

鹏华尊裕一年定期开放债券型发起式证券
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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	鹏华尊裕一年定开发起式债券
基金主代码	008951
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 27 日
报告期末基金份额总额	999,999,500.00 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、信用策略等积极投资策略。（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

	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(6) 信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价。本基金主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响，相应地采用以下两种投资策略：</p> <p>1) 信用利差曲线变化策略：首先分析经济周期和相关市场变化情况，其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势，最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定本基金信用债分行业投资比例。</p> <p>2) 信用变化策略：信用债信用等级发生变化后，本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。本基金将根据内、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。</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。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
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。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

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	8,756,029.41
2. 本期利润	10,195,029.41

3. 加权平均基金份额本期利润	0.0102
4. 期末基金资产净值	1,046,698,712.84
5. 期末基金份额净值	1.0467

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

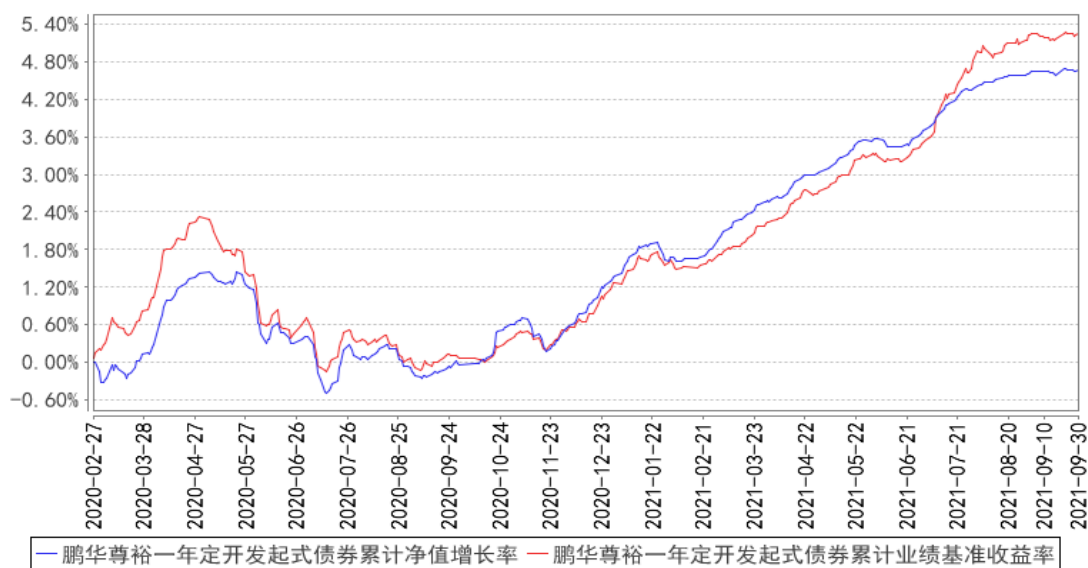
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.98%	0.02%	1.70%	0.06%	-0.72%	-0.04%
过去六个月	2.04%	0.02%	2.95%	0.05%	-0.91%	-0.03%
过去一年	4.71%	0.04%	5.19%	0.05%	-0.48%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	4.67%	0.06%	5.25%	0.07%	-0.58%	-0.01%

注：业绩比较基准=中证综合债指数收益率

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

鹏华尊裕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 02 月 27 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		
曾皓明	基金经理	2020-02-27	-	6 年	曾皓明先生，国籍中国，金融学硕士，6 年证券从业经验。曾任招商证券股份有限公司固定收益总部债券信用评估岗研究员，2016 年 8 月加盟鹏华基金管理有限公司从事研究分析工作，曾任固定收益部债券研究员，现担任债券投资一部基金经理。2020 年 02 月至今担任鹏华尊裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2020 年 05 月至 2021 年 05 月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，2020 年 08 月至今担任鹏华丰饶定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 12 月至今担任鹏华丰源债券型证券投资基金基金经理，曾皓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 年三季度债券市场收益率下行幅度较大，长端下行幅度大于短端，收益率曲线平坦化，中低评级城投债收益率下行较多，信用利差维持低位。具体指数来看，国债总财富指数上涨 2.22%，金融债总财富指数上涨 1.82%，企业债总财富指数上涨 1.78%。三季度收益率下行主要受到资金面维持稳定、经济基本面下行压力加大等因素的影响，7 月初，央行超预期全面降准，市场对下半年流动性边际收紧的预期发生扭转，经济基本面下行逐步成为一致预期，前期欠配资金涌入市场，收益率快速向下突破；进入 8 月后，降息预期多次落空，收益率在大幅下行后缺乏进一步的利多催化，短端利率逐步企稳回升，虽然基本面数据依然疲软，但宽信用预期逐步形成，叠加政府债供给和 PPI 数据持续冲高，收益率陷入区间震荡。向后看，在 PPI 高企和海外流动性收紧的条件下，央行货币政策面临较大制约，预计降准、降息概率不大，而在双控政策纠偏和地产政策边际

缓和后，市场对基本面走弱的预期也将面临修正，在目前收益率曲线较为平坦的背景下，长端可能面临较大上行压力。

报告期内，本基金以持有高评级信用债为主，总体维持了中性的久期水平，并根据市场变化灵活调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 0.98%，同期业绩比较基准增长率为 1.70%。

