

鹏华金城保本混合型证券投资基金 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	鹏华金城保本
场内简称	-
基金主代码	002714
交易代码	002714
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 1 日
报告期末基金份额总额	4,618,549,797.27 份
投资目标	灵活运用投资组合保险策略，在保证本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金通过灵活运用投资组合保险策略，在本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。本基金的整体投资策略分为三个层次：第一层次，以保本为出发点的资产配置策略；第二层次，以追求本金安全和稳定的收益回报为目的的固定收益类资产投资策略；第三层次，以股票为主要投资对象的权益类资产投资策略。
业绩比较基准	三年期定期存款税后利率。
风险收益特征	本基金属于保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金保证人	北京首创融资担保有限公司

§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	15,490,400.40
2. 本期利润	25,801,172.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0056
4. 期末基金资产净值	4,649,639,488.86
5. 期末基金份额净值	1.007

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

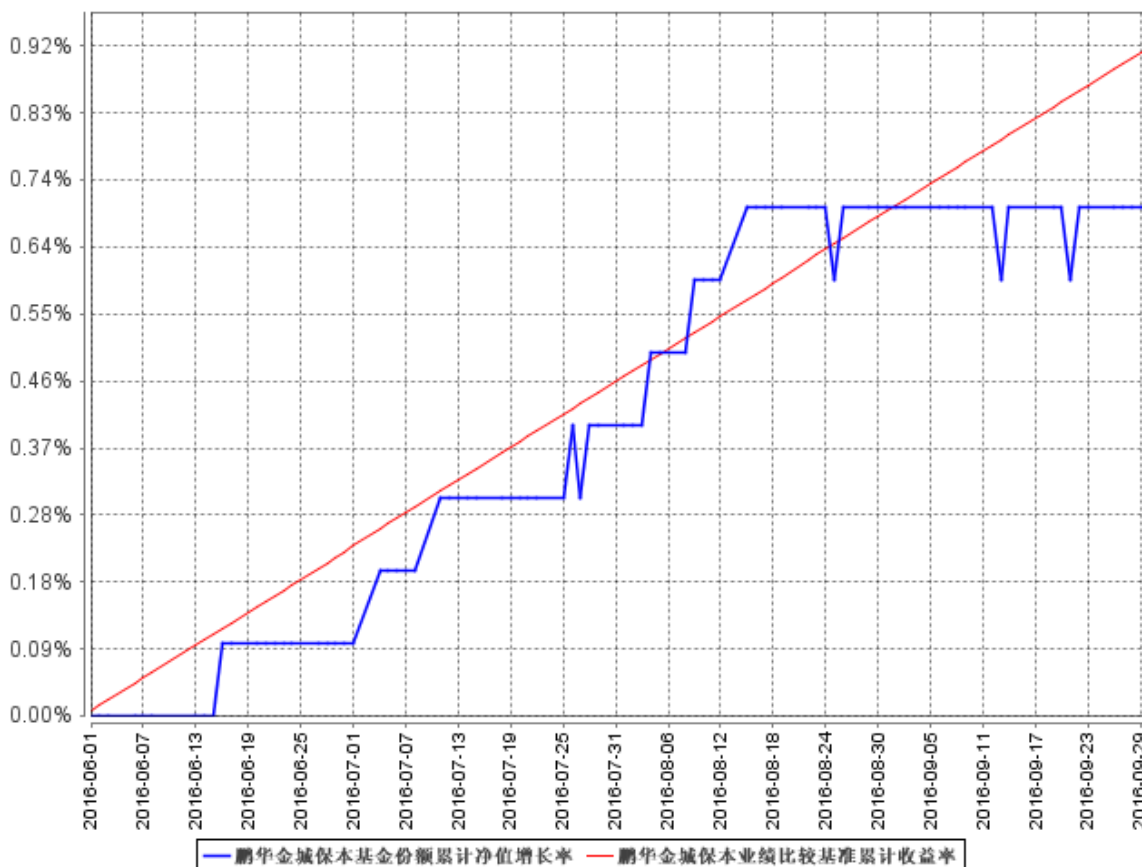
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.60%	0.05%	0.69%	0.01%	-0.09%	0.04%

注：业绩比较基准=三年期定期存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

鹏华金城保本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 2016 年 6 月 1 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

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	说明
		任职日期	离任		

			日期	限	
王宗合	本基金基金经理	2016年6月1日	-	10	王宗合先生，国籍中国，金融学硕士，10年证券从业经验，曾经在招商基金从事食品饮料、商业零售、农林牧渔、纺织服装、汽车等行业的研究。2009年5月加盟鹏华基金管理有限公司，从事食品饮料、农林牧渔、商业零售、造纸包装等行业的研究工作，担任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理助理，2010年12月起担任鹏华消费优选混合基金基金经理，2012年6月起兼任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2014年7月起兼任鹏华品牌传承混合基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华养老产业股票基金基金经理，2016年4月起兼任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华金城保本混合基金基金经理，现同时担任权益投资二部总经理、投资决策委员会成员。王宗合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。
祝松	本基金基金经理	2016年6月1日	-	10	祝松先生，国籍中国，经济学硕士，10年金融证券从业经验。曾任职于中国工商银行深圳市分行资金营运部，从事债券投资及理财产品组合投资管理；招商银行总行金融市场部，担任代客理财投资经理，从事人民币理财产品组合的投资管理工作。2014年1月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资管理工作，2014年2月起担任普天债券基金基金经理，2014年2月起兼任鹏华丰润债券（LOF）基金基金经理，2014年3月起兼任鹏华产业债债券基金基金经理，2015年3月起兼任鹏华双债加利债券基金基金经理，2015年12月起兼任鹏华丰华债券基金基金经理，2016年2月起兼任鹏华弘泰混合基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华金城保本混合基金、鹏华丰茂债券基金基金经理，现同时担任固定收益部副总经理。祝松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合规守信情况的说明

