

鹏华丰润债券型证券投资基金(LOF)

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

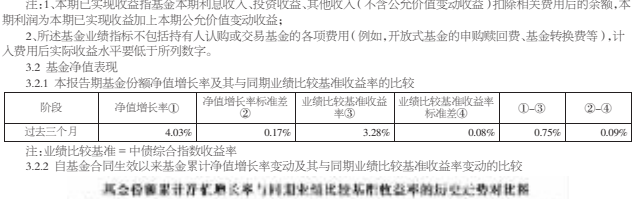
重要提示
基金管理人、基金托管人及会计师事务所按照有关规定,未发现本报告存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金管理人鹏华基金管理有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托职责,但不保证基金一定盈利,基金的投资业绩并不表示对其未来表现,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2014年7月1日起至2014年6月30日止。

基金简称	鹏华丰润债券型证券投资基金(LOF)
基金代码	160617
交易代码	160617
基金运作方式	契约型,本基金在基金合同生效后三年内,每年开放一次,在定期开放交易期间上市交易,封闭期结束后转换为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日期	2010年12月29日
报告期末基金份额总额	109,572,815.51份
投资目标	严格控制投资组合风险的基础上,通过积极的投资策略,力争为基金份额持有人创造持续稳定的投资回报。
投资策略	基金管理人将采取积极的投资策略,寻找各种可能的价值增长机会,力争实现超越基准的投资收益。 资产配置策略:本基金通过对宏观经济形势及利率变化趋势的重点分析,结合对债券市场利率走势的判断,适当调整债券资产比例,在保持资产流动性及控制风险的前提下,将投资组合的资产配置在债券资产、股票资产、金融衍生品及其他资产之间。 债券投资策略: 1. 久期配置策略 本基金通过对宏观经济、货币政策、通胀预期等因素的综合分析,判断未来利率走势,结合对债券市场利率走势的判断,适当调整债券资产比例。 2. 期限配置策略 本基金通过对宏观经济、货币政策、通胀预期等因素的综合分析,判断未来利率走势,结合对债券市场利率走势的判断,适当调整债券资产比例。 3. 品种配置策略 本基金通过对宏观经济、货币政策、通胀预期等因素的综合分析,判断未来利率走势,结合对债券市场利率走势的判断,适当调整债券资产比例。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金,为证券投资基金中的中低风险品种。
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

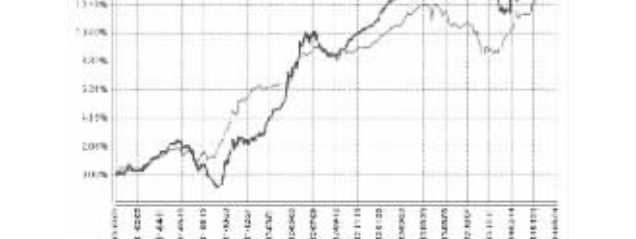
基金投资组合情况	
序号	项目
1	权益投资
1.1	其中:股票
2	固定收益投资
2.1	其中:债券
3	银行存款
4	金融衍生品投资
5	买入返售金融资产
6	其他各项资产

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	18,604,520.00	14.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,039,033.20	0.89
8	其他	-	-
9	合计	18,604,520.00	14.29

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	122199	12国债09	66,140,900.00	59.02	51.34
2	122850	11国债05	490,000.00	39,200,000.00	33.69
3	122856	10国债03	221,400.00	22,325,000.00	19.30
4	122865	12国债06	94,970.00	20,819,000.00	17.36
5	121059	11国债18	179,490.00	18,307,900.00	15.83



阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
过去三个月	4.03%	0.17%	3.28%	0.08%	0.75%



姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
陈兵	本基金基金经理	2014年2月22日	8	曾任鹏华基金基金经理,2014年2月22日起担任本基金基金经理。

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7月19日

重要提示
基金管理人、基金托管人及会计师事务所按照有关规定,未发现本报告存在虚假记载、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。
基金管理人鹏华基金管理有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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、勤勉尽责的原则履行受托职责,但不保证基金一定盈利,基金的投资业绩并不表示对其未来表现,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。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2014年7月1日起至2014年6月30日止。

