鹏华双债增利债券型证券投资基金

【2015】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:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华双债增利债券
场内简称	-
基金主代码	000054
交易代码	000054
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月13日
报告期末基金份额总额	239,575,654.92份
投资目标	在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上,以信用债和可转债为主要投资标的,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	1.大类资产配置 本基金综合运用定性和定量的分析手段,在对宏观经济因素进行充分研究的基础上,判断宏观经济周期所处阶段。基金将依据经济周期理论,结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估,制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则。 2.债券投资策略 本基金债券投资将主要采取久期策略及信用策略,同时辅之以收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过对久期及信用利差趋势的判断,力争获取信用溢价取得超越基金业绩比较基准的收益。 3.股票投资策略 本基金股票投资以精选个股为主,发挥基金管理人专业研究团队的研究能力,从定量和定性两方面考察上市公司的增值潜力。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+1.5%
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低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,为证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司

§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7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	2,344,226.80
2.本期利润	1,921,316.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0077
4.期末基金资产净值	283,456,238.09
5.期末基金份额净值	1.183

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。

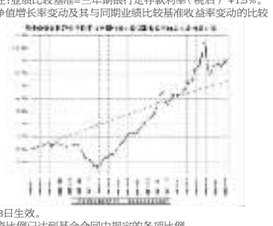
3.2 基金净值表现

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	0.94%	0.22%	1.17%	0.01%	-0.23%	0.21%

注:业绩比较基准=三年期银行定存款利率(税后)+1.5%。

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



注:1.本基金基金合同于2013年3月13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		
初冬	本基金基金经理	2013年3月13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。
刘建岩	本基金基金经理	2015年3月10日	-	9	刘建岩先生,国籍中国,经济学硕士,9年证券从业经验。历任第一创业证券有限责任公司资管部投资经理;2009年12月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券研究分析工作,担任固定收益部债券研究员,2011年4月起担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理,2013年2月至2014年3月担任鹏华产业债债券型证券投资基金基金经理,2013年3月起兼任鹏华国有企业债债券型证券投资基金基金经理,2013年11月起兼任鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年5月起兼任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2015年3月起兼任鹏华双债增利债券型证券投资基金基金经理。刘建岩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,在保证基金安全和基金资产流动性的基础上,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

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-13.78%,同期上证综指下跌28.63%,深证成指下跌30.34%,沪深300指数下跌28.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际方面由于大宗商品价格大范围疲软,全球需求疲弱,美联储对通胀的担忧降低;同时美国9 月制造业继续以8 月的疲弱速度扩张,企业核心资本支出亦小幅下滑, 表明美元升值和海外的经济动荡可能限制了对美国生产的商品的需求,美国经济也许并未如想象那么好。基于以上两点美国加息预期推迟,而欧洲和日本经济依旧疲软,人民币汇率贬值压力降低。

中国经济也不乐观,3季度GDP低于7%;工业情况继续恶化,8月PPI同比增速为-5.9%,跌幅较上月扩大0.5个百分点,工业企业实现利润4489.6亿元,累计同比增长由前月的-1.0%降为-1.9%;9月PMI为49.8%,较上月上升0.1%;季调后较上月下降0.1%,为49.8%。地产和汽车这两大引擎趋势依旧向下,政府出台刺激政策也在加码,降低住宅地产首付比例,降低1.6升汽车的购置税,以及扩大信贷资产质押再贷款试点区域,都显示政府稳增长的决心。

对于A股市场,我们保持谨慎乐观,一方面,场外配置清理进入尾声,突发性杀跌因素逐步消失,市场经过前期快速下跌,大幅下跌风险释放;另一方面,经济刺激虽加码,但实体经济恢复是长期过程,经济势头尚未扭转,企业盈利难以改善,抑制上升空间。我们对本基金的操作想法是以获取正收益为目标,目前市场我们认为还是震荡风格为主,并不是大幅加仓的良机,另外受到下跌和政策影响,并购重组类公司进程可能受到延迟影响,但短期我们也会相对三季度心态更加积极,发掘投资机会。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注: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	7,696,250.00	1.92
	其中:股票	7,696,250.00	1.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	365,700,350.70	91.28
	其中:债券	365,700,350.70	91.28
	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	17,614,874.58	4.40
8	其他资产	9,609,549.93	2.40
9	合计	400,621,025.21	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	1,464,000.00	0.52
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	-	-
J	金融业	2,356,200.00	0.83
K	房地产业	2,081,050.00	0.73
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,795,000.00	0.63
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	7,696,250.00	2.72

