

B123

					李振宇先生，国籍中国，经济学硕士，7年证券基金从业经验，曾任恒华基金管理
--	--	--	--	--	--------------------------------------

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	债券投资	--	--
3	固定收益投资	49,462,800.00	92.79
	其中:债券	49,462,800.00	92.79
	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	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和拆借支付金合计	1,908,025.72	3.58
8	其他资产	1,833,724.97	3.63
9	合计	53,304,550.69	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股票投资组合

注:无。

5.2.3 报告期末按行业分类的贵金属投资比例大排序的前十名贵金属明细

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	49,462,800.00	93.38
	其中:政策性金融债	49,462,800.00	93.38
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转换债(可交换债)	--	--
8	资产支持证券	--	--
9	其他	49,462,800.00	93.38
10	合计	49,462,800.00	93.38

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	120221	12国债(21)	290,000	29,034,800.00	54.81
2	180208	18国债(8)	200,000	20,426,000.00	38.56

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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

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

注:本基金基金合同约定的投资范围均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:本基金基金合同约定的投资范围均未包含国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金基金合同约定的投资范围均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生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、处罚的情况。

5.10.2

本基金投资的前十名证券中有卖出基金合同约定规定的证券选择券。			
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	—	
2	应收证券清算款	—	
3	应收股利	—	
4	应收利息	1,933,724.97	
5	应收申购款	—	
6	其他应收款	—	
7	待摊费用	—	
8	其他	—	
9	合计	1,933,724.97	

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本重要部分

由于四舍五入的原因，投资组合持仓中数字与分母之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金投资变动

报告期间期初基金总额	50,101,707.02
报告期间赎回基金已申购的份额	8.42
减：报告期间赎回基金已赎回的份额	5,260.04
报告期间赎回基金分摊总费用（份额减少—系列）	—
报告期间期末基金总额	50,096,476.56

单位：元

§ 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

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

投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况		报告期末持有基金份额	
投资者序号	持有基金份额的投资者超过20%的时间区间	期初份额	期初份额
机构1	20190101-20190331	50,000,000.00	—
个人	—	—	50,000,000.00

产品运作风险

基金份额持有人持有的基金份额所占比列于下表中时，可能会因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，基金管理人无法及时变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、申购赎回包含基金申购份额、基金赎回份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投资；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换转出份额、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

注：无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)《鹏华非保本货币型证券投资基金基金合同》；

(二)《鹏华非保本货币型证券投资基金托管协议》；

(三)《鹏华非保本货币型证券投资基金2019年第1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

投资者可至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。

投资者对本报告有任何疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，或拨打客户服务热线，咨询电话：4008878889。

4.3 公平交易专项说明

基金

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	67,727,300.00	6.41
	其中:政策性金融债	67,727,300.00	6.41
4	企业债	9,779,000.00	0.97
5	企业短期融资券	116,168,000.00	10.99
6	中期票据	823,521,500.00	77.89
7	可转换债(可交换债)	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,027,196,400.00	97.15

5.5 报告期末按公允价值、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	101800008	18宏城债 MTN001	750,000	770,017,000.00	7.37
2	101800026	18川铁债 MTN002	700,000	73,332,000.00	6.94
3	101800379	18国盛泰 MTN003	700,000	70,406,000.00	6.66
4	101660083	15吉林高速 MTN004	600,000	60,282,000.00	5.70
5	101800811	18大普集 MTN002	550,000	56,034,000.00	5.30

5.6 报告期末按公允价值、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	116879	信惠债3	50,000	5,006,962.06	0.47

注:以上为以本基金持有的金融资产支持证券情况。

5.7 报告期末按公允价值、基金资产净值比例大小排序的前五名金融负债投资明细

注:无。

5.8 报告期末按公允价值、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股指期货交易情况说明

5.9.1 本期股指期货投资政策

注:本基金基金合同约定的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同约定的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9.3 本期股指期货投资评价

注:本基金基金合同约定的投资范围尚未包含股指期货投资。

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约定的证券选择库。

5.10.3 特殊品种构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	55,279,452.06
3	应收股利	-
4	应收利息	27,698,304.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	预缴费用	-
8	其他	-
9	合计	82,977,756.26

5.10.4 报告期末持有的处于转股期可转换债券明细
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本描述或说明
由于四舍五入的原因，投资组合中资产公允价值之和与合计数之间可能存在误差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：元

报告期期初基金份额总额	1,004,387,589.68
报告期内基金已申购份额	94,804
减：报告期内基金份额赎回份额	4,799,253.66
减：报告期内基金拆分变动额（份额减少—填列）	-
报告期末基金份额总额	1,000,064,244.76

§ 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的变动情况
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 影响投资者权益的其他重要信息

8.1 报告期内前十大投资者持有基金份额比例超过20%的情况

报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金份额	
投资人 类别	持有基 金份 额比 例达 到前 20% 的区 间	期初 份 额	申 购 份 额	赎回 份 额	持有份 额	份额比 重 (%)
机构	1	20100101-2 0100000	499,599, 000.00	--	499,699, 000.00	50.00
	2	20100101-2 0100331	500,000, 000.00	--	500,000, 000.00	50.00
个人	--	--	--	--	--	--

产品特征有风险

基金持有人持有其持有的基金份额，但通过下列事项，可能会导致丧失一基金持有人持有人大额股份时引起基金净值波动，甚至可能引发基金流动性风险。基金管理人将依法及为变更基金资产以应对基金持有人的大额赎回申请，基金份额持有人有可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注：(一)申购赎回包含基金申购赎回、基金赎回转入、赎回转入认购、赎回转配基金等申购赎回和赎回；(二)赎回转出非货币型证券投资基金收益分配；(三)赎回转出非货币型证券投资基金收益分配(含红利再投资)；(四)、(五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(二十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(二十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(二十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(二十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(二十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(二十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(二十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(二十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(二十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(二十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(三十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(三十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(三十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(三十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(三十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(三十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(三十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(三十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(三十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(三十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(四十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(四十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(四十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(四十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(四十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(四十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(四十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(四十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(四十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(四十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(五十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(五十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(五十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(五十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(五十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(五十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(五十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(五十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(五十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(五十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(六十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(七十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(八十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(九十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百零一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百零二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百零三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百零四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百零五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百零六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百零七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百零八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百零九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百一十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百一十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百一十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百一十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百一十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百一十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百一十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百一十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百一十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百一十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百二十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百二十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百二十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百二十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百二十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百二十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百二十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百二十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百二十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百二十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百三十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百三十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百三十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百三十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百三十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百三十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百三十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百三十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百三十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百三十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百四十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百四十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百四十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百四十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百四十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百四十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百四十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百四十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百四十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百四十九)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百五十)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百五十一)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百五十二)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百五十三)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百五十四)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百五十五)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百五十六)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百五十七)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百五十八)见招募说明书第 42 页“风险提示”章节；(一百五

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—

[illegible][illegible]