

鹏华丰收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 重要提示

基金管理人的董事、监事和高级管理人员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的责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，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、重大遗漏，并不保证基金一定盈利。

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2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 鹏华丰收债券

场内简称 -

基金主代码 160612

交易代码 160612

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2006年8月28日

报告期末基金份额总额 1,386,050,221.95份

投资目标 在严格控制风险的前提下，通过主动投资债券等固定收益品种，在追求资本增值的基础上，力求基金资产拥有良好的流动性。

投资策略 本基金将采取“积极投资”策略，通过分析宏观经济形势和货币资金市场的变化，选择具有较好流动性的金融工具，进行资产配置，从而对未来看好单券形态变化的品种，相应地增加持有比例，同时对看淡的品种则卖出，以此达到规避风险、获取收益的目的。

业绩比较基准 中证国债指数收益率

风险收益特征 本基金属于债券型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金，低于股票基金，为证券投资基金中的较低风险品种。

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

主要财务指标 单位:人民币元

1.本期已实现收益 报告期: 2015年7月1日 - 2015年9月30日 -18,466,334.06

2.本期利润 -15,045,734.72

3.加权平均基金份额利润率 -0.10%

4.期末基金份额净值 1,630,690.00(0.6150)

5.期末可供分配基金份额利润 1.10%

注:1.本公司已实现收益扣除非经常性损益后的金额为-18,466,334.06元，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.所述基金绩效指标不包括持有人认购或申购本基金的各项费用(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将低于所列数字。

3.基金净值表现

3.21 本报告期内基金的每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(%) 净值增长率标准差(%) 业期间收益率(%) 业期间收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -0.98% 0.27% 2.13% 0.09% -3.12% 0.19%

注:业期间收益率是指最近一个封闭期结束后的开放期的区间平均收益率。

3.22 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:本基金合同于2006年8月28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 任本基金的基金基金经理 任期日期 离任日期 说明

阳先伟 基金经理 2008年5月28日 - 13 阳先伟先生,国籍中国,经济学硕士,13年证券从业经验,先后任职于民生证券、国信证券、广发证券从事研究工作,2008年5月加入鹏华基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理,2007年1月起担任鹏华丰收债券基金经理,2010年12月起担任鹏华丰泰定期开放债券基金经理,2011年1月起担任鹏华丰泰定期开放债券基金经理,2012年1月起担任鹏华丰泰定期开放债券基金经理,2013年1月起担任鹏华丰收债券基金经理,2014年1月起担任鹏华丰收债券基金经理,2014年12月起担任鹏华丰收债券基金经理,2015年3月起担任鹏华丰收债券基金经理,2015年7月起担任鹏华丰收债券基金经理。

注:任职日期和离任日期均经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。

4.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

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,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,努力取得良好的回报。

4.3 管理人对宏观经济、证券市场走势的简要展望

2015年宏观经济形势整体表现良好,在股市方面,大宗商品价格震荡下行,大量权重股的资金转向配置地产、公用事业、金融等行业,部分行业估值合理,中期均线形成有效支撑,部分个股,如万科A、美的集团等,在中期均线支撑下,股价呈现强势上涨趋势,下半年有望延续这一趋势,但需警惕海外市场不确定性影响,全球经济复苏存在较大不确定性,因此,我们在四季度的投资中,将继续注重对于行业的明确定位,更加严控风格配置风险,把握结构性机会。

4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期内的业绩表现符合预期,整体表现稳定,实现了较好的收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场走势的简要展望

宏观经济方面,我们认为下半年经济企稳概率较大,但经济复苏基础较为脆弱,通胀压力较小,货币政策宽松概率较大,但政策执行力度可能不及预期,因此,我们预计下半年经济将呈现温和复苏态势,但需警惕海外市场不确定性影响,全球经济复苏存在较大不确定性,因此,我们在四季度的投资中,将继续注重对于行业的明确定位,更加严控风格配置风险,把握结构性机会。

