

# 鹏华丰收债券型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华丰收债券
基金主代码	160612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 5 月 28 日
报告期末基金份额总额	203,549,617.47 份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过主要投资债券等固定收益类品种，同时兼顾部分被市场低估的权益类品种，力求使基金份额持有人获得持续稳定的投资收益。
投资策略	<p>1、固定收益类品种投资策略</p> <p>(1) 利率策略</p> <p>利率是固定收益类品种最主要的风险来源和收益来源。因此利率策略的选择对基金的投资风险与收益尤为重要。利率策略的选择取决于利率的走势和收益率曲线变动两个方面。</p> <p>本基金通过对宏观经济状况和货币政策等因素的研究，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平；通过对债券市场具体情况分析判断，形成对未来收益率曲线形状变化的预期，相应地选择子弹型、哑铃型或梯形的组合期限配置，获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。</p> <p>(2) 类属配置策略</p> <p>本基金根据对金融债、企业债等债券品种与同期限国债之间收益率利差的历史数据比较，结合当时的市场环境，形成利差预期，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预</p>

期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

### （3）券种的选择策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上，本基金根据债券定价模型，选择最具有投资价值优势的债券品种进行投资。

### （4）动态增强策略

在以上债券投资策略的基础上，本基金还将根据债券市场的动态变化，采取多种灵活策略，获取超额收益，主要包括：

#### 1) 骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，获得资本利得收益。

#### 2) 息差策略

息差策略是指通过不断正回购融资并持续买入债券的操作，只要回购资金成本低于债券收益率，就可以达到杠杆放大的套利目标。

#### 3) 套利策略

a. 利用同一债券品种在不同债券市场上的价格差异，通过无风险套利操作获得由于市场分割带来的超额收益；

b. 利用同期限债券回购品种在不同市场上的利率差异，通过开展无风险套利操作，提高投资组合的盈利能力；

c. 利用同期限债券品种在一、二级市场上的收益率差异，通过投资品种的转换获得一、二级市场的差价收入；

d. 随着未来利率期货、利率期权、利率互换等可以有效规避利率风险的金融衍生产品的推出，在主管机关批准后积极开展套利操作。

#### 4) 可转换公司债的投资策略

可转换公司债券是一种介于股票和债券之间的债券衍生投资品种，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析，选择合适的品种买入持有。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。本基金投资于可转换债券的比例不超过基金资产净值的 30%。同时，本基金可以投资认购可分离交易的可转换公司债券。

#### 5) 资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券由于受到诸多因素影响，定价更为复杂。本基金将根据资产支持证券自身的特点，建立相应的定价模型，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值后再进行投资。

## 2、股票投资策略

股票投资采用“行业配置”与“个股选择”双线并行的投资策略，并通过灵活的仓位调控等手段来避免市场中的系统风险。

### （1）仓位控制策略

对于股票的投资，本基金主要根据股票市场的走势进行仓位控制：

当股票市场处于上涨波段时，本基金将在限定的股票投资比例范围内提高股票投资比例，实现较高回报；当市场震荡运行时，利用市场失衡，重点投资低估的行业、个股，进行波段操作；当市场将下跌或风险较高时，减少股票投资比例甚至不投资股票，尽量回避股市风险。

#### （2）行业配置策略

本基金行业配置采取适度分散、相对集中的配置策略。重点投资景气周期处于拐点或者景气度处于上升阶段的相关行业，同时通过投资于五个以上行业来避免过大的非系统风险。

#### （3）精选个股策略

本基金的选股将主要考虑紧密联系我国目前的宏观经济背景和制度变迁，把握以下三个指标选择股票：管理优秀、治理结构完善；具有稳定、持续的增长能力；公司资产负债率较低、现金流充裕。

#### （4）止盈止损策略

当股票市场基本面没有好转的情况下，基金股票资产跌幅超过投资委员会规定的风险线时，本基金将逐步减少股票仓位，把损失控制在有限范围内；当基金股票资产盈利超过投资委员会规定的止盈线时，本基金将主动梯度式降低股票仓位，以锁定收益。

