

鹏华实业债纯债债券型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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7月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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的规定,于2015年7月15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,保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺在本报告期间内不采取重大投资决策。投资者有疑问,投资人在作出投资决策前请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。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:鹏华实业债纯债债券型证券投资基金

场内简称:鹏华实业债

基金代码:000063

交易代码:000063

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2013年6月27日

报告期末基金份额总额:40,400,443,260

投资目标:本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争取得超越业绩基准的收益。

投资策略:本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争取得超越业绩基准的收益。

投资范围:本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、央行票据、中期票据、中小企业私募债、股票(非股票型基金的股票投资比例不超过基金资产的20%)、权证、货币市场工具、银行存款、国债回购、货币市场基金、股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品种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:中债企业债总指数*80%+中债国债指数*20%

风险收益特征:本基金属于债券型基金,风险低于股票型基金,风险高于货币型基金,为投资者提供中低风险的理财产品。

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4月1日 - 2015年6月30日)

1.本期已实现收益 3,820,629,600

2.本期利润 4,326,598,02

3.加权平均基金份额本期利润 0.121

4.期末基金份额净值 69,336,704,48

5.期末基金份额净值 1.461

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.本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),计上场后实际收益水平可能低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 0.02% 0.01% 2.90% 0.07% 7.03% 0.02%

注:业绩比较基准=中债企业债总指数*80%+中债国债指数*20%

3.2.2 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

图示了基金成立以来的净值增长率,并将其与同期业绩比较基准收益率进行了比较。

注:1.本基金合同于2013年6月3日生效。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 任职日期 离任日期 说明

刘太阳 基金经理 2013年6月3日 - 9 本基金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。

本基金的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10 其他资产构成

序号 代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 041600094 国开行票据 300,000 24,918,000.00 41.99

2 041600094 CPO02 100,000 10,104,000.00 17.03

3 1220671 111期国债 70,000 7,140,000.00 12.03

4 1232011 14国开08 25,000 4,623,250.00 7.79

5 14国开08 40,000 4,067,200.00 6.95

6 14国开08 40,000 4,067,200.00 6.95

7 14国开08 40,000 4,067,200.00 6.95

8 其他 - - -

9 合计 - - -

1,408,443.25

5.10.4 报告期末持有的待转股的可转换债券明细

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 1220671 111期国债 2,894,774.46 4.98

5.10.5 报告期内基金的宏观经济分析

5.10.6 报告期内基金的投资组合报告

5.10.7 报告期内基金的利润分配情况

5.10.8 报告期末基金资产净值

5.10.9 报告期末持有的基金份额总额

5.10.10 报告期末资产配置

5.10.11 报告期末持有的基金份额

5.10.12 报告期末持有的基金份额

5.10.13 报告期末持有的基金份额

5.10.14 报告期末持有的基金份额

5.10.15 报告期末持有的基金份额

5.10.16 报告期末持有的基金份额

5.10.17 报告期末持有的基金份额

5.10.18 报告期末持有的基金份额

5.10.19 报告期末持有的基金份额

5.10.20 报告期末持有的基金份额

5.10.21 报告期末持有的基金份额

5.10.22 报告期末持有的基金份额

5.10.23 报告期末持有的基金份额

5.10.24 报告期末持有的基金份额

5.10.25 报告期末持有的基金份额

5.10.26 报告期末持有的基金份额

5.10.27 报告期末持有的基金份额

5.10.28 报告期末持有的基金份额

5.10.29 报告期末持有的基金份额

5.10.30 报告期末持有的基金份额

5.10.31 报告期末持有的基金份额

5.10.32 报告期末持有的基金份额

5.10.33 报告期末持有的基金份额

5.10.34 报告期末持有的基金份额

5.10.35 报告期末持有的基金份额

5.10.36 报告期末持有的基金份额

5.10.37 报告期末持有的基金份额

5.10.38 报告期末持有的基金份额

5.10.39 报告期末持有的基金份额

5.10.40 报告期末持有的基金份额

5.10.41 报告期末持有的基金份额

5.10.42 报告期末持有的基金份额

5.10.43 报告期末持有的基金份额

5.10.44 报告期末持有的基金份额

5.10.45 报告期末持有的基金份额

5.10.46 报告期末持有的基金份额

5.10.47 报告期末持有的基金份额

5.10.48 报告期末持有的基金份额

5.10.49 报告期末持有的基金份额

5.10.50 报告期末持有的基金份额

5.10.51 报告期末持有的基金份额

5.10.52 报告期末持有的基金份额

5.10.53 报告期末持有的基金份额

5.10.54 报告期末持有的基金份额

5.10.55 报告期末持有的基金份额

5.10.56 报告期末持有的基金份额

5.10.57 报告期末持有的基金份额

5.10.58 报告期末持有的基金份额

5.10.59 报告期末持有的基金份额

5.10.60 报告期末持有的基金份额

5.10.61 报告期末持有的基金份额

5.10.62 报告期末持有的基金份额

5.10.63 报告期末持有的基金份额

5.10.64 报告期末持有的基金份额

5.10.65 报告期末持有的基金份额

5.10.66 报告期末持有的基金份额

5.10.67 报告期末持有的基金份额

5.10.68 报告期末持有的基金份额

5.10.69 报告期末持有的基金份额

5.10.70 报告期末持有的基金份额

5.10.71 报告期末持有的基金份额

5.10.72 报告期末持有的基金份额

5.10.73 报告期末持有的基金份额

5.10.74 报告期末持有的基金份额

5.10.75 报告期末持有的基金份额

5.10.76 报告期末持有的基金份额

5.10.77 报告期末持有的基金份额

5.10.78 报告期末持有的基金份额

5.10.79 报告期末持有的基金份额

5.10.80 报告期末持有的基金份额

5.10.81 报告期末持有的基金份额

5.10.82 报告期末持有的基金份额

5.10.83 报告期末持有的基金份额

5.10.84 报告期末持有的基金份额

5.10.85 报告期末持有的基金份额

5.10.86 报告期末持有的基金份额

5.10.87 报告期末持有的基金份额

5.10.88 报告期末持有的基金份额

5.10.89 报告期末持有的基金份额

5.10.90 报告期末持有的基金份额

5.10.91 报告期末持有的基金份额

5.10.92 报告期末持有的基金份额

5.10.93 报告期末持有的基金份额