鹏华丰润债券型证券投资基金(LOF)

【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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,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2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华丰润债券(LOF)
场内简称	鹏华丰润
基金主代码	160617
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2010年12月2日
报告期末基金份额总额	35,949,904.11份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,通过积极的投资策略,力争为基金持有人创造较高的当期收益。
投资策略	基金管理人将采取积极的投资策略,寻找各种可能的价值增长机会,力争实现超越基准的投资收益。 1.资产配置策略 在大类资产配置方面,本基金通过对宏观经济形势及利率变化趋势的重点分析,结合对股票市场趋势的研判及新股申购收益率的预测,比较未来一定时间内债券市场和股票市场的相对预期收益率,在债券、股票一级市场及现金之间进行动态调整。 2.资产流动性拟同分配策略 鉴于投资人对投资标的流动性需求随时间呈递增分布的规律,本基金在成立后初期将在以最小成本确保合理流动性水平的前提下,适当降低资产组合的流动性水平,争取累积较高的投资收益。当预期投资人对流动性的边际需求上升到一定程度(本基金界定为基金合同生效后三年),本基金将调高投资组合的流动性水平并开放基金的申购、赎回,以优化投资回报及流动性给投资人带来的整体收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金,为证券投资基金中的低风险品种。
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	2,835,440.78
2.本期利润	1,993,718.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0500
4.期末基金资产净值	46,308,628.14
5.期末基金份额净值	1.288

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。

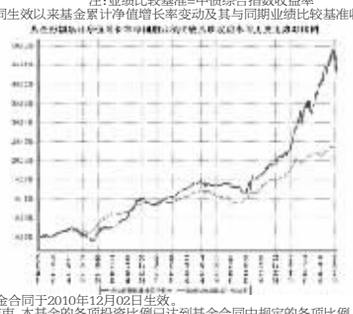
3.2 基金净值表现

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	3.70%	0.50%	2.35%	0.10%	1.35%	0.40%

注:业绩比较基准=中债综合指数收益率

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.本基金基金合同于2010年12月02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		
祝松	本基金基金经理	2014年2月22日	-	9	祝松先生,国籍中国,经济学硕士,9年金融证券从业经验。曾任职于中国工商银行深圳市分行资金营运部,从事债券投资及理财产品组合投资管理;招商银行总行金融市场部,担任代客理财投资经理,从事人民币理财产品组合的投资管理工作。2014年1月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券投资管理工作,2014年2月至今担任鹏华普天债券基金经理,2014年2月至今兼任鹏华丰润债券型证券投资基金基金经理,2014年3月起兼任鹏华产业债债券型证券投资基金基金经理,2015年3月起兼任鹏华双债加利债券型证券投资基金基金经理。祝松先生具备基金从业资格。本报告期内本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。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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%的情况。

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

2015年二季度我国债券市场整体延续小幅上涨走势,与上季度末相比,上证国债指数上涨1.13%,银行间中债综合财富指数上涨2.36%。具体来看,债券收益率曲线趋于陡峭化,中短期债券利率明显下行,长期债券表现为区间震荡,这主要是由于一方面,经济低迷、通胀不高,货币政策延续宽松,基本面仍然对债市有利,尤其是在短端市场上;另一方面,股市资金分流、地方债供给压力、稳增长加力引发的经济企稳反弹预期则抑制了长债的上涨。

权益及可转债市场方面,股票市场在四、五月份大幅上行,但六月后半月出现大幅回调,二季度上证综指总体上涨14%。可转债跟随正股呈现过山车走势,由于临近赎回时点,本季末部分转债品种价格甚至低于上季末水平。

