

鹏华永盛一年定期开放债券型证券投资基金  
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 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：2020 年 10 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 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 2020 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 鹏华永盛定期开放债券   |
| 基金主代码      | 003662   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2016 年 12 月 29 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 2,342,937,501.29 份   |
| 投资目标       | 在有效控制风险的基础上，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，在有效控制风险的基础上，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，以实现组合利率风险的有效控制。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测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 |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>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。</p> <p>3、收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、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。</p> <p>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度的下滑，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。</p> <p>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。</p> <p>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，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p> <p>7、中小企业私募债投资策略 本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，与中小企业私募债券承销券商紧密合作，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，力求规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。</p> <p>8、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> |
| 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较低风险收益特征的品种。  |
| 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   |

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（2020年7月1日-2020年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 22,395,806.20             |
| 2. 本期利润         | 13,095,422.24             |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0056                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,869,492,338.25          |

|             |        |
|-------------|--------|
| 5. 期末基金份额净值 | 1.2247 |
|-------------|--------|

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

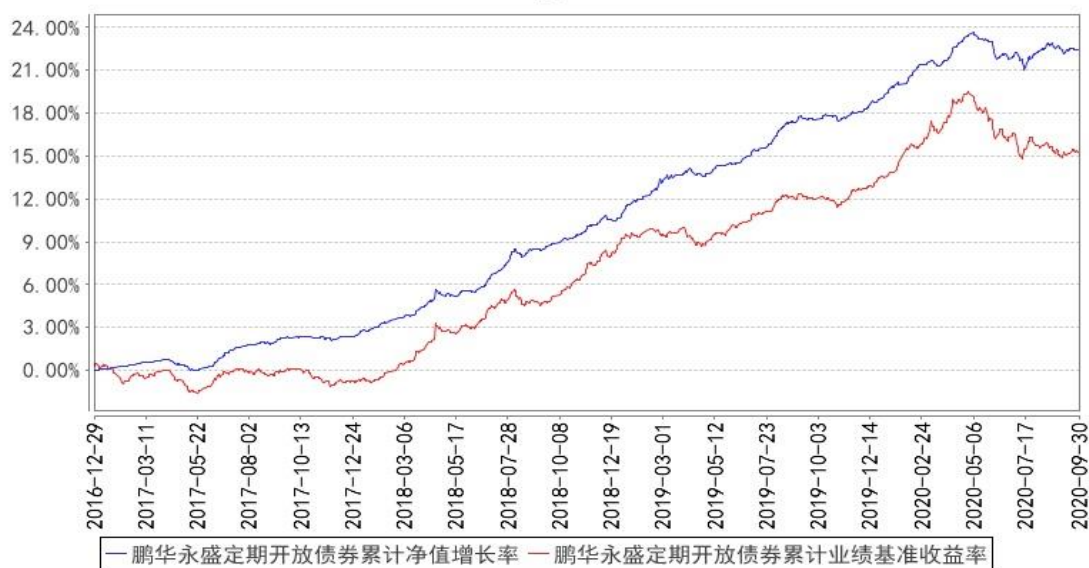
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | 0.45%    | 0.10%       | -1.19%     | 0.14%         | 1.64% | -0.04% |
| 过去六个月      | 0.63%    | 0.10%       | -2.00%     | 0.17%         | 2.63% | -0.07% |
| 过去一年       | 4.18%    | 0.08%       | 2.89%      | 0.15%         | 1.29% | -0.07% |
| 过去三年       | 19.74%   | 0.07%       | 15.05%     | 0.12%         | 4.69% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.47%   | 0.07%       | 15.22%     | 0.12%         | 7.25% | -0.05% |

