

鹏华尊和一年定期开放债券型发起式证券
投资基金
2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 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：2021 年 4 月 21 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。

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 2021 年 04 月 20 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华尊和一年定开发起式债券
基金主代码	011080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 23 日
报告期末基金份额总额	8,009,999,000.00 份
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	1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定债券、现金类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用债投资策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。 （1）久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。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。 （2）收益率曲线策略 收益率曲线的形

	<p>状变化是判断市场整体走向的一个重要依据,本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配,即通过对收益率曲线形状变化的预测,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。(3) 骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略,以达到增强组合的持有期收益的目的。该策略是指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。(4) 息差策略 本基金将采用息差策略,以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。该策略是指在回购利率低于债券收益率的情形下,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。(5) 个券选择策略 本基金将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。(6) 信用债投资策略 本基金将投资于信用债,以提高组合收益能力。本基金投资信用债的评级范围为 AA 至 AAA,投资于各个信用等级信用债资产占基金总资产的大致比例如下:</p> <table border="1" data-bbox="555 952 1383 996"> <tr> <td>信用等级</td> <td>占比</td> </tr> <tr> <td>AAA</td> <td>30%-100%</td> </tr> <tr> <td>AA+</td> <td>0%-70%</td> </tr> <tr> <td>AA</td> <td>0%-20%</td> </tr> </table> <p>本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价,根据内、外部信用评级结果,结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。在信用风险控制方面,本基金将定期对所投债券的信用资质和发行人的偿付能力进行评估,持续监控和分析信用风险。当出现外部评级下调或者评级展望为负面、发债主体财务状况恶化、出现借款本金利息的延期支付情况、发行人现金流恶化且继续恶化等情形的可能性增大时,本基金将及时预警、处置高风险信用债。</p> <p>3、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。未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书中更新并公告。</p>	信用等级	占比	AAA	30%-100%	AA+	0%-70%	AA	0%-20%
信用等级	占比								
AAA	30%-100%								
AA+	0%-70%								
AA	0%-20%								
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%								
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。								
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（2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	47,255,591.07
2. 本期利润	56,137,971.17
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0070
4. 期末基金资产净值	8,069,140,163.61
5. 期末基金份额净值	1.0074

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

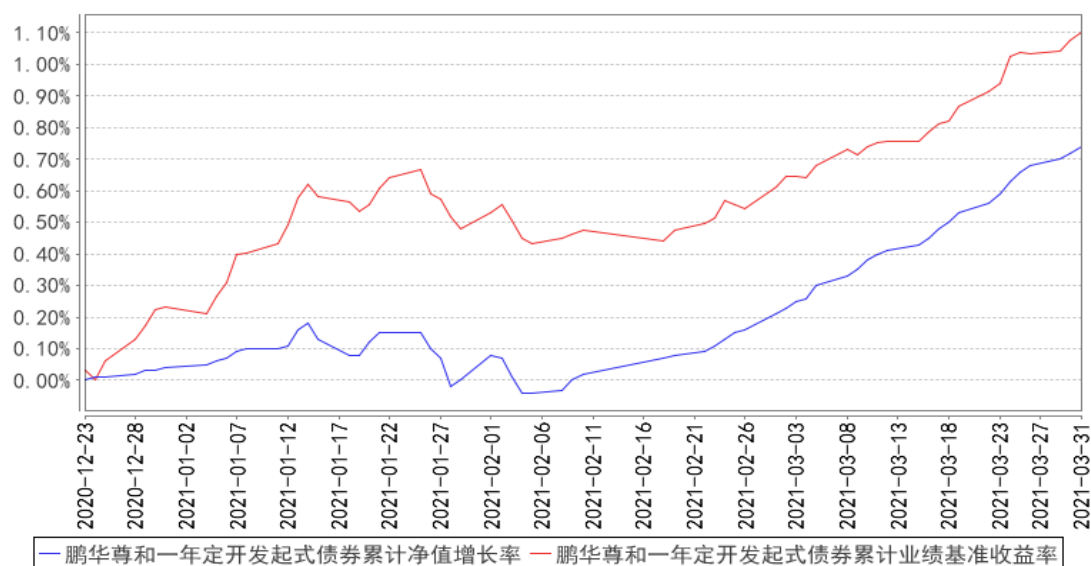
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	0.70%	0.03%	0.86%	0.04%	-0.16%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	0.74%	0.03%	1.10%	0.04%	-0.36%	-0.01%