#### （5）新股申购策略

本基金将研究首次发行股票及增发新股的上市公司基本面，估计新股上市交易的合理价格，并参考一级市场资金供求关系，制定相应新股申购策略。本基金对于通过参与新股申购所获得的股票，将比较市场价格与其内在合理价值，决定继续持有或者卖出。

### 3、基金投资决策

#### （1）决策依据

- 1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- 2) 国内国际宏观经济环境、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、国家产业政策；
- 3) 各行业发展状况、市场波动和风险特征；
- 4) 上市公司研究，包括上市公司成长性的研究和市场走势；
- 5) 证券市场走势。

#### （2）投资流程

- 1) 行业研究小组：行业研究小组对于宏观经济、行业、上市公司、投资策略等与投资决策有关的内容都会进行全面深入的研究，作为投资决策的依据。
- 2) 投资决策委员会：确定本基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，由公司总经理或指定人员召集。如需做出及时重大决策或基金经理小组提议，可临时召开投资决策委员会会议。
- 3) 基金管理小组：设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独

	立判断；绩效与风险评估小组的建议等。 4) 集中交易室：基金经理向集中交易室下达投资指令，集中交易室经理收到投资指令后分发予交易员，交易员收到基金投资指令后准确执行。 5) 绩效与风险评估小组：对开放式基金投资组合进行评估，向基金管理小组提出调整建议。 6) 监察稽核部：对投资指令、流程等进行合法合规审核、监督和检查。
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，其预期的风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，为证券投资基金中的较低风险品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	849,479.15
2. 本期利润	8,360,104.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0438
4. 期末基金资产净值	213,536,596.87
5. 期末基金份额净值	1.049

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

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

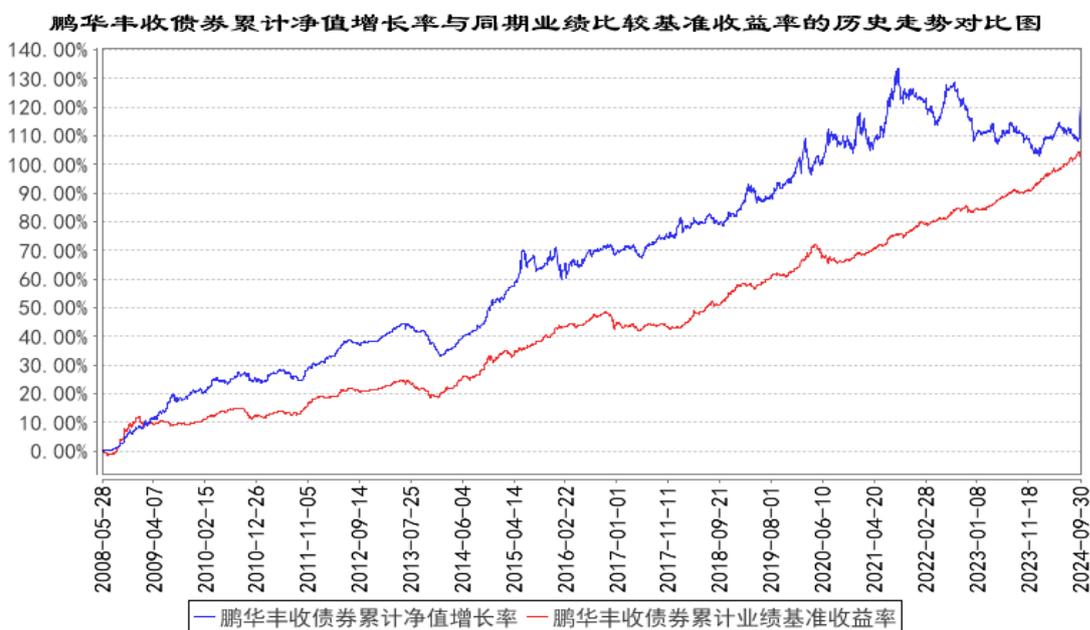
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.96%	0.38%	1.05%	0.13%	2.91%	0.25%

