鹏华普天债券证券投资基金

2018年第四季度报告

2018年12月31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01月21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01月18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2018年10月01日起至12月31日。

§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	鹏华债券
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	1,645,373,495.37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组形成投资策略,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	1,146,065,375.49份	499,308,119.88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(2018年10月01日－2018年12月31日)	
	鹏华普天债券A	鹏华普天债券B
1.本期已实现收益	15,467,112.38	4,153,142.67
2.本期利润	23,744,233.52	5,610,392.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0301	0.0233
4.期末基金资产净值	1,448,338,763.85	612,741,967.92
5.期末基金份额净值	1.264	1.227

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	2.69%	0.06%	2.57%	0.05%	0.12%	0.01%

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	2.58%	0.06%	2.57%	0.05%	0.01%	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	-	5年	刘涛先生,国籍中国,理学硕士,5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。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06月担任鹏华丰融定期开放债券基金基金经理,2016年11月担任鹏华丰禄债券基金基金经理,2017年02月至2018年06月担任鹏华丰达债券基金基金经理,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月担任鹏华丰鹏债券基金基金经理,2017年02月担任鹏华丰恒债券基金基金经理,2017年06月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理,2017年06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。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

四季度债市震荡上涨。通过央行降准, 四季度以来利率债收益率整体快速回落,金融债表现相对较好,资本利得贡献高收益。在债券的配置上,我们以中高等级信用债为主,从而使得组合净值在12月上中旬债市整体调整的情况下表现稳健, 并且在10月中旬至12月初抓住时机适当加仓长端利率债券,使得净值表现相对较佳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内普天债券A组合净值增长率2.69%, 业绩比较基准增长率2.57%;普天债券B组合净值增长率为2.58%,业绩比较基准增长率2.57%。同期上证综指涨跌幅为-11.6063%,深证成指涨跌幅为-13.8232%,沪深300指数涨跌幅为-12.4521%。

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	2,318,044,413.80	88.48
	其中:债券	2,318,044,413.80	88.48
	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	196,924,915.89	7.52
	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	50,571,290.32	1.93
8	其他资产	54,322,143.17	2.07
9	合计	2,619,862,763.18	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	298,814,801.40	14.50
	其中:政策性金融债	288,872,801.40	14.02
4	企业债券	1,534,414,572.40	74.45
5	企业短期融资券	154,517,150.00	7.50
6	中期票据	329,050,250.00	15.96
7	可转债(可交换债)	1,247,640.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,318,044,413.80	112.47

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	180210	18国开10	900,000	92,817,000.00	4.50
2	127313	15东丽投	1,140,000	89,205,000.00	4.33
3	108901	农发1801	705,000	70,507,050.00	3.42
4	1880230	18玉环债01	700,000	70,252,000.00	3.41
5	152053	18吴中债	690,000	69,000,000.00	3.35

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	53,583.98
2	应收证券清算款	3,258,769.71
3	应收股利	-
4	应收利息	38,644,560.62
5	应收申购款	12,365,228.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,322,143.17

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

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	613,297,656.29	89,384,464.98
报告期期间基金总申购份额	543,971,700.72	592,297,621.04
减:报告期期间基金总赎回份额	11,203,981.52	182,373,966.14
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	1,146,065,375.49	499,308,119.88

§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(%)	3.04	-

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

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	20181001-20181127	215,032,260.22	1,073,457.40	-	216,105,717.62	13.13	
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实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。

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2018年第4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)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01月21日

鹏华金元宝货币市场基金

2018年第四季度报告

2018年12月31日

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年01月21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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年01月18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2018年10月01日起至12月31日。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华金元宝货币
场内简称	-
基金主代码	004776
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年06月16日
报告期末基金份额总额	33,766,103,511.12份
投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金将综合宏观经济运行状况,货币政策、财政政策等政府宏观经济状况及政策,分析资本市场资金供给状况的变动趋势,预测市场利率水平变动趋势。在此基础上,综合考虑各类投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况,进行积极的投资组合管理。1、久期策略 结合宏观经济运行态势及利率预期分析,本基金将动态确定并调整基金组合平均剩余期限。预测利率将进入下降通道时,适当延长投资品种的平均期限;预测市场利率将进入上升通道时,适当缩短投资品种的平均期限。2、类属配置策略 在保证流动性的前提下,根据各类货币市场工具的市场规模、信用等级、流动性、市场供求、票息及付息频率等确定不同类别资产的具体配置比例。3、套利策略 本基金根据对货币市场变动趋势、各市场机品种之间的风险收益差异的充分研究和论证,适当进行跨市场或跨品种套利操作,力争提高资产收益率,具体策略包括跨市场套利和跨期限套利等。4、现金管理策略 本基金作为现金管理工具,具有较高的流动性要求,本基金按根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测,通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效分配基金的现金流,在保持充分流动性的基础上争取较高收益。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
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

