

鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金2019年第三季度报告

2019-06-30

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2019-07-16

重要提示

基金管理人承诺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。
基金托管人中国建设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预示其未来表现，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。
本报告中的财务资料未经审计。
本报告自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes details like 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金管理人 (Fund Manager), etc.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30). Includes 本期已实现收益, 本期利润, etc.

基金净值表现

Table with 6 columns: 阶段 (Period), 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. Includes 过去三个月, 过去一年, etc.



注：1. 本基金合同于2018年12月19日生效。
2. 截至本报告期末，本基金的各项投资比例已符合基金合同中规定的各项比例。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-04-01至2019-06-30). Includes 其他指标, 其他指标.

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Tenure), 证券从业年限 (Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Lists 刘涛 as the manager.

注：1. 任免日期和离任日期指公司作出决定后正式对外公告之日；担任和成立基金经理的，任免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的相关规定。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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。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。

公平交易专项说明

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、交易等各环节得到公平对待。

异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。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5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度债市先跌后涨，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，我们以中高等中长期高等级信用债为主，从而使得组合净值在二季度债市震荡的情况下表现稳健。

报告期内基金的业绩表现

2019年二季度本基金的净值增长率为1.52%，同期业绩比较基准增长率为0.38%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Lists 权益类投资, 固定收益投资, etc.

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists 农、林、牧、渔业, 采矿业, etc.

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Lists 国家债券, 央行票据, etc.

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousands), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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。

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。

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。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement).

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Statement).

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。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本基金投资的前十名证券中本期没有发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。

本基金投资的前十名股票中是否存在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备选股票库。

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in Yuan). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 报告期初基金份额总额, 报告期间基金申购份额, etc.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Fund Shares). Includes 报告期末管理人持有的基金份额, 报告期间买入/申购总份额, etc.

注：本基金管理人投资本基金的费用标准与其他符合条件的投资者适用的费率标准相一致。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Transaction Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 5 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占总份额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额总数 (Total Shares Issued), 发起份额占总份额比例 (Percentage of Total Shares Issued), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period for Issued Shares).

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 6 columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Initial Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Current Shares), 份额占比 (Percentage of Total Shares).

注：1. 申购份额包含基金申购份额、基金转换转入份额、场内买入份额、指数分级基金买入份额和红利再投资；2. 赎回份额包含基金赎回份额、基金转换转出份额、场内卖出份额和指数分级基金卖出份额。

影响投资者赎回的其他重要信息

无。

备查文件目录

(一)《鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金合同》；
(二)《鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
(三)《鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金2019年第三季度报告》(原文)。

存放地点

深圳市福田区福华三路188号深圳证券交易所中心40层鹏华基金管理有限公司。

查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站 (http://www.pfund.com.cn) 查阅。
投资者对本报告如有任何疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通投资者服务热线，咨询电话：400888999。