报告期内本基金以持有中等评级信用债为主,债券组合久期保持中性水平,此外,本基金在二季度逐步降低了权益仓位,但是在季末少量增加了转债的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年二季度本基金份额净值增长率为3.7%,同期业绩基准增长率为2.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期内债券市场可能维持区间震荡格局,一方面,宽松货币政策延续,股市调整可能使部分资金回流债市,推动债券市场继续走好;另一方面,上半年稳增长政策逐渐发力,房地产销售持续好转,经济存在企稳反弹可能,可能使得长期债券利率水平进一步下降的空间受到抑制。

对于权益及可转债市场,我们持谨慎乐观的态度,一方面,经济结构转型仍然需要良好的资本市场环境,另一方面,短期内股市的大幅调整对市场各方均产生了较为明显的心理影响,我们倾向于认为下半年市场仍然面临一定的波动风险。

基于以上分析,三季度本基金仍将以中等评级信用债为主,维持中等久期,适量参与权益及转债市场波段操作。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形;截至报告期末,本基金资产净值仍低于五千万元。

§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	7,267,133.76	9.51
	其中:股票	7,267,133.76	9.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	63,537,453.80	83.17
	其中:债券	63,537,453.80	83.17
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,249,213.93	5.56
8	其他资产	1,339,415.44	1.75
9	合计	76,393,216.93	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	采矿业	-	-
C	制造业	2,380,140.00	5.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123,240.00	0.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,443,754.40	9.60
K	房地产业	319,999.36	0.69
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,267,133.76	15.69

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	600016	民生银行	246,760	2,452,794.40	5.30
2	000425	徐工机械	130,000	1,725,100.00	3.73
3	600109	国金证券	50,000	1,220,000.00	2.63
4	600875	东方电气	32,000	655,040.00	1.41
5	601398	工商银行	120,000	633,600.00	1.37
6	600067	冠城大通	32,258	319,999.36	0.69
7	601211	国泰君安	4,000	137,360.00	0.30
8	601985	中国核电	8,000	104,560.00	0.23
9	601368	绿城水务	1,000	18,680.00	0.04

注:以上为本基金本报告期末持有的全部股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	61,984,723.50	133.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,552,730.30	3.35
8	其他	-	-
9	合计	63,537,453.80	137.20

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	122868	ST沈煤债	162,460	16,216,757.20	35.02
2	122850	11华泰债	160,000	16,150,400.00	34.88
3	122685	12吉城投	154,990	13,076,506.30	28.24
4	122058	10豫园债	70,000	7,079,100.00	15.29
5	112059	11联化债	60,000	6,552,000.00	14.15

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券之一的国金证券的发行主体国金证券股份有限公司(简称"国金证券")于2014年12月22日收到中国证监会厦门监管局下发的"[2014]9号"行政监管措施决定书,称国金证券在金融产品销售过程中未制定相应的内控管理制度,内规管理缺失;国金证券未按照中国证监会厦门监管局证券营业部例行检查通知的要求报告信托计划等产品的代销情况,同时责令国金证券完善内控合规管理,加强员工执业行为监督,认真履行监管报告义务。

对该证券的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该证券发行人,认为国金证券作为国内规模较大的综合性券商将长期受益于我国资本市场的发展,上述行政监管措施决定书中涉及的问题不会对国金证券的财务状况及经营成果产生实质性影响。本次行政监管措施对该证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,482.11
2	应收证券清算款	98,694.44
3	应收股利	-
4	应收利息	1,235,139.53
5	应收申购款	99.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,339,415.44

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113501	洛钼转债	1,533,840.00	3.31

5.10.5 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。

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	44,227,678.42
报告期期间基金总申购份额	6,918,419.41
减:报告期期间基金总赎回份额	15,196,193.72
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	35,949,904.11

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)《鹏华丰润债券型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华丰润债券型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华丰润债券型证券投资基金2015年第2季度报告》(原文)。

8.2 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

北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行股份有限公司。

8.3 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)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
2015年7月18日