注：业绩比较基准=中证综合债指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%

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

鹏华尊和一年定开发起式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 2020 年 12 月 23 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

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		
邓明明	本基金基金经理	2020-12-23	-	7 年	邓明明先生，国籍中国，金融学硕士，7 年证券基金从业经验。曾任融通基金管理有限公司固定收益研究员、专户投资经理；2019 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究分析工作，现任公募债券投资部基金经理。2019 年 06 月担任鹏华永安定期开放债券基金基金经理，2019 年 08 月担任鹏华金利债券基金基金经理，2019 年 10 月担任鹏华尊享定期开放发起式债券基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华丰茂债券基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华丰惠债券基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华丰达债券基金基金经理，2020 年 06 月担任鹏华永融一年定期开放债券基金基金经理，2020 年

					07 月担任鹏华锦润 86 个月定开债券基金基金经理，2020 年 10 月担任鹏华丰泽债券（LOF）基金基金经理，2020 年 12 月担任鹏华尊和一年定开发起式债券基金基金经理，2021 年 03 月担任鹏华锦利两年定期开放债券基金基金经理。邓明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。

4.1.1 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

2021 年一季度，债券收益率先上后下，呈现区间震荡格局。宏观经济开局良好，海外需求持续复苏，国内疫情控制有力，在“就地过年”等政策的支持下，工业生产、制造业投资和消费表现出了较为强劲的复苏态势。宏观政策不急转弯，货币政策保持了连续性、稳定性和可持续性，银行间流动性合理充裕，信贷和社融大幅增长。经济强、政策稳。

在此宏观背景下，1 月资金面先松后紧，月末出现了短暂的大幅去杠杆现象，债券收益率迅速上升。春节过后，资金面转为平稳，央行没有明显收紧的动作，财政投放力度加大，DR007 等指标稳定，并持续至 3 月底。在此期间，出现了大宗商品大涨、金融数据大超预期、经济数据表现亮眼等利空因素，但债券市场反应平平，各期限收益率稳步下行。

具体来看，本季度 1 年国股存单上行近 20bp，各期限国债上行 5-10bp，国开债上行 10-20bp 不等。信用利差持续压缩，已至历史较低位置。信用债表现仍有分化，中低等级长久期信用债下行幅度偏少。

报告期内，本基金以中高等级信用债为主，灵活操作了杠杆，久期基本保持稳定。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年一季度本基金份额净值增长率为 0.70%，同期业绩基准增长率为 0.86%。

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	8,124,188,000.00	98.46
	其中：债券	8,124,188,000.00	98.46
	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	银行存款和结算备付金合计	19,825,470.12	0.24
8	其他资产	107,573,013.09	1.30
9	合计	8,251,586,483.21	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	6,571,048,000.00	81.43
	其中：政策性金融债	2,253,054,000.00	27.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,553,140,000.00	19.25
9	其他	-	-
10	合计	8,124,188,000.00	100.68

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	200202	20 国开 02	12,000,000	1,172,400,000.00	14.53
2	1728022	17 工商银行二级 02	7,100,000	723,348,000.00	8.96
3	1928002	19 民生银行二级 01	6,900,000	702,558,000.00	8.71
4	200207	20 国开 07	5,000,000	498,600,000.00	6.18
5	1728018	17 农业银行二级	4,500,000	458,685,000.00	5.68

**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

中国银行

2020 年 12 月，公司曾收到《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）60 号）》。

一、处罚事由

中国银行“原油宝”产品风险事件相关违法违规行主要包括：产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等。

二、处罚机构及处罚结果

根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会予以中国银行罚款 5050 万元的行政处罚决定。

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。上述通告对该公司股票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。

农业银行

本基金前十大持仓中的中国农业银行股份有限公司

于 2020 年 8 月 28 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚, 信息如下:

