

鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 25 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 20 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 鹏华丰融定期开放债券 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 000345 |
| 交易代码 | 000345 |
| 基金运作方式 | <p>契约型，本基金采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。</p> <p>本基金自基金合同生效之日（含）起或自每一开放期结束之日次日（含）起一年的期间封闭运作，不办理申购与赎回业务，也不上市交易。</p> <p>本基金自封闭期结束之后第一个工作日（含）起进入开放期，每个开放期原则上不少于五个工作日、不超过二十个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。</p> |
| 基金合同生效日 | 2013 年 11 月 19 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 97,701,591.39 份 |
| 投资目标 | 在有效控制风险的基础上，通过每年定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基 |

| | |
|--------|---|
| | 准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金债券投资将主要采取久期策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略，在有效控制风险的基础上，通过每年定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 业绩比较基准 | 一年期定期存款税后利率+0.5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。 |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |

§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（2016年7月1日—2016年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 2,420,998.36 |
| 2. 本期利润 | 2,557,864.45 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0262 |
| 4. 期末基金资产净值 | 115,593,614.42 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.183 |

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

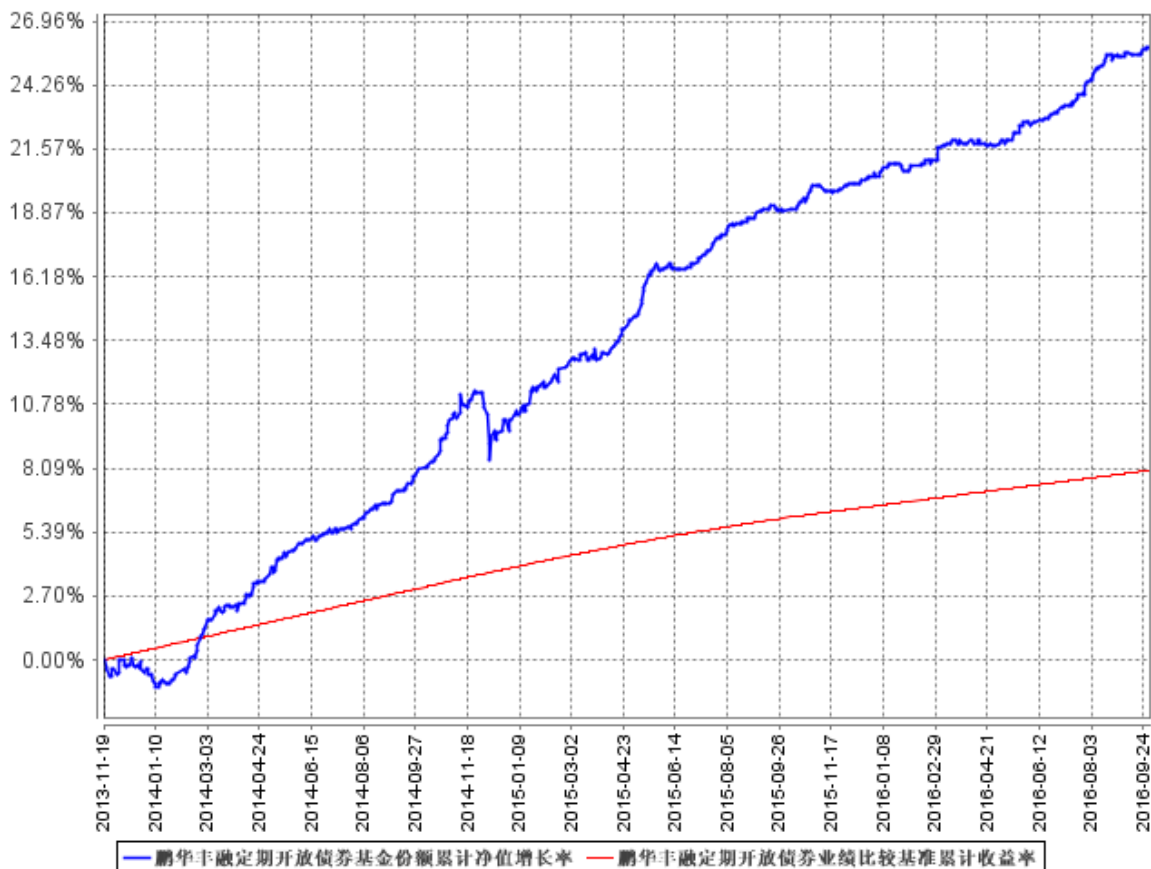
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 2.25% | 0.07% | 0.50% | 0.00% | 1.75% | 0.07% |

注：业绩比较基准=一年期定期存款税后利率+0.5%

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

鹏华丰融定期开放债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2013 年 11 月 19 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。

3.3 其他指标

注：无。

§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 | | |
| 刘涛 | 本基金基金经理 | 2016 年 5 月 27 日 | - | 3 | 刘涛先生，国籍中国，理学硕士，3 年金融证券从业经验。2013 年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资研究工 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 作，担任固定收益部债券研究员，2016 年 5 月起担任鹏华国企债债券基金、鹏华丰融定期开放债券基金基金经理。刘涛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 管理人对报告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，本基金运作合规，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% 的交易次数为 2 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度债券市场总体表现较强，中债总财富指数上涨 1.92%，涨幅较二季度扩大。三季度以来，经济走势在传统淡季稳中偏弱，与此同时，央行货币政策总体稳健，债市交易主体回购融资规模有所上升，配置盘与交易盘共同驱动收益率下行，城投债与长期利率债均有较好表现。在债券资产的配置上，我们以中高等级信用债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016 年三季度本基金的净值增长率为 2.25%，同期业绩基准增长率为 0.5%。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 166,754,427.80 | 84.20 |
| | 其中：债券 | 166,754,427.80 | 84.20 |
| | 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 | 20,000,270.00 | 10.10 |
| | 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 | 7,445,283.62 | 3.76 |
| 8 | 其他资产 | 3,850,534.88 | 1.94 |
| 9 | 合计 | 198,050,516.30 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

| | | | |
|----|-----------|----------------|--------|
| 1 | 国家债券 | 110,440.00 | 0.10 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 164,622,846.00 | 142.42 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,021,141.80 | 1.75 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 166,754,427.80 | 144.26 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 1280075 | 12 绵阳投控债 | 100,000 | 10,656,000.00 | 9.22 |
| 2 | 122028 | 09 华发债 | 100,000 | 10,481,000.00 | 9.07 |
| 3 | 122821 | 11 吉城建 | 100,000 | 10,479,000.00 | 9.07 |
| 4 | 136463 | 16 香城建 | 100,000 | 10,383,000.00 | 8.98 |
| 5 | 127440 | 16 惠投 01 | 100,000 | 10,146,000.00 | 8.78 |

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：无。

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：无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 3,141.38 |
| 2 | 应收证券清算款 | 970,455.63 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,876,937.87 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,850,534.88 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1 | 113009 | 广汽转债 | 778,150.80 | 0.67 |
| 2 | 110035 | 白云转债 | 170,910.00 | 0.15 |
| 3 | 113010 | 江南转债 | 140,393.00 | 0.12 |
| 4 | 128011 | 汽模转债 | 61,168.80 | 0.05 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.10.6 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 | 97,701,591.39 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - |
| 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 | 97,701,591.39 |

§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

注：截止本报告期末，本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金管理人本报告期末申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- （一）《鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金 2016 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

上海市仙霞路 18 号交通银行股份有限公司

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
2016 年 10 月 25 日