鹏华产业债债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2015年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中期财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华产业债债券
场内简称	-
基金主代码	206018
交易代码	206018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年2月6日
报告期末基金份额总额	345,839,104.59份
投资目标	在追求基金资产稳定增值、有效控制风险的基础上,通过对产业债积极主动的投资管理,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 在资产配置方面,本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种及债券类资产与现金类资产之间进行动态调整。 2.债券投资策略 本基金在债券投资中以产业债投资为主,一般情况下,在债券类投资产品中,产业债的收益率要高于国债、央行票据等其他债券的收益率。投资产业债是通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益,所以在个券的选择当中特别重视信用风险的评估和防范。 本基金将主要采取信用策略,同时辅之以久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,力争获取信用溢价,以最大程度上取得超越基金业绩比较基准的收益。
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,为证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。
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

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	4,348,101.91
2.本期利润	4,971,939.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0260
4.期末基金资产净值	395,308,164.26
5.期末基金份额净值	1.143

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。

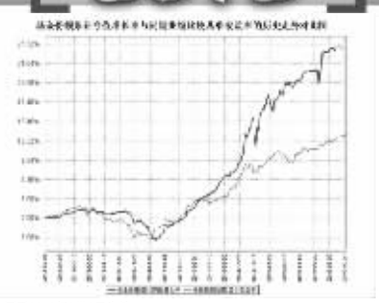
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	2.93%	0.37%	2.13%	0.08%	0.80%	0.29%

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2013年2月6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 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	本基金基金经理	2014年3月14日	-	9	祝松先生,国籍中国,经济学硕士,9年金融证券从业经验。曾任职于中国工商银行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,2014年2月起担任鹏华普天债券基金基金经理,2014年2月起兼任鹏华丰润债券型证券投资基金基金经理,2014年3月起兼任鹏华产业债债券型证券投资基金基金经理,2015年3月起兼任鹏华双债加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。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度我国债券市场整体延续小幅上涨走势,与上季度末相比,上证国债指数上涨1.32%,银行间中债综合财富指数上涨2.10%。股市大幅下挫,大量资金涌入债市,同时经济未见起色,猪肉价格高位回落带动通胀预期减弱,长期债券利率下行幅度较大;但受到人民币贬值资金外流影响,短期利率有所反弹,制约了中短期债券利率下降幅度。

权益及可转债市场方面,股票市场在一系列救市政策下逐渐企稳,但市场信心受挫严重,市场反弹乏力,可转债品种日渐稀少,转债估值有所提升,转债表现好于正股。

报告期内本基金以持有中高评级信用债为主,债券组合久期保持中性水平,对于可转债,本基金在三季度整体采取较为谨慎的态度,少量参与了可转债的波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年三季度本基金份额净值增长率为2.93%,同期业绩基准增长率为2.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面,房地产、制造业投资持续低迷,稳增长短期内仍需要依赖基建发力,尽管政府稳增长措施不断,但其效果仍需要观察;货币政策方面,经济弱势背景下,货币政策需要延续宽松,整体而言,债市风险有限。需要警惕的是稳增长持续发力背景下,经济存在短期企稳甚至反弹的可能,长久期利率债可能面临一定的调整风险。

对于权益及可转债市场,当前市场面临着比较复杂的影响因素,有利的因素是,金融市场整体流动性依然充裕,渴望高收益的资金不断在大类资产间寻找机会,不利的因素是,股票估值仍然偏高,市场信心整体较弱,我们倾向于认为四季度市场仍然面临一定的波动风险。

基于以上分析,2015年四季度本基金将以中高评级信用债为主, 维持中等久期, 谨慎参与可转债市场的波段操作,本基金将继续坚持稳健投资原则,以获取中长期收益为最主要目标。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注: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	335,416,800.00	69.82
	其中:债券	335,416,800.00	69.82
	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	40,000,000.00	8.33
	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	92,613,960.32	19.28
8	其他资产	12,364,250.16	2.57
9	合计	480,395,010.48	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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:本基金本报告期末未持有股票。

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	20,134,000.00	5.09
	其中:政策性金融债	20,134,000.00	5.09
4	企业债券	225,084,800.00	56.94
5	企业短期融资券	90,198,000.00	22.82
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	335,416,800.00	84.85

