

鹏华永盛一年定期开放债券型证券投资基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 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：2021 年 10 月 26 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 10 月 25 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 07 月 01 日起至 2021 年 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	2,807,244,013.24 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

	<p>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。</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（2021年7月1日-2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	40,954,895.94
2. 本期利润	46,884,243.72
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0167

4. 期末基金资产净值	3,603,433,334.75
5. 期末基金份额净值	1.2836

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

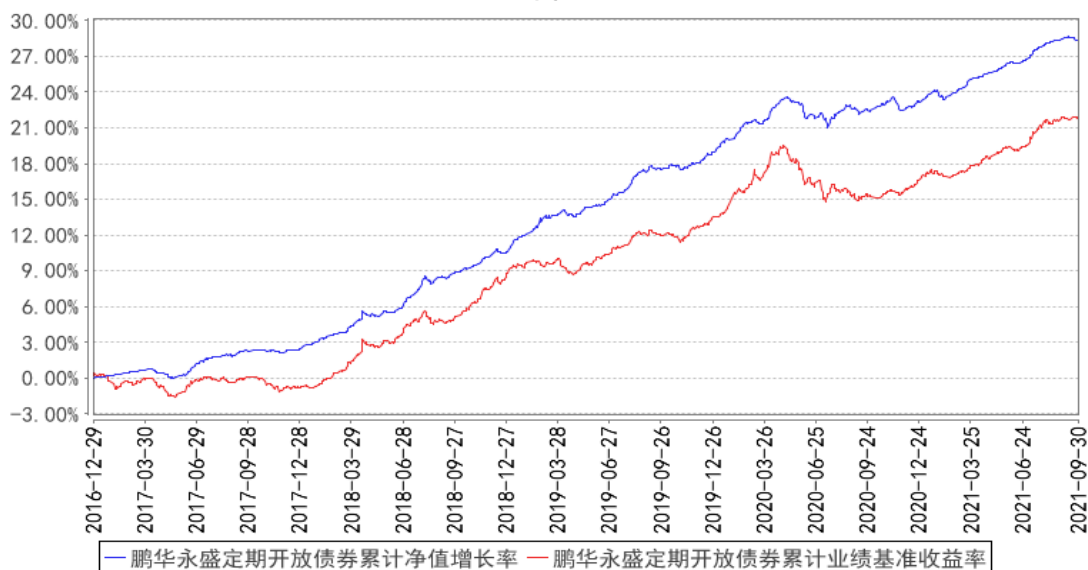
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.32%	0.03%	2.02%	0.10%	-0.70%	-0.07%
过去六个月	2.56%	0.03%	3.43%	0.08%	-0.87%	-0.05%
过去一年	4.81%	0.05%	5.81%	0.08%	-1.00%	-0.03%
过去三年	17.89%	0.07%	15.87%	0.11%	2.02%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	28.36%	0.06%	21.92%	0.11%	6.44%	-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	基金经理	2016-12-29	-	15 年	祝松先生，国籍中国，经济学硕士，15 年证券从业经验。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，历任固定收益部基金经理、公募债券投资部副总经理/基金经理，现担任债券投资一部联席总经理/基金经理。2014 年 02 月至 2018 年 04 月担任鹏华普天债券证券投资基金基金经理，2014 年 02 月至 2019 年 09 月担任鹏华丰润债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2014 年 03 月至今担任鹏华产业债债券型证券投资基金基金经理，2015 年

				<p>03 月至 2018 年 03 月担任鹏华双债加利债券型证券投资基金基金经理, 2015 年 12 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰华债券型证券投资基金基金经理, 2016 年 02 月至 2018 年 04 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 06 月至 2018 年 04 月担任鹏华金城保本混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 06 月至 2019 年 11 月担任鹏华丰茂债券型证券投资基金基金经理, 2016 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华丰惠债券型证券投资基金基金经理, 2016 年 12 月至今担任鹏华永盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2016 年 12 月至 2018 年 07 月担任鹏华丰盈债券型证券投资基金基金经理, 2017 年 03 月至今担任鹏华永安 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2017 年 05 月至今担任鹏华永泰 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2018 年 01 月至 2019 年 09 月担任鹏华永泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2018 年 02 月至 2019 年 11 月担任鹏华丰达债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 06 月至今担任鹏华尊晟 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理, 2019 年 08 月至今担任鹏华金利债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 08 月至今担任鹏华尊信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理, 2019 年 09 月至今担任鹏华丰泽债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2019 年 10 月至今担任鹏华尊享 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理, 2020 年 03 月至今担任鹏华丰诚债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 09 月至今担任鹏华丰达债券型证券投资基金基金经理, 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>	
杜培俊	基金经理	2021-03-26	-	7 年	<p>杜培俊先生, 国籍中国, 经济学硕士, 7 年证券从业经验。曾任民生银行石材产业金融事业部、市场业务部客户经理, 兴业基金管理有限公司投资管理部研究员。2018 年 03 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任固定收益部信用研究员, 固定收</p>

