# 鹏华普天收益证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014年4月22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2014年4月17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2014年1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 鹏华普天收益混合 |
| 基金主代码 | 160603 |
| 交易代码 | 160603 |
| 系列基金名称 | 鹏华普天系列基金 |
| 系列其他子基金名称 | 鹏华普天债券A(160602),鹏华普天债券B(160608) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2003年7月12日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,835,177,385.89份 |
| 投资目标 | 以分享中国经济成长和资本长期稳健增值为宗旨,主要投资于连续现金分红股票及债券,通过组合投资,在充分控制风险的前提下实现基金财产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | (1)债券投资方法:本基金债券投资的目的是降低组合总体波动性从而改善组合风险构成。在债券的投资上,采取积极主动的投资策略,不对持续期作限制。持续期、期限结构、类属配置以及个券选择的动态调整都将是我们获得超额收益的重要来源。<br>(2)股票投资方法:本基金主要采用积极管理的投资方式。以鹏华股票池中连续两年分红股票以及三年内有两年分红记录的公司作为投资对象,适当集中投资。所有重点投资股票必须经过基金经理研究员的调研,就企业经营、融资计划、分红能力、绝对价值、相对价值给出全面评估报告。 |
| 业绩比较基准 | 中信标普A股综合指数涨跌幅×70%+中信标普国债指数涨跌幅×25%+金融同业存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属平衡型证券投资基金,为证券投资基金中的中等风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金,高于指数型基金、纯债券基金和国债。 |
| 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(2014年1月1日－2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 22,494,147.13 |
| 2.本期利润 | -31,559,675.85 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0167 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,423,595,127.09 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.776 |

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。

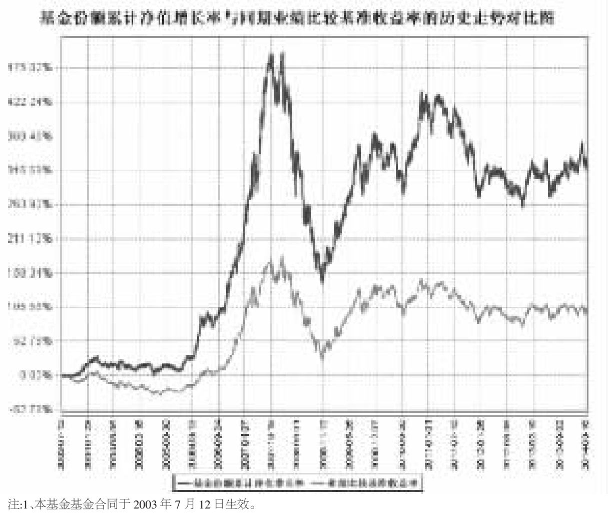
3.2 基金净值表现

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 | -2.27% | 1.07% | -2.00% | 0.85% | -0.27% | 0.22% |

注:业绩比较基准=中信标普A股综合指数涨跌幅×70%+中信标普国债指数涨跌幅×25%+金融同业存款利率×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



注:1、本基金基金合同于2003年7月12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 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张卓 | 本基金基金经理 | 2009年1月17日 | - | 10 | 张卓先生,国籍中国,管理学硕士,10年证券从业经验。2004年6月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,历任行业研究员、鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理,2007年8月至2009年1月担任鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2011年1月至2013年3月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理,2009年1月起担任鹏华普天收益证券投资基金基金经理。张卓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1次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自去年底开始逐步调整为成长风格为主的结构,在2014年一季度后半期鉴于经济的不确定性,考虑地产行业的景气变弱,将基金保持较低仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-2.27%,同期上证综指下跌3.91%,深证成指下跌11.48%,沪深300指数下跌7.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济复苏趋势依旧,尤其消费起色明确,QE开始逐步退出;欧洲经济低位徘徊,存在乌克兰政局风险,复苏存在隐患。

中国3月中采制造业PMI公布初值为50.3%,比上月微升0.1个百分点,有所复苏,但趋势较弱。政府于4月初出台经济刺激方案,依旧以基建为主,难以获取资本市场的好感,另外地产放松政策还不明确,与其相对的是地产销售的疲软持续带动地产行业景气的下滑,短期难有周期性行业的拐点出现。