鹏华丰盛稳固收益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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,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	鹏华丰盛债券
场内简称	-
基金主代码	206008
交易代码	206008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月25日
报告期末基金份额总额	1,449,745,813.93份
投资目标	注重风险控制,力争获取超越存款利率的绝对收益。
投资策略	本基金力争获取超越存款利率的绝对收益,并认为对风险的敏感相握和精准控制是创造绝对收益的关键。在控制风险方面,本基金将通过投资组合保险策略对系统性风险进行管理,通过构建投资组合对非系统性风险进行分散,在此基础上,重视基金管理人自上而下投资能力的发挥,以追求超越基准的绝对收益。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+1.6%
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金,为证券投资基金中的中低风险品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	142,167,804.36
2.本期利润	111,951,642.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0745
4.期末基金资产净值	1,671,088,840.21
5.期末基金份额净值	1.153

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。

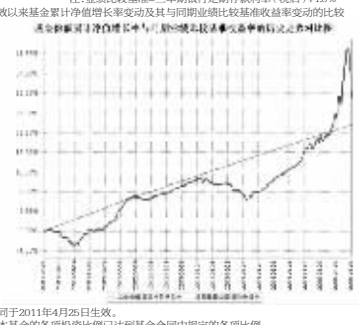
3.2 基金净值表现

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	5.99%	0.78%	1.30%	0.01%	4.69%	0.77%

注:业绩比较基准=三年期银行定期存款利率(税后)+1.6%

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、本基金基金合同于2011年4月25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。

3.3 其他指标

§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		
初冬	本基金基金经理、固定收益部总经理	2011年4月25日	-	18	初冬女士,国籍中国,经济学硕士,18年证券从业经验。曾在平安证券研究所、平安保险投资管理中心等公司从事研究与投资工作,2000年8月至今就职于鹏华基金管理有限公司,历任研究员、鹏华普丰基金基金经理助理等职,2005年4月至2013年1月担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2011年4月起至今担任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理,2013年3月起至今兼任鹏华双债增利债券型证券投资基金基金经理,2013年5月起至今兼任鹏华双债加利债券型证券投资基金基金经理;现同时担任鹏华基金总裁助理、固定收益投资总监、固定收益部总经理、投资决策委员会成员及社保基金组合投资经理。初冬女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
刘太阳	本基金基金经理	2015年3月10日	-	9	刘太阳先生,国籍中国,理学硕士,9年金融证券从业经验。曾任中国农业银行金融市场部高级交易员,从事债券投资交易工作;2011年5月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券研究工作,担任固定收益部研究员。2012年9月起至今担任鹏华纯债债券型证券投资基金基金经理,2012年12月至2014年3月担任鹏华理财21天债券型证券投资基金(2014年3月已转型为鹏华月月发短期理财债券型证券投资基金)基金经理,2013年4月起兼任鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金基金经理,2013年5月起兼任鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金经理,2014年3月起兼任鹏华月月发短期理财债券型证券投资基金基金经理,2015年3月起兼任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理,现同时担任固定收益部副总经理。刘太阳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。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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%的情况。

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

2015年二季度债券市场整体走强,中债总财富指数上涨2.27%。二季度由于宏观经济增速下行趋势依旧,央行进一步放宽了货币政策,这使得银行间短端回购利率回落明显,从而带动了债券市场的上涨。不过临近半年末,资金面有所收紧,债券市场出现了小幅回调。

在组合的资产配置上,我们对债券资产仍然维持了以中短期债券品种为主的投资策略,并维持了一定的杠杆。对于权益类资产,我们关注可转债波段性机会,因此进行了适度配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年二季度丰实A基金的净值增长率为5.10%,丰实B基金的净值增长率为5.01%,同期业绩基准增长率为0.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观数据上看,经济增速下行的趋势并未得到扭转,因此政府对经济的托底政策仍将延续。在经济增长平稳之前,预计货币政策和财政政策都将维持较为宽松的局面。

