

鹏华普天债券证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

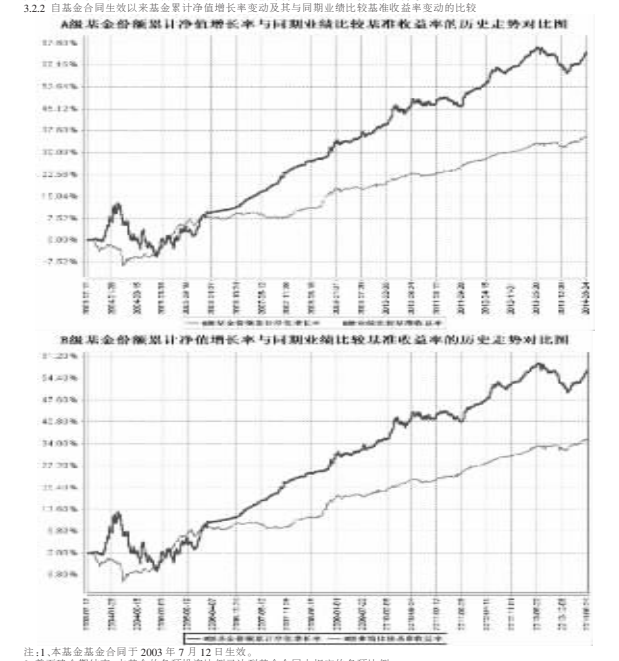
基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

1.1 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。
 基金管理人中国工商银行股份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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
 本报告财务数据截止至2014年6月30日。

基金投资组合		
基金代码	160602	
交易所名称	鹏华普天系列基金	
基金名称	鹏华普天收益混合(160602)	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日期	2007年7月16日	
报告期末基金份额总额	695,400,260.91份	
投资组合	本基金为固定收益类基金,主要投资于债券及货币市场工具,在充分分散投资的前提下实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金主要采用自上而下策略,综合考虑宏观经济、利率、信用、流动性等因素,对债券市场进行整体判断,确定债券组合的久期、期限、品种、类属配置和个券选择,并对每一类别的风险因素进行相应的管理以形成投资组合,追求中长期资产增值。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率*90%+金融债指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属证券投资基金名称	鹏华普天债券 A 鹏华普天债券 B	
下属证券投资基金代码	160602	160608
报告期末下属证券投资基金总额	645,969,309.85份	49,430,951.06份
报告期末基金份额总额	705,400,260.91份	

3.1 主要财务指标			
主要财务指标	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)	鹏华普天债券 A	鹏华普天债券 B
1.本期已实现收益	3,828,873.31	108,915.41	108,915.41
2.本期利润	16,661,736.73	1,261,023.27	1,261,023.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.0252	0.0307	0.0307
4.期末基金份额净值	674,179,484.89	30,868,363.17	30,868,363.17
5.期末基金份额净值增长率	1.04%	1.03%	1.03%

3.2 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较					
阶段	净值增长率	净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差	①-②	②-③	
过去三个月	2.55%	0.09%	1.06%	0.09%	1.45%
过去六个月	2.38%	0.09%	1.09%	0.09%	1.28%



4.1 基金管理人及基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏峻	基金基金经理	2014年3月22日	-	8	原任东方基金管理公司基金经理,2014年3月22日起任鹏华普天债券基金基金经理,曾任东方基金管理公司基金经理,负责东方基金管理公司旗下多只公募基金产品的投资管理工作,具有多年证券从业经验,具备扎实的基金投资管理经验,2014年3月22日起任鹏华普天债券基金基金经理,负责鹏华普天债券基金的投资管理工作,具有多年证券从业经验,具备扎实的基金投资管理经验。

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

1.1 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。
 基金管理人中国工商银行股份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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
 本报告财务数据截止至2014年6月30日。

基金投资组合		
基金代码	160602	
基金名称	鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日期	2012年9月27日	
报告期末基金份额总额	479,956,607.91份	
投资组合	本基金为股票型基金,主要投资于国内 A 股市场,追求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金主要采用自上而下策略,综合考虑宏观经济、行业景气度、估值水平等因素,对股票市场进行整体判断,确定股票组合的行业配置和个股选择,追求中长期资产增值。	
业绩比较基准	中证 A 股资源产业指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的高风险品种,其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属证券投资基金名称	鹏华中证 A	鹏华中证 B
下属证券投资基金代码	160620	160610
报告期末下属证券投资基金总额	27,648,555.91份	226,144,036.00份