行政处罚决定书文号:银保监罚决字(2020)36 号

被处罚当事人:中国农业银行股份有限公司

主要违法违规事实:(一)向关系人发放信用贷款

(二)批量处置不良资产未公告

(三)批量处置不良资产未向监管部门报告

(四)违规转让正常类贷款

(五)个人住房贷款首付比例违规

(六)流动资金贷款被用于固定资产投资

(七)超过实际需求发放流动资金贷款

(八)贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发

(九)贷款用于偿还银行承兑汇票垫款

(十)承兑业务贸易背景审查不严

(十一)保理业务授权管理不到位

(十二)贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人

(十三)贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金

(十四)信贷资金用于兑付到期理财产品

(十五)信贷资金用于承接承销债券

(十六)销售非保本理财产品违规出具承诺函

(十七)提供与事实不符的报告

(十八)理财产品相互交易、相互调节收益

(十九)面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资

(二十)将系统内资金纳入一般存款核算,虚增存款

(二十一)开立同业银行结算账户不合规

(二十二)个别人员未经核准即履行高管人员职责

(二十三)对小微企业不当收费

(二十四)未按规定报送案件

行政处罚依据:《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第(五)项,《中

《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第五十五条、第七十四条和相关审慎经营规则

行政处罚决定:没收违法所得 55.3 万元, 罚款 5260.3 万元, 罚没合计 5315.6 万元

作出处罚决定的机关名称:中国银行保险监督管理委员会

作出处罚决定的日期:2020 年 7 月 13 日

于 2021 年 1 月 29 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚, 信息如下:

行政处罚决定书文号:银保监罚决字(2021)1 号

被处罚当事人:中国农业银行股份有限公司

主要违法违规事实

- (一) 发生重要信息系统突发事件未报告
- (二) 制卡数据违规明文留存
- (三) 生产网络、分行无线互联网络保护不当
- (四) 数据安全较粗放, 存在数据泄露风险
- (五) 网络信息系统存在较多漏洞
- (六) 互联网门户网站泄露敏感信息

行政处罚依据:《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第五项和相关审慎经营规则

行政处罚决定:罚款 420 万元

作出处罚决定的机关名称:中国银行保险监督管理委员会

作出处罚决定的日期:2021 年 1 月 19 日

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。上述通告对该公司股票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。

民生银行

本基金前十大持仓中的民生银行股份有限公司

于 2020 年 9 月 4 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚, 信息如下:

行政处罚决定书文号: 银保监罚决字(2020)43 号

被处罚当事人:中国民生银行股份有限公司

主要违法违规事实:

- (一) 违反宏观调控政策, 违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资
- (二) 为“四证”不全的房地产项目提供融资

- (三) 违规为土地储备中心提供融资
- (四) 违规为地方政府提供融资，接受地方政府担保或承诺
- (五) 多名股东在已派出董事的情况下，以推荐代替提名方式推举独立董事及监事
- (六) 多名股东在股权质押超比例的情况下违规在股东大会上行使表决权，派出董事在董事会上的表决权也未受限
- (七) 股东持股份额发生重大变化未向监管部门报告
- (八) 多名拟任高管人员及董事未经核准即履职
- (九) 关联交易不合规
- (十) 理财产品风险信息披露不合规
- (十一) 年报信息披露不真实
- (十二) 贷款资金被挪用，虚增贷款
- (十三) 以贷转存，虚增存款
- (十四) 贸易背景审查不尽职
- (十五) 向关系人发放信用贷款
- (十六) 违规转让正常类信贷资产
- (十七) 违规转让不良资产
- (十八) 同业投资他行非保本理财产品审查不到位，接受对方机构违规担保，少计风险加权资产
- (十九) 同业投资未穿透底层资产计提资本拨备，少计风险加权资产
- (二十) 同业存放业务期限超过一年
- (二十一) 违规开展票据转贴现交易
- (二十二) 个别理财产品管理费长期未入账
- (二十三) 理财业务风险隔离不充分
- (二十四) 违规向非高净值客户销售投向股权类资产的理财产品
- (二十五) 非标准化资产纳入标准化资产统计，实际非标债权资产比例超监管要求
- (二十六) 违规出具补充协议及与事实不符的投资说明
- (二十七) 以代销名义变相向本行授信客户融资，并承担兜底风险
- (二十八) 向不符合条件的借款人办理收益权转让再融资业务
- (二十九) 代理福费廷业务违规承担风险，会计处理不规范
- (三十) 迟报瞒报多起案件（风险）信息

