

鹏华普天债券证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	鹏华普天债券	
基金主代码	160602	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 年 7 月 12 日	
报告期末基金份额总额	303,155,020.96 份	
投资目标	以分享中国经济成长和资本长期稳定增值为宗旨，主要投资于债券及新股配售和增发，在充分控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	债券管理的风险因素依据其对超额收益的贡献大小依次分为久期、期限结构、类属配置和个券选择，我们针对每一类别的风险因素设计相应的管理方法即形成投资策略，依次为久期配置策略、期限结构策略、类属配置策略和个券选择策略。	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏华普天债券 A	鹏华普天债券 B
下属分级基金的交易代码	160602	160608
报告期末下属分级基金的份额总额	274,322,282.16 份	28,832,738.80 份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上

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）	
	鹏华普天债券 A	鹏华普天债券 B
1. 本期已实现收益	3,362,093.06	317,330.54
2. 本期利润	4,027,217.09	383,530.83
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0138	0.0122
4. 期末基金资产净值	362,108,278.94	36,633,867.65
5. 期末基金份额净值	1.320	1.271

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

鹏华普天债券 A

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	1.07%	0.05%	1.70%	0.06%	-0.63%	-0.01%
过去六个月	2.17%	0.05%	2.95%	0.05%	-0.78%	0.00%
过去一年	1.85%	0.08%	5.19%	0.05%	-3.34%	0.03%
过去三年	10.55%	0.07%	14.89%	0.06%	-4.34%	0.01%
过去五年	14.07%	0.11%	19.74%	0.07%	-5.67%	0.04%
自基金合同生效起至今	146.48%	0.22%	78.92%	0.10%	67.56%	0.12%

鹏华普天债券 B

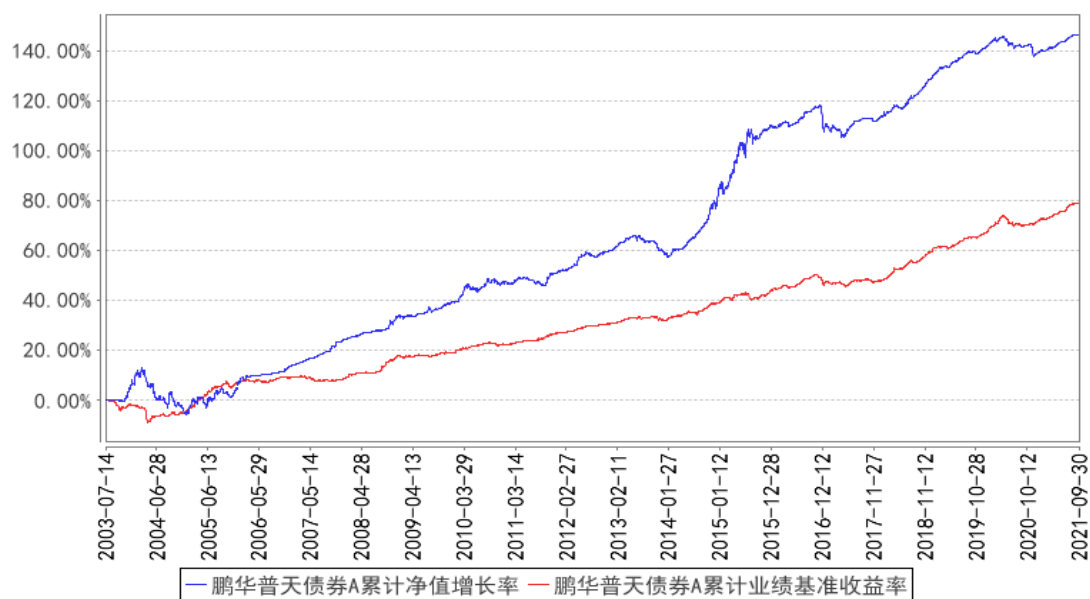
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
----	--------	-----------	--------	--------	-----	-----

