鹏华货币市场证券投资基金

【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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	鹏华货币
场内简称	-
基金主代码	160606
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月12日
报告期末基金份额总额	15,364,985,486.50份
投资目标	在保证资产安全与资产充分流动性的前提下,为投资者追求稳定的现金收益。
投资策略	在战略资产配置上,主要采取利率预期与组合久期控制相结合的策略,在战术资产操作上,主要采取波动投资、关键时期的时机抉择策略,并结合市场环境适时进行回购套利等操作。
业绩比较基准	活期存款税后利率(即活期存款利率×(1-利息税率))
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种;长期平均的风险和预期收益低于成长型基金、价值型基金、指数型基金、纯债券基金。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	鹏华货币A / 鹏华货币B
下属分级基金的交易代码	160606 / 160609
报告期末下属分级基金的份额总额	614,292,813.08份 / 14,750,692,673.42份

§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)	
	鹏华货币A	鹏华货币B
1. 本期已实现收益	4,447,444.61	69,640,414.61
2. 本期利润	4,447,444.61	69,640,414.61
3. 期末基金资产净值	614,292,813.08	14,750,692,673.42

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增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华货币A

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	0.6536%	0.0020%	0.0882%	0.0000%	0.5654%	0.0020%

注:业绩比较基准=活期存款税后利率(即活期存款利率×(1-利息税率))

基金收益分配按月结转份额

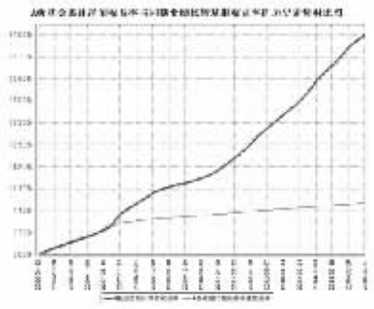
鹏华货币B

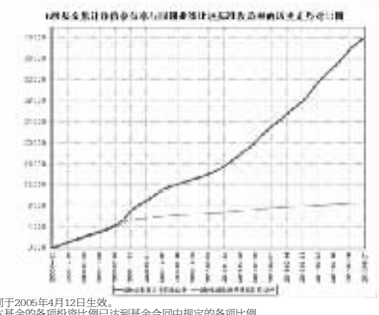
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7145%	0.0020%	0.0882%	0.0000%	0.6263%	0.0020%

注:业绩比较基准=活期存款税后利率(即活期存款利率×(1-利息税率))

基金收益分配按月结转份额

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2005年4月12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		
刘建岩	本基金基金经理	2014年5月27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 管理人对投资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年三季度,由于杠杆资金的清理,宏观经济的持续恶化,以及人民币贬值压力等原因,A股市场出现了短期内大幅单边下跌。

本基金三季度整体上以均衡配置为主,在配置地产、家电、金融等低估值蓝筹股的基础上,在市场调整中逐步增加了对部分超跌的优质成长型公司的配置。

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-26.16%,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

展望后市,国内的货币政策持续宽松,财政政策有所放松,杠杆资金的清理也基本结束,海外美联储的加息预期不断推后,在这样的市场环境下,我们认为A股市场最坏的时间已经过去。但目前宏观经济依然没有见底迹象,微观层面的企业业绩仍在恶化,中国经济和A股市场依然面临很大的挑战。中长期来看,改革与创新仍将是市场的希望所在,我们依然看好拥有好的治理结构和优秀管理层、具备较强的创新与执行能力的公司在中长期的投资价值。我们会在市场调整中发掘优秀公司的投资价值,逐步增加优质成长股的配置。

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	2,890,151,300.36	18.77
	其中:债券	2,890,151,300.36	18.77
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,236,657,554.98	14.52
	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	10,180,748,687.33	66.10
4	其他资产	93,670,311.61	0.61
5	合计	15,401,227,854.28	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	0.11
	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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	79
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

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180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分析比例

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	35.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	13.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	21.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	25.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	4.69	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.63	-