对于资本市场,我们判断2季度呈现震荡局面,中小市值股票相对趋弱,本基金以低仓位防守策略,等待行业景气好的公司的超跌机会,力争为持有人创造收益。

### §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 | 933,201,280.28 | 65.29 |
| | 其中:股票 | 933,201,280.28 | 65.29 |
| 2 | 固定收益投资 | 329,635,000.00 | 23.06 |
| | 其中:债券 | 329,635,000.00 | 23.06 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 149,567,939.30 | 10.46 |
| 7 | 其他资产 | 17,016,176.97 | 1.19 |
| 8 | 合计 | 1,429,420,396.55 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 2,434,341.20 | 0.17 |
| B | 采矿业 | 291,010.00 | 0.02 |
| C | 制造业 | 580,282,551.00 | 40.76 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,344,800.60 | 0.38 |
| E | 建筑业 | 1,006,197.98 | 0.07 |
| F | 批发和零售业 | 4,634,300.01 | 0.33 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 156,694.48 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 114,954,881.82 | 8.07 |
| J | 金融业 | 49,642,977.96 | 3.49 |
| K | 房地产业 | 681,621.00 | 0.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | 47,530,800.00 | 3.34 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 14,957.39 | 0.00 |
| 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 | 50,047,180.80 | 3.52 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 76,178,966.04 | 5.35 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 933,201,280.28 | 65.55 |

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 | 601908 | 京运通 | 6,500,000 | 51,935,000.00 | 3.65 |
| 2 | 300244 | 迪安诊断 | 651,656 | 50,047,180.80 | 3.52 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 1,299,902 | 48,824,319.12 | 3.43 |
| 4 | 000061 | 农产品 | 5,000,000 | 44,950,000.00 | 3.16 |
| 5 | 600978 | 宜华木业 | 8,799,947 | 44,351,732.88 | 3.12 |
| 6 | 300316 | 晶盛机电 | 1,799,897 | 39,993,711.34 | 2.81 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 1,049,940 | 37,619,350.20 | 2.64 |
| 8 | 002544 | 杰赛科技 | 2,799,844 | 36,005,993.84 | 2.53 |
| 9 | 300047 | 天源迪科 | 3,299,924 | 35,573,180.72 | 2.50 |
| 10 | 002470 | 金正大 | 1,799,682 | 34,337,932.56 | 2.41 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 329,635,000.00 | 23.16 |
| | 其中:政策性金融债 | 329,635,000.00 | 23.16 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 329,635,000.00 | 23.16 |

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 | 130236 | 13国开36 | 1,400,000 | 139,846,000.00 | 9.82 |
| 2 | 130243 | 13国开43 | 1,300,000 | 129,831,000.00 | 9.12 |
| 3 | 110413 | 11农发13 | 300,000 | 30,003,000.00 | 2.11 |
| 4 | 130227 | 13国开27 | 300,000 | 29,955,000.00 | 2.10 |

注:上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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
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
本基金本报告期末未持有权证。

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
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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中国平安的发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司(简称"中国平安")于2013年5月22日发布公告称其控股子公司平安证券收到中国证监会《行政处罚和市场禁入事先告知书》,中国证监会决定对平安证券被给予警告并没收其在"万福生科"发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。2013年10月15日,中国平安保险(集团)股份有限公司发布公告称近日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2013]48号),决定对平安证券予以前述行政处罚。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为中国平安作为国内最大的保险机构之一将长期受益于我国保险行业的发展,从处罚公告中知悉,2012年平安证券投行业务承销佣金收入占平安集团营业收入的0.19%,净利润的0.66%,对平安集团的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次行政处罚对该股票的投资价值不产生重大影响。行政处罚不改变该股票的投资价值。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