基金投资组合情况
投资策略
业绩比较基准
风险收益特征
基金管理人
基金托管人

主要财务指标
主要财务指标
1.本期已实现收益
2.本期利润
3.加权平均基金份额本期利润
4.期末基金资产净值
5.期末基金份额净值

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比
基金投资组合的行业分布

鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

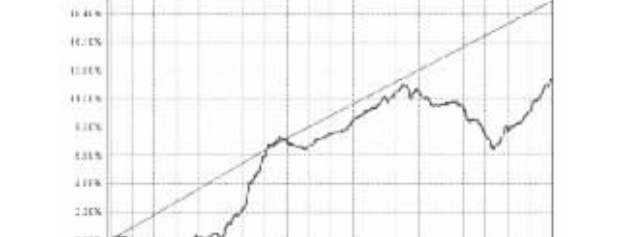
重要提示
基金管理人、基金托管人及会计师事务所按照有关规定,未发现本报告存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金管理人鹏华基金管理有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托职责,但不保证基金一定盈利,基金的投资业绩并不表示对其未来表现,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2014年7月1日起至2014年6月30日止。

基金简称	鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金
基金代码	200808
交易代码	200808
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2011年4月25日
报告期末基金份额总额	3,083,176,241.70份
投资目标	注重风险控制,力争获取超越业绩比较基准的绝对收益。
投资策略	本基金力争获取超越业绩比较基准的绝对收益,并通过对风险的严格把握和精确控制,实现长期稳健增值。 资产配置策略:本基金通过对宏观经济、货币政策、通胀预期等因素的综合分析,判断未来利率走势,结合对债券市场利率走势的判断,适当调整债券资产比例。 债券投资策略:本基金通过对宏观经济、货币政策、通胀预期等因素的综合分析,判断未来利率走势,结合对债券市场利率走势的判断,适当调整债券资产比例。 品种配置策略:本基金通过对宏观经济、货币政策、通胀预期等因素的综合分析,判断未来利率走势,结合对债券市场利率走势的判断,适当调整债券资产比例。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+1.6%
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金,为证券投资基金中的中低风险品种。
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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
1.1	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	169,094,553.20	91.23
2.1	其中:债券	169,094,553.20	91.23
3	银行存款	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他各项资产	12,229,361.12	6.40
7	其他负债	4,016,835.15	2.17
8	合计	183,341,547.47	100.00

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	18,604,520.00	14.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,039,033.20	0.89
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	合计	18,604,520.00	14.29

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	122199	12国债09	66,140,900.00	59.02	51.34
2	122850	11国债05	490,000.00	39,200,000.00	33.69
3	122856	10国债03	221,400.00	22,325,000.00	19.30
4	122865	12国债06	94,970.00	20,819,000.00	17.36
5	121059	11国债18	179,490.00	18,307,900.00	15.83



阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
过去三个月	3.18%	0.07%	1.46%	0.02%	1.72%

姓名	职务	任期自	任期至	说明
陈兵	本基金基金经理	2014年4月25日	-	曾任鹏华基金基金经理,2014年4月25日起担任本基金基金经理。

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7月19日

重要提示
基金管理人、基金托管人及会计师事务所按照有关规定,未发现本报告存在虚假记载、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。
基金管理人鹏华基金管理有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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、勤勉尽责的原则履行受托职责,但不保证基金一定盈利,基金的投资业绩并不表示对其未来表现,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。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2014年7月1日起至2014年6月30日止。