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	722,710,129.20	4.70
	其中:政策性金融债	722,710,129.20	4.70
4	企业债券	14,961,201.23	0.10
5	企业短期融资券	2,152,479,969.93	14.01
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,890,151,300.36	18.81
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	140230	14国开30	1,600,000	160,283,276.51	1.04
2	150301	15进出01	1,300,000	130,458,691.74	0.85
3	150403	15农发03	1,000,000	100,417,741.37	0.65
4	150202	15国开02	1,000,000	100,310,926.82	0.65
5	011599055	15粤珠江SCP001	1,000,000	100,165,570.31	0.65
6	011599030	15招金SCP001	1,000,000	100,077,365.75	0.65
7	011586005	15光明SCP005	1,000,000	99,995,100.23	0.65
8	011599089	15山钢SCP002	800,000	80,290,726.82	0.52
9	150411	15农发11	800,000	80,272,518.82	0.52
10	041453108	14昆钢CP003	800,000	80,053,087.55	0.52

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	0.2002%
报告期内偏离度的最低值	0.0665%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1329%

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	85,738,467.69
4	应收申购款	7,931,843.92
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	93,670,311.61

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日行调整;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

项目	鹏华货币A	鹏华货币B
报告期期初基金份额总额	678,399,125.38	5,592,051,244.67
报告期期间基金总申购份额	1,643,087,596.79	19,062,830,556.17
减:报告期期间基金总赎回份额	1,707,193,909.09	9,904,189,127.42
报告期期末基金份额总额	614,292,813.08	14,750,692,673.42

§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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年7月7日	60,000,000.00	60,000,000.00	-
2	申购	2015年8月12日	200,000,000.00	200,000,000.00	-
3	申购	2015年9月9日	80,000,000.00	80,000,000.00	-
合计			340,000,000.00	340,000,000.00	

注:(1)本基金管理人于2015年7月7日申购本基金份额60,000,000份。

(2)本基金管理人于2015年8月12日申购本基金份额200,000,000份。

(3)本基金管理人于2015年9月9日申购本基金份额80,000,000份。

(4)本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 鹏华资产管理(深圳)有限公司及其产品持有鹏华货币市场证券投资基金情况

公司/产品名称	期末持有份额(份)	
	鹏华货币A	鹏华货币B
鹏华资产管理(深圳)有限公司	-	22,830,821.12

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华货币市场证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华货币市场证券投资基金2015年第3季度报告》(原文)。

9.2 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28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司

9.3 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

鹏华价值精选股票型证券投资基金

【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	鹏华价值精选股票
场内简称	-
交易代码	206012
基金主代码	206012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年4月16日
报告期末基金份额总额	42,505,204.92份
投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,精选具备估值优势以及良好基本面的上市公司,力争实现超额收益与长期资本增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,运用定量及定性相结合的手段,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2.股票投资策略 本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略,自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的股票构建股票投资组合。 3.债券投资策略 本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等,采取积极主动的投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现债券组合增值。 4.权证产品投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为采用高仓位运作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金及普通股票型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。
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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-8,174,168.51
2.本期利润	-16,990,613.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4020
4.期末基金资产净值	49,174,591.08
5.期末基金份额净值	1.157

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	-26.16%	3.70%	-25.54%	3.01%	-0.62%	0.69%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×90%+中证综合债指数收益率×10%。

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2012年4月16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		
彭建辉	本基金基金经理	2014年7月26日	2015年9月16日	7	彭建辉先生,国籍中国,工学博士,7年证券从业经验。曾任职于博时基金管理有限公司,担任研究部研究员、从事行业研究工作;2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司从事研究投资工作,历任高级研究员、基金经理助理,2013年3月起至2015年8月担任鹏华行业成长证券投资基金(2015年8月已转型为鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金)基金经理,2014年7月至2015年9月兼任鹏华价值精选股票型证券投资基金基金经理。彭建辉先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,彭建辉不再担任本基金基金经理,仅由胡东健担任本基金基金经理。
胡东健	本基金基金经理	2015年6月26日	-	4	胡东健先生,国籍中国,北京大学经济学硕士,4年金融证券从业经验,历任海通基金管理有限公司研究员;2015年1月加盟鹏华基金管理有限公司,担任高级研究员,从事投资研究工作,2015年6月起担任鹏华价值精选股票型证券投资基金基金经理。胡东健先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,彭建辉不再担任本基金基金经理,仅由胡东健担任本基金基金经理。