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(2018年10月01日－2018年12月31日)
1.本期已实现收益	293,688,855.42
2.本期利润	293,688,855.42
3.期末基金资产净值	33,766,103,511.12

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.7845%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.6963%	0.0010%

注:业绩比较基准=活期存款利率(税后)

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 2017年06月16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。

§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		
叶朝明	本基金基金经理	2017-06-16	-	10年	叶朝明先生,国籍中国,工商管理硕士,10年证券基金从业经验。曾任职于招商银行总行,从事本外币资金管理相关工作;2014年1月加盟鹏华基金管理有限公司,从事货币基金管理工作,现担任固定收益部副总经理、基金经理。2014年02月担任鹏华增值宝货币基金基金经理,2015年01月担任鹏华安盈宝货币基金基金经理,2015年07月担任鹏华添利宝货币基金基金经理,2016年01月担任鹏华添利基金基金经理,2017年06月担任鹏华聚财通货币基金基金经理,2017年06月担任鹏华盈余宝货币基金基金经理,2017年06月担任鹏华金元宝货币基金基金经理,2018年06月担任鹏华弘泰混合基金基金经理,2018年09月担任鹏华兴鑫宝货币基金基金经理,2018年09月担任鹏华货币基金基金经理,2018年11月担任鹏华弘泽混合基金基金经理,2018年12月担任鹏华弘康混合基金基金经理。叶朝明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

2018年四季度以来,国内需求端持续疲软,出口增速下行压力增大,经济延续下行趋势;11月CPI与PPI同比增速有所下降,整体通胀风险可控。货币政策更加关注内部均衡,基调保持稳健,流动性合理充裕。央行政策注重宽货币向宽信用的传导,创设定向中期借贷便利(TMLF),进一步支持实体经济。12月美联储确定加息,但下调2019年加息次数预期,货币政策受到的外部掣肘正在减弱。年末时点银行间流动性分层现象仍然存在,资金利率出现时点性波动,四季度银行间 7天质押式回购加权利率均值为2.83%,比三季度上升16BP。

2018年四季度,除半年内资产收益率随资金面有所波动外,债券市场收益率整体有所下行。短端收益率下行幅度不及长端,收益率曲线变平。其中,1年期国开债收益率下行33BP ,1年期AA+短融收益率下行13BP。受跨年资金面波动影响,3个月期限同业存单收益率高点出现在12月底,较三季度末明显上行。

基于对经济基本面、货币政策及资金面的预判,本基金四季度适度拉长组合的剩余期限,维持一定的杠杆水平,在类属配置方面以存单及银行存款为主,并把握季末等资金紧张时期,配置收益率较高的短期资产,在保证组合良好流动性的基础上,提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内净值增长率为0.7845%,业绩比较基准增长率0.0882%。同期上证综指涨跌幅为-11.6063%,深证成指涨跌幅为-13.8232%,沪深300指数涨跌幅为-12.4521%。

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	固定收益投资	23,079,467,305.73	60.90
	其中:债券	22,999,467,305.73	60.69
	资产支持证券	80,000,000.00	0.21
2	买入返售金融资产	7,186,198,039.28	18.96
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	7,540,692,103.16	19.90
4	其他资产	90,555,580.33	0.24
5	合计	37,896,913,028.50	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.37	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	4,103,594,535.07	12.15
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:无。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	97
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	22.85	12.15
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	18.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	39.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天 (含)—397天(含)	28.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		111.97	12.15