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 | 509,441.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,510,261.39 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,949,342.95 |
| 5 | 应收申购款 | 47,131.30 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 17,016,176.97 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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 | 1,935,340,964.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 6,859,201.71 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 107,022,779.83 |
| 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 | 1,835,177,385.89 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期未申购、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)《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》;
(二)《鹏华普天系列开放式证券投资基金托管协议》;
(三)《鹏华普天收益证券投资基金2014年第1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第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**
**2014年4月22日**

---

# 鹏华中国50开放式证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014年4月22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2014年4月17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2014年1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 鹏华中国50混合 |
| 基金主代码 | 160605 |
| 交易代码 | 160605 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年5月12日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,952,466,886.63份 |
| 投资目标 | 以价值投资为本,通过集中投资于基本面和流动性良好同时收益价值或成长价值相对被低估的股票,长期持有结合适度波段操作,以求在充分控制风险的前提下分享中国经济成长和实现基金财产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | (1)股票投资方法:本基金股票投资中,精选个股,长期持有结合适度波段操作,注重长期收益。将类指数的选股方式与积极的权重配置相结合,从而在保持了收益空间的前提下一定程度上降低了投资风险。股票价值分析兼顾收益性和成长性。<br>(2)债券投资方法:本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的,采取积极主动的投资策略,谋取超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 上证180指数涨跌幅×65%+深证100指数涨跌幅×30%+金融同业存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于平衡型证券投资基金,为证券投资基金中的中风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金,高于价值型基金、指数型基金、纯债券基金和国债。 |
| 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(2014年1月1日－2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -166,590,069.16 |
| 2.本期利润 | -321,517,447.59 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0994 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,880,013,475.49 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.975 |

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。

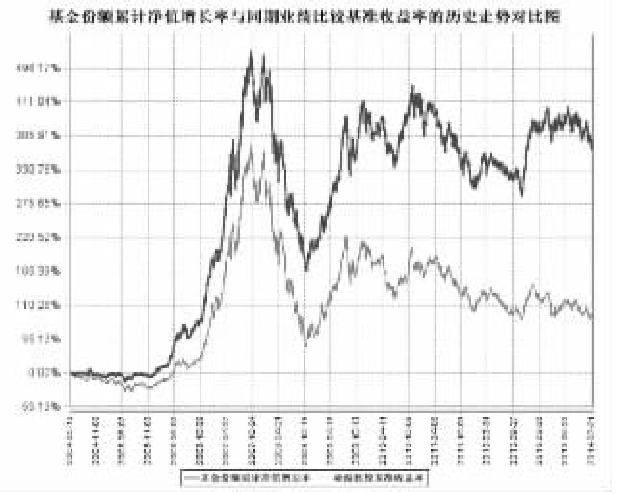
3.2 基金净值表现

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 | -9.30% | 1.14% | -7.44% | 1.14% | -1.86% | 0.00% |

注:业绩比较基准=上证180指数涨跌幅×65%+深证100指数涨跌幅×30%+金融同业存款利率×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



注:1、本基金基金合同于2004年5月12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 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈鹏 | 本基金基金经理 | 2011年1月28日 | - | 11 | 陈鹏先生,国籍中国,清华大学工商管理硕士,11年证券从业经验。曾在联合证券有限责任公司任行业研究员;2006年5月加入鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,历任行业研究员、鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金经理助理,2007年8月至2011年1月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理,2008年8月至2011年5月担任鹏华普丰基金基金经理,2011年6月至2013年3月担任鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2011年1月起至今担任鹏华中国50开放式证券投资基金基金经理,2013年1月起兼任鹏华普丰基金基金经理,现同时担任基金管理部副总经理、投资决策委员会成员。陈鹏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1次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年一季度,市场延续弱势,沪深300指数一度下跌接近10%;创业板指数在二月份创出历史新高,之后有所调整。金融、地产、周期性板块进一步下跌,食品饮料、医药等传统的防御性行业也被抛售。

季度内,本基金降低了股票仓位,行业配置进一步向与经济周期关联度较小的防御性行业集中。不过一季度总体看,市场的获利机会主要还是集中于新兴产业和并购等事件性刺激,本组合被动防御的效果不明显,表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-9.30%,同期上证综指下跌3.91%,深证成指下跌11.48%,沪深300指数下跌7.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

