

鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金

2014] 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:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2014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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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，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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 鹏华丰实定期开放债券

场内简称 -

基金主代码 000295

交易代码 000295

基金运作方式 约定,本基金采取在封闭期内封闭运作,封闭期与封闭期之间即期开放的运作方式。

基金合同生效日 2013年7月10日

报告期初基金份额总额 272,338,459.01份

报告目标 在有效控制风险的前提下,通过每日定期开放的形式操作灵活流动机制,力求取得超越基准业绩的回报。

投资策略 本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券、可分离交易的可转债、短期融资券、超短期融资券、货币市场工具、央行票据、逆回购、同业存单、资产支持证券、债券回购、资产支持票据等品种,同时可少量投资于股票、权证、股指期货、国债期货等权益类金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

业绩比较基准 一年期定期存款利率+0.5%

风险收益特征 本基金属于货币市场基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金、高风险偏好的基金,为货币市场基金中具有较低风险收益特征的产品。

基金管理人 中信银行股份有限公司

基金合同生效日 2013年7月10日

报告期初基金资产净值 166,566,535.10份

报告期末基金的风险收益特征 风险收益特征同上

报告期末基金资产净值 166,566,535.10份

注:1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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申购基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计算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 本基金报告期内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

鹏华丰实定期开放债券A

阶段

净值增长①

净值增长标准差②

业绩比较基准收益率③

基准差④

过去三个月 3.46% 0.13% 0.88% 0.01% 2.58% 0.12%

鹏华丰实定期开放债券B

阶段

净值增长①

净值增长标准差②

业绩比较基准收益率③

基准差④

过去三个月 3.37% 0.14% 0.86% 0.01% 2.49% 0.13%

注:业绩比较基准一年定期存款利率+0.5%

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

鹏华丰实定期开放债券A

阶段

净值增长①

净值增长标准差②

业绩比较基准收益率③

基准差④

过去三个月 3.46% 0.13% 0.88% 0.01% 2.58% 0.12%

鹏华丰实定期开放债券B

阶段

净值增长①

净值增长标准差②

业绩比较基准收益率③

基准差④

过去三个月 3.37% 0.14% 0.86% 0.01% 2.49% 0.13%

注:本基金合同于2013年9月10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。

5.4 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间 证券从业年限 说明

戴钢 基金经理 2013年9月10日 - 12 戴钢先生,国籍中国,厦门大学经济法专业毕业,获法学学士学位,先后就职于平安证券研究所,担任研究员;2005年9月加入鹏华基金管理有限公司,历任债券研究员、专户投资经理等职位;2013年1月起兼任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理;2013年10月起兼任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理;2013年11月起兼任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理;2014年1月起兼任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理;2014年3月起兼任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理;2014年7月起兼任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理;2014年9月起兼任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理;2014年10月起兼任鹏华丰实定期开放债券型证券投资基金基金经理。

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,但对新成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

2.正职以上的人员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求最大利益。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 公平交易行为的执行情况

