鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

(原鹏华实业债纯债债券型证券投资基金)

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
送出日期:2019年03月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本基金由鹏华实业债纯债债券型证券投资基金经2018年04月28日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予鹏华实业债纯债债券型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2018]771号文)变更注册而来。根据2018年12月19日发布的《鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金基金合同生效暨首个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告》,鹏华实业债纯债债券型证券投资基金转型成为鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金,《鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》及《鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》自2018年12月19日起生效。转型后的基金投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。

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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告中,原鹏华实业债纯债债券型证券投资基金报告期自2018年01月01日至2018年12月18日止,鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金报告期自2018年10月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	鹏华永诚一年定期开放债券
基金主代码	000053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月19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
报告期末基金份额总额	212,314,836.89份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	鹏华实业债纯债债券
基金主代码	000053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月3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
报告期末基金份额总额	104,674,918.98份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	在严格控制风险的基础上,通过定期开放的形式保持适度流动性,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金债券投资将主要采取久期策略,同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在严格控制风险的基础上,通过定期开放的形式保持适度流动性,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。1.资产配置策略 在资产配置方面,本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种,及债券与现金类资产之间进行动态调整。2.久期策略 本基金将主要采取久期策略,通过自上而下的组合久期管理策略,以实现对组合利率风险的严格控制。为控制风险,本基金采用以“目标久期”为中心的资产配置方式。目标久期的设定划分为两个层次:战略性配置和战术性配置。“目标久期”的战略性配置由投资决策委员会确定,主要根据对宏观经济和资本市场的预期分析决定组合的目标久期。“目标久期”的战术性配置由基金经理根据市场短期因素的影响在战略性配置预先设定的范围内进行调整。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,直至接近目标久期上限,以较多地获得债券价格上升带来的收益;反之,如果预期利率上升,本基金将缩短组合的久期,直至目标久期下限,以减小债券价格下降带来的风险。3.收益率曲线策略 收益率曲线变化是判断市场整体走向的依据之一,本基金将根此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测,适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合,并进行动态调整。4.骑乘策略 本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析,在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下,随着其剩余期限的衰减,债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅的下滑,从而获得较高的资本收益;即使收益率曲线上升或进一步变陡,这一策略也能够提供更多的安全边际。5.息差策略 本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得的资金投资于债券,利用杠杆放大债券投资的收益。6.债券选择策略 根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素,确定其投资价值。(7)资产支持证券等品种投资策略 资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。(8)中小企业私募债券 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让,约定在一定期限还本付息的公司债券。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况,合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况,尽力规避可能存在的债券违约,并获取超额收益。本基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

业绩比较基准	中债总指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,为证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金年度报告备置地点	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年12月19日(基金合同生效日)-2018年12月31日
本期已实现收益	292,784.94
本期利润	616,714.69
加权平均基金份额本期利润	0.0039
本期基金份额净值增长率	0.34%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末
期末可供分配基金份额利润	0.2414
期末基金资产净值	213,031,041.56
期末基金份额净值	1.0034

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)表中的“期末”均指报告期最后一日,即12月31日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4)本基金基金合同于2018年12月19日生效,至2018年12月31日未满一年,故2018年的数据和指标为非完整会计年度数据。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年01月01日-2018年12月18日	2017年	2016年
本期已实现收益	1,410,150.98	-8,427,492.81	62,901.92
本期利润	4,073,500.84	-71,182.25	-9,302,077.89
加权平均基金份额本期利润	0.1504	-0.0007	-0.1122
本期基金份额净值增长率	9.79%	-1.74%	-7.43%
3.1.2 期末数据和指标	2018年12月18日	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.2396	0.3005	0.3478
期末基金资产净值	104,674,919.20	23,387,331.36	226,535,563.98
期末基金份额净值	1.0000	1.3244	1.3478

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)转型前基金本报告期自2018年1月1日起至2018年12月18日止。

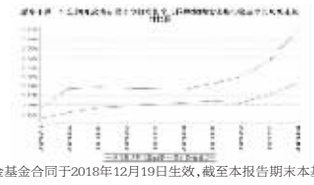
3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 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

阶段	份额净值增长率① (%)	份额净值增长率标准差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 (%)
自基金成立起至今	0.34	0.04	0.80	0.09	-0.46	-0.05

注:业绩比较基准=中债总指数收益率

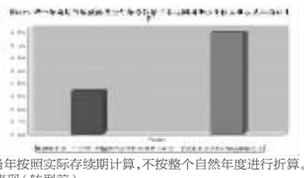
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同于2018年12月19日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 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