开年以来,数据显示国内经济继续低迷,政府投资在防控地方债务风险的考虑下受到一定压制,房地产销售与投资转弱,消费增长不温不火。市场对国内经济增速预期进一步下调。季度末,政策出现一些保增长的迹象,市场开始憧憬投资与房地产政策的放松,从而引发了A股市场风格在一定程度的转变。

展望未来:一方面,从全球来看,美联储给出了QE退出的计划,不过由于其退出影响的复杂性,路径仍不清晰。QE的退出不仅对美国的经济,对全球的流动性状况都将会有较大的影响;另一方面,国内经济政策虽有转向保增长的可能,但其力度、效果、市场反应仍存很多不确定性。保增长既要达到稳定经济与就业的效果,又能顺应经济结构调整的方向,这才是市场愿意看到的;如果重回刺激投资的旧路,不仅有可能达不到预期效果,也可能造成"钱荒"再现。

在如此复杂的经济环境中,本基金只能将关注点集中于更为深入的研究公司基本面,并且尽可能的减少市场系统性风险带来的波动,力争为投资人创造良好的回报。

### §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 | 2,138,475,301.32 | 73.99 |
| | 其中:股票 | 2,138,475,301.32 | 73.99 |
| 2 | 固定收益投资 | 194,766,500.00 | 6.74 |
| | 其中:债券 | 194,766,500.00 | 6.74 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 498,378,098.19 | 17.24 |
| 7 | 其他资产 | 58,464,437.68 | 2.02 |
| 8 | 合计 | 2,890,084,337.19 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 1,731,838,154.81 | 60.13 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 38,780,897.12 | 1.35 |
| E | 建筑业 | 101,411,105.95 | 3.52 |
| F | 批发和零售业 | 11,413,029.04 | 0.40 |
| 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 | 143,467,754.40 | 4.98 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 111,564,360.00 | 3.87 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,138,475,301.32 | 74.25 |

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 | 600887 | 伊利股份 | 5,238,216 | 187,685,279.28 | 6.52 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 3,783,386 | 170,555,040.88 | 5.92 |
| 3 | 002250 | 联化科技 | 7,299,969 | 134,538,428.67 | 4.67 |
| 4 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,297,817 | 110,410,913.16 | 3.83 |
| 5 | 600557 | 康缘药业 | 2,853,583 | 87,005,745.67 | 3.02 |
| 6 | 601633 | 长城汽车 | 2,599,862 | 84,417,519.14 | 2.93 |
| 7 | 600703 | 三安光电 | 2,949,831 | 67,108,655.25 | 2.33 |
| 8 | 000024 | 招商地产 | 3,500,000 | 66,010,000.00 | 2.29 |
| 9 | 002152 | 广电运通 | 3,666,178 | 64,964,674.16 | 2.26 |
| 10 | 000530 | 大冷股份 | 6,799,927 | 63,851,314.53 | 2.22 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 194,766,500.00 | 6.76 |
| | 其中:政策性金融债 | 194,766,500.00 | 6.76 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 194,766,500.00 | 6.76 |

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 | 130311 | 13进出11 | 550,000 | 54,906,500.00 | 1.91 |
| 2 | 130243 | 13国开43 | 500,000 | 49,935,000.00 | 1.73 |
| 3 | 120409 | 12农发09 | 500,000 | 49,925,000.00 | 1.73 |
| 4 | 130322 | 13进出22 | 300,000 | 30,000,000.00 | 1.04 |
| 5 | 130218 | 13国开18 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.35 |

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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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
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
本基金本报告期末未持有权证。

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
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,192,262.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | 51,712,301.34 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,025,962.21 |
| 5 | 应收申购款 | 533,911.30 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 58,464,437.68 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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 | 3,583,135,978.24 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 40,428,655.44 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 671,097,747.05 |
| 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 | 2,952,466,886.63 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期未申购、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)《鹏华中国50开放式证券投资基金基金合同》;
(二)《鹏华中国50开放式证券投资基金托管协议》;
(三)《鹏华中国50开放式证券投资基金2014年第1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第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**
**2014年4月22日**