本基金报告期内未发生违法买卖证券的情况。

4.3.3 报告期内基金投资组合类资产的偏离度

本基金报告期内不存在偏离度绝对值连续超过0.5%的情况。

4.3.4 报告期内未进行关联交易的说明

本基金报告期内未进行关联交易。

4.3.5 报告期内未向关联方输送商品、服务或借款的说明

本基金报告期内未向关联方输送商品、服务或借款。

4.3.6 报告期内未向关联方支付管理费的说明

本基金报告期内未向关联方支付管理费。

4.3.7 报告期内未向关联方支付托管费的说明

本基金报告期内未向关联方支付托管费。

4.3.8 报告期内未向关联方支付销售服务费的说明

本基金报告期内未向关联方支付销售服务费。

4.3.9 报告期内未向关联方租赁固定资产的说明

本基金报告期内未向关联方租赁固定资产。

4.3.10 报告期内未向关联方购买原材料的说明

本基金报告期内未向关联方购买原材料。

4.3.11 报告期内未向关联方出售产品或服务的说明

本基金报告期内未向关联方出售产品或服务。

4.3.12 报告期内未向关联方拆借资金的说明

本基金报告期内未向关联方拆借资金。

4.3.13 报告期内未向关联方划拨资金的说明

本基金报告期内未向关联方划拨资金。

4.3.14 报告期内未向关联方转移财产的说明

本基金报告期内未向关联方转移财产。

4.3.15 报告期内未向关联方租用无形资产的说明

本基金报告期内未向关联方租用无形资产。

4.3.16 报告期内未向关联方借款的说明

本基金报告期内未向关联方借款。

4.3.17 报告期内未向关联方购买商品或接受劳务的说明

本基金报告期内未向关联方购买商品或接受劳务。

4.3.18 报告期内未向关联方捐赠资产的说明

本基金报告期内未向关联方捐赠资产。

4.3.19 报告期内未向关联方提供担保的说明

本基金报告期内未向关联方提供担保。

4.3.20 报告期内未向关联方出售资产的说明

本基金报告期内未向关联方出售资产。

4.3.21 报告期内未向关联方转让股权的说明

本基金报告期内未向关联方转让股权。

4.3.22 报告期内未向关联方取得报酬的说明

本基金报告期内未向关联方取得报酬。

4.3.23 报告期内未向关联方支付管理费的说明

本基金报告期内未向关联方支付管理费。

4.3.24 报告期内未向关联方支付托管费的说明

本基金报告期内未向关联方支付托管费。

4.3.25 报告期内未向关联方支付销售服务费的说明

本基金报告期内未向关联方支付销售服务费。

4.3.26 报告期内未向关联方支付租赁费的说明

本基金报告期内未向关联方支付租赁费。

4.3.27 报告期内未向关联方支付无形资产的说明

本基金报告期内未向关联方支付无形资产。

4.3.28 报告期内未向关联方出售资产的说明

本基金报告期内未向关联方出售资产。

4.3.29 报告期内未向关联方转移财产的说明

本基金报告期内未向关联方转移财产。

4.3.30 报告期内未向关联方租用无形资产的说明

本基金报告期内未向关联方租用无形资产。

4.3.31 报告期内未向关联方出售商品或接受劳务的说明

本基金报告期内未向关联方出售商品或接受劳务。

4.3.32 报告期内未向关联方捐赠资产的说明

本基金报告期内未向关联方捐赠资产。

4.3.33 报告期内未向关联方提供担保的说明

本基金报告期内未向关联方提供担保。

4.3.34 报告期内未向关联方支付管理费的说明

本基金报告期内未向关联方支付管理费。

4.3.35 报告期内未向关联方支付托管费的说明

本基金报告期内未向关联方支付托管费。

4.3.36 报告期内未向关联方支付销售服务费的说明

本基金报告期内未向关联方支付销售服务费。

4.3.37 报告期内未向关联方支付租赁费的说明

本基金报告期内未向关联方支付租赁费。

4.3.38 报告期内未向关联方支付无形资产的说明

本基金报告期内未向关联方支付无形资产。

4.3.39 报告期内未向关联方出售商品或接受劳务的说明

本基金报告期内未向关联方出售商品或接受劳务。

4.3.40 报告期内未向关联方捐赠资产的说明

本基金报告期内未向关联方捐赠资产。

4.3.41 报告期内未向关联方提供担保的说明

本基金报告期内未向关联方提供担保。

4.3.42 报告期内未向关联方支付管理费的说明

本基金报告期内未向关联方支付管理费。

4.3.43 报告期内未向关联方支付托管费的说明

本基金报告期内未向关联方支付托管费。

4.3.44 报告期内未向关联方支付销售服务费的说明

本基金报告期内未向关联方支付销售服务费。

4.3.45 报告期内未向关联方支付租赁费的说明

本基金报告期内未向关联方支付租赁费。

4.3.46 报告期内未向关联方支付无形资产的说明

本基金报告期内未向关联方支付无形资产。

4.3.47 报告期内未向关联方出售商品或接受劳务的说明

本基金报告期内未向关联方出售商品或接受劳务。

4.3.48 报告期内未向关联方捐赠资产的说明