3.1 主要财务指标			
主要财务指标	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)	鹏华中证 A	鹏华中证 B
1.本期已实现收益	-26,776,741.83	-	-
2.本期利润	-11,375,675.55	-	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0231	-	-
4.期末基金份额净值	421,840,973.80	-	-
5.期末基金份额净值增长率	0.87%	-	-

注:1本基金基金合同于2012年9月27日生效。

1.1 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。
 基金管理人中国工商银行股份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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
 本报告财务数据截止至2014年6月30日。

基金投资组合		
基金代码	160621	
交易所名称	鹏华中小企业债券	
基金名称	鹏华中证中小企业债券指数证券投资基金	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日期	2012年11月5日	
报告期末基金份额总额	986,822,099.11份	
投资组合	本基金为固定收益类基金,主要投资于中小企业债券,追求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金主要采用自上而下策略,综合考虑宏观经济、利率、信用、流动性等因素,对中小企业债券市场进行整体判断,确定债券组合的久期、期限、品种、类属配置和个券选择,追求中长期资产增值。	
业绩比较基准	中证中小企业债券指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属证券投资基金名称	鹏华中证中小企业债券 A	鹏华中证中小企业债券 B
下属证券投资基金代码	160621	160622
报告期末下属证券投资基金总额	645,969,309.85份	49,430,951.06份
报告期末基金份额总额	705,400,260.91份	

3.1 主要财务指标			
主要财务指标	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)	鹏华中证中小企业债券 A	鹏华中证中小企业债券 B
1.本期已实现收益	11,579,108.39	-	-
2.本期利润	62,275,047.26	-	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0681	-	-
4.期末基金份额净值	1,058,870,027.96	-	-
5.期末基金份额净值增长率	1.07%	-	-

3.2 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较					
阶段	净值增长率	净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差	①-②	②-③	
过去三个月	6.24%	0.09%	1.06%	0.09%	5.18%
过去六个月	5.18%	0.09%	1.09%	0.09%	4.09%



4.1 基金管理人及基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏峻	基金基金经理	2012年11月5日	-	12	原任东方基金管理公司基金经理,2012年11月5日起任鹏华中证中小企业债券基金基金经理,曾任东方基金管理公司基金经理,负责东方基金管理公司旗下多只公募基金产品的投资管理工作,具有多年证券从业经验,具备扎实的基金投资管理经验,2012年11月5日起任鹏华中证中小企业债券基金基金经理,负责鹏华中证中小企业债券基金的投资管理工作,具有多年证券从业经验,具备扎实的基金投资管理经验。

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

1.1 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。
 基金管理人中国工商银行股份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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
 本报告财务数据截止至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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

1.1 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。
 基金管理人中国工商银行股份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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
 本报告财务数据截止至2014年6月30日。

基金投资组合		
基金代码	160621	
交易所名称	鹏华中小企业债券	
基金名称	鹏华中证中小企业债券指数证券投资基金	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日期	2012年11月5日	
报告期末基金份额总额	986,822,099.11份	
投资组合	本基金为固定收益类基金,主要投资于中小企业债券,追求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金主要采用自上而下策略,综合考虑宏观经济、利率、信用、流动性等因素,对中小企业债券市场进行整体判断,确定债券组合的久期、期限、品种、类属配置和个券选择,追求中长期资产增值。	
业绩比较基准	中证中小企业债券指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属证券投资基金名称	鹏华中证中小企业债券 A	鹏华中证中小企业债券 B
下属证券投资基金代码	160621	160622
报告期末下属证券投资基金总额	645,969,309.85份	49,430,951.06份

3.1 主要财务指标			
主要财务指标	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)	鹏华中证中小企业债券 A	鹏华中证中小企业债券 B
1.本期已实现收益	11,579,108.39	-	-
2.本期利润	62,275,047.26	-	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0681	-	-
4.期末基金份额净值	1,058,870,027.96	-	-
5.期末基金份额净值增长率	1.07%	-	-