---

# 鹏华丰收债券型证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3月31日

**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:2014年4月22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的法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月17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2014年1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 鹏华丰收债券 |
| 基金主代码 | 160612 |
| 交易代码 | 160612 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年5月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,576,929,725.72份 |
| 投资目标 | 在严格控制投资风险的基础上,通过主要投资债券等固定收益类品种,同时兼顾部分被市场低估的权益类品种,力求使基金份额持有人获得持续稳定的投资收益。 |
| 投资策略 | (1)股票投资:股票投资采用"行业配置"与"个股选择"双线并行的投资策略,并通过灵活的仓位调控等手段来避免市场中的系统风险。<br>(2)债券投资:本基金通过对宏观经济状况和货币政策等因素的研究,形成对未来市场利率变动方向的预期,主动地调整债券投资组合的久期,提高债券投资组合的收益水平;通过对债券市场具体情况的分析判断,形成对未来收益率曲线形状变化的预期,相应地选择子弹型、哑铃型或梯形的组合期限配置,获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债总指数收益率 |
| 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,低于混合型基金、股票型基金,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(2014年1月1日－2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -18,770,394.92 |
| 2.本期利润 | 7,356,082.12 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0044 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,559,837,056.31 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.989 |

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。

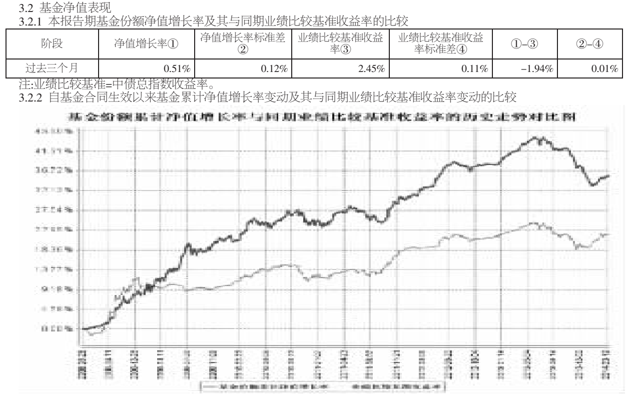
3.2 基金净值表现

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 | 0.51% | 0.12% | 2.45% | 0.11% | -1.94% | 0.01% |

注:业绩比较基准=中债总指数收益率。

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



注:1、本基金基金合同于2008年5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 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 阳先伟 | 本基金基金经理 | 2008年5月28日 | - | 12 | 阳先伟先生,国籍中国,经济学硕士,12年证券从业经验。先后在民生证券、国海证券等机构从事债券研究及投资组合管理工作,历任研究员、高级经理等职务。2004年9月加盟鹏华基金管理有限公司从事债券及宏观研究工作,曾任鹏华普天债券基金基金经理助理;2007年1月至2014年2月担任鹏华普天债券基金基金经理,2010年12月至2014年2月担任鹏华丰润债券型证券投资基金基金经理,2008年5月至今担任鹏华丰收债券型证券投资基金基金经理,2013年9月至今兼任鹏华双债保利债券型证券投资基金基金经理,现同时担任固定收益部执行总经理、投资决策委员会成员。阳先伟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1次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在经历2013年下半年的大幅调整之后,2014年一季度债市迎来明显反弹。1月至2月,市场在资金面宽松、经济景气下行、银行信贷扩张减缓等利好推动下明显上涨;进入3月份后,市场开始盘整并略有回落,乐观情绪也所降温。分类别来看,中等评级的城投类债券表现较好,部分低等评级的企业债表现相对落后;从收益率曲线结构看,短期收益率下行幅度明显高于长期收益率,收益曲线呈陡峭化。债券指数方面,与2013年末相比,交易所上证国债指数上涨了1.02%,银行间中债总财富指数上涨2.45%。