				益研究部高级信用研究员。现任职于固定收益研究部，从事投资管理相关工作。2021 年 03 月至今担任鹏华永盛一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华丰惠债券型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华尊信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华丰达债券型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华丰诚债券型证券投资基金基金经理，2021 年 03 月至今担任鹏华丰茂债券型证券投资基金基金经理，2021 年 04 月至今担任鹏华丰腾债券型证券投资基金基金经理，2021 年 05 月至今担任鹏华尊达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，杜培俊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 年三季度我国债券市场整体上涨，与上季末相比，上证国债指数上涨 1.47%，银行间中债综合财富指数上涨 1.65%。央行三季度初“意外”降准，叠加水灾、疫情反复背景下经济数据进一步走弱，市场对货币政策进一步放松预期增强，债券市场利率明显下行；9 月份“双控”政策效应下大宗商品价格大幅走高，市场对货币政策预期出现分化，叠加银行理财估值监管趋严，债市出现调整之势。信用债方面，信用利差整体呈现先收窄后扩大走势，银行理财等机构行为变化对信用利差走势影响较大。

权益及可转债市场方面，三季度股票市场整体震荡，半导体、新能源等景气赛道冲高回落，食品饮料等板块下跌后反弹，板块轮动加速，市场波动加大，三季度上证综指下跌 0.64%，创业板指下跌 6.69%；转债方面，受债市上涨拉动及转债结构比较符合权益市场风格等因素影响，三季度转债市场整体表现较好，中证转债指数上涨 6.39%，转债估值进一步拉升，转债性价比有所降低。报告期内本基金以买入并持有中高评级信用债为主，组合久期小幅波动。此外，报告期内本基金对可转债和可交换债投资采取了相对谨慎的投资策略。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 1.32%，同期业绩比较基准增长率为 2.02%。

#### 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	4,797,074,601.70	96.46
	其中：债券	4,767,053,601.70	95.85
	资产支持证券	30,021,000.00	0.60
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	109,645,498.99	2.20
8	其他资产	66,625,927.82	1.34
9	合计	4,973,346,028.51	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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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。

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

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	9,763,000.00	0.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	466,632,000.00	12.95
	其中：政策性金融债	10,305,000.00	0.29
4	企业债券	1,918,510,000.00	53.24
5	企业短期融资券	297,281,900.00	8.25
6	中期票据	1,723,903,400.00	47.84
7	可转债（可交换债）	39,290,301.70	1.09
8	同业存单	301,544,000.00	8.37
9	其他	10,129,000.00	0.28
10	合计	4,767,053,601.70	132.29

注：其他为地方政府债。

## 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	175957	21 龙盛 03	1,200,000	121,212,000.00	3.36
2	112103101	21 农业银行 CD101	1,000,000	97,340,000.00	2.70
3	112114070	21 江苏银行 CD070	1,000,000	97,260,000.00	2.70
4	112110146	21 兴业银行 CD146	1,000,000	97,210,000.00	2.70
5	188102	21 远洋 01	900,000	89,658,000.00	2.49

## 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 比例（%）
1	189000	旭嘉 02 优	300,000	30,021,000.00	0.83

## 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

中国农业银行股份有限公司

中国农业银行股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会安徽监管局、上海监管局、西藏监管局、云南监管局、浙江监管局、北京监管局、山东监管局、辽宁监管

