鹏华新兴产业股票型证券投资基金

【2012】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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月24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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华新兴产业股票
基金主代码	206009
交易代码	206009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月15日
报告期末基金份额总额	750,090,334.42份
投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,挖掘未来推动经济发展的新兴产业并从中精选优质个股,力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,运用定量及定性相结合的手段,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2、股票投资策略 本基金通过跟踪、分析经济运行态势、经济政策以及产业结构的优化升级,识别经济发展过程中具有良好发展前景的新兴产业及相关上市公司,针对各类公司的不同特征,通过自上而下及自下而上相结合的方法筛选出优秀的上市公司构建投资组合。 3、债券投资策略 本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等,采取积极主动的投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现债券组合增值。 4、权证产品投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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(2012年7月1日 - 2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,968,580.62
2.本期利润	-15,864,490.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0202
4.期末基金资产净值	711,205,424.46
5.期末基金份额净值	0.948

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。

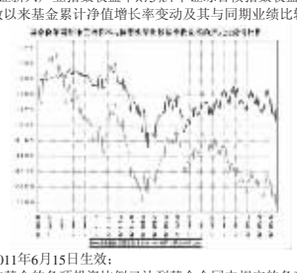
3.2 基金净值表现

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	-2.17%	0.90%	-5.52%	1.01%	3.35%	-0.11%

注:业绩比较基准=中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%

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、本基金合同于2011年6月15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		
陈鹏	本基金基金经理	2011年6月15日	-	9	陈鹏先生,国籍中国,清华大学工商管理硕士,9年证券从业经验。曾在联合证券有限责任公司任行业研究员;2006年5月加入鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,历任行业研究员、鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金经理助理,2007年8月至2011年1月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理,2008年8月至2011年5月担任鹏华普丰基金基金经理,2011年1月起至今担任鹏华中国50开放式证券投资基金基金经理,2011年6月15日起兼任鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金经理。陈鹏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。
梁浩	本基金基金经理	2011年7月14日	-	4	梁浩先生,国籍中国,中国人民大学经济学博士,4年证券从业经验。曾任职于信息产业部电信研究院,从事产业政策研究;2008年5月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,担任研究部高级研究员、基金经理助理,2011年7月起担任鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金经理。梁浩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并对基金财产造成损失的异常交易行为,未存在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%的异常交易行为。

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

受宏观数据影响,三季度市场整体表现平平。由于对宏观经济相对谨慎,新兴产业基金在三季度维持较低仓位,并坚持在医药、计算机、电子、通讯、环保等行业相对较高的配置比例,使得本基金取得一定的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-2.17%,同期上证综指下跌6.26%,深圳成指下跌8.64%,沪深300指数下跌6.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观数据看,7月、8月的PMI、工业增加值、M2等数据持续低迷。市场部分人士对于宏观经济2季度见底,3季度缓慢回升的预期未能实现。相反,市场逐步达成共识的是,未来1-2年内,中国经济的潜在增长率将有所下降,宏观经济将维持向下或底部震荡格局,与宏观经济高度相关的行业和公司将很难有趋势性的表现。与此同时,一些成长性较好的公司仍会受到市场的眷顾,其业绩能否达预期或超预期将成为股价的决定因素。我们维持之前的判断,将更为积极的配置那些在国民经济转型中,在成长性较好的行业中,选择优秀的公司。

§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	512,784,746.97	71.47
	其中:股票	512,784,746.97	71.47
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	204,250,056.06	28.47
6	其他资产	407,424.07	0.06
7	合计	717,442,227.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	206,091,190.51	28.98
C0	食品、饮料	11,061,000.00	1.56
C1	纺织、服装、皮毛	1,958,686.56	0.28
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	26,459,953.28	3.72
C5	电子	7,981,563.16	1.12
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	98,248,729.14	13.81
C8	医药、生物制品	60,381,258.37	8.49
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,319,539.92	1.59
E	建筑业	1,996,000.00	0.28
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	132,620,695.52	18.65
H	批发和零售贸易	35,221,649.24	4.95
I	金融、保险业	48,716,052.34	6.85
J	房地产业	25,770,622.94	3.62
K	社会服务业	43,423,889.10	6.11
L	传播与文化产业	7,625,107.40	1.07
M	综合类	-	-
	合计	512,784,746.97	72.10

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

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	600050	中国联通	10,501,089	38,749,018.41	5.45
2	600498	烽火通信	1,209,960	29,353,629.60	4.13
3	600535	天士力	368,652	18,963,458.88	2.67
4	002152	广电运通	1,170,042	16,965,609.00	2.39
5	600276	恒瑞医药	549,791	16,664,165.21	2.34
6	000157	中联重科	1,899,957	16,377,629.34	2.30
7	002255	海陆重工	1,182,580	16,355,081.40	2.30
8	600104	上汽集团	1,199,916	16,246,862.64	2.28
9	000069	华侨城A	2,895,000	16,212,000.00	2.28
10	000963	华东医药	450,000	15,525,000.00	2.18