一季度本基金在投资策略继续强调对于风险的防范:久期方面,我们减持了部分长期限的债券,进一步降低了组合久期;品种选择方面,我们仍然保持配置流动性较好的中高等评级信用债券。权益和可转债方面,我们保持着较为谨慎的态度,包括可转债在内的权益类持仓处于极低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

一季度丰收债券基金份额净值增长率为0.51%,低于基准1.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年二季度债券市场,我们认为:目前经济下行和通胀压力趋弱的迹象明显,全社会较高的总融资需求长期来看不具有持续性,因此,我们仍然看好债市的长期表现。但从中短期来看,各地的投资冲动仍然存在、部分高负债企业的再融资压力较大,在经济增速下行的背景下,一旦中央启动"稳增长"措施,潜在的投资冲动就可能转变为现实的融资需求,从而再度导致信贷市场紧张,利率全面上行。因此,在经济的投融资需求系统性下降之前,债券市场仍可能继续承受压力。

同时,在实体经济层面信贷供给较为紧张的情况下,在一些过度负债的部门或企业,债务链条相对脆弱的环节可能发生断裂,从而直接或间接地引发债券市场的信用风险。因此,我们在2014年二季度的投资中,将继续注重对于信用风险的识别和管理,更加严格地规避经营不善、投融资过于激进的企业。

权益市场方面,我们仍认为目前股市估值整体上处于基本合理的区间,不存在系统性低估。由于国内经济增长减速、流动性总体偏紧,新股发行制度改革等原因,股市难以出现系统性机会。综上,我们判断2014年二季度权益市场可能仍然延续指数区间震荡的格局,仅部分板块和公司可能存在机会。

组合的纯债券投资方面:在久期配置上,我们将坚持平衡收益与风险的原则,在更加注重风险控制的前提下适度承担久期风险;在结构方面,以配置中短期品种为主,谨慎参与长期债券,适时相机操作,以积极把握利率市场可能存在的机会;在类属配置上,将在严格控制信用风险的前提下,根据组合规模适度配置中高信用评级的品种。

权益投资方面:我们将继续遵循价值投资的理念,以较为谨慎的态度进行股票和转债的投资,力求保持基金份额净值平稳增长。

### §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 | 固定收益投资 | 1,582,485,176.50 | 93.97 |
| | 其中:债券 | 1,582,485,176.50 | 93.97 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 36,883,332.19 | 2.19 |
| 7 | 其他资产 | 64,704,146.75 | 3.84 |
| 8 | 合计 | 1,684,072,655.44 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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
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 | 6,689,900.00 | 0.43 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 82,852,500.00 | 5.31 |
| | 其中:政策性金融债 | 82,852,500.00 | 5.31 |
| 4 | 企业债券 | 1,414,910,776.50 | 90.71 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,222,000.00 | 1.94 |
| 6 | 中期票据 | 47,810,000.00 | 3.07 |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,582,485,176.50 | 101.45 |

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 | 122621 | 12赣城债 | 1,000,000 | 98,500,000.00 | 6.31 |
| 2 | 1380161 | 13潍滨投债 | 1,000,000 | 96,650,000.00 | 6.20 |
| 3 | 124201 | 13南高速 | 700,000 | 66,654,000.00 | 4.27 |
| 4 | 124249 | 13大城投 | 600,000 | 61,104,000.00 | 3.92 |
| 5 | 122685 | 12吉城投 | 600,000 | 60,600,000.00 | 3.89 |

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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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
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
本基金本报告期末未持有权证。

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
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
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
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 | 82,073.16 |
| 2 | 应收证券清算款 | 13,271,829.61 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 51,257,988.74 |
| 5 | 应收申购款 | 92,255.24 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 64,704,146.75 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

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 | 1,870,728,177.61 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 11,034,134.77 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 304,832,586.66 |
| 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 | 1,576,929,725.72 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

### §9 备查文件目录

9.1 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托管协议》;
(三)《鹏华丰收债券型证券投资基金2014年第1季度报告》(原文)。

9.2 存放地点
深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司
北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行股份有限公司

9.3 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**
**2014年4月22日**