局、新疆监管局、青海监管局、贵州监管局、迪庆监管分局、包头监管分局、保山监管分局、南平监管分局、吐鲁番监管分局、中卫监管分局、阜阳监管分局、东营监管分局、丽江监管分局、扬州监管分局、德州监管分局、芜湖监管分局、临沂监管分局、宿州监管分局、嘉兴监管分局、石河子监管分局、伊犁监管分局、孝感监管分局、防城监管分局、苏州监管分局、无锡监管分局、呼伦贝尔监管分局、安康监管分局、濮阳监管分局、青岛监管分局、运城监管分局、吉林监管分局、泉州监管分局、佛山监管分局、牡丹江监管分局、吴忠监管分局、黄山监管分局、三亚监管分局、咸阳监管分局、新余监管分局、国家税务总局安徽省税务局、淮南市毛集社会发展综合实验区税务局、宜春市税务局第一税务分局、长丰县税务局、永兴县税务局、六安市叶集区税务局、衡阳市石鼓区税务局第二税务所、国家外汇管理局青海省分局、甘肃省分局、江西省分局、黑龙江省分局、新疆维吾尔自治区分局、深圳市分局、重庆外汇管理部、绍兴市中心支局、金华市中心支局、呼伦贝尔市中心支局、大庆市中心支局、锡林郭勒盟中心支局、巴彦淖尔市中心支局、乌海市中心支局、阿拉善盟中心支局、金昌市中心支局、丽水市中心支局、宿迁市中心支局、常州市中心支局和中国人民银行太原中心支行、深圳市中心支行、东营市中心支行、南昌中心支行、绵阳市中心支行、海口中心支行、蚌埠市中心支行、亳州市中心支行、吉林市中心支行、泸州市中心支行的行政处罚。

2021 年 1 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国农业银行股份有限公司的如下的违法违规行为，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，对公司做出行政处罚决定：罚款 420 万元。

主要违法行为：

- （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

中国银行股份有限公司

中国银行股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会宁夏监管局、海南监管局、上海监管局、福建监管局、安徽监管局、广东监管局、深圳监管局、天津监管局、莆田监管分局、海东监管分局、乌兰察布监管分局、两江监管分局、长治监管分局、九江监管分局、丽水监管分局、临沂监管分局、衢州监管分局、平顶山监管分局、佛山监管分局、万州监管

分局、中山监管分局、温州监管分局、金华监管分局、台州监管分局、潮州监管分局、晋城监管分局、常州监管分局、漯河监管分局、龙岩监管分局、松原监管分局、马鞍山监管分局、滁州监管分局、池州监管分局、黄山监管分局、国家税务总局郴州市北湖区税务局、安仁县税务局、临武县税务局、耒阳市税务局第二税务所、国家外汇管理局吉林省分局、青海省分局、贵州省分局、云南省分局、深圳市分局、东阳市支局、格尔木市支局、广安市中心支局、吉林市中心支局、漳州市中心支局、海东市中心支局、黑河市中心支局、石嘴山市中心支局、绍兴市中心支局、舟山市中心支局、双鸭山市中心支局、唐山市中心支局和中国人民银行天津分行、沈阳分行、成都分行、合肥中心支行、哈尔滨中心支行、石家庄中心支行、呼和浩特中心支行、银川中心支行的行政处罚。

2021 年 5 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国银行股份有限公司：

- 一、向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款
- 二、违规向关系人发放信用贷款
- 三、向无资金缺口企业发放流动资金贷款
- 四、存款月末冲时点
- 五、为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票
- 六、贷款管理不严，信贷资金被挪用
- 七、票据贴现资金直接回流至出票人或其关联人账户
- 八、理财产品质押贸易融资业务风险控制有效性不足
- 九、超比例发放并购贷款
- 十、向未经备案的跨境并购业务提供并购贷款
- 十一、违规为私募股权基金收购境内企业发放并购贷款
- 十二、超授权期限办理汇出汇款融资业务
- 十三、与名单外交易对手开展同业业务
- 十四、违规为他行开立投融资性同业账户
- 十五、以同业返存方式不当吸收存款
- 十六、自营和代客理财业务未能实现风险隔离
- 十七、面向一般客户销售的理财产品投资二级市场股票
- 十八、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权风险状况
- 十九、违规向四证不全房地产项目提供融资
- 二十、理财资金违规用于支付土地款或置换股东购地借款

- 二十一、理财资金违规用于土地储备项目
  - 二十二、理财非标融资入股商业银行
  - 二十三、理财非标融资用于商业银行注册验资
  - 二十四、超授信额度提供理财非标融资
  - 二十五、买入返售业务标的资产不合规
  - 二十六、个人住房贷款业务搭售保险产品
  - 二十七、单家分支行代销 3 家以上保险公司保险产品
  - 二十八、主承销债券包销余券未通过风险处置专户处置
  - 二十九、通过平移贷款延缓风险暴露
  - 三十、债券投资业务未分类，表内人民币债券未计提减值准备
  - 三十一、与资产管理公司合作设立有限合伙基金，不洁净转让不良资产
  - 三十二、迟报案件信息
  - 三十三、案件问责不到位
  - 三十四、提供质价不符的服务
  - 三十五、违规收取福费廷风险承担费
  - 三十六、违规向部分已签约代发工资客户收取年费
- 以上违法违规行为，对公司罚没 8761.355 万元。