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	1.03%	0.04%	1.70%	0.06%	-0.67%	-0.02%
过去六个月	2.09%	0.05%	2.95%	0.05%	-0.86%	0.00%
过去一年	1.61%	0.08%	5.19%	0.05%	-3.58%	0.03%
过去三年	9.55%	0.07%	14.89%	0.06%	-5.34%	0.01%
过去五年	12.37%	0.11%	19.74%	0.07%	-7.37%	0.04%
自基金合同 生效起至今	129.34%	0.22%	78.92%	0.10%	50.42%	0.12%

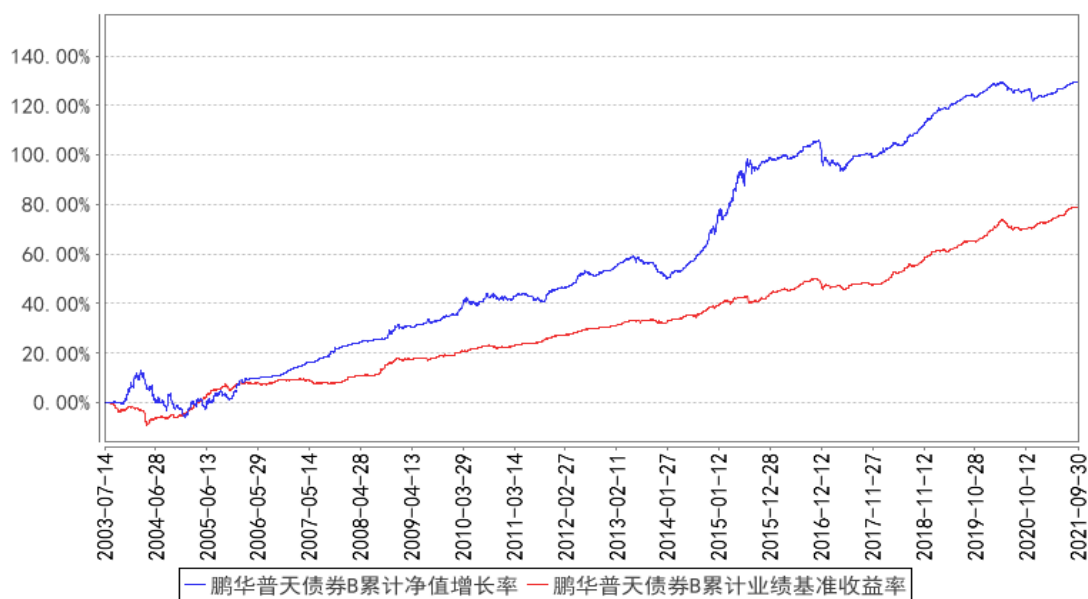
注：业绩比较基准=中证综合债指数收益率

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

鹏华普天债券A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



鹏华普天债券B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 2003 年 07 月 12 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		
刘涛	基金经理	2017-05-24	-	8 年	刘涛先生，国籍中国，金融学硕士，8 年证券从业经验。2013 年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资研究工作，历任固定收益部债券研究员、公募债券投资部副总经理/基金经理，现担任债券投资一部副总经理/基金经理。2016 年 05 月至今担任鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华国有企业债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月至今担任鹏华丰禄债券型证券投资基金基金经理，2017 年 02 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰达债券型证券投资基金基金经理，2017 年 02 月至 2017 年 09 月担任鹏华丰安债券型证券投资基金基金经理，2017 年 02 月至 2019 年 08 月担任鹏

				<p>华丰腾债券型证券投资基金基金经理, 2017 年 02 月至 2019 年 02 月担任鹏华丰恒债券型证券投资基金基金经理, 2017 年 05 月至 2020 年 02 月担任鹏华丰瑞债券型证券投资基金基金经理, 2017 年 05 月至今担任鹏华普天债券证券投资基金基金经理, 2018 年 03 月至 2018 年 12 月担任鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金经理, 2018 年 03 月至 2019 年 08 月担任鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 07 月至今担任鹏华尊悦 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理, 2018 年 10 月至 2019 年 11 月担任鹏华中短债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2018 年 12 月至今担任鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 03 月至 2020 年 06 月担任鹏华永融一年定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 03 月至今担任鹏华永润一年定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 10 月至 2021 年 02 月担任鹏华稳利短债债券型证券投资基金基金经理, 2019 年 12 月至今担任鹏华尊泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理, 2020 年 06 月至今担任鹏华普利债券型证券投资基金基金经理, 2020 年 08 月至今担任鹏华年年红一年持有期债券型证券投资基金基金经理, 2020 年 10 月至今担任鹏华丰瑞债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华永融一年定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华丰宁债券型证券投资基金基金经理, 刘涛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