我们认为,目前债券市场风险不大,仍有较好的配置价值,尤其是中短期的信用品种。因此,在债券资产的配置上,我们仍将以中短期品种为主,维持组合的基本稳定,并保持适度的杠杆水平。展望下半年,我们将重点关注注册制推出导致打新资金回流债券市场所带来的投资机会。对于转债资产,我们仍将关注其中的结构性和波段性机会,积极参与。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	275,420,642.18	15.13
	其中:股票	275,420,642.18	15.13
2	固定收益投资	1,471,665,857.00	80.85
	其中:债券	1,471,665,857.00	80.85
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	40,992,686.51	2.25
7	其他资产	32,194,615.47	1.77
8	合计	1,820,273,801.16	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	采矿业	-	-
C	制造业	264,589,724.71	15.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,116,400.00	0.37
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,714,517.47	0.28
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	275,420,642.18	16.48

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	002531	天顺风能	3,433,000	50,087,470.00	3.00
2	002129	中环股份	2,024,128	40,057,493.12	2.40
3	300205	天喻信息	1,246,889	37,593,703.35	2.25
4	002202	金风科技	1,856,432	36,144,731.04	2.16
5	000925	众合科技	1,300,000	35,880,000.00	2.15
6	600498	烽火通信	1,116,240	29,535,710.40	1.77
7	000957	中通客车	1,061,360	25,610,616.80	1.53
8	300257	开山股份	400,000	9,680,000.00	0.58
9	300310	宜通世纪	180,000	6,116,400.00	0.37
10	002344	海宁皮城	240,169	4,714,517.47	0.28

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,442,000.00	5.41
	其中:政策性金融债	90,442,000.00	5.41
4	企业债券	1,115,946,371.10	66.78
5	企业短期融资券	201,555,000.00	12.06
6	中期票据	20,324,000.00	1.22
7	可转债	43,398,485.90	2.60
8	其他	-	-
9	合计	1,471,665,857.00	88.07

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	124125	13温经开	500,000	52,285,000.00	3.13
2	124192	13邳城建	500,000	51,750,000.00	3.10
3	124210	13阜投债	500,000	51,550,000.00	3.08
4	1280351	12三环债	500,000	51,320,000.00	3.07
5	150403	15农发03	500,000	50,305,000.00	3.01

5.6 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资产支持证券投资明细

注: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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	216,630.99
2	应收证券清算款	3,993,910.73
3	应收股利	-
4	应收利息	27,477,484.39
5	应收申购款	506,589.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,194,615.47

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113501	洛钼转债	28,221,261.60	1.69
2	110030	格力转债	4,288,341.60	0.26
3	113007	吉视转债	1,368,984.50	0.08

5.10.5 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	300310	宜通世纪	6,116,400.00	0.37	重大事项

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	1,886,315,438.36
报告期期间基金总申购份额	412,241,646.36
减:报告期期间基金总赎回份额	848,811,270.79
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,449,745,813.93

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金管理人本报告期未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)《鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金2015年第2季度报告》(原文)。

8.2 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

北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行股份有限公司

8.3 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)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
2015年7月18日

鹏华丰实定期开放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:中信银行股份有限公司
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	鹏华丰实定期开放债券
场内简称	-
交易代码	000296
基金运作方式	契约型,本基金采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。 本基金自基金合同生效之日(含)起或自每一开放期结束之日次日(含)起一年的期间封闭运作,不办理申购与赎回业务,也不上市交易。 本基金自封闭期结束之后第一个工作日(含)起进入开放期,每个开放期原则上不超过二十个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的,基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。
基金合同生效日	2013年9月10日
报告期末基金份额总额	274,374,959.98份
投资目标	在有效控制风险的基础上,通过每年定期开放的形式保持适度流动性,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金债券投资将主要采取久期策略,同时辅之以债券类属配置策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在有效控制风险的基础上,通过每年定期开放的形式保持适度流动性,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	一年期定期存款税后利率+0.5%
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期的收益与风险