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 管理人对投资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年三季度,由于杠杆资金的清理,宏观经济的持续恶化,以及人民币贬值压力等原因,A股市场出现了短期内大幅单边下跌。

本基金三季度整体上以均衡配置为主,在配置地产、家电、金融等低估值蓝筹股的基础上,在市场调整中逐步增加了对部分超跌的优质成长型公司的配置。

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-26.16%,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

展望后市,国内的货币政策持续宽松,财政政策有所放松,杠杆资金的清理也基本结束,海外美联储的加息预期不断推后,在这样的市场环境下,我们认为A股市场最坏的时间已经过去。但目前宏观经济依然没有见底迹象,微观层面的企业业绩仍在恶化,中国经济和A股市场依然面临很大的挑战。中长期来看,改革与创新仍将是市场的希望所在,我们依然看好拥有好的治理结构和优秀管理层、具备较强的创新与执行能力的公司在中长期的投资价值。我们会在市场调整中发掘优秀公司的投资价值,逐步增加优质成长股的配置。

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	41,969,570.93	84.16
	其中:股票	41,969,570.93	84.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	6,778,602.15	13.59
8	其他资产	1,120,182.96	2.25
9	合计	49,868,356.04	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	576.80	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	20,765,919.89	42.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,182,722.00	2.41
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	2,899,741.00	5.90
J	金融业	3,105,080.80	6.31
K	房地产业	7,131,988.44	14.50
L	租赁和商务服务业	1,500,972.00	3.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,534,020.00	5.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	831,480.00	1.69
R	文化、体育和娱乐业	2,017,070.00	4.10
S	综合	-	-
	合计	41,969,570.93	85.35

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

代码	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	000024	招商地产	132,756	3,782,218.44	7.69
2	000333	美的集团	101,707	2,566,067.61	5.22
3	300070	碧水源	58,000	2,534,020.00	5.15
4	601398	工商银行	490,000	2,116,800.00	4.30
5	300136	信维通信	65,921	1,830,626.17	3.72
6	000858	五粮液	70,000	1,516,200.00	3.08
7	600325	华发股份	130,000	1,509,300.00	3.07
8	002400	省广股份	82,200	1,500,972.00	3.05
9	300017	网宿科技	27,100	1,428,441.00	2.90
10	600136	道博股份	39,000	1,284,270.00	2.61

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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投资组合。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指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股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

代码	名称	金额(元)
1	存出保证金	94,701.07
2	应收证券清算款	951,072.52
3	应收股利	-
4	应收利息	1,544.00
5	应收申购款	72,865.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,120,182.96

5.11.4 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。

5.11.5 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	300070	碧水源	2,534,020.00	5.15	重大事项
2	000858	五粮液	1,516,200.00	3.08	重大事项

5.11.6 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	37,940,064.99
报告期期间基金总申购份额	26,176,366.16
减:报告期期间基金总赎回份额	21,611,226.23
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	42,505,204.92

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	7,384,785.82
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	7,384,785.82
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	17.37

注:(1)本基金管理人于2015年7月17日申购本基金份额7,384,785.82份。

(2)本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年7月17日	7,384,785.82	10,000,000.00	-
合计			7,384,785.82	10,000,000.00	

注:(1)本基金管理人于2015年7月17日申购本基金份额7,384,785.82份。

(2)本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)《鹏华价值精选股票型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华价值精选股票型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华价值精选股票型证券投资基金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43层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区阜成门大街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10月27日

鹏华环球发现证券投资基金

【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	鹏华环球发现(QDII-FOF)
场内简称	-
基金主代码	206006
交易代码	206006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年10月12日
报告期末基金份额总额	32,287,540.42份
投资目标	积极地环球寻找并发现投资机会,通过积极的战略战术资产配置来进行资产在基金、股票、货币市场工具及现金中的分配,在分散风险的前提下,最大化地实现资本的长期增值。
投资策略	本基金采用多重投资策略,包括自上而下和自下而上方法来增强基金选择流程并提升其效率。衍生品策略将不作为本基金的主要投资策略,且仅用于在适当时候力争规避外汇风险及其他相关