2020 年 12 月 5 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国银行股份有限公司在“原油宝”产品风险事件当中的产品管理不规范，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相关违法违规行为，对公司罚款 5050 万元。

中国光大银行

2020 年 10 月 20 日，国家外汇管理局北京外汇管理部针对中国光大银行股份有限公司违反银行交易记录管理规定的违法违规行为，对公司处以罚款 60 万元。

2020 年 10 月 20 日，国家外汇管理局北京外汇管理部针对中国光大银行股份有限公司违规开展外汇交易的违法违规行为，对公司处以 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

兴业银行股份有限公司

兴业银行股份有限公司在报告期内受到中国人民银行的行政处罚。

兴业银行股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会湖北监管局、新疆监管局、湖北监管局、江苏监管局、陕西监管局、天津监管局、青岛监管局、北京监管局、福建监管局、内蒙古监管局、宜昌监管分局、马鞍山监管分局、驻马店监管分局、泰州监管分局、南充监管分局、国家税务总局奇台县税务局和国家外汇管理局黑龙江省分局、福建省分局、北海市中心支局的行政处罚。

2020 年 7 月 17 日，中国人民银行上海分行对兴业银行股份有限公司上海分行 1. 未执行金融统计制度，错报统计数据，2. 未按规定报备人民币结算账户开户资料，3. 国库经收业务未使用规定科目核算，4. 未按照规定履行客户身份识别义务，5. 发布引人误解的营销宣传信息的违法违规行为，给予警告，并罚款 123.5 万元。

2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司 1. 为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2. 为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3. 违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4. 违反银行卡收单外包管理规定；5. 未按规定履行客户身份识别义务的违法违规行为，给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司福州分行允许外包服务机构以特约商户名义入网并接收其发送的银行卡交易信息的违法违规行为，给予警告，没收违法所得 34.38 元，处 50 万元罚款。

2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规行为，没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。

2021 年 7 月 21 日，国家外汇管理局福建省分局针对兴业银行股份有限公司的以下违规行为 1. 违

规办理内保外贷业务 2. 未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料 3. 违反外汇市场交易管理规定 4. 未按规定保存交易通讯记录 5. 违规办理银行卡业务，对公司责令改正、给予警告、没收违法所得和罚款合计 300.10537 万元人民币、责令对相关责任人进行处分。

2021 年 8 月 13 日，中国人民银行针对兴业银行股份有限公司违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违规行为，对公司处以罚款 5 万元。

江苏银行

2020 年 12 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局针对江苏银行股份有限公司的以下违法违规行 1. 个人贷款资金用途管控不严；2. 发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款；3. 理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理；4. 个人理财资金对接项目资本金；5. 理财业务未与自营业务相分离；6. 理财资金投资非标准化债权资产的余额超监管比例要求，对公司处以罚款人民币 240 万元。

以上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	105,522.65
2	应收证券清算款	41,881.40
3	应收股利	-
4	应收利息	66,478,523.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,625,927.82

### 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	128081	海亮转债	7,613,280.00	0.21
2	128034	江银转债	5,008,186.16	0.14
3	123049	维尔转债	4,219,248.80	0.12
4	123059	银信转债	3,092,750.00	0.09
5	128075	远东转债	3,038,000.00	0.08
6	128048	张行转债	2,591,160.00	0.07

7	128144	利民转债	2,354,800.00	0.07
8	128107	交科转债	2,267,133.00	0.06
9	113033	利群转债	1,867,860.00	0.05
10	127019	国城转债	1,506,300.00	0.04
11	128108	蓝帆转债	1,366,680.00	0.04
12	128105	长集转债	904,323.42	0.03
13	127013	创维转债	834,319.00	0.02
14	128066	亚泰转债	482,062.52	0.01
15	128035	大族转债	421,800.00	0.01
16	110064	建工转债	234,232.20	0.01

### 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	2,807,244,013.24
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	2,807,244,013.24

## § 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 2021 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

2021 年 10 月 26 日