基金投资组合情况
投资策略
业绩比较基准
风险收益特征
基金管理人
基金托管人

主要财务指标
主要财务指标
1.本期已实现收益
2.本期利润
3.加权平均基金份额本期利润
4.期末基金资产净值
5.期末基金份额净值

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比
基金投资组合的行业分布

鹏华价值精选股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

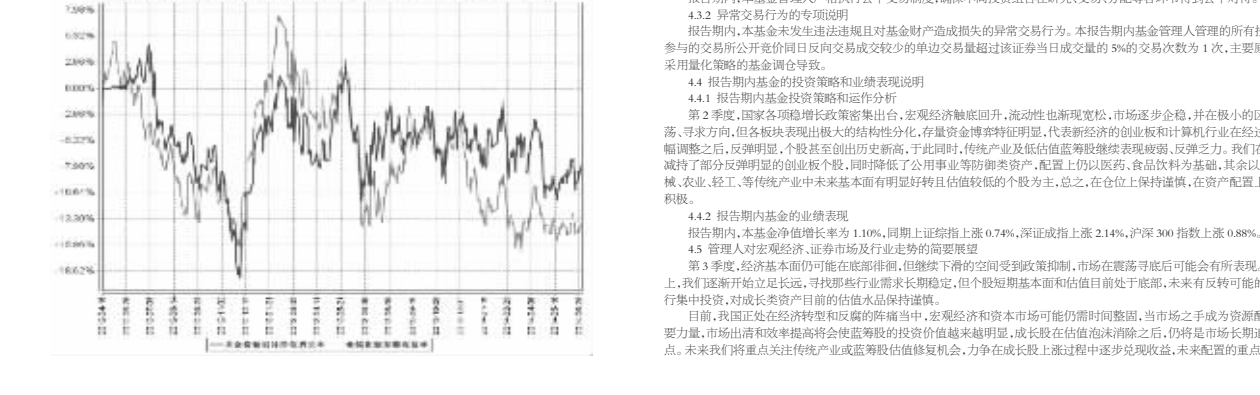
基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

重要提示
基金管理人、基金托管人及会计师事务所按照有关规定,未发现本报告存在虚假记载、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。
基金管理人鹏华基金管理有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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、勤勉尽责的原则履行受托职责,但不保证基金一定盈利,基金的投资业绩并不表示对其未来表现,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。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2014年7月1日起至2014年6月30日止。

基金简称	鹏华价值精选股票型证券投资基金
基金代码	200812
交易代码	200812
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2012年4月16日
报告期末基金份额总额	49,727,422.22份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,精选具备优良成长性且具有良好的市场前景的上市公司,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置策略:本基金通过对宏观经济、货币政策、通胀预期等因素的综合分析,判断未来利率走势,结合对债券市场利率走势的判断,适当调整债券资产比例。 债券投资策略:本基金通过对宏观经济、货币政策、通胀预期等因素的综合分析,判断未来利率走势,结合对债券市场利率走势的判断,适当调整债券资产比例。 品种配置策略:本基金通过对宏观经济、货币政策、通胀预期等因素的综合分析,判断未来利率走势,结合对债券市场利率走势的判断,适当调整债券资产比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*90%+中证综合债指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为主动管理型股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币型基金,高于债券型基金和混合型基金,为证券投资基金中的中高风险品种。
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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	41,370,357.04	83.33
1.1	其中:股票	41,370,357.04	83.33
2	固定收益投资	-	-
3	银行存款	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他各项资产	5,255,273.65	11.22
7	其他负债	102,966.65	0.21
8	合计	46,727,577.34	100.00

姓名	职务	任期自	任期至	说明
魏伟	本基金基金经理	2012年4月16日	-	曾任鹏华基金基金经理,2012年4月16日起担任本基金基金经理。

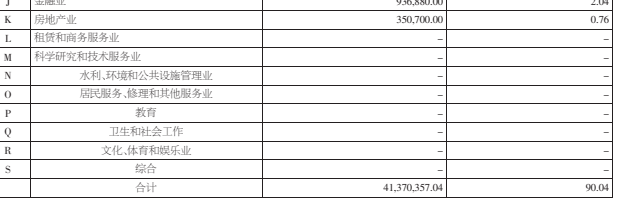


基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

重要提示
基金管理人、基金托管人及会计师事务所按照有关规定,未发现本报告存在虚假记载、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。
基金管理人鹏华基金管理有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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、勤勉尽责的原则履行受托职责,但不保证基金一定盈利,基金的投资业绩并不表示对其未来表现,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。
本报告中财务数据未经审计。
本报告自2014年7月1日起至2014年6月30日止。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	41,370,357.04	83.33
1.1	其中:股票	41,370,357.04	83.33
2	固定收益投资	-	-
3	银行存款	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他各项资产	5,255,273.65	11.22
7	其他负债	102,966.65	0.21
8	合计	46,727,577.34	100.00

姓名	职务	任期自	任期至	说明
魏伟	本基金基金经理	2012年4月16日	-	曾任鹏华基金基金经理,2012年4月16日起担任本基金基金经理。



阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
过去三个月	1.06%	0.88%	1.08%	0.79%	0.03%

姓名	职务	任期自	任期至	说明
魏伟	本基金基金经理	2012年4月16日	-	曾任鹏华基金基金经理,2012年4月16日起担任本基金基金经理。

姓名	职务	任期自	任期至	说明
魏伟	本基金基金经理	2012年4月16日	-	曾任鹏华基金基金经理,2012年4月16日起担任本基金基金经理。