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	1,220,736,000.00	95.44
	其中：债券	1,220,736,000.00	95.44
	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	38,786,859.63	3.03
8	其他资产	19,515,456.21	1.53
9	合计	1,279,038,315.84	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	502,624,000.00	48.02
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	303,786,000.00	29.02
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	414,326,000.00	39.58
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,220,736,000.00	116.63

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	101760025	17 深业集 MTN001	900,000	91,188,000.00	8.71
2	163092	20 安信 G1	900,000	90,504,000.00	8.65
3	112857	19 广发 03	900,000	90,342,000.00	8.63
4	112864	19 申证 03	900,000	90,342,000.00	8.63
5	2028020	20 兴业银行小微债 03	900,000	89,748,000.00	8.57

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

中国民生银行股份有限公司

2021 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国民生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、第四十六条和相关审慎经营规则，对公司做出行政处罚决定：罚款 11450 万元。

主要违法行为：

- 一、监管发现问题屡查屡犯
- 二、检查发现问题整改不到位
- 三、对责任人员的责任认定和问责不到位
- 四、内部制度管理不足，个别制度与监管要求冲突
- 五、配合现场检查不力
- 六、信息系统管控有效性不足
- 七、未向监管部门真实反映业务数据
- 八、未严格执行理财投资合作机构名单制管理
- 九、理财业务整改转型不符合监管要求
- 十、违规调整理财产品收益
- 十一、理财产品收益兑付不合规
- 十二、违规调节理财业务利润
- 十三、使用内部账户截留理财产品浮动管理费收入和承接风险资产

- 十四、理财产品间相互交易资产调节收益
- 十五、理财产品未实现账实相符、单独托管
- 十六、理财产品投资清单未反映真实情况，合格投资者认定不审慎
- 十七、开放式公募理财产品投资杠杆水平超标
- 十八、公募理财产品持有单只证券市值比例超标
- 十九、开放式公募理财产品流动性资产持有比例不达标
- 二十、理财产品信息登记不规范
- 二十一、理财产品信息披露不规范
- 二十二、理财产品托管不尽职
- 二十三、违规开展委托资产管理业务
- 二十四、同业业务未实行专营部门制
- 二十五、同业业务交易对手管理不健全
- 二十六、同业业务统一授信管理不到位
- 二十七、违规将转贴现票据转为投资资产，未真实反映票据规模
- 二十八、会计核算不规范
- 二十九、发行虚假结构性存款产品
- 三十、未对信贷资产收益权转让业务对应资产计提资本
- 三十一、委托贷款委托人资质审查不审慎

交通银行股份有限公司

交通银行股份有限公司在报告期内受到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚。

交通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北京监管局、新疆监管局、大连监管局、上海监管局、天津监管局、河南监管局、福建监管局、九江监管分局、临沂监管分局、襄阳监管分局、舟山监管分局、淄博监管分局、金华监管分局、韶关监管分局、南通监管分局、淮安监管分局、运城监管分局、平顶山监管分局、国家税务总局奇台县税务局、国家外汇管理局河北省分局、绥化市中心支局、三明市中心支局和中国人民银行上海分行、武汉市中心支行、长沙中心支行、马鞍山市中心支行、哈尔滨中心支行的行政处罚。

2021 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会针对交通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、第四十六条和相关审慎经营规则，对公司做出行政处罚决定：罚款 4100 万元。

主要违法行为：

- 一、理财业务和同业业务制度不健全
- 二、理财业务数据与事实不符
- 三、部分理财业务发展与监管导向不符
- 四、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资
- 五、理财资金违规投向土地储备项目
- 六、理财产品相互交易调节收益
- 七、面向机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券
- 八、公募理财产品投资单只证券超限额
- 九、理财资金违规投向交易所上市交易的股票
- 十、理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位
- 十一、私募理财产品销售文件未约定冷静期
- 十二、开放式公募理财产品资产配置未达到流动性管理监管比例要求
- 十三、理财产品信息登记不及时
- 十四、理财产品信息披露不合规
- 十五、同业业务交易对手名单调整不及时
- 十六、将同业存款纳入一般性存款核算
- 十七、同业账户管理不规范
- 十八、违规增加政府性债务，且同业投资抵质押物风险管理有效性不足
- 十九、结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为
- 二十、未严格审查委托贷款资金来源
- 二十一、违规向委托贷款借款人收取手续费
- 二十二、利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表
- 二十三、监管检查发现问题屡查屡犯

2021 年 08 月 13 日，中国人民银行针对交通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 62 万元。

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。

安信证券股份有限公司

安信证券股份有限公司旗下分支机构在报告期内受到国家税务总局天津市和平区税务局和中国人民银行武汉分行的行政处罚。

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	2,216.75
2	应收证券清算款	176,733.71
3	应收股利	-
4	应收利息	19,336,505.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,515,456.21

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	999,999,500.00
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	999,999,500.00

§ 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 (%)	1.00

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	1.00	10,000,000.00	1.00	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	1.00	10,000,000.00	1.00	-

注：1、本基金自 2020 年 2 月 25 日至 2020 年 2 月 25 日止期间公开发售，于 2020 年 2 月 27 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	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	期初	申购	赎回	持有份额

类别		达到或者超过 20% 的时间区间	份额	份额	份额		(%)
机构	1	20210701~20210930	989,999,500.00	-	-	989,999,500.00	99.00
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。

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) 《鹏华尊裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华尊裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华尊裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年第 3 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 10 月 26 日