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	99,772,725.62	0.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,702,758,634.44	5.04
	其中:政策性金融债	1,702,758,634.44	5.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	21,196,935,945.67	62.78
8	其他	-	-
9	合计	22,999,467,305.73	68.11
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111815473	18民生银行CD473	20,000,000	1,986,309,156.99	5.88
2	111804095	18中国银行CD095	16,000,000	1,590,111,405.09	4.71
3	111820227	18广发银行CD227	15,000,000	1,492,424,164.26	4.42
4	111808330	18中信银行CD330	15,000,000	1,488,018,173.34	4.41
5	111818347	18华夏银行CD347	14,000,000	1,392,930,715.02	4.13
6	111809276	18浦发银行CD276	10,800,000	1,072,580,807.52	3.18
7	111810616	18兴业银行CD616	10,000,000	992,218,496.07	2.94
8	111818360	18华夏银行CD360	8,000,000	795,056,069.67	2.35
9	111810569	18兴业银行CD569	7,000,000	696,465,151.42	2.06
10	111815625	18民生银行CD625	7,000,000	695,674,175.79	2.06

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0418%
报告期内偏离度的最低值	-0.0491%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0226%

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	139183	蚁信05A	800,000	80,000,000.00	0.24

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

(1)基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际协议利率逐日计提利息;

(2)基金持有的回购协议(封闭式回购)以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;

(3)基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(4)基金持有的买断式回购以协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时,若双方都能履约,则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产,实际持有的相关资产按其性质进行估值;

(5)基金持有的资产支持证券视同债券,购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

5.8.2 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明

浦发银行 2018年1月19日, 上海浦东发展银行股份有限公司 (以下简称"公司")成都分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局(以下简称"银监会四川监管局")行政处罚决定书(川银监罚字【2018】2号),公司就相关事项公告如下:

一、行政处罚的主要内容

2018年1月18日,银监会四川监管局对公司成都分行作出行政处罚决定,对成都分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处,执行罚款46,175万元人民币。此外,对成都分行原行长、2名副行长、1名部门负责人和1名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高级管理人员任职资格、警告及罚款。对此,公司坚决支持和接受监管机构的上述处罚决定,并深表歉意。

二、公司相关情况说明

针对成都分行上述违规经营事项,公司高度重视,在监管机构和地方政府的指导和帮助下,及时调整了成都分行经营班子,并对资产状况进行了全面评估,分类施策、强化管理,按照审慎原则计提风险拨备,稳妥有序化解风险。目前,成都分行已按监管要求完成了整改,总体风险可控,客户权益未受影响,经营管理迈入正轨。

在此基础上,公司在全行范围内认真开展举一反三教育整改工作,深刻反思,统一思想,吸取教训;端正全行经营理念,更加关注安全性、流动性和效益性的平衡发展,强化统一法人管理;将防范和化解金融风险放在更加突出的位置,强化合规内控体制机制建设,着重提升内控执行力和有效性,确保全行依法合规、稳健发展。

公司将认真贯彻落实党的十九大精神和全国金融工作会议、中央经济工作会议要求,积极服务实体经济,有效防控经营风险;坚持"回归本源、突出主业、做精专业、协调发展",为供给侧结构性改革和广大客户提供更加优质的服务,努力为股东创造更大的价值,以良好的经营成果回报社会各界的关心和支持。

三、不构成重大不利影响

上述处罚金额已全额计入2017年度公司损益, 对公司的业务开展及持续经营无重大不利影响。

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,认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	88,291,689.24
4	应收申购款	2,263,891.09
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	90,555,580.33

5.8.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、本基金的投资决策流程主要包括:久期决策、期限结构策略、类属配置策略和个券选择策略。其中久期区间决策由投资决策委员会负责制定,基金经理在设定的区间内根据市场情况自行调整; 期限结构配置和类属配置决策由固定收益小组讨论确定,由基金经理实施该决策并选择相应的个券进行投资。 2、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

报告期期初基金份额总额	39,399,884,742.95
报告期期间基金总申购份额	13,220,322,389.05
减:报告期期间基金总赎回份额	18,854,103,620.88
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	33,766,103,511.12

§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)《鹏华金元宝货币市场基金基金合同》;

(二)《鹏华金元宝货币市场基金托管协议》;

(三)《鹏华金元宝货币市场基金2018年第4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)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01月21日

鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

2018年12月31日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2019年01月21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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年01月18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2018年10月01日起至12月31日。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华品牌传承混合
场内简称	-
基金主代码	000431
交易代码	000431
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年01月28日
报告期末基金份额总额	75,729,765.22份
投资目标	通过积极灵活的资产配置,并精选优质的品牌类上市公司,在有效控制风险前提下,力求超越业绩比较基准的投资