注：业绩比较基准=中债总指数收益率

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

鹏华永盛定期开放债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 29 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 |        |  |
| 祝松 | 本基金基金经理 | 2016-12-29  | -    | 14 年   | 祝松先生，国籍中国，经济学硕士，14 年证券基金从业经验。曾任职于中国工商银行深圳市分行资金营运部，从事债券投资及理财产品组合投资管理；招商银行总行金融市场部，担任代客理财投资经理，从事人民币理财产品组合的投资管理工作。2014 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资管理工作；现担任公募债券投资部副总经理、基金经理。2014 年 02 月至 2018 年 04 月担任鹏华普天债券基金基金经理，2014 年 02 月至 2019 年 09 月担任鹏华丰润债券（LOF）基金基金经理，2014 年 03 月担任鹏华产业债基金基金经理，2015 年 03 月至 2018 年 03 月担任鹏华双债加利债券基金基金经理，2015 年 12 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>华债券基金基金经理，2016 年 02 月至 2018 年 04 月担任鹏华弘泰混合基金基金经理，2016 年 06 月至 2018 年 04 月担任鹏华金城保本混合基金基金经理，2016 年 06 月至 2019 年 11 月担任鹏华丰茂债券基金基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华丰盈债券基金基金经理，2016 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华丰惠债券基金基金经理，2016 年 12 月担任鹏华永盛定期开放债券基金基金经理，2017 年 03 月担任鹏华永安定期开放债券基金基金经理，2017 年 05 月担任鹏华永泰定期开放债券基金基金经理，2018 年 01 月至 2019 年 09 月担任鹏华永泽定期开放债券基金基金经理，2018 年 02 月至 2019 年 11 月担任鹏华丰达债券基金基金经理，2019 年 06 月担任鹏华尊晟定期开放发起式债券基金基金经理，2019 年 08 月担任鹏华金利债券基金基金经理，2019 年 08 月担任鹏华尊信 3 个月定开发起式债券基金基金经理，2019 年 09 月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理，2019 年 10 月担任鹏华尊享定期开放发起式债券基金基金经理，2020 年 03 月担任鹏华丰诚债券基金基金经理。祝松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。</p> |
|--|--|--|--|--|

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年三季度我国债券市场整体震荡调整，与上季末相比，上证国债指数上涨 0.33%，银行间中债综合财富指数下跌 0.63%。7 月中上旬受股票市场大幅上涨影响，债券市场抛压较重，债券利率上行显著；此后股市进入震荡期，债券市场小幅回暖；但 8、9 月份债券市场供给压力加大，叠加银行负债端趋紧，债券利率继续震荡上行。

权益及可转债市场方面，三季度股票市场整体上涨，上证综指上涨 7.82%，创业板指上涨 5.6%；转债方面，转债跟随正股呈现普涨行情，三季度中证转债指数上涨 4.59%。

报告期内本基金以买入并持有中高评级信用债为主，同时继续减仓利率债，组合久期有所下降。此外，报告期内本基金对可转债和可交换债进行了增持和波段操作。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，鹏华永盛定期开放债券组合净值增长率 0.45%，业绩比较基准增长率-1.19%。

### 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（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 | 4,002,896,986.62 | 90.75        |
|    | 其中：债券  | 3,898,896,986.62 | 88.40        |
|    | 资产支持证券 | 104,000,000.00   | 2.36         |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 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 | 银行存款和结算备付金合计      | 113,631,331.60   | 2.58   |
| 8 | 其他资产              | 294,167,158.97   | 6.67   |
| 9 | 合计                | 4,410,695,477.19 | 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      | 139,630,000.00   | 4.87         |
|    | 其中：政策性金融债 | -                | -            |
| 4  | 企业债券      | 2,139,781,500.00 | 74.57        |
| 5  | 企业短期融资券   | 353,586,600.00   | 12.32        |
| 6  | 中期票据      | 1,112,726,000.00 | 38.78        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 153,172,886.62   | 5.34         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 3,898,896,986.62 | 135.87       |

## 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  | 112871    | 19 珠纒 02     | 900,000 | 90,513,000.00 | 3.15         |
| 2  | 101800853 | 18 兴泸 MTN001 | 800,000 | 81,432,000.00 | 2.84         |
| 3  | 175102    | 20 漳九 Y1     | 800,000 | 80,016,000.00 | 2.79         |



|   |        |          |         |               |      |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 4 | 175005 | 20 电投 Y7 | 800,000 | 79,568,000.00 | 2.77 |
| 5 | 175025 | 20 铁 Y09 | 800,000 | 79,528,000.00 | 2.77 |

## 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

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（份）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值<br>比例（%） |
|----|--------|---------|---------|---------------|------------------|
| 1  | 137172 | 世武 01   | 380,000 | 38,000,000.00 | 1.32             |
| 2  | 168263 | 碧山 01 优 | 360,000 | 36,000,000.00 | 1.25             |
| 3  | 137104 | 中借 04A  | 300,000 | 30,000,000.00 | 1.05             |