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	300012	华测检测	100,000	1,795,000.00	0.63
2	000001	平安银行	140,000	1,468,600.00	0.52
3	000024	招商地产	45,000	1,282,050.00	0.45
4	601601	中国太保	40,000	887,600.00	0.31
5	600048	保利地产	100,000	799,000.00	0.28
6	600525	长园集团	50,000	750,000.00	0.26
7	000925	众合科技	50,000	714,000.00	0.25

注:上述股票明细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	365,700,350.70	129.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	365,700,350.70	129.01

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	124250	13宿建投	600,000	62,142,000.00	21.92
2	124268	13渝南发	500,000	51,605,000.00	18.21
3	122588	12益城投	450,000	37,795,500.00	13.33
4	124116	12渝北飞	300,000	30,423,000.00	10.73
5	122708	PR伊旗债	355,760	26,482,774.40	9.34

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	109,542.66
2	应收证券清算款	1,469,105.37
3	应收股利	-
4	应收利息	8,030,901.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,609,549.93

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	600525	长园集团	750,000.00	0.26	重大事项

5.10.6 报告期末前十名股票投资明细

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	311,603,693.16
报告期期间基金总申购份额	183,379.89
减:报告期期间基金总赎回份额	72,211,418.13
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	239,575,654.92

§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末申购、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)《鹏华双债增利债券型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华双债增利债券型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华双债增利债券型证券投资基金2015年第3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第43层鹏华基金管理有限公司

上海市银城中路168 号上海银行股份有限公司

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10月27日

鹏华添利宝货币市场基金

【2015】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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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7月21日(基金合同生效日)起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华添利宝货币
场内简称	-
基金主代码	001666
交易代码	001666
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月21日
报告期末基金份额总额	345,991,356.66份
投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上,力争获得超越业绩比较准的投资收益率。
投资策略	本基金将综合宏观经济运行状况,货币政策、财政政策等政府宏观经济状况及政策,分析资本市场资金供给状况的变动趋势,预测市场利率水平变动趋势。在此基础上,综合考虑各类投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况,进行积极的投资组合管理。 1.久期策略 结合宏观经济运行态势及利率预测分析,本基金将动态确定并调整基金组合平均剩余期限。预测利率将进入下降通道时,适当延长投资品种的平均期限;预测市场利率将进入上升通道时,适当缩短投资品种的平均期限。 2.类属配置策略 在保证流动性的前提下,根据各类货币市场工具的市场规模、信用等级、流动性、市场供求、票息及付息频率等确定不同类别资产的具体配置比例。 3.套利策略 本基金根据对货币市场变动趋势、各市场和品种之间的风险收益差异的充分研究和论证,适当进行跨市场或跨品种套利操作,力争提高资产收益率,具体策略包括跨市场套利和跨期限套利等。 4.现金管理策略 本基金作为现金管理工具,具有较高的流动性要求,本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测,通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效分配基金的现金流,在保持充分流动性的基础上争取较高收益。 5.资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§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7月21日 - 2015年9月30日)
1. 本期已实现收益	1,744,852.86
2. 本期利润	1,744,852.86
3. 期末基金资产净值	345,991,356.66

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,由于货币市场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。

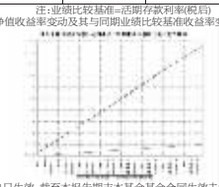
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6718%	0.0013%	0.0690%	0.0000%	0.6028%	0.0013%

注:业绩比较基准=活期存款利率(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



注:1.本基金基金合同于2015年7月21日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2.本基金管理人将严格按照本基金合同的约定,于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

§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		
叶朝明	本基金基金经理	2015年7月6日	-	7	叶朝明先生,国籍中国,工商管理硕士,7年金融证券从业经验。曾任职于招商银行总行,从事本外币资金管理相关工作;2014年1月加盟鹏华基金管理有限公司,从事货币基金管理工作,2014年2月担任鹏华增值宝货币市场基金基金经理,2015年1月起兼任鹏华安盈宝货币市场基金基金经理,2015年7月起兼任鹏华添利宝货币市场基金基金经理。叶朝明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。本基金为本期内新成立基金。

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年三季度,国内经济内生增长动力仍然偏弱,整体增速维持低位,CPI同比增速受猪肉价格上涨影响有所回升,但物价水平整体可控。三季度以来,尽管受经济低迷、资本市场动荡以及汇率中间价形成机制改革等因素影响,人民币贬值预期加剧,金融机构外汇占款大幅下降,资金外流压力不断加大,但央行通过各类货币政策工具投放了流动性,市场资金总体稳定。