4.6 报告期内基金份额持有人数或基金资产净值披露说明

§ 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 37,169,947.00 1.90%

2 固定收益投资 37,169,947.00 1.90%

3 货币市场工具 -

4 其他资产 1,891,046,894.50 94.60%

5 合计 1,926,005,841.50 100.00%

注:本基金合同于2010年7月1日起至2010年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 鹏华丰收债券

场内简称 -

基金主代码 000629

交易代码 000629

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2010年10月22日

报告期末基金份额总额 391,006,654.03份

§ 3 主要财务指标

主要财务指标 单位:人民币元

1.本期已实现收益 报告期: 2015年7月1日 - 2015年9月30日 -13,383,121.16

2.本期利润 13,360,890.94

3.加权平均基金份额利润率 0.0342

4.期末基金份额净值 494,223.9520

5.期末可供分配基金份额利润 1.162

注:1.本期已实现收益扣除非经常性损益后的金额为-13,383,121.16元,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,扣除非经常性损益后的金额为-13,383,121.16元。

2.所述基金绩效指标不包括持有人认购或申购本基金的各项费用(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将低于所列数字。

3.基金净值表现

3.21 本报告期内基金的每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(%) 净值增长率标准差(%) 业期间收益率(%) 业期间收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 30.1% 0.28% 21.3% 0.08% 0.88% 0.20%

注:业期间收益率是指最近一个封闭期结束后的开放期的区间平均收益率。

3.22 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:本基金合同于2010年10月22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.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 任本基金的基金基金经理 任期日期 离任日期 说明

戴钢 基金经理 2013年10月22日 - 13 戴钢先生,国籍中国,厦门大学经济学硕士,13年证券从业经验,先后任职于国泰君安证券、广发证券从事研究工作,2006年1月加入鹏华基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理,2010年1月起担任鹏华丰收债券基金经理,2011年1月起担任鹏华丰泰定期开放债券基金经理,2012年1月起担任鹏华丰收债券基金经理,2013年1月起担任鹏华丰收债券基金经理,2014年1月起担任鹏华丰收债券基金经理,2015年3月起担任鹏华丰收债券基金经理。

注:任职日期和离任日期均经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。

4.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

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,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,努力取得良好的回报。

4.3 管理人对宏观经济、证券市场走势的简要展望

宏观经济方面,我们认为下半年经济企稳概率较大,但经济复苏基础较为脆弱,通胀压力较小,货币政策宽松概率较大,但政策执行力度可能不及预期,因此,我们预计下半年经济将呈现温和复苏态势,但需警惕海外市场不确定性影响,全球经济复苏存在较大不确定性,因此,我们在四季度的投资中,将继续注重对于行业的明确定位,更加严控风格配置风险,把握结构性机会。

4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期内的业绩表现符合预期,整体表现稳定,实现了较好的收益。

§ 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 3,148,800.00 0.21%

2 固定收益投资 13,369,907.00 0.97%

3 货币市场工具 -

4 其他资产 1,891,046,314.48 94.60%

5 合计 1,926,005.841.50 100.00%

注:本基金合同于2010年10月22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.其他指标

§ 6 报告期内基金资产组合变动情况

报告期内,本基金没有发生关联交易。

4.报告期末基金资产净值

5.报告期末基金份额净值

§ 7 基金净值增长率表现

(1)报告期各时间段基金净值增长率情况

单位:份

报告期初基金份额总额 1,926,005.841.50

报告期最后一日基金份额总额 1,926,005.841.50

报告期基金净值增长率 0.00%

注:业期间收益率是指最近一个封闭期结束后的开放期的区间平均收益率。

3.22 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:本基金合同于2010年10月22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.其他指标

§ 8 备查文件目录

(一)《鹏华丰收债券型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华丰收债券型证券投资基金招募说明书》;

(三)《鹏华丰收债券型证券投资基金2015年第3季度报告》(原文)。

鹏华基金管理有限公司网站(www.phfund.com)查阅。

4.备查文件

§ 9 备查文件

1.基金合同、基金章程、基金托管协议及基金契约。