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	124062	12冀顺德	500,000	52,415,000.00	13.26
2	122465	15广越01	500,000	50,000,000.00	12.65
3	124054	12株云龙	300,000	31,395,000.00	7.94
4	011519001	15国电SCP001	300,000	30,207,000.00	7.64
5	011599639	15龙源电力SCP009	300,000	29,997,000.00	7.59

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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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:本基金本报告期末未持有贵金属。

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:本基金本报告期末未持有权证。

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中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,808.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,688,320.41
5	应收申购款	4,661,121.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,364,250.16

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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:本基金本报告期末未持有股票。

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	147,942,282.99
报告期期间基金总申购份额	209,463,487.07
减:报告期期间基金总赎回份额	11,566,665.47
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	345,839,104.59

§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:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金管理人本报告期未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)《鹏华产业债债券型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华产业债债券型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华产业债债券型证券投资基金2015年第3季度报告》(原文)。

8.2 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

北京市西城区金融大街 25 号中国建设银行股份有限公司

8.3 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)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
2015年10月27日

鹏华创业板指数分级证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2015年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华创业板分级		
场内简称	创业指基		
基金主代码	160637		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年6月9日		
报告期末基金份额总额	326,707,029.86份		
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。 本基金力争鹏华创业板份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。		
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		
下属分级基金简称	创业板分级	创业板A	创业板B
下属分级场内简称	创业指基	创业A	创业B
下属分级基金交易代码	160637	150243	150244
下属分级基金报告期末基金份额总额	81,437,432.85份	122,634,798.00份	122,634,799.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	鹏华创业板A份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的特征。	鹏华创业板B份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日7)
1.本期已实现收益	-45,030,188.18
2.本期利润	-47,977,172.83
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1287
4.期末基金资产净值	235,483,267.74
5.期末基金份额净值	0.721

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。

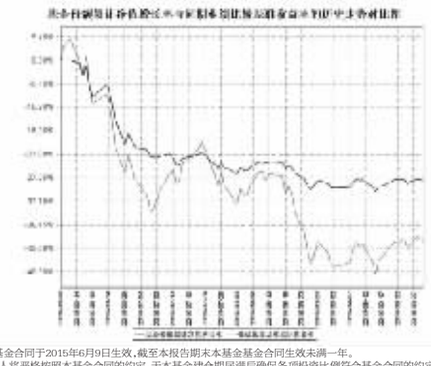
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	-13.24%	1.17%	-25.78%	3.90%	12.54%	-2.73%

注:业绩比较基准=创业板指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2015年6月9日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定,于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

§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		
王咏辉	本基金基金经理	2015年6月9日	-	17	王咏辉先生,国籍英国,英国牛津大学工程和计算机专业硕士,17年证券基金从业经验。曾担任伦敦摩根大通投资基金管理公司高级分析师,汇丰投资基金管理公司高级分析师,伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人,巴克莱资本公司部门负责人,泰达宏利基金公司国际投资部副总监、产品与金融工程部副总经理等职,2010年4月至2012年8月担任泰达宏利中证财富大盘指数型证券投资基金基金经理,2011年7月至2012年8月担任泰达宏利全球新格局证券投资QDII基金基金经理,2011年12月至2012年8月担任泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理;2012年11月加盟鹏华基金管理有限公司,2013年12月起担任鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金经理,2014年9月起兼任鹏华中证800地产指数分级证券投资基金基金经理,2014年12月起兼任鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,2015年6月起兼任鹏华创业板指数分级证券投资基金、鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理,现同时担任量化及衍生品投资部总经理,投资决策委员会成员。王咏辉先生具备基金从业资格,英国基金经理从业资格(IMC)。本报告期内本基金基金经理未发生变动。本基金为本期内新成立基金。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

受房地产和制造业投资增速下滑影响,第三季度国内经济增速延续下滑趋势;叠加股市大幅调整,机构避险资金大量涌入债券市场,推动债券收益率曲线出现平坦化下行,7年期以上品种收益率回落幅度超过30BP。第三季度所有全价及财富指数均出现不同程度的上涨,其中企业债财富指数上涨幅度最大,涨幅达2.88%。

在第三季度,基于经济增长较弱及政策放松的判断,我们对整体债券市场持谨慎乐观态度,组合久期维持中性水平,主要配置3年期附近中期品种,其中信用品种以中高评级为主。此外,在第三季度,我们继续调整了可转债的配置力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本季度基金份额净值增长率为-2.28%,业绩基准增长率为2.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第四季度,虽然近期房地产市场销售持续回暖,但全国房地产库存仍处于较高水平,严重制约房地产企业的新开工意愿。由于当前企业杠杆率居于高位,且盈利保持低迷,制造业投资短期内难以大幅回升。除非政府进一步出台稳增长措施,并能有效推动社会融资增速持续回升,否则国内经济增长将保持低迷走势,债市仍处于较好的投资环境。

