

# 鹏华基金致远股债平衡多策略 2 号集合 资产管理计划

## 2024 年第 1 季度报告

资产管理计划管理人：鹏华基金管理有限公司

资产管理计划托管人：招商银行股份有限公司

报告期间：2024 年 01 月 01 日 - 2024 年 03 月 31 日

报告送出日期：2024 年 04 月 30 日

## 1 基本信息

投资组合名称:	鹏华基金致远股债平衡多策略2号集合资产管理计划
合同生效时间:	2020-11-18
管理人:	鹏华基金管理有限公司
托管人:	招商银行股份有限公司

## 2 资产管理计划投资表现

### 2.1 基本收益率信息

	本期末
期末资产净值(元)	13,411,544.32
本期利润(元)	140,341.22
份额净值(元)	0.894
份额累计净值(元)	0.894

## 3 资产管理计划投资组合报告

### 3.1 期末资产配置情况

序号	资产类别	市值(元)	占总资产的比例(%)
1	权益投资	4,678,610.35	34.56
	其中:股票	4,678,610.35	34.56
2	固定收益投资	5,821,216.58	43.00
3	基金	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款及清算备付金	2,877,715.13	21.26
7	其他资产	161,089.99	1.19
8	资产合计	13,538,632.05	100.00

注:本资产管理计划期末持有期货合约0手。

### 3.2 期末资产投资前十名股票(按市值)明细

代码	名称	持仓数量(股)	市值(元)	市值占净资产比例(%)
601766	中国中车	20,500.00	139,810.00	1.04
01766	中国中车	72,000.00	275,446.15	2.05

00902	华能国际电力股份	62,000.00	259,110.12	1.93
600019	宝钢股份	37,000.00	245,680.00	1.83
000807	云铝股份	16,400.00	226,320.00	1.69
000651	格力电器	5,700.00	224,067.00	1.67
01071	华电国际电力股份	58,000.00	220,309.78	1.64
000333	美的集团	3,400.00	218,348.00	1.63
600023	浙能电力	32,000.00	213,440.00	1.59
600150	中国船舶	4,900.00	181,300.00	1.35
600079	人福医药	8,200.00	159,162.00	1.19

### 3.3 期末资产投资前五名固收品种（按市值）明细

代码	名称	持仓数量(张)	市值(元)	市值占净资产比例(%)
110059	浦发转债	10,000.00	1,090,089.04	8.13
132026	G 三峡 EB2	9,000.00	1,082,819.59	8.07
113065	齐鲁转债	10,000.00	1,056,447.95	7.88
113052	兴业转债	10,000.00	1,041,702.74	7.77
128129	青农转债	8,000.00	833,680.00	6.22

### 3.4 期末资产投资前五名基金（按市值）明细

无。

### 3.5 期末管理计划运用杠杆情况

截止本报告期末，本资产管理计划的杠杆比例为 100.95%，符合合同及相关规定。

## 4 管理人履职报告

### 4.1 投资经理（或投资经理小组成员）情况

投资经理姓名	学历	证券从业年限	主要工作经历
张佳	硕士研究生	20 年	张佳先生，国籍中国，经济学硕士，20 年证券从业经验。曾任职于中国银行天津分行稽核部及财富管理与私人银行部，从事信审核查及理财资金池管理工作；华夏银行总行个人部及资产管理部，担任投资经理，从事固定收益投资研究和投资组合的管理工作；天津银行资产

			管理部，担任投资主管，分管理财投资组合的投资研究及风控工作。 2015年8月加盟鹏华基金管理有限公司，历任固定收益部副总经理/投资经理，专户债券投资部总经理/投资经理，混合资产投资部总经理/投资经理，现担任稳定收益投资部总经理/投资经理。张佳先生具备基金从业资格
--	--	--	--

## 4.2 投资策略回顾与展望

1月债市市场对于宽货币预期继续升温，叠加股市波动，长短端利率均明显下行，降准落地后曲线走陡。春节后基本面数据处于真空期，资金面平稳偏松，多个中小银行降低存款利率支撑债市情绪，长短端利率均大幅下行，超长债交投尤其活跃。3月5日政府工作报告靴子落地，政策力度基本符合市场预期，并提出“从今年开始拟连续几年发行超长期特别国债”，债市围绕宽货币政策预期、特别国债供给预期、股债跷跷板等因素宽幅震荡。一季度各期限债券收益率全线下行，截至3月29日，1Y/10Y/30Y国债利率分别收于1.72%、2.29%、2.46%。一季度A股巨幅震荡，年初A股遭遇了罕见的流动性冲击，短期流动性压力已经大幅释放。一季度来看，红利指数领涨，涨幅达10%，组合参与了受益于货币政策确定性宽松的类债资产，以及受供应影响的资源股，择机参与主题行业投资。

## 4.3 公平交易专项说明

### 1、公平交易制度的执行情况的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司管理的不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

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。

### 2、本资产管理计划与其他投资风格相似的证券投资基金之间的业绩比较的专项说明

本资产管理人旗下无其他投资风格相似的证券投资基金。

### 3、异常交易行为的专项说明

报告期内，本资产管理计划未发生违法违规并且对资产管理计划财产造成损失的异常交易行为。

#### 4.4 报告期内资管计划投资收益分配情况

无。

### 5 托管人履职报告

本报告期内，本资产管理计划托管人在托管过程中，严格遵守资产管理计划合同的有关规定和相关法律法规，不存在任何损害资产管理计划持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了资产管理计划托管人应尽的义务。

本报告期内，管理人在投资运作、资产管理计划资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害资产管理计划持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照资产管理计划合同的规定进行。

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本定期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### 6 管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

#### 6.1 管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 03 月 31 日	上季度可比期间 2023 年 10 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	49,256.88	62,295.83

注：本资产管理计划管理费年费率为 1.50%，逐日计提，按季支付。日管理费=前一日资产管理计划资产净值\*1.50%/当年天数。

#### 6.2 托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 03 月 31 日	上季度可比期间 2023 年 10 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	1,641.95	2,076.55

注：本资产管理计划托管费年费率为 0.05%，逐日计提，按季支付。日托管费=前一日资产管理计划资产净值\*0.05%/当年天数。

#### 6.3 浮动管理费

注：本报告期未发生此事项。

#### 6.4 业绩报酬

注：本报告期未发生此事项。

### 7 涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

#### 7.1 投资经理变更

无。

#### 7.2 公司关联人员的持有情况

无。

#### 7.3 重大关联交易情况

本基金在本报告期内未参与基金管理人、托管人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。

#### 7.4 报告期内开放期的相关说明

本计划于 2024 年 2 月分别开放产品份额的退出，退出开放日为：2024 年 02 月 19 日。

#### 7.5 其他

无。

### 8 声明

郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表、附件真实、准确、完整。

鹏华基金管理有限公司

2024 年 04 月 30 日