过去六个月	5.22%	0.31%	2.82%	0.11%	2.40%	0.20%
过去一年	4.27%	0.28%	6.44%	0.10%	-2.17%	0.18%
过去三年	-1.95%	0.29%	15.21%	0.09%	-17.16%	0.20%
过去五年	14.74%	0.37%	25.43%	0.10%	-10.69%	0.27%
自基金合同 生效起至今	120.22%	0.28%	102.49%	0.12%	17.73%	0.16%

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



注：1、本基金基金合同于 2008 年 05 月 28 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	2023-06-10	-	18 年	祝松先生, 国籍中国, 经济学硕士, 18 年证券从业经验。曾任职于中国工商银行

				<p>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 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 2018 年 07 月担任鹏华丰盈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，2017 年 03 月至 2022 年 05 月担任鹏华永安 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 2022 年 05 月担任鹏华尊晟 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 2023 年 01 月担任鹏华金利债券型证券投资基金基金经理，2019 年 08 月至 2023 年 06 月担任鹏华尊信 3 个月定期</p>
--	--	--	--	--

				<p>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 2021 年 12 月担任鹏华尊享 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 2023 年 07 月担任鹏华丰达债券型证券投资基金基金经理，2022 年 01 月至今担任鹏华丰康债券型证券投资基金基金经理，2022 年 09 月至 2024 年 04 月担任鹏华永平 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2023 年 06 月至今担任鹏华丰收债券型证券投资基金基金经理，2024 年 01 月至今担任鹏华尊和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2024 年 04 月至今担任鹏华双债保利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>
--	--	--	--	--

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。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 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

2024 年三季度我国债券市场呈小幅盘整走势，与上季度末相比，上证国债指数上涨 1.31%，银行间中债综合财富指数上涨 0.9%。三季度经济基本面环比走弱，央行单季度两次降息，但市场面临较大获利盘止盈压力，同时季末稳增长政策信号强烈，债市整体走势纠结；信用债抛压较重，信用利差有所走阔。

权益及可转债市场方面，股票市场整体先跌上涨，季末政治局会议透露出明确的经济稳增长信号，市场信心大幅提振，最后几日市场出现罕见大幅上涨，非银金融、TMT 等板块领涨大盘，三季度上证综指上涨 12.44%，创业板指上涨 29.21%；转债方面，受岭南转债违约等因素影响，转债本季度整体表现落后于正股，三季度中证转债指数小幅上涨 0.58%。

报告期内本基金以买入并持有中高评级信用债为主，组合久期整体在中低水平。此外，报告期内本基金股票和转债部位进行了一定调整，加仓了 TMT、家电等品种，减仓了银行股等。

### 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 3.96%，同期业绩比较基准增长率为 1.05%。

### 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	34,660,127.80	16.07
	其中：股票	34,660,127.80	16.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	178,956,539.63	82.98
	其中：债券	178,956,539.63	82.98
	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	1,895,385.60	0.88
8	其他资产	142,977.17	0.07
9	合计	215,655,030.20	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,736,782.80	8.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,329,890.00	1.09
F	批发和零售业	244,350.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,190,462.00	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,741,800.00	0.82
J	金融业	9,541,263.00	4.47
K	房地产业	1,875,580.00	0.88
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	34,660,127.80	16.23

### 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	300750	宁德时代	11,800	2,972,302.00	1.39
2	600030	中信证券	78,500	2,135,200.00	1.00
3	601336	新华保险	40,700	1,889,294.00	0.88
4	002402	和而泰	165,000	1,882,650.00	0.88
5	601601	中国太保	41,600	1,626,560.00	0.76
6	601688	华泰证券	88,400	1,555,840.00	0.73
7	600150	中国船舶	34,900	1,457,773.00	0.68
8	601628	中国人寿	26,000	1,144,000.00	0.54
9	000651	格力电器	23,200	1,112,208.00	0.52
10	688347	华虹公司	29,000	1,095,040.00	0.51