另一方面,受股票市场调整影响,大量理财资金涌入债市,目前各主要期限品种债券收益率已创年内新低,机构进一步配置债券动力可能略有减弱,短期内债券收益率继续大幅回落的可能性也进一步下降。

信用产品方面,虽然目前央行维持较为宽松的货币政策,市场流动性持续改善,企业外部融资难度有所下降,但受宏观经济环境持续恶化影响,企业盈利尚未出现明显改善,信用风险事件仍可能继续发生。并且当前信用利差已处于历史较低水平,短期内难以继续大幅缩窄。因此,后期投资中我们将继续规避中低评级信用债,以有效控制风险。

综合而言,我们预计四季度债券收益率呈窄幅整理格局,投资收益可能主要来自于票息收入。组合将保持中性久期,品种选择方面,预计仍会以中高评级信用债为主。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注: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	50,452,137.93	20.00
	其中:股票	50,452,137.93	20.00
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	201,310,510.25	79.82
7	其他资产	440,241.58	0.17
8	合计	252,202,889.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

序号	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	83,808.00	0.04
C	制造业	20,983,777.03	8.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	716,977.86	0.30
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,809,134.32	7.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,304,464.37	0.55
M	科学研究和技术服务业	645,635.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	1,643,268.28	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,840,095.99	0.78
R	文化、体育和娱乐业	5,424,977.08	2.30
S	综合	-	-
	合计	50,452,137.93	21.42

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.3 报告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 报告期末指数投资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	300027	华谊兄弟	82,600	2,612,638.00	1.11
2	300104	乐视网	63,273	2,586,600.24	1.10
3	300059	东方财富	53,900	1,939,322.00	0.82
4	300024	机器人	31,758	1,800,678.60	0.76
5	300070	碧水源	37,612	1,643,268.28	0.70
6	300017	网宿科技	30,214	1,592,579.94	0.68
7	300168	万达信息	43,813	1,334,105.85	0.57
8	300058	蓝色光标	98,911	1,055,380.37	0.45
9	300315	掌趣科技	78,000	856,440.00	0.36
10	300124	汇川技术	23,941	854,933.11	0.36

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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:本基金本报告期末未持有贵金属。

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:本基金本报告期末未持有权证。

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中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	278,384.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,315.88
5	应收申购款	93,703.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,837.60
8	其他	-
9	合计	440,241.58

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300027	华谊兄弟	2,612,638.00	1.11	重大事项停牌
2	300070	碧水源	1,643,268.28	0.70	重大事项停牌
3	300168	万达信息	1,334,105.85	0.57	重大事项停牌
4	300058	蓝色光标	1,055,380.37	0.45	重大事项停牌

5.11.6 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.11.7 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	创业板分级	创业板A	创业板B
报告期期初基金份额总额	106,611,432.77	35,003,135.00	35,003,136.00
报告期期间基金总申购份额	1,488,522,346.13	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	1,338,433,020.05	-	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-"填列)	-175,263,326.00	87,631,663.00	87,631,663.00
报告期期末基金份额总额	81,437,432.85	122,634,798.00	122,634,799.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额

§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:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金管理人本报告期未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 鹏华资产管理(深圳)有限公司及其产品持有鹏华创业板指数分级证券投资基金情况

公司/产品名称	期末持有份额(份)		
	鹏华创业板分级	鹏华创业板A	鹏华创业板B
鹏华资产-银河证券-安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	-	2,462,527.00	2,962,500.00

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)《鹏华创业板指数分级证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华创业板指数分级证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华创业板指数分级证券投资基金2015年度第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43层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行股份有限公司

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)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
2015年10月27日

鹏华纯债债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2015年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华纯债债券
场内简称	-
基金主代码	206015
交易代码	206015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月3日
报告期末基金份额总额	475,104,055.98份
投资目标	在适度控制风险的基础上,通过严格的利差分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金债券投资将主要采取久期策略,同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过严格的利差分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 在资产配置方面,本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。
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,为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。
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

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	2,670,600.77
2.本期利润	-8,228,002.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0229
4.期末基金资产净值	512,509,506.31
5.期末基金份额净值	1.079

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同