

鹏华普天债券证券投资基金

[2013] 第四季度报告

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

重要提示

基金管理人的董事会及监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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2014年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，保证复核后不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告中财务数据未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称 鹏华普天债券

交易代码 160602

类别名称 债券型基金

基金名称 鹏华普天债券混合(160603)

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2003年7月12日

报告期末基金资产总额 973,422,589.55元

基金份额 0.995

基金总资产 973,422,589.55元

基金总负债 -639,924.58元

基金份额净值 0.995

基金净值 0.995

基金份额净值增长率 -3.25%

同期基准收益 -2.11%

净值增长率标准差 -0.56%

同期基准收益率标准差 -0.10%

风险收益特征 风险收益特征:本基金为债券型基金,其长期平均的风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金,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 交通银行股份有限公司

下属两个基金的基金简称 鹏华普天债券 A 鹏华普天债券 B

下属两个基金的交易代码 160602 160603

报告期末下属两个基金的份额总额 714,755,844.75份 258,666,744.80份

下属两个基金的风险收益特征 风险收益特征:本基金为债券型基金,其长期平均的风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

§ 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(2013年10月1日-2013年12月31日) 鹏华普天债券 A 鹏华普天债券 B

1.本期已实现收益 242,460.07 -639,924.58

2.本期利润 -25,858,49.18 -1,483,639.51

3.加权平均基金份额本期利润 0.0361 -0.0299

4.期末基金资产净值 718,887,904.79 257,248,616.05

5.期末基金份额净值 1.006 0.995

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，本期利息收入为本期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)。

3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:业绩比较基准=中信标普国债指数收益率×90%+中信金债指数年均收益率×10%
注:本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:鹏华普天债券 A 2003年7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。

4.1 管理人报告

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

阳先伟 基金基金经理 2007年1月20日 - 11 任职日期

注:阳先伟先生,国籍中国,经济学硕士,2000年7月起担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2007年1月起担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2010年9月起担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2012年3月起担任鹏华基金管理有限公司基金经理,现同时担任鹏华基金管理有限公司总经理,投资决策委员会委员、阳先伟先生因个人原因辞职,由张卓先生接任,阳先伟先生辞职后本公司将重新聘任基金经理。

注:阳先伟辞职后,本公司将重新聘任基金经理。

注:本基金合同于2003年7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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守纪情况的说明

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,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金运作符合基金合同和有关法律法规的规定。

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。

本报告中的财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称 鹏华普天债券混合

交易代码 160603

类别名称 债券型基金

基金名称 鹏华普天债券混合(160602),鹏华普天债券 B(160603)

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2003年7月12日

报告期末基金资产总额 1,935,340,964.01元

基金份额 0.995

基金总资产 1,935,340,964.01元

基金份额净值 0.995

基金净值 0.995

基金份额净值增长率 -0.56%

同期基准收益 -0.10%

净值增长率标准差 -0.20%

同期基准收益率标准差 -0.05%

风险收益特征 风险收益特征:本基金为债券型基金,为追求投资基金的稳定性和高安全性,严格控制风险和预期收益,力争在长期内获得超越通胀的回报。

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。

本报告中的财务资料未经审计。

§ 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(2013年10月1日-2013年12月31日) 鹏华普天债券混合

1.本期已实现收益 44,443,018.50

2.本期利润 61,203,722.77

3.加权平均基金份额本期利润 0.0317

4.期末基金资产净值 1,573,311,544.75

5.期末基金份额净值 0.994

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,本期利息收入为本期实现收益加上本期公允价值变动收益;

2.所述基金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)。

3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:业绩比较基准=中信标普国债指数收益率×70%+中信金债指数年均收益率×25%+金融债指数年均收益率×5%

注:本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:鹏华普天债券混合 2003年7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。

4.1 管理人报告

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

阳先伟 基金基金经理 2007年1月20日 - 11 任职日期

注:阳先伟先生,国籍中国,经济学硕士,2000年7月起担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2007年1月起担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2010年9月起担任鹏华基金管理有限公司基金经理,2012年3月起担任鹏华基金管理有限公司基金经理,现同时担任鹏华基金管理有限公司总经理,投资决策委员会委员、阳先伟先生因个人原因辞职,由张卓先生接任,阳先伟先生辞职后本公司将重新聘任基金经理。

注:阳先伟辞职后,本公司将重新聘任基金经理。

注:本基金合同于2003年7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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守纪情况的说明

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用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金运作符合基金合同和有关法律法规的规定。

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。

本报告中的财务资料未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称 鹏华普天债券混合

交易代码 160602

类别名称 债券型基金

基金名称 鹏华普天债券混合(160602)

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2003年7月12日

报告期末基金资产总额 1,935,340,964.01元

基金份额 0.994

基金总资产 1,935,340,964.01元

基金份额净值 0.994

基金净值 0.994

基金份额净值增长率 -0.56%

同期基准收益 -0.10%

净值增长率标准差 -0.20%

同期基准收益率标准差 -0.05%

风险收益特征 风险收益特征:本基金为债券型基金,为追求投资基金的稳定性和高安全性,严格控制风险和预期收益,力争在长期内获得超越通胀的回报。

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。

本报告中的财务资料未经审计。

§ 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(2013年10月1日-2013年12月31日) 鹏华普天债券混合

1.本期已实现收益 44,443,018.50

2.本期利润 61,203,722.77

3.加权平均基金份额本期利润 0.0317

4.期末基金资产净值 1,573,311,544.75

5.期末基金份额净值 0.994

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,本期利息收入为本期实现收益加上本期公允价值变动收益;

2.所述基金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)。

3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:业绩比较基准=中信标普国债指数收益率×70%+中信金债指数年均收益率×25%+金融债指数年均收益率×5%

注:本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:鹏华普天债券混合 2003年7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。