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

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名的前十名资产支持证券投资明细

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	40,491.77
4	应收利息	40,675.91
5	应收申购款	76,256.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	407,424.07

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末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	600498	烽火通信	12,130,000.00	1.71	非公开发行

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	811,937,374.59
本报告期基金总申购份额	6,522,156.62
减:本报告期基金总赎回份额	68,369,196.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	750,090,334.42

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金合同);

(二)鹏华新兴产业股票型证券投资基金托管协议);

(三)鹏华新兴产业股票型证券投资基金2012年第3季度报告》原文)。

7.2 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。

7.3 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
2012年10月24日

鹏华普天收益证券投资基金

【2012】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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月24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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华普天收益混合
基金主代码	160603
交易代码	160603
系列基金名称	鹏华普天系列基金
系列其他子基金名称	鹏华普天债券A(160602),鹏华普天债券B(160608)
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	3,191,331,395.48份
投资目标	以分享中国经济成长和资本长期稳健增值为宗旨,主要投资于连续现金分红股票及债券,通过组合投资,在充分控制风险的前提下实现基金财产的长期稳定增值。
投资策略	(1)债券投资方法:本基金债券投资的目的是降低组合总体波动性从而改善组合风险构成。在债券的投资上,采取积极主动的投资策略,不对持续期作限制。持续期、期限结构、类属配置以及个券选择的动态调整都将是我们获得超额收益的重要来源。 (2)股票投资方法:本基金主要采用积极管理的投资方式。以鹏华股票池中连续两年分红股票以及三年内有两年分红记录的公司作为投资对象,适当集中投资。所有重点投资股票必须经过基金经理/研究员的调研,就企业经营、融资计划、分红能力、绝对价值、相对价值给出全面评估报告。
业绩比较基准	中信标普A股综合指数涨跌幅×70%+中信标普国债指数涨跌幅×25%+金融同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属平衡型证券投资基金,为证券投资基金中的中等风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金,高于指数型基金、纯债券基金和国债。
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

§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(2012年7月1日 - 2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-132,668,495.79
2.本期利润	-133,561,573.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0416
4.期末基金资产净值	2,301,438,010.35
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。

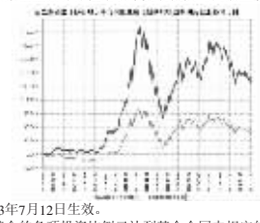
3.2 基金净值表现

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	-5.50%	0.87%	-4.61%	0.87%	-0.89%	0.00%

注:业绩比较基准=中信标普A股综合指数涨跌幅×70%+中信标普国债指数涨跌幅×25%+金融同业存款利率×5%。

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 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		
张卓	本基金基金经理	2009年1月17日	-	8	张卓先生,国籍中国,管理学硕士,8年证券从业经验。2004年6月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,历任行业研究员、鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理,2007年8月至2009年1月担任鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2009年1月起至今担任鹏华普天收益证券投资基金基金经理,2011年1月起至今兼任鹏华行业成长证券投资基金基金经理。张卓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,未存在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%的异常交易行为。

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

3季度期间,经济景气暂无起色,本基金采取了防守的策略,择机将基金仓位降至契约规定的下限,配置上回避了周期性的股票,加强对个股的研究,结合估值和行业前景发掘投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-5.50%,同期上证综指下跌6.26%,深圳成指下跌8.64%,沪深300指数下跌6.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入9月新一轮全球货币宽松已经开始,美联储推出QE3,欧央行进行OMT以及日本加大资产购买力度,这些政策短期会刺激市场,但由于国际各国的经济结构问题以及边际效用递减,政策对经济增长的提振力度有限。

而我国也在9月大幅推出了许多大型项目,9月初批准全国多个城市共计25个城市轨道交通项目建设规划,总投资额超8400亿元,加之随后的公路、港口、机场、市政建设以及环保项目,据媒体统计超过5万亿。政府还对大病医疗、医院改革、中小企业融资、节能家电补贴、降低企业税负以及提高出口补贴等出台了各类政策。

我们认为这些政策依旧围绕促进民生和稳定增长,近期促进经济增长的力度更大;不过国际的货币宽松将使得我国扩张政策受到一定抑制,住宅房地产市场价格不稳定也使得政策可能出现反复。总体而言,我们判断政策大方向上使得经济可能在明年上半年有所超预期复苏,目前来看,无论是宏观经济还是股票市场,都应该是机遇大于风险。我们将继续密切跟踪核心经济指标,择机增加仓位,把握周期性品种的投资机会。

