

鹏华实业债纯债债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

注：1. 任日期和截止日期均指公告作出决定正式对外公告之日；新任或成立基金基金经理的，任日期自基金合同生效日。
2. 证券从业的合文遵照行业协会关于从业人员资格管理的相关规定。
3. 报告期末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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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，因市场波动导致报告期内本基金投资组合不符合基金合同约定的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，不存在违反基金合同约定的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、分配等环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，本基金未发生法律法规及中国证监会规定的异常交易行为。报告期内未发生基金管理人管理的不同投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易超过证券当日交易额的规定的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
三季度债市行情出现分化，信用债价格上涨，利率债区间波动。三季度信用债收益率整体大幅回落，资本回报率或超预期。在债市的配合上，我们加大高等级信用债为主，从而使得组合在第三季度债市大幅回落下表现较好，并在7月上旬转债行情启动叠加中等级信用债持仓，使得净值表现良好。

2018年三季度鹏华实业债纯债债券型证券投资基金净值增长率为1.94%。
4.6 报告期末基金持有人户数或基金份额报告期末报告期末，本基金存在连续六十个工作日出现基金份额净值低于五元的情形，本基金管理人已公告召开持有人大会审议基金转型事项。

5 投资组合报告

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	26,620,134.20	99.06
3	应收利息	20,400,134.20	74.80
4	银行存款	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	-	-
7	存拆出款项	-	-
8	其他	-	-
9	合计	47,020,268.40	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,798,460.00	2.87
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-
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	金融业	60,910.00	0.10
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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		1,798,460.00	2.87

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
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
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	地方政府债	3,701,622.00	6.56
4	企业债	2,762,622.00	4.96
5	公司债	20,947,890.20	38.33
6	金融债	1,518,160.00	2.72
7	中期票据	3,061,040.00	5.50
8	资产支持证券	721,612.00	1.29
9	可转债	-	-
10	其他	-	-
合计		20,400,134.20	36.96

6.6 报告期末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	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.6 报告期末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	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180005	18国债05	20,000	2,091,300.00	4.73
2	180004	18国债04	20,000	1,558,200.00	3.47
3	041702049	广汇汇通(资产支持)	15,000	1,518,160.00	3.43
4	101700003	17国债03	15,000	1,510,460.00	3.42
5	120804	12国债04	15,070	1,341,440.00	3.03

6.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
6.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。
6.10.6 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之和与合计项之间可能存在尾差。
5 开放式基金净值变动

项目	鹏华实业债	鹏华新债分级	鹏华新债B
报告期末基金份额总额	16,000,852.00	-	-
报告期末基金份额总额	16,344,219.00	-	-
减:报告期末基金份额总额	964,767.53	-	-
报告期末基金份额总额	-	-	-
报告期末基金份额总额	-	-	-