阶段	份额净值增长率① (%)	份额净值增长率标准差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	3.41	0.14	2.40	0.04	1.01	0.10
过去六个月	6.03	0.10	4.38	0.05	1.65	0.05
过去一年	9.79	0.10	7.89	0.06	1.90	0.04
过去三年	-0.14	0.17	11.81	0.08	-11.95	0.09
过去五年	51.00	0.45	37.69	0.09	13.31	0.36
自基金成立起至今	46.77	0.43	34.93	0.09	11.84	0.34

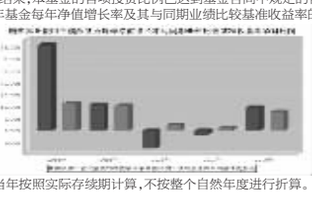
注:业绩比较基准=中债企业债总指数×80%+中债国债总指数×20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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2013年5月3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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况(转型后)

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况(转型前)

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日,业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末,公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成,公司性质为中外合资企业。公司原注册资本8,000万元人民币,后于2001年9月完成增资扩股,增至15,000万元人民币。截至2018年12月,公司管理资产总规模达到5,164.62亿元,管理146只公募基金、10只全国社保投资组合、4只基本养老保险投资组合。经过20年投资管理基金,在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型后)

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘太阳	本基金基金经理	2013-05-03	2019-01-25	12	刘太阳先生,国籍中国,理学硕士,12年证券基金从业经验。曾任中国农业银行金融市场部高级交易员,从事债券投资交易工作;2011年5月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券研究工作,担任固定收益部债券研究员。2016年06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月担任鹏华丰腾债券基金基金经理,2017年02月担任鹏华丰恒债券基金基金经理,2017年05月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理,2017年05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。刘海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。
刘海	本基金基金经理	2018-03-28	2018-12-19	5	刘海先生,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06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月担任鹏华丰腾债券基金基金经理,2017年02月担任鹏华丰恒债券基金基金经理,2017年05月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理,2017年05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。刘海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。

4.2 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利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》,将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理,在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动,建立对公平交易的执行、监督及审核流程,严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节:1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”,确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;2.公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》,执行股票及信用产品出入库及日常维护工作,确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据;3.在公司股票库基础上,各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和功能范关联交易的原则分别建立资产组合股票库,基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合;4.严格执行投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分,合理确定 基金经理的投资权限,超过投资权限的操作,应严格履行审批程序。在交易执行环节:1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成,集中交易室负责建立和执行交易分配制度, 确保各投资组合享有公平的交易执行机会;2.针对交易所公开竞价交易,集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序,交易系统则自动启用公平交易功能,由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配;如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易,且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时,交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托;当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时,则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式,进行公平委托和交易量分配;3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行;银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易, 各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行,对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节:1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理,杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为,防范日常交易风险,公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制;所监控的交易包括但不限于:交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等;2.将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容,发现的异常情况由投资监察员进行分析;3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》,内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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。同时,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年债市整体上涨。全年资金面宽松,叠加大宗商品价格逐步回落、经济逐步下行和通胀预期下行等因素,债市出现明显上涨,收益率不断下行。在债券的配置上,我们以中等偏长期中高等级信用债为主,从而使得组合净值在全年债市上涨的情况下表现良好,并且在1月底和9月中下旬逐步抄底长端利率债、在4月下旬和12月中上旬兑现收益,使得净值表现相对较佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018年鹏华实业债组合净值增长率9.79%,同期业绩基准增长率为7.89%。鹏华永诚一年定期开放债组合净值增长率0.34%,业绩比较基准增长率0.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年经济增速可能呈稳中逐级下降的态势,年内增速走势可能前低后高。总需求方面:第一、消费预计维持稳定;第二、出口可能因中美贸易摩擦极而未决以及前期人民币实际有效汇率的升值而存在压力,对经济形成制约;第三、投资方面,制造业投资增速有望因企业利润改善的滞后效应及更新需求而总体保持稳定,房地产投资增速大概率因调控政策持续而有所下滑,基建投资增速则可能因地方政府的约束性文件出台及监管加强等因素影响而有所放缓。总体而言,考虑到供给侧改革持续推进后,房地产市场、周期性行业的供需平衡已有明显改善,预计,今年实体经济增速的下滑总体处于稳中略降、降幅可控的态势。

债券市场方面,预计债市在当前仍面临一些不利因素,但可能在年内保持温和牛市。一方面,金融监管政策大概率会继续稳步推进,在此情况下,银行表内与理财以及非银机构的投资行为仍会经历一段调整期,从而对债市配置力量形成制约。另一方面,随着监管政策的不断落地,前期不规范、高收益的金融产品会逐步淡出市场,资金逐步回归规范化的金融产品,并且在金融监管政策基本落地后,金融体系加杠杆行为会被抑制,央行中性偏松的货币政策亦有望持续保持,因此,当金融监管政策落地、金融体系调整进入后期时,利率水平有望持续震荡回落。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1)日常估值流程