行政处罚依据：《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十条、第二十一条、第四十六条第（一）、

(五) 项,《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第五十五条、第七十四条规定和相关审慎经营规则

行政处罚决定:没收违法所得 296.47 万元, 罚款 10486.47 万元, 罚没合计 10782.94 万元

作出处罚决定的机关名称:中国银行保险监督管理委员会

作出处罚决定的日期: 2020 年 7 月 14 日

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。上述通告对该公司股票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。

光大银行

本基金前十大持仓中的光大银行股份有限公司

于 2020 年 11 月 6 日收到中国银行间市场交易商协会自律处分信息, 信息如下:

中国光大银行股份有限公司(以下简称“光大银行”)作为债务融资工具主承销商, 在相关债务融资工具的簿记建档过程中未妥善保存工作底稿, 未就簿记建档工作建立有效的内部监督制度, 违反了银行间市场相关自律管理规则。

依据相关自律规定, 经 2020 年第 11 次自律处分会议审议, 对光大银行予以诫勉谈话, 责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

于 2021 年 1 月 15 日收到交易商协会自律处分信息, 信息如下:

中国光大银行股份有限公司(以下简称“光大银行”)作为债务融资工具主承销商, 在为永城煤电控股集团有限公司(以下简称“永煤控股”)提供中介服务过程中, 存在以下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为:

一是未对永煤控股独立性开展进一步核查并在尽职调查报告中体现, 未能充分保证尽职调查质量; 二是永煤控股 DFI 项目尽职调查工作开展不规范。

根据银行间债券市场相关自律规定, 经 2020 年第 18 次自律处分会议审议, 对光大银行予以诫勉谈话; 责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。同时, 中国银行间市场交易商协会已将光大银行有关违规情况报送中国人民银行、中国银保监会。

对上述股票的投资决策程序的说明: 本基金为指数基金, 为更好地跟踪标的指数, 控制跟踪误差, 对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置, 符合指数基金的管理规定, 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。

国家开发银行

一、处罚事由

2020 年 12 月 25 日，公司受到银保监会处罚（银保监罚决字〔2020〕67 号），涉及以下违规事项：

- （1）为违规的政府购买服务项目提供融资；
- （2）项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；
- （3）违规变相发放土地储备贷款；
- （4）设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；
- （5）贷款风险分类不准确；
- （6）向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；
- （7）违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；
- （8）向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品；
- （9）扶贫贷款存贷挂钩；
- （10）易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；
- （11）未落实同业业务交易对手名单制监管要求；
- （12）以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；
- （13）以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；
- （14）风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；
- （15）未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；
- （16）逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；
- （17）利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；
- （18）违规收取小微企业贷款承诺费；
- （19）收取财务顾问费质价不符；
- （20）利用银团贷款承诺费浮利分费；
- （21）向检查组提供虚假整改证明材料；
- （22）未如实提供信贷资产转让台账
- （23）案件信息迟报、瞒报；
- （24）对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。

二、处罚机构及处罚结果

依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，银保监会决定对国开行处以 4880 万元罚款。

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。上述通告对该公司证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	90,833.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	107,482,179.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,573,013.09

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

报告期期初基金份额总额	8,009,999,000.00
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	8,009,999,000.00

§ 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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
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	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.12

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.12	10,000,000.00	0.12	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.12	10,000,000.00	0.12	-

注：1、本基金自 2020 年 12 月 22 日至 2020 年 12 月 22 日止期间公开发售，于 2020 年 12 月 23 日基金合同正式生效。

2、本基金管理人在募集期间认购本基金份额 10,000,000.00 份。

3、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。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20210101~20210331	7,999,999,000.00	-	-	7,999,999,000.00	99.88
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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华尊和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华尊和一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华尊和一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告》（原文）。

10.2 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。

10.3 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

2021 年 4 月 21 日