## 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

注：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

南京证券

关于收到纪律处分正式决定文件的公告（20191203），具体如下：

2019 年 10 月 8 日，南京证券股份有限公司（以下简称“公司”）分别收到上海证券交易所和深圳证券交易所下发的纪律处分事先告知文件，上海证券交易所和深圳证券交易所拟对公司作出暂停股票质押回购交易权限 3 个月的纪律处分，具体情况详见公司于 2019 年 10 月 10 日披露的相关公告（临 2019-45 号）。就前述事项，上海证券交易所和深圳证券交易所于近日分别向公司下发

正式的纪律处分决定文件，现将相关情况公告如下：

一、上海证券交易所《关于对南京证券股份有限公司予以纪律处分的决定》（纪律处分决定书（2019）113 号）主要内容

根据中国证券监督管理委员会江苏监管局《关于对南京证券股份有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定》（行政监管措施决定书（2019）75 号），公司在开展股票质押式回购交易中，存在对融入方准入尽职调查不充分、融出资金管理不完善的问题。经上海证券交易所纪律处分委员会审核通过，上海证券交易所作出如下纪律处分决定：对公司予以暂停股票质押式回购交易（限于新增初始交易）相关权限 3 个月的纪律处分，即自 2019 年 11 月 30 日（含当日）至 2020 年 2 月 29 日（含当日），不得新增股票质押式回购交易业务初始交易。

二、深圳证券交易所《关于对南京证券股份有限公司给予纪律处分的决定》（深证会〔2019〕462 号）主要内容

根据中国证券监督管理委员会江苏监管局《关于对南京证券股份有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定》（行政监管措施决定书（2019）75 号），公司在开展股票质押式回购交易中，存在对融入方准入尽职调查不充分、融出资金管理不完善的问题，经深圳证券交易所纪律处分委员会审议通过，深圳证券交易所作出如下处分决定：对公司作出暂停股票质押回购交易权限 3 个月的处分，自 2019 年 11 月 30 日起（含当日）至 2020 年 2 月 29 日止（含当日），不得新增股票质押回购初始交易。

公司高度重视股票质押回购业务的合规经营和风险管理，对于存在的问题，公司严格按照监管要求积极整改。公司将引以为戒，切实加强风险管控，促进业务平稳健康发展。公司目前经营情况正常，敬请投资者注意投资风险。

关于收到纪律处分事先告知文件的公告（20191010），具体如下：

南京证券股份有限公司（以下简称“公司”）于 2019 年 10 月 8 日分别收到上海证券交易所会员部下发的《纪律处分意向书》（上证会函（2019）179 号）和深圳证券交易所会员管理部下发的《纪律处分事先告知书》（会员部处分告知书（2019）第（5）号），现将相关情况披露如下：

一、上海证券交易所会员部下发的《纪律处分意向书》（上证会函（2019）179 号）主要内容如下：

“根据中国证券监督管理委员会江苏监管局《关于对南京证券股份有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定》（行政监管措施决定书（2019）75 号），你公司在开展股票质押式回购交易中，存在对融入方准入尽职调查不充分、融出资金管理不完善的问题。你公司上述相关行为涉

嫌违反了《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》第十五条、第七十二条相关规定。

根据《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》第十条、《上海证券交易所会员管理规则》、《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的相关规定，我部拟提请本所纪律处分委员会审核，对你公司予以暂停股票质押式回购交易权限 3 个月的纪律处分。

你公司应于收到本纪律处分意向书后 5 个工作日内，书面回复本所，回复中应说明本纪律处分意向书的送达及异议情况。如有异议，应附上相关证据材料。

你公司如要求听证，应当在收到纪律处分意向书后 5 个工作日内，以书面方式向我部提出，其中应当载明要求听证的具体事项及申辩事由。你公司如逾期不回复，将视为本纪律处分意向书已送达且你公司无异议并不要求听证。”

