

鹏华双债保利债券型证券投资基金

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：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2019年01月21日

基金管理人员对本基金的管理费、托管费不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的内容的真实性、准确性、完整性进行承诺并承担法律责任。

基金托管人对上海银行股份有限公司本基金的定期报告、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。

本报告期自2018年10月01日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称 鹏华双债保利债券

场内简称 -

基金主代码 000938

前缀交易代码 -

基金运作方式 约定契约开放式

基金合同期生效日 2013年09月18日

报告期末基金份额总额 56,363,825,239份

注：1. 本基金基金合同于 2013年09月18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

§ 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 在本基金的任职期间 证券从业年限 说明

刘太平 基金经理 2016-08-04 - 12 刘太平先生，国籍中国，理学硕士，12 年证券投资基金管理经验。曾任中国农业银行总行资金部交易员，中国建设银行总行资金部交易员，2011年5月加盟鹏华基金管理有限公司，从事证券投资研究工作，担任基金经理助理职务。2012 年9月起任鹏华产业债债券型证券投资基金基金经理，2013年1月起任鹏华双债保利债券型证券投资基金基金经理，2013年6月起任鹏华双债添利债券型证券投资基金基金经理，2014年1月起任鹏华双债增利债券型证券投资基金基金经理，2014年6月起任鹏华双债债券型证券投资基金基金经理，2015年1月起任鹏华双债增强债券型证券投资基金基金经理，2015年6月起任鹏华双债债券型证券投资基金基金经理，2016年1月起任鹏华双债增利债券型证券投资基金基金经理，2016年6月起任鹏华双债债券型证券投资基金基金经理，2016年12月起任鹏华双债增利债券型证券投资基金基金经理，2017年6月起任鹏华双债债券型证券投资基金基金经理，2017年12月起任鹏华双债增利债券型证券投资基金基金经理，2018年6月起任鹏华双债债券型证券投资基金基金经理，2018年12月起任鹏华双债增利债券型证券投资基金基金经理，2019年1月起任鹏华双债债券型证券投资基金基金经理，2019年6月起任鹏华双债增利债券型证券投资基金基金经理，2019年12月起任鹏华双债债券型证券投资基金基金经理。

注：1. 本基金的原基金经理刘太平因个人原因辞职，由刘太平先生接替其基金经理职务，刘太平先生接替后，本基金的基金经理变更为刘太平先生和刘太平。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时所发生的费用（例如，开放式基金的申购费用、基金转换费用等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.22 基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1.任期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。

3.2.2 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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 管理人对报告期内基金运用于遵守销售机构的有关规定。

报告期间内，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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

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.本期实现收益 966,721.25

2.本期利润 1,035,612.50

3.加权平均基金份额本期利润 0.0182

4.期末基金资产净值 62,677,496.60

5.期末基金份额净值 1.1120

注：1. 本期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申购基金时所发生的费用（例如，开放式基金的申购费用、基金转换费用等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.22 基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1. 任期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。

3.2.2 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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 管理人对报告期内基金运用于遵守销售机构的有关规定。

报告期间内，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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

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.本期实现收益 -6,307,266.40

2.本期利润 -19,376,069.07

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0395

4.期末基金资产净值 156,291,240.31

5.期末基金份额净值 0.8133

注：1. 本期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申购基金时所发生的费用（例如，开放式基金的申购费用、基金转换费用等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.22 基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1. 任期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。

3.2.2 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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 管理人对报告期内基金运用于遵守销售机构的有关规定。

报告期间内，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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

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.本期实现收益 -1,336,019.00

2.本期利润 -4,794,413.40

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0385

4.期末基金资产净值 98,466,826.12

5.期末基金份额净值 1.006

注：1. 本期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申购基金时所发生的费用（例如，开放式基金的申购费用、基金转换费用等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.22 基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1. 任期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。

3.2.2 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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 管理人对报告期内基金运用于遵守销售机构的有关规定。

报告期间内，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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

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.本期实现收益 -1,326,400.00

2.本期利润 -4,784,413.40

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0385

4.期末基金资产净值 98,466,826.12

5.期末基金份额净值 1.006

注：1. 本期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申购基金时所发生的费用（例如，开放式基金的申购费用、基金转换费用等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.22 基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1. 任期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。

3.2.2 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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 管理人对报告期内基金运用于遵守销售机构的有关规定。

报告期间内，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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

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.本期实现收益 -1,326,400.00

2.本期利润 -4,784,413.40

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0385

4.期末基金资产净值 98,466,826.12

5.期末基金份额净值 1.006

注：1. 本期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申购基金时所发生的费用（例如，开放式基金的申购费用、基金转换费用等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.22 基金合同生效以来基金累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1. 任期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。

3.2.2 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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 管理人对报告期内基金运用于遵守销售机构的有关规定。

报告期间内，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用基金资产，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

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.本期实现收益 -1,326,400.00

2.本期利润 -4,784,413.40

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0385

4.期末基金资产净值 98,466,826.12

5.期末基金份额净值 1.006

注：1. 本期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申购基金时所发生的费用（例如，开放式基金的申购费用、基金转换费用等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。