

鹏华信用增利债券型证券投资基金

[2015] 第一季度报告

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:2015年4月21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。
基金销售代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。

§ 2 基金财务指标
报告期利润2015年1月1日起至3月31日止

§ 3 主要财务指标
单位:人民币元

报告期(2015年1月1日—2015年3月31日)

鹏华信用增利债券A 鹏华信用增利债券B

1.本期实现收益 9,065,663.52 1,633,848.37

2.本期利润 8,331,736.48 1,554,538.32

3.加权平均基金份额本期利润 0.0255 0.0268

4.期末基金资产净值 329,081,549.83 68,978,277.35

5.期末基金份额净值 1.214 1.195

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入，投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和除相关费用后的利润，本期利润为期间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 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日—2015年3月31日)

鹏华信用增利债券A 鹏华信用增利债券B

1.本期实现收益 9,065,663.52 1,633,848.37

2.本期利润 8,331,736.48 1,554,538.32

3.加权平均基金份额本期利润 0.0255 0.0268

4.期末基金资产净值 329,081,549.83 68,978,277.35

5.期末基金份额净值 1.214 1.195

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入，投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和除相关费用后的利润，本期利润为期间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。

§ 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年1月1日—2015年3月31日)

鹏华信用增利债券A 鹏华信用增利债券B

1.本期实现收益 9,065,663.52 1,633,848.37

2.本期利润 8,331,736.48 1,554,538.32

3.加权平均基金份额本期利润 0.0255 0.0268

4.期末基金资产净值 329,081,549.83 68,978,277.35

5.期末基金份额净值 1.214 1.195

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入，投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和除相关费用后的利润，本期利润为期间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 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

鹏华信用增利债券A

注:1.本基金业绩比较基准为中债总财富(现券)指数。
3.2.2 自基金合同生效以来本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

鹏华信用增利债券A

注:1.本基金业绩比较基准为中债总财富(现券)指数。
2.截至报告期末，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。

§ 3.3 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 简介

刘建岩 基金基金经理 2011年4月8日 - 9

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.本公司对从业人员实行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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。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 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.3.1 公平交易专项说明

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

本基金管理人在发生异常交易行为时及时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投资人买卖同日反向交易或反向交易次数较少的单边交易超过该账户当月成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的估值政策和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的估值政策和运作分析

2015年1月，本基金的估值政策调整为：定期存款按持有天数比例进行摊余成本法估值，定期存款的利率调整时，定期存款的估值收益率将调整为定期存款的利率乘以持有天数的百分比，定期存款的利率调整时，定期存款的估值收益率将调整为定期存款的利率乘以持有天数的百分比，定期存款的利率调整时，定期存款的估值收益率将调整为定期存款的利率乘以持有天数的百分比。

4.4.2 本报告期内基金的业绩表现

本基金管理人运用固有资金投资于本基金，报告期内，本基金的业绩表现良好，超额收益率显著。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.5.1 公平交易专项说明

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。

4.5.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人在发生异常交易行为时及时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投资人买卖同日反向交易或反向交易次数较少的单边交易超过该账户当月成交量5%的情况。

4.6 报告期内基金的业绩表现

本基金管理人在发生异常交易行为时及时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投资人买卖同日反向交易或反向交易次数较少的单边交易超过该账户当月成交量5%的情况。

4.7 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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.8 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.8.1 公平交易专项说明

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。

4.8.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人在发生异常交易行为时及时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投资人买卖同日反向交易或反向交易次数较少的单边交易超过该账户当月成交量5%的情况。

4.9 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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.10 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.10.1 公平交易专项说明

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。

4.10.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人在发生异常交易行为时及时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投资人买卖同日反向交易或反向交易次数较少的单边交易超过该账户当月成交量5%的情况。

4.10.3 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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.10.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

4.10.5 报告期内前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期内未持有前十名股票中存在流通受限情况。

4.10.6 投资组合报告附注的前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

5. 报告期内基金的业绩表现

5.1 本期基金的业绩表现

本基金的业绩评价指标显示，本报告期内，本基金的净值增长率为2.53%，B类份额净值增长率为2.40%，同期业绩基准增加率为0.32%。

5.2 报告期内基金持有数量最多的前20名持有人情况

注:本基金本报告期内未持有数量最多的前20名持有人情况。

5.3 报告期内基金投资组合报告

5.3.1 期末基金资产组合

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.2 报告期内基金行业分类

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.3 报告期内基金持有数量最多的前20名行业分类

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.4 报告期内基金投资的前十名行业

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.5 报告期内基金投资的前十名股票

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.6 报告期内基金投资的前十名债券

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.7 报告期内基金投资的前十名贵金属

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.8 报告期内基金投资的前十名保险

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.9 报告期内基金投资的前十名股指期货

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.10 报告期内基金投资的前十名国债期货

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.11 报告期内基金投资的前十名股票期权

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.12 报告期内基金投资的前十名权证

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.13 报告期内基金投资的前十名沪股通

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.14 报告期内基金投资的前十名深股通

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.15 报告期内基金投资的前十名沪股通港股通

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.16 报告期内基金投资的前十名深股通港股通

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.17 报告期内基金投资的前十名沪股通基金

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.18 报告期内基金投资的前十名深股通基金

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.19 报告期内基金投资的前十名沪股通基金

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.20 报告期内基金投资的前十名深股通基金

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.21 报告期内基金投资的前十名沪股通基金

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.22 报告期内基金投资的前十名深股通基金

注:本基金本报告期内未持有资产。

5.3.23 报告期内基金投资的前十名沪股通基金

注