二、深圳证券交易所会员管理部下发的《纪律处分事先告知书》（会员部处分告知书（2019）第（5）号）主要内容如下：

“根据中国证券监督管理委员会江苏监管局《关于对南京证券股份有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定》（行政监管措施决定书（2019）75 号），你公司在开展股票质押式回购交易中，存在对融入方准入尽职调查不充分、融出资金管理不完善的问题。你公司上述行为涉嫌违反本所《股票质押式回购交易及登记结算业务办法（2018 年修订）》第十五条、第七十三条的规定。

依据本所《股票质押式回购交易及登记结算业务办法（2018 年修订）》第十条、《会员管理规则（2015 年修订）》第 12.1 条的规定，本所拟对你公司作出暂停股票质押回购交易权限 3 个月的处分。

请你公司在收到本告知书之日起五个交易日内向我部发回附件《送达回执》。你公司可以在收到本告知书之日起十个交易日内向我部提出书面陈述和申辩，并提供相关证据，逾期视为放弃陈述和申辩的权利。根据本所《自律监管听证程序细则》的相关规定，你公司还可申请听证，如申请听证的，应当在收到本告知书之日起五个交易日内，以书面形式向我部提出申请，逾期视为放弃听证的权利。

你公司提出的申辩事实、理由和证据，经核实成立的，将予以采纳；如果你公司放弃听证、陈述和申辩的权利，我部将依照本所相关业务规则办理。”

公司高度重视股票质押回购业务的合规经营和风险管理，自开展该项业务以来没有发生过风险事项，对于存在的问题，公司将进一步强化合规管理，积极按照监管要求予以整改。目前，公司经营情况正常。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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（元）          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 116,574.82     |
| 2  | 应收证券清算款 | 244,996,298.92 |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 49,054,285.23  |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 294,167,158.97 |

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 113537 | 文灿转债 | 10,466,235.30 | 0.36         |
| 2  | 110056 | 亨通转债 | 10,028,802.60 | 0.35         |
| 3  | 128097 | 奥佳转债 | 7,704,080.00  | 0.27         |
| 4  | 113550 | 常汽转债 | 6,405,088.10  | 0.22         |
| 5  | 113571 | 博特转债 | 6,288,510.00  | 0.22         |
| 6  | 113534 | 鼎胜转债 | 5,432,491.40  | 0.19         |
| 7  | 110064 | 建工转债 | 5,356,587.60  | 0.19         |
| 8  | 110066 | 盛屯转债 | 5,276,530.00  | 0.18         |
| 9  | 128075 | 远东转债 | 3,237,250.00  | 0.11         |
| 10 | 113557 | 森特转债 | 2,424,513.00  | 0.08         |
| 11 | 128092 | 唐人转债 | 2,079,200.00  | 0.07         |
| 12 | 110059 | 浦发转债 | 2,046,200.00  | 0.07         |
| 13 | 128099 | 永高转债 | 1,991,605.60  | 0.07         |
| 14 | 128065 | 雅化转债 | 1,696,217.00  | 0.06         |
| 15 | 113029 | 明阳转债 | 1,598,848.30  | 0.06         |
| 16 | 128034 | 江银转债 | 1,398,410.00  | 0.05         |
| 17 | 123022 | 长信转债 | 1,295,520.00  | 0.05         |

|    |        |          |              |      |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 18 | 128058 | 拓邦转债     | 1,261,896.72 | 0.04 |
| 19 | 132007 | 16 凤凰 EB | 1,125,300.00 | 0.04 |
| 20 | 113553 | 金牌转债     | 1,070,880.00 | 0.04 |
| 21 | 128051 | 光华转债     | 1,051,931.70 | 0.04 |
| 22 | 123044 | 红相转债     | 1,019,649.00 | 0.04 |
| 23 | 123002 | 国祯转债     | 922,684.14   | 0.03 |
| 24 | 110058 | 永鼎转债     | 840,191.40   | 0.03 |
| 25 | 128066 | 亚泰转债     | 517,860.16   | 0.02 |
| 26 | 128095 | 恩捷转债     | 275,944.50   | 0.01 |
| 27 | 127013 | 创维转债     | 139,607.00   | 0.00 |

### 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

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 2,342,937,501.29 |
| 报告期期间基金总申购份额              | -                |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | -                |
| 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               | 2,342,937,501.29 |

## § 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

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) 《鹏华永盛一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华永盛一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华永盛一年定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 3 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.cn>）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

2020 年 10 月 28 日