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

2016 年三季度我国债券市场震荡上涨，与上季度末相比，上证国债指数上涨 1.31%，银行间中债综合财富指数上涨 1.77%。三季度经济基本保持稳定，尽管季末银行间市场资金面较为紧张，但机构配置需求仍然旺盛，债券收益率整体有所走低。

权益及可转债市场方面，三季度股票市场整体延续小幅震荡走势，上证综指微涨 2.6%；可转债和可交换债整体小幅盘整，估值表现平稳。

报告期内本基金以投资中高评级信用债为主，债券组合久期保持中性水平。此外，本基金在三季度权益市场操作比较谨慎，少量参与了二级市场波段性行情。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016 年三季度本基金份额净值增长率为 0.6%，同期业绩基准增长率为 0.69%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	11,348,876.85	0.23
	其中：股票	11,348,876.85	0.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,804,522,086.70	98.34
	其中：债券	4,804,522,086.70	98.34
	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	37,970,698.95	0.78
8	其他资产	31,760,804.92	0.65
9	合计	4,885,602,467.42	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

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,402,900.08	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	197,746.27	0.00
F	批发和零售业	4,018,000.00	0.09
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	3,889,180.73	0.08
J	金融业	944,247.58	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	78,252.19	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	818,550.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	11,348,876.85	0.24

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

序号	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	000028	国药一致	56,000	4,018,000.00	0.09
2	300017	网宿科技	50,000	3,490,000.00	0.08
3	601997	贵阳银行	51,440	774,172.00	0.02
4	600977	中国电影	24,000	648,720.00	0.01
5	600285	羚锐制药	52,300	632,307.00	0.01
6	600936	广西广电	17,150	231,696.50	0.00
7	603986	兆易创新	1,133	201,640.01	0.00
8	002807	江阴银行	13,466	170,075.58	0.00
9	601595	上海电影	4,500	169,830.00	0.00
10	002812	创新股份	2,211	141,548.22	0.00

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	49,490,000.00	1.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	310,139,000.00	6.67
	其中：政策性金融债	310,139,000.00	6.67
4	企业债券	2,752,471,311.00	59.20
5	企业短期融资券	730,912,000.00	15.72
6	中期票据	934,483,000.00	20.10
7	可转债（可交换债）	27,026,775.70	0.58
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,804,522,086.70	103.33

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	136469	16 联通 01	2,000,000	200,900,000.00	4.32
2	136544	16 联通 03	2,000,000	200,600,000.00	4.31
3	136510	16 华电 01	2,000,000	200,540,000.00	4.31
4	071603006	16 中信	2,000,000	200,220,000.00	4.31

		CP006			
5	136611	16 电投 04	2,000,000	199,820,000.00	4.30

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：无。

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：无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

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

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

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：无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券之一的 16 国君 G3 的发行主体国泰君安证券股份有限公司(简称“国泰君安”)于 2016 年 2 月 1 日发布《关于受到全国中小企业股份转让系统有限责任公司纪律处分的公告》、于 2016 年 3 月 1 日发布《关于收到中国证券监督管理委员会上海监管局行政监管措施决定书的公告》、于 2016 年 6 月 17 日发布《关于期货子公司收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该证券发行人，认为国泰君安作为中国证监会 AA 级综合类证券公司，行业地位较为突出，经营较为稳定，上述行政措施中涉及的问题不会对国泰君安的财务状况及经营成果产生实质性影响。上述行政监管措施对该证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券之一的 16 中信 CP006 的发行主体中信证券股份有限公司(简称“中信证券”)于 2015 年 11 月 27 日发布《关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该证券发行人，认为中信证券目前作为国内最大券商之一，行业地位较为突出，经营较为稳定，上述行政措施中涉及的问题不会对中信证券的财务状况及经营成果产生实质性影响。上述行政监管措施对该证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券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

报告期内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

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	74,332.45

2	应收证券清算款	26,836.25
3	应收股利	-
4	应收利息	31,659,626.34
5	应收申购款	9.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,760,804.92

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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	603986	兆易创新	201,640.01	0.00	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	4,630,274,675.35
报告期期间基金总申购份额	56,474.67
减：报告期期间基金总赎回份额	11,781,352.75
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	4,618,549,797.27

§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) 《鹏华金城保本混合型证券投资基金基金合同》;
- (二) 《鹏华金城保本混合型证券投资基金托管协议》;
- (三) 《鹏华金城保本混合型证券投资基金 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 号荣超国际商会中心 43 层鹏华基金管理有限公司

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