

## 鹏华丰泽债券型证券投资基金(LOF)

[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:中国工商银行股份有限公司

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、监事、高级管理人员不存在虚假记载、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、及时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	鹏华丰泽债券(LOF)
场内简称	鹏华丰泽
基金代码	160618
基金运作方式	上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2011年12月1日
报告期末基金资产总额	442,920,298.76份

在适当性风险的基础上,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,力争争取信用溢价,以最大程度上取得超越基金业平均水平的收益。

投资策略

本基金是债券型基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,长期平均风险和预期收益水平低于股票基金,混合基金,高于货币市场基金。

风险收益特征

本基金是债券型基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,长期平均风险和预期收益水平低于股票基金,混合基金,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

中国工商银行股份有限公司

§ 3 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.本期初次收益 -16,540,367.48

2.本期利润 6,205,110.01

3.加权平均基金份额本期利润 0.0144

4.期末基金资产净值 469,210,234.21

5.期末基金份额 1,059

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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字;

3.基金净值表现

3.1.本报告期基金份额净值增长率及其同同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率(%) 资产负债率(%) 业绩比较基准收益率(%) 基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 15.3% 0.7% 2.13% 0.08% -0.6% 0.05%

注:业比较基准=中证总指数收益率。

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

图:鹏华丰泽债券型证券投资基金(LOF)2015年第三季度净值增长率与业绩比较基准收益率变动情况

注:1.本基金基金合同于2011年12月1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 基金管理人(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	任本基金的基金经理日期	离任日期	证券从业年限	说明
戴钢	本基金基金经理	2011年12月8日	-	13		

注:1.任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合规性情况的说明

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、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,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。

4.3 公平交易专章说明

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,本基金未发生违法交易规则且对基金财产造成损失的异常交易行为。本基金报告期内未发生基金经理人以个人名义开立账户买卖基金的情况。

4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

2015年三季度债券市场延续了上涨的走势,中债总财富指数上涨2.13%。债券市场的上涨主要来自于两方面的因素:一方面是债券市场的大幅调整以及新的修复导致大量资金回流债券市场;另一方面是宏观经济本身走强,导致央行进一步放松了货币政策,在8月中下旬进行了降息和降准。

在组合的配置上,我们仍将以中期品种为主,维持组合的基本稳定,并保持适度的杠杆水平。对于债券资产,在资金面较为宽松、通胀政策持续出台的支持下,权益市场存在一定的机会。我们将对其保持密切关注,争取提高组合回报。

4.4.2 报告期内本基金的业绩表现

2015年三季度本基金的净值增长率为1.53%,同期业绩基准增长率为2.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

从宏观数据上看,经济增速下行的趋势并未得到扭转,因此对经济的担忧政策仍将延续。在经济增长平缓的情况下,预计货币政策和财政政策都将维持较为宽松的态势。

我们认为,目前债券市场的风险不大,仍有较好的配置价值,尤其是中期的信用品种。因此,在债券资产的配置上,我们仍将以中期品种为主,维持组合的基本稳定,并保持适度的杠杆水平。对于债券资产,在资金面较为宽松、通胀政策持续出台的支持下,权益市场存在一定的机会。我们将对其保持密切关注,争取提高组合回报。

4.6 报告期内本基金持有人数或基金资产净值预警说明

4.7 基金管理人持有本基金份额变动情况

4.8 备查文件目录

(一)《鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华丰泽分级债券型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华丰泽分级债券型证券投资基金(LOF)2015年第3季度报告》(原文)。

4.9 存续期信息披露

深圳证券交易所福田区三路168号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司

北京西城区金融大街17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。

投资者对本基金报告如有疑问,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。

## 信息披露 Disclosure

2015年10月27日 星期二

B335

## 鹏华改革红利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:中国工商银行股份有限公司

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、监事、高级管理人员不存在虚假记载、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、及时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

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	权证投资	1,769,117,178.16	88.10
2	基金投资	1,769,117,178.16	88.10
3	固定收益投资	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	货币市场基金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	222,578,260.60	11.08
8	其他资产	16,489,398.27	0.82
9	合计	2,006,185,364.23	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(%)
1	农、林、牧、渔业	31,433,584.80	1.57
2	采掘业	-	-
3	制造业	953,649,960.20	47.65
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,015,798.81	1.35
5	建筑业	-	-
6	批发和零售业	124,115,338.02	6.20
7	交通运输、仓储和邮政业	177,541,131.32	8.87
8	住宿和餐饮业	-	-
9	信息传输、软件和信息技术服务业	121,772,214.00	6.08
10	金融业	129,034,638.75	6.45
11	房地产业	-	-
12	租赁和商务服务业	-	-
13	科学研究、技术服务及地质勘查业	-	-
14	水利、环境和公共设施管理业	-	-
15	公园、休闲娱乐和娱疗业	-	-
16	农、林、牧、渔业	-	-
17	畜牧业	-	-
18	渔业	-	-
19	批发和零售业	-	-
20	交通运输、仓储和邮政业	-	-
21	住宿和餐饮业	-	-
22	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
23	金融业	-	-
24	科学研究、技术服务及地质勘查业	-	-
25	水利、环境和公共设施管理业	-	-
26	公园、休闲娱乐和娱疗业	-	-
27	农、林、牧、渔业	-	-
28	畜牧业	-	-
29	渔业	-	-
30	批发和零售业	-	-
31	交通运输、仓储和邮政业	-	-
32	住宿和餐饮业	-	-
33	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
34	金融业	-	-
35	科学研究、技术服务及地质勘查业	-	-
36	水利、环境和公共设施管理业	-	-
37	公园、休闲娱乐和娱疗业	-	-
38	农、林、牧、渔业	-	-
39	畜牧业	-	-
40	渔业	-	-
41	批发和零售业	-	-
42	交通运输、仓储和邮政业	-	-
43	住宿和餐饮业	-	-
44	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
45	金融业	-	-
46	科学研究、技术服务及地质勘查业	-	-
47	水利、环境和公共设施管理业	-	-
48	公园、休闲娱乐和娱疗业	-	-
49	农、林、牧、渔业		