§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	1,451,027,640.41	62.59
	其中:股票	1,451,027,640.41	62.59
2	固定收益投资	541,961,000.00	23.38
	其中:债券	541,961,000.00	23.38
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	307,933,566.07	13.28
6	其他资产	17,537,024.79	0.76
7	合计	2,318,459,231.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	11,422,000.00	0.50
B	采掘业	12,622,996.08	0.55
C	制造业	773,909,320.54	33.63
C0	食品、饮料	253,470,989.08	11.01
C1	纺织、服装、皮毛	1,582,574.50	0.07
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	560,406.71	0.02
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,932,293.34	0.39
C5	电子	32,058,561.80	1.39
C6	金属、非金属	49,804,249.99	2.16
C7	机械、设备、仪表	229,338,337.89	9.97
C8	医药、生物制品	135,632,870.03	5.89
C99	其他制造业	62,529,037.20	2.72
D	电力、煤气及水的生产和供应业	27,700,507.39	1.20
E	建筑业	21,737,238.64	0.94
F	交通运输、仓储业	24,445,353.47	1.06
G	信息技术业	132,377,240.54	5.75
H	批发和零售贸易	27,296,744.37	1.19
I	金融、保险业	134,955,139.92	5.86
J	房地产业	127,281,555.53	5.53
K	社会服务业	123,598,953.23	5.37
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	33,680,590.70	1.46
	合计	1,451,027,640.41	63.05

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

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	601318	中国平安	2,000,000	83,880,000.00	3.64
2	600519	贵州茅台	300,000	73,740,000.00	3.20
3	000069	华侨城A	13,000,000	72,800,000.00	3.16
4	000799	酒鬼酒	1,200,000	65,640,000.00	2.85
5	000651	格力电器	3,000,000	64,140,000.00	2.79
6	002574	明牌珠宝	3,190,257	62,529,037.20	2.72
7	002317	众生药业	2,058,759	62,380,397.70	2.71
8	000858	五粮液	1,599,994	54,239,796.60	2.36
9	002244	滨江集团	7,099,814	52,183,632.90	2.27
10	002051	中工国际	1,690,000	50,497,200.00	2.19

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	33,231,000.00	1.44
2	央行票据	367,688,000.00	15.98
3	金融债券	141,042,000.00	6.13
	其中:政策性金融债	141,042,000.00	6.13
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	541,961,000.00	23.55

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	1001047	10央行票据47	1,500,000	149,670,000.00	6.50
2	1001032	10央行票据32	1,200,000	119,808,000.00	5.21
3	120216	12国开16	800,000	80,064,000.00	3.48
4	110413	11农发13	600,000	60,978,000.00	2.65
5	1001060	10央行票据60	500,000	49,860,000.00	2.17

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	904,810.55
2	应收证券清算款	10,019,704.39
3	应收股利	273,780.00
4	应收利息	6,310,266.44
5	应收申购款	28,463.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,537,024.79

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	3,222,922,504.10
本报告期基金总申购份额	7,822,738.70
减:本报告期基金总赎回份额	39,413,847.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,191,331,395.48

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同);

(二)鹏华普天系列开放式证券投资基金托管协议);

(三)鹏华普天收益证券投资基金2012年第3季度报告》原文)。

7.2 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。

7.3 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
2012年10月24日

鹏华普天债券证券投资基金

【2012】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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月24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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华普天债券
交易代码	160602
系列基金名称	鹏华普天系列基金
系列其他子基金名称	鹏华普天收益混合(160603)
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	672,941,523.38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	中信标普国债指数涨跌幅×90%+金融同业存款利率×10%
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
下属两级基金的基金简称	鹏华普天债券A / 鹏华普天债券B
下属两级基金的交易代码	160602 / 160608
报告期末下属两级基金的份额总额	517,797,782.20份 / 155,143,741.18份
下属两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

§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(2012年7月1日 - 2012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	3,654,636.86	1,140,344.75
2.本期利润	-2,543,713.89	-522,159.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0058	-0.0030
4.期末基金资产净值	614,000,299.88	175,638,641.06
5.期末基金份额净值	1.186	1.132

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

鹏华普天债券A

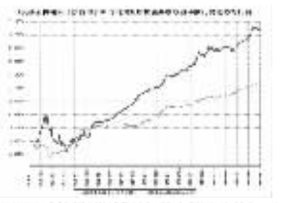
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去三个月	-0.17%	0.10%	0.64%	0.04%	-0.81%	0.06%

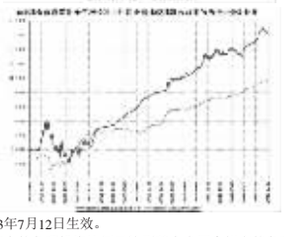
鹏华普天债券B

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	-0.26%	0.10%	0.64%	0.04%	-0.90%	0.06%

注:业绩比较基准=中信标普国债指数涨跌幅×90%+金融同业存款利率×10%

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 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		
阳先伟	本基金基金经理	2006年12月6日	-	10	阳先伟先生,国籍中国,经济学硕士,10年证券从业经验。先后在民生证券、国海证券等机构从事债券研究及投资组合管理工作,历任研究员、高级经理等职务。2004年9月加盟鹏华基金管理有限公司从事债券及宏观研究工作,曾任鹏华普天债券基金基金经理助理;2006年12月起至今任鹏华普天债券基金基金经理,2008年5月起至今兼任鹏华丰收债券型证券投资基金基金经理,2010年12月起兼任鹏华丰润债券型证券投资基金基金经理。阳先伟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