

# 鹏华实业债纯债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: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 基金提示

基金管理人的董事会及监事会对本基金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、完整性和及时性负责。

基金托管人对本基金的财务报告、净值公告、收益分配公告等文件进行复核，保证复核后的内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金销售机构在销售基金时，应向客户说明基金的销售适用性，推荐适合客户购买的产品。

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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告不构成投资建议。

本基金报告期自2015年7月1日至2015年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

## 鹏华实业债纯债债券型证券投资基金

基金简称	鹏华实业债纯债债券型证券投资基金
场内简称	-
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	2015年3月6日
报告期末基金份额总额	33,980,840.25份
投资目标	在合理控制风险的前提下，保持较高的稳定性，力争获得超越基准的稳定回报。
1.资产配置策略	
本基金通过宏观经济、经济周期所处阶段、利差变化趋势和信用利差的变化对宏观经济、市场流动性进行判断，企业债收益率相对国债收益率的利差是影响企业债收益率的主要因素，因此在分析企业债收益率时，主要关注企业债与国债收益率的利差，从而判断企业债的配置价值。	
2.债券投资策略	
本基金通过信用评级、期限、行业等因素对债券品种进行筛选，在合理控制风险的前提下，选择具有较好流动性的债券品种进行投资。	
3.组合构建	
本基金在综合考虑宏观经济、信用利差、久期、流动性等因素的基础上，以安全性为主的投资原则，力求取得超越基准的稳定回报。	
4.报告期投资策略	
本基金在报告期内主要通过信用评级、期限、行业等因素对债券品种进行筛选，在合理控制风险的前提下，选择具有较好流动性的债券品种进行投资。	
5.报告期业绩比较基准	
中债企业债总指数*80%+中债国债总指数*20%	
风险收益特征	
本基金属于债券型基金，其预期的风险与收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
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

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	-765,305.67
2.本期利润	-2,730,260.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0776
4.期末基金份额净值	47,166.3908
5.期末基金份额净值	1.388

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.所列数据基金业绩不包括持有人认购或申购基金所产生的费用(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可能低于不计费用的情况。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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 业绩比较基准收益率标准差③ ①-③ ②-④

过去三个月 -5.60% 0.05% 2.72% 0.06% -7.72% 0.44%

注:1.本基金净值自2013年6月1日起效。

2.截至报告期结束，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间	证券从业年限
刘太阳	本基金基金经理	2013年6月1日	-

## 4.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

报告期内，基金管理人严格按照《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用基金资产，严格控制风险，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人制定了公平交易制度，确保不同投资组合在研究、分析、决策、交易等方面获得平等对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人制定了异常交易行为的专项制度，确保不同投资组合在研究、分析、决策、交易等方面获得平等对待。

4.3.3 报告期内公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易制度，未发现存在不公平交易的情况。

4.4 报告期内的基金投资策略和业绩表现

4.4.1 报告期内基金投资策略和操作分析

报告期内，基金管理人严格按照《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用基金资产，严格控制风险，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期无基金分红派息记录。

4.5 管理人对报告期内基金估值政策和会计政策的说明

本基金报告期无基金估值政策和会计政策的说明。

4.6 报告期内基金的利润分配情况

本基金报告期无基金利润分配情况。

4.7 报告期内基金持有的债券品种情况

本基金报告期无基金持有的债券品种情况。

4.8 报告期内基金投资组合报告

4.8.1 投资组合报告

报告期末，本基金的资产配置情况如下表所示：

资产配置情况表

报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细