本季度债市上涨后跌。7 月初随着央行全面降准资金宽松，债市出现上涨，8 月底至 9 月随着地方债发行力度加大，债市出现回调。在债券的配置上，我们先攻后守，前期以偏长久期利率做进攻，后期卖出利率债兑现收益、以偏中短久期中高等级信用债持有为主，从而使得组合净值在本季度债市波动的情况下表现稳健。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为 1.07%，同期业绩比较基准增长率为 1.70%，B 类份额净值增长率为 1.03%，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	462,052,673.00	90.43
	其中：债券	462,052,673.00	90.43
	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	26,000,159.00	5.09
	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	1,871,655.16	0.37
8	其他资产	21,027,243.02	4.12
9	合计	510,951,730.18	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	224,114,400.00	56.21
	其中：政策性金融债	221,097,000.00	55.45
4	企业债券	102,428,373.00	25.69
5	企业短期融资券	69,704,500.00	17.48
6	中期票据	65,805,400.00	16.50
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	462,052,673.00	115.88

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	210211	21 国开 11	500,000	49,880,000.00	12.51
2	200402	20 农发 02	500,000	49,645,000.00	12.45
3	180204	18 国开 04	400,000	41,172,000.00	10.33
4	190214	19 国开 14	400,000	40,212,000.00	10.08
5	200312	20 进出 12	400,000	40,188,000.00	10.08

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

国家开发银行

国家开发银行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大连监管局、陕西监管

局、浙江监管局、国家外汇管理局广西壮族自治区分局、海南省分局和中国人民银行南宁中心支行的行政处罚。

2020 年 12 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会对国家开发银行的以下违法违规行为一、为违规的政府购买服务项目提供融资，二、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，三、违规变相发放土地储备贷款，四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款，五、贷款风险分类不准确，六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产，七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量，八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品，九、扶贫贷款存贷挂钩，十、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，十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求，十二、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，十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理，十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务，十五、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，十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务，十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表，十八、违规收取小微企业贷款承诺费，十九、收取财务顾问费质价不符，二十、利用银团贷款承诺费浮利分费，二十一、向检查组提供虚假整改说明材料，二十二、未如实提供信贷资产转让台账，二十三、案件信息迟报、瞒报，二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位，对公司处以罚款 4880 万元。

2020 年 10 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对国家开发银行违反银行交易记录管理规定的违法违规行为，对国家开发银行处以 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。

中国农业发展银行

中国农业发展银行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江苏监管局、上海监管局、浙江监管局、内蒙古监管局、达州监管分局、眉山监管分局、塔城监管分局、楚雄监管分局、南充监管分局、曲靖监管分局、宿州监管分局、黄冈监管分局、亳州监管分局、玉溪监管分局、阿克苏监管分局、晋城监管分局、开封监管分局、鹤壁监管分局、商丘监管分局、德州监管分局、国家税务总局泸溪县税务局、安仁县税务局、凤凰县税务局、衡阳市石鼓区税务局第二税务所和国家外汇管理局常州市中心支局行政处罚。

中国进出口银行

中国进出口银行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天津监管局、新疆监管局、海南监管局、福建监管局的行政处罚。

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	4,731.20
2	应收证券清算款	13,650,938.36
3	应收股利	-
4	应收利息	7,346,359.13
5	应收申购款	25,214.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,027,243.02

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

项目	鹏华普天债券 A	鹏华普天债券 B
报告期期初基金份额总额	308,972,193.78	37,866,930.32
报告期期间基金总申购份额	3,477,491.23	9,815,937.20
减：报告期期间基金总赎回份额	38,127,402.85	18,850,128.72
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	274,322,282.16	28,832,738.80

§ 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	20210701~20210930	76,863,182.17	-	-	76,863,182.17	25.35
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。

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) 《鹏华普天债券证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华普天债券证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华普天债券证券投资基金 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