

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2015年3月26日

1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人:中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月24日复核了本报告中的财务指标、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,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及其更新。

本基金鹏华理财21天债券型证券投资基金基金合同于2014年1月28日至2014年2月26日,鹏华理财21天债券型证券投资基金基金合同持有人大会以通讯方式召开。本次基金份额持有人大会,出席有效书面表决意见的基金份额持有人及代理人所代表的基金份额占权益登记日鹏华理财21天债券型证券投资基金份额的90.9374%,达到法定表决条件,符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《鹏华理财21天债券型证券投资基金合同》的相关规定,本次持有人大会审议通过了《鹏华理财21天债券型证券投资基金转型相关事项的议案》,并将会议结果报送中国证监会备案,修改后的《鹏华月月发短期理财债券型证券投资基金合同》正式生效。

本年度报告摘要自年度报告正文、投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期,鹏华理财21天债券型证券投资基金报告期自2014年1月1日至2014年3月16日止,鹏华月月发短期理财债券型证券投资基金报告期自2014年3月17日至2014年3月31日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型前)

基金名称	鹏华理财21天债券
场内简称	-
基金代码	200016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年1月10日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金的份额总额	68,549,664.65份
基金合同的延续期	不定期
下属分级基金的基金简称	鹏华理财21天债券A 鹏华理财21天债券B
下属分级基金的交易代码	200016 200617
报告期末分级基金的份额总额	8,460,631.73份 50,089,032.92份

2.1 基金基本情况(转型后)

基金名称	鹏华月月发理财A
场内简称	-
基金代码	200016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同的延续期	2014年1月10日
报告期末基金的份额总额	23,479,762.34份
下属分级基金的交易代码	200016 200617
报告期末分级基金的份额总额	23,479,762.34份

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	本基金在安全的基点上,以有效控制投资风险和保持适度流动性为前提,追求获得高于商业银行存款的稳定收益。
投资策略	本基金采用价值投资的策略策略,将投资组合的平均剩余期限控制在141天以内,在控制利率风险、尽享货币市场净值波动并满足流动性的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	七天通知存款(税后)
风险收益特征	本基金属于低风险品种,是证券投资基金中的最低风险较低预期风险品种。本基金的风险和预期收益水平低于货币型基金,风险收益水平高于货币型基金和债券型基金。
下属分级基金的风险收益特征	鹏华理财21天债券A 风险收益特征同上 鹏华理财21天债券B 风险收益特征同上

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	在追求安全的基点上,追求稳健的当期收益。
投资策略	本基金采用价值投资的策略策略,在报告期内,本基金将坚持将组合期限与运作期限基本一致,从而使得本基金的平均剩余期限与所投资的债券品种的剩余期限相匹配,从而实现债券投资组合的稳定性。
业绩比较基准	七天通知存款(税后)
风险收益特征	本基金属于低风险品种,是证券投资基金中的最低风险较低预期风险品种。本基金的风险和预期收益水平低于货币型基金,风险收益水平高于货币型基金和债券型基金。
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
姓名	张文	林葛
信息披露负责人	联系人电话	010-60000069
电子邮箱	zhangwp@phfund.com.cn	tgx@caicn.com
客户服务电话	4000788999	95599
传真	0755-82321126	010-69121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	深圳市福田区福华三路101号深国投国际商业中心B3层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯旋国际中心东座9层中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位:人民币元

鹏华理财21天债券A		鹏华理财21天债券B	
2014年1月1日至2014年3月16日	2013年	2012年12月19日至基金合同生效日(2012年12月31日)	
本期已实现收益			
本期利润	4,361,563.12	3,525,101.07	2,595,582.19
本期净值	4,361,563.12	3,525,101.07	2,595,582.19
本期基金份额净值	0.9985%	0.9187%	0.8785%
本期基金份额净值	0.9985%	0.9187%	0.8785%
期末基金资产净值	8,460,631.73	50,089,032.92	10,347,028.26
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
期末可供分配基金份额利润	1.0000	1.0000	1.0000

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(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,开放式基金的转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

(3) 表中的“期末”指转型前最后一日,即3月16日。

(4) 基金收益分配按运作期定期份额。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位:人民币元

鹏华理财21天债券A		鹏华理财21天债券B	
2014年3月17日至2014年12月31日			
本期已实现收益	4,302,503.12	4,202,503.12	3,803,061.00
本期利润	4,302,503.12	4,202,503.12	3,803,061.00
本期净值	1.0000	1.0000	1.0000
本期基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
期末基金资产净值	23,479,762.34	23,479,762.34	23,479,762.34
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(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,开放式基金的转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

(3) 表中的“期末”指报告期最后一日,即12月31日,无论该日是否为开放日或交易日的。

(4) 基金收益分配按运作期定期份额。

(5) 本基金基金合同于2014年3月17日生效,至2014年12月31日未满一年,故2014年的数据和指标为非完整会计年度数据。

3.2 基金净值表现(转型前)

基金净值的计算方法同上。

3.2.1 基金份额净值收益及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华理财21天债券A

金额单位:人民币元

阶段	份额净收益 收益率(%)	业绩比较基准 收益率(%)	业绩比较基准 收益率差(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.0658%	0.0048%	0.2774%	0.0000%	0.3811%
过去六个月	0.4721%	0.0046%	0.9679%	0.0000%	1.5142%
自基金合同生 效日至至今	4.7190%	0.0104%	1.6756%	0.0000%	3.0430%
鹏华理财21天债券B					
阶段	份额净收益 收益率(%)	业绩比较基准 收益率(%)	业绩比较基准 收益率差(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.0708%	0.0048%	0.2774%	0.0000%	0.3004%
过去六个月	0.5038%	0.0046%	1.0679%	0.0000%	1.7264%
自基金合同生 效日至至今	5.0694%	0.0105%	1.6756%	0.0000%	3.3909%

注: 业绩比较基准=七天通知存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华理财21天债券A

金额单位:人民币元

阶段	份额净收益 收益率(%)	业绩比较基准 收益率(%)	业绩比较基准 收益率差(%)	①-③	②-④

<tbl_r cells="6" ix="3