券基金基金经理，2018年03月担任鹏华弘盛混合基金基金经理，2018年03月至2018年12月担任鹏华实业债基金基金经理，2018年07月担任鹏华尊悦发起式定开债券基金基金经理，2018年10月担任鹏华 3 个月中短债基金基金经理，2018 年 12 月担任鹏华永诚一年

					定期开放债券基金基金经理，2019年03月担任鹏华永融一年定期开放债券基金基金经理，2019年03月担任鹏华永润一年定期开放债券基金基金经理。刘涛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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度债市先跌后涨。4 月初股市表现强势叠加通胀预期回升等因素，收益率快速上行。4 月下旬以来，市场资金面持续宽松，市场预期经济有走弱趋势，长端收益率水平有所下行。在债券的配置上，我们以中等期中高等级信用债为主，从而使得组合净值在二季度债市震荡整的情况下表现稳健。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2019 年二季度普天债券 A 组合净值增长率 1.16%;普天债券 B 组合净值增长率 1.04%，同期业绩基准增长率为 0.64%。

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（人民币元 ）	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	3,956,845,201.14	87.44
	其中：债券	3,906,845,201.14	86.34
	资产支持证券	50,000,000.00	1.10
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	353,100,964.90	7.80
	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	59,655,737.93	1.32
8	其他资产	155,513,333.63	3.44
9	合计	4,525,115,237.60	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

注：无。

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 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

注：无。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	638,216,505.10	16.95
	其中：政策性金融债	628,215,505.10	16.68
4	企业债券	2,156,630,097.50	57.26
5	企业短期融资券	352,398,600.00	9.36
6	中期票据	564,712,050.00	14.99
7	可转债（可交换债）	194,887,948.54	5.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,906,845,201.14	103.73

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	190205	19 国开 05	2,700,000	264,465,000.00	7.02
2	108901	农发 1801	1,700,400	170,210,040.00	4.52
3	155451	19 泰达 02	1,300,000	130,351,000.00	3.46
4	155444	19 津投 13	1,200,000	119,712,000.00	3.18
5	180210	18 国开 10	1,100,000	111,738,000.00	2.97

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	159424	启程 04 优	300,000	30,000,000.00	0.80
2	156599	19 信易 1	200,000	20,000,000.00	0.53

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中本期没有发行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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	170,385.05
2	应收证券清算款	56,111,058.13
3	应收股利	-
4	应收利息	71,557,596.76
5	应收申购款	27,674,293.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	155,513,333.63

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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	132013	17 宝武 EB	26,838,887.00	0.71
2	110046	圆通转债	26,270,710.00	0.70
3	113015	隆基转债	10,219,200.00	0.27
4	127005	长证转债	5,799,000.00	0.15
5	128048	张行转债	4,220,197.16	0.11
6	110049	海尔转债	3,609,600.00	0.10
7	113020	桐昆转债	3,564,600.00	0.09
8	132005	15 国资 EB	2,661,537.00	0.07
9	113525	台华转债	1,597,950.00	0.04
10	110047	山鹰转债	1,545,520.30	0.04
11	128016	雨虹转债	1,321,194.00	0.04
12	110041	蒙电转债	1,048,215.00	0.03

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

项目	鹏华普天债券 A	鹏华普天债券 B
报告期期初基金份额总额	1,500,871,400.81	1,223,851,783.31
报告期期间基金总申购份额	398,859,330.23	732,391,809.94
减:报告期期间基金总赎回份额	60,551,025.33	875,560,998.62
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	1,839,179,705.71	1,080,682,594.63

§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

单位：份

项目	鹏华普天债券 A	鹏华普天债券 B
报告期期初管理人持有的本基金份额	34,811,263.27	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	34,811,263.27	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.89	-

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。

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

注：无。

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)《鹏华普天债券证券投资基金基金合同》；

(二)《鹏华普天债券证券投资基金托管协议》；

(三)《鹏华普天债券证券投资基金 2019 年第 2 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
2019 年 07 月 16 日