三季度,银行间市场资金面保持宽松,7天回购利率均值为2.48%,小幅低于二季度250%的均值水平。受资金面持续宽松和权益市场调整影响,债券市场总体呈现上涨态势,收益率出现不同程度下行,信用利差有所收窄,其中1年期国开债收益率较二季度小幅下行3 bp左右,1年期AA+短融收益率则下降40bp左右。

本基金自成立以来以同业存款为主要配置资产,组合剩余期限保持略低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自2015年7月成立以来,本基金的净值增长率为0.6718%,同期业绩基准增长率为0.0690%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年四季度,我们认为美国有望总体保持稳定的增长态势,欧、日经济可能维持低速增长,新兴市场国家经济相对较弱。从国内市场来看,一方面,消费对经济贡献相对稳定,投资增速处于持续回落之中,经济内生动力仍然不足;另一方面,由于稳增长力度加大,宽信用政策不断推进,未来社融增速企稳可能使得经济进一步下行的压力暂时缓和。预计四季度国内经济增速将继续低位徘徊。市场资金面方面,在经济偏弱和资金流出压力仍存的情况下,预计央行会延续宽松的货币政策,维持资金面整体平稳。但由于社融增速企稳可能带来资金需求有所增长,而央行宽松货币政策主要对冲资金外流,所以我们需要适当关注资金供需格局变化带来的资金面边际收紧风险。

基于以上分析,本组合2015年四季度将采取中性久期策略,保持稳健操作,严格控制风险,合理安排组合的现金流分布。同时密切关注市场出现的资产配置机会,在保证组合安全的前提下力争提高组合的收益回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注: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	固定收益投资	110,237,155.74	31.85
	其中:债券	110,237,155.74	31.85
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	29,300,283.95	8.47
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	203,771,932.98	58.88
4	其他资产	2,779,771.22	0.80
5	合计	346,089,143.89	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.54	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	46
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	67.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	8.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	8.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.23	-

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	摊余成本(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	20,072,381.98	5.80
	其中:政策性金融债	20,072,381.98	5.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,164,773.76	26.06
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	110,237,155.74	31.86
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041560036	15渝江北嘴CP001	100,000	10,065,972.15	2.91
2	041554027	15铁道CP001	100,000	10,063,649.39	2.91
3	011599400	15首农SCP002	100,000	10,047,990.67	2.90
4	150202	15国开02	100,000	10,037,503.71	2.90
5	150301	15进出01	100,000	10,034,878.27	2.90
6	011525006	15中化股SCP006	100,000	9,999,217.01	2.89
7	011540001	15港中旅SCP001	100,000	9,999,158.91	2.89
8	071507006	15中信建投CP006	100,000	9,998,173.89	2.89
9	011599711	15建发集SCP003	100,000	9,997,520.35	2.89
10	011599581	15园交运SCP004	100,000	9,997,441.69	2.89

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0123%
报告期内偏离度的最低值	-0.0025%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0026%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

基金计价方法说明

(1)基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际协议利率逐日计提利息;

(2)基金持有的回购协议(封闭式回购)以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;

(3)基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(4)基金持有的买断式回购以协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时,若双方都能履约,则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产,实际持有的相关资产按其性质进行估值;

(5)基金持有的资产支持证券视同债券,购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

5.8.2

若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况

本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本不存在超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,520,544.47
4	应收申购款	259,226.75
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,779,771.22

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1.本基金的投资决策流程主要包括:久期决策、期限结构策略、类属配置策略和个券选择策略。其中久期区间决策由投资决策委员会负责制定,基金经理在设定的区间内根据市场情况自行调整;期限结构配置和类属配置决策由固定收益小组讨论确定,由基金经理实施该决策并选择相应的个券进行投资。

2.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

基金合同生效日(2015年7月21日)基金份额总额	236,402,974.82
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	194,392,431.69
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	84,804,049.85
报告期期末基金份额总额	345,991,356.66

§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末申购、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)《鹏华添利宝货币市场基金基金合同》;

(二)《鹏华添利宝货币市场基金托管协议》;

(三)《鹏华添利宝货币市场基金2015年第3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第43层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区大木桥大街 25 号中国光大中心

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10月27日

鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华外延成长
场内简称	-
基金主代码	001222
交易代码	001222
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月19日
报告期末基金份额总额	705,046,138.16份
投资目标	本基金为混合型基金,通过积极灵活的资产配置,并精选外延成长主题股票,重点挖掘