

B340

信息披露 Disclosure

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日
§ 1 重要提示
基金管理人的董事及监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。
基金托管人及其高级管理人员保证本基金合同规定,于2015年10月22日核对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。
本基金中财报告未经过审计。

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 | 鹏华安盈货币 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 000096 |
| 交易代码 | 000096 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年1月20日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,032,262,510.07份 |

投资目标

在严格控制风险的前提下追求稳定的收益,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。

本基金综合宏观经济运行状况、货币政策、财政政策等政府发布的政策,结合对市场利率走势的判断,在严格控制风险的前提下,在保持资产流动性的同时,综合考虑资金的流动性的预期收益性、风险性和流动性状况,进行积极的投资组合管理。

§ 1.1 久期策略

在宏观经济运行趋势及利率变动的情况下,本基金将动态确定并适时调整组合久期,并根据利率变动情况适时调整组合期限结构,通过长期投资品种的平均期限,短期投资品种的平均期限,达到组合品种的平均期限。

在保证流动性的前提下,根据各类货币市场工具的市场价格、信用、流动性、市场规模、票面利率及期限等不同类别的特点,选择利差较大的品种。

§ 1.2 利率策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.3 资产配置策略

本基金综合运用资产配置和战术资产配置进行资产配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整资产配置比例,从而达到资产配置的优化,在保证充分流动性的基础上争取较高收益。

§ 1.4 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.5 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.6 投资组合的构建

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.7 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.8 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.9 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.10 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.11 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.12 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.13 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.14 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.15 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.16 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.17 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.18 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.19 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.20 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.21 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.22 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.23 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.24 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.25 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.26 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.27 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.28 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.29 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.30 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.31 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.32 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.33 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.34 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.35 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.36 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.37 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.38 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.39 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.40 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.41 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.42 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.43 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.44 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.45 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.46 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.47 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.48 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.49 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.50 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.51 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。

§ 1.52 其他投资策略

本基金综合运用信用评估、信用评级和信用分析等方法,在控制风险的前提下,在信用利差较大的情况下,选择具有较好投资价值的信用品种,在保证充分流动性的基础上获得稳定收益。

§ 1.53 风险控制策略

本基金将根据对货币市场利率的预期,结合对收益率曲线的预测,在适当的时机,适当增加或降低组合中长期债券的持有比例,提高或降低组合的收益,具体包括低估值的货币市场利差利得。