#### 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	16,302,293.15	7.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	83,941,840.56	39.31
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	30,851,778.08	14.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,429,830.14	4.88
7	可转债（可交换债）	37,430,797.70	17.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	178,956,539.63	83.81

#### 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	1928003	19 农业银行二级 01	100,000	11,122,603.84	5.21
2	2128039	21 中国银行二级 03	100,000	10,585,803.28	4.96
3	2228017	22 邮储银行二级 01	100,000	10,490,609.32	4.91
4	188054	21 中金 Y2	100,000	10,434,446.58	4.89
5	102380592	23 鲁高速 MTN003	100,000	10,429,830.14	4.88

#### 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

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。

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	6,171.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	136,805.44
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	142,977.17
---	----	------------

#### 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	128048	张行转债	6,842,995.10	3.20
2	110079	杭银转债	2,263,147.31	1.06
3	113060	浙 22 转债	2,210,948.27	1.04
4	113065	齐鲁转债	2,107,858.07	0.99
5	113062	常银转债	2,102,082.95	0.98
6	127032	苏行转债	1,654,756.98	0.77
7	123063	大禹转债	1,352,309.48	0.63
8	113667	春 23 转债	1,274,902.96	0.60
9	113055	成银转债	1,031,322.08	0.48
10	113033	利群转债	751,233.30	0.35
11	123228	震裕转债	750,310.19	0.35
12	113050	南银转债	691,372.30	0.32
13	127014	北方转债	671,794.20	0.31
14	128063	未来转债	653,484.25	0.31
15	127045	牧原转债	647,757.52	0.30
16	123176	精测转 2	629,933.70	0.30
17	123221	力诺转债	606,313.70	0.28
18	128087	孚日转债	589,334.61	0.28
19	123219	宇瞳转债	585,181.92	0.27
20	118046	诺泰转债	532,228.66	0.25
21	123224	宇邦转债	521,642.39	0.24
22	123213	天源转债	516,804.93	0.24
23	127074	麦米转 2	505,960.77	0.24
24	110068	龙净转债	504,238.25	0.24
25	111010	立昂转债	500,696.55	0.23
26	111007	永和转债	472,276.16	0.22
27	123101	拓斯转债	466,375.89	0.22
28	123188	水羊转债	448,188.16	0.21
29	110083	苏租转债	359,388.21	0.17
30	127095	广泰转债	344,454.62	0.16
31	123150	九强转债	342,041.51	0.16
32	113623	凤 21 转债	341,305.89	0.16
33	123211	阳谷转债	339,606.99	0.16
34	118028	会通转债	337,343.01	0.16
35	118021	新致转债	291,197.53	0.14
36	127103	东南转债	289,464.58	0.14
37	127051	博杰转债	265,533.37	0.12
38	113668	鹿山转债	256,534.47	0.12

39	127081	中旗转债	243,964.66	0.11
40	118030	睿创转债	237,942.74	0.11
41	123192	科思转债	224,219.84	0.11
42	123092	天壕转债	222,456.57	0.10
43	118044	赛特转债	123,351.29	0.06
44	128108	蓝帆转债	5,472.43	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	156,298,297.31
报告期期间基金总申购份额	50,186,295.39
减：报告期期间基金总赎回份额	2,934,975.23
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	203,549,617.47

## § 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	20240724~20240930	0.00	49,700,795.23	0.00	49,700,795.23	24.42
	2	20240701~20240930	99,903,845.99	0.00	0.00	99,903,845.99	49.08

**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份额；

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）《鹏华丰收债券型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华丰收债券型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华丰收债券型证券投资基金 2024 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

2024 年 10 月 24 日