注:1本基金基金合同于2012年11月5日生效。

鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

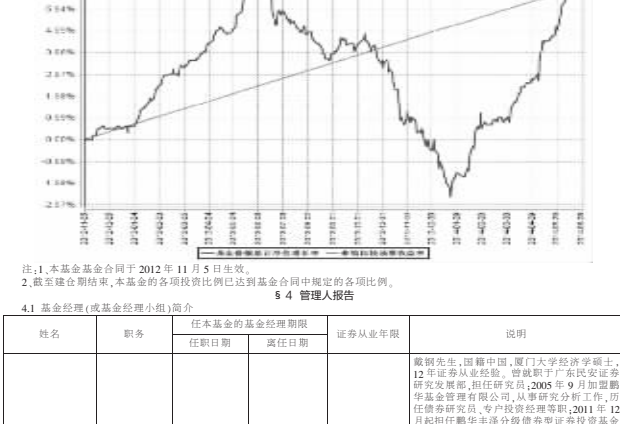
基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

1.1 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。
 基金管理人中国工商银行股份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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
 本报告财务数据截止至2014年6月30日。

基金投资组合		
基金代码	160621	
交易所名称	鹏华中小企业债券	
基金名称	鹏华中证中小企业债券指数证券投资基金	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日期	2012年11月5日	
报告期末基金份额总额	986,822,099.11份	
投资组合	本基金为固定收益类基金,主要投资于中小企业债券,追求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金主要采用自上而下策略,综合考虑宏观经济、利率、信用、流动性等因素,对中小企业债券市场进行整体判断,确定债券组合的久期、期限、品种、类属配置和个券选择,追求中长期资产增值。	
业绩比较基准	中证中小企业债券指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属证券投资基金名称	鹏华中证中小企业债券 A	鹏华中证中小企业债券 B
下属证券投资基金代码	160621	160622
报告期末下属证券投资基金总额	645,969,309.85份	49,430,951.06份
报告期末基金份额总额	705,400,260.91份	

3.1 主要财务指标			
主要财务指标	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)	鹏华中证中小企业债券 A	鹏华中证中小企业债券 B
1.本期已实现收益	11,579,108.39	-	-
2.本期利润	62,275,047.26	-	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0681	-	-
4.期末基金份额净值	1,058,870,027.96	-	-
5.期末基金份额净值增长率	1.07%	-	-

3.2 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较					
阶段	净值增长率	净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差	①-②	②-③	
过去三个月	6.24%	0.09%	1.06%	0.09%	5.18%
过去六个月	5.18%	0.09%	1.09%	0.09%	4.09%



4.1 基金管理人及基金经理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏峻	基金基金经理	2012年11月5日	-	12	原任东方基金管理公司基金经理,2012年11月5日起任鹏华中证中小企业债券基金基金经理,曾任东方基金管理公司基金经理,负责东方基金管理公司旗下多只公募基金产品的投资管理工作,具有多年证券从业经验,具备扎实的基金投资管理经验,2012年11月5日起任鹏华中证中小企业债券基金基金经理,负责鹏华中证中小企业债券基金的投资管理工作,具有多年证券从业经验,具备扎实的基金投资管理经验。

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

1.1 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。
 基金管理人中国工商银行股份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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
 本报告财务数据截止至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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

1.1 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。
 基金管理人中国工商银行股份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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
 本报告财务数据截止至2014年6月30日。

基金投资组合				
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-	-
B	采矿业	27,015,171.53	6.48	-
C	制造业	119,160,512.12	28.25	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,356,840.00	1.98	-
E	建筑业	-	-	-
F	批发和零售业	-	-	-
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	-	-	-
J	金融业	-	-	-
K	房地产业	-	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-	-
N	卫生、医药和公共卫生管理业	-	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-	-
Q	教育	-	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-	-
S	综合	399,532,532.15	94.71	-
合计				

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,300.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	卫生、医药和公共卫生管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	其他	-	-
S	合计	21,400.00	0.01

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五名股票投资明细			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	000060	中金黄金	832,008
2	600516	方大特钢	1,000,349
3	601088	中国神华	519,540
4	600028	中国石化	1,700,599
5	601018	宝钢股份	1,297,352

注:1本基金基金合同于2012年11月5日生效。

1.1 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