基金的估值由基金会计负责,基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体,独立建账、独立核算,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理;每日按时接收成交数据及权益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式,每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对;每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外,还设有基金会计复核岗位,负责基金会计核算的日常事后复核工作,确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格,在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

(2)特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定,本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组,成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论,发表相关意见和建议,与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末,本基金期末可供分配利润为51,257,232.40元,期末基金份额净值1.0034元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定,本基金管理人将会综合考虑各方面因素,在严格遵守规定前提下,对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告(转型后)

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§6 审计报告(转型前)

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表

会计主体:鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产		本期末 2018年12月31日
资产:		
银行存款		547,457.07
结算备付金		866,532.60
存出保证金		3,515.82
交易性金融资产		240,359,310.10
其中:股票投资		-
基金投资		-
债券投资		240,359,310.10
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		100,000.00
应收证券清算款		-
应收利息		4,835,783.09
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		246,712,598.68
负债和所有者权益		本期末 2018年12月31日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		33,400,000.00
应付证券清算款		43,312.19
应付赎回款		-
应付管理人报酬		34,949.46
应付托管费		17,423.05
应付销售服务费		-
应付交易费用		3,808.25
应交税费		20,826.60
应付利息		-8,662.43
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		169,900.00
负债合计		33,681,557.12
所有者权益:		
实收基金		146,019,146.48
未分配利润		67,011,895.08
所有者权益合计		213,031,041.56
负债和所有者权益总计		246,712,598.68

注:(1)报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0034元,基金份额总额212,314,836.89份。

(2)本基金合同于2018年12月19日生效,无上年度数据。

7.2 利润表

会计主体:鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2018年12月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年12月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
一、收入		695,359.30
1.利息收入		324,082.46
其中:存款利息收入		17,079.67
债券利息收入		306,378.38
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		624.41
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		22,356.22
其中:股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		22,356.22
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		323,929.75
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		24,990.87
减:二、费用		78,644.61
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	17,629.85
2. 托管费	7.4.8.2.2	5,876.62
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-
4. 交易费用		1,957.18
5. 利息支出		61,263.29
其中:卖出回购金融资产支出		61,263.29
6. 税金及附加		1,066.82
7. 其他费用		-9,149.15
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		616,714.69
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		616,714.69

注:(1)报告实际编制期间为2018年12月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

(2)本基金基金合同于2018年12月19日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2018年12月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年12月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	71,991,008.87	32,683,910.33	104,674,919.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	616,714.69	616,714.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	74,028,137.61	33,711,270.06	107,739,407.67
其中:1.基金申购款	77,183,603.83	35,146,226.94	112,329,830.77
2.基金赎回款	-3,155,466.22	-1,434,956.88	-4,590,423.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	146,019,146.48	67,011,895.08	213,031,041.56

注:(1)报告实际编制期间为2018年12月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

(2)本基金基金合同于2018年12月19日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1	至7.4财务报表由下列负责人签署:	
邓召明	苏波	郝文高
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华实业债纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2013]98号文《关于核准鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规的规定以及和《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金合同》的约定负责公开募集设立。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资报告予以验证,本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,316,026,519.96元。经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第194号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金合同》本基金合同已于2013年5月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,317,313,904.29份。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。基金份额,其中认购资金利息折合1,287,384.33份基金份额。鹏华实业债纯债债券型证券投资基金于2018年10月24日至2018年11月18日以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于鹏华实业债纯债债券型证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》,同意将鹏华实业债纯债债券型证券投资基金转型为鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金。根据《鹏华基金管理有限公司关于鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》及《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金基金份额折算和变更登记结果的公告》,本基金于自2018年12月18日起进行基金份额拆分,拆分比例为1.45399989,并与2018年12月19日进行了变更登记。

2018年10月24日至2018年11月18日,鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会已通过通讯方式召开,大会审议通过了《关于鹏华实业债纯债债券型证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》,上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自2019年12月19日起,基金名称由“鹏华实业债纯债债券型证券投资基金”变更为“鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金”。转型后本基金由“开放式基金”变更为“一年定期开放基金”。自《鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效,原《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金合同》失效。与此同时,鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金合同失效前的基金资产净值104,674,919.20元,于本基金基金合同生效时全部转为本基金的期初基金资产净值。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。《鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、公开发行的次级债、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:对债券的投资比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期前一个月(首个开放期除外)、开放期内及开放期结束后一个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;开放期内现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%;对实业债的投资比例不低于固定收益类资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金转型后的业绩比较基准为:中债总指数收益率。本基金的业绩比较基准为:中债企业债总指数。

本财务报表由本基