

鹏华丰华债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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。

4.2 管理人对于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 公平交易制度的执行情况 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有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易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 2018年三季度我国债券市场震荡走弱，与上季度末相比，上证指数涨幅0.89%，银行间中债综合财富指数上涨1.48%。季初资金面宽松，以NCND为代表的短端利率快速下行，并带动中长期利率整体下行；7月中下旬开始，在央行鼓励金融机构购买信用债、资管新规细则落地、国常会提出支持融资平台合理融资需求等“宽信用”政策背景下，信用债利率整体显著下行，信用利差有所收窄；但受“稳增长”和通胀预期、地方债供给放量等因素影响，中长期利率走势较为纠结，季末10年期国债利率较上季末抬升13bp。

4.5 报告期内基金的业绩表现 2018年三季度本基金份额净值增长率为0.78%，同期业绩基准增长率为1.00%。 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 注：无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%). Rows include 权益投资, 其中: 股票, 基金投资, 固定收益投资, 其中: 国债, 金融债, 企业债, 可转债, 资产支持证券, 衍生品投资, 买入返售金融资产, 货币资金, 其他资产.

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

Table with 4 columns: 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(%).

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

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

5.4.1 国债投资 5.4.2 央行票据 5.4.3 金融债 5.4.4 企业债 5.4.5 可转债 5.4.6 资产支持证券 5.4.7 其他品种

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 注：无。

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 本期国债期货投资策略 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.9.3 本期国债期货投资评价 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

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

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

5.4.1 国债投资 5.4.2 央行票据 5.4.3 金融债 5.4.4 企业债 5.4.5 可转债 5.4.6 资产支持证券 5.4.7 其他品种

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 注：无。

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 本期国债期货投资策略 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.9.3 本期国债期货投资评价 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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(人民币元).

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 注：无。 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

Table with 2 columns: 项目, 鹏华丰华债券型证券投资基金.

§ 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

Table with 2 columns: 投资者类别, 鹏华丰华债券型证券投资基金.

基金管理人持有的基金份额占报告期内期末基金份额总额的比例不超过20%。 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分拆份额。 8.2 影响投资者决策的其他重要信息 注：无。

§ 9 备查文件目录 9.1 备查文件目录 (一)《鹏华丰华债券型证券投资基金基金合同》； (二)《鹏华丰华债券型证券投资基金托管协议》； (三)《鹏华丰华债券型证券投资基金2018年第三季度报告》(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。投资者对本报告如有疑问，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：4006788899。 鹏华基金管理有限公司 2018年10月26日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司 基金托管人:招商银行股份有限公司 报告送出日期:2018年10月26日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司 基金托管人:招商银行股份有限公司 报告送出日期:20