

鹏华丰收债券型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

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
送出日期:2014年8月26日

1.1 重要提示

基金管理人的董事、监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法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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,投资者投资于本基金时,应认真阅读基金招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中所列财务数据未经审计。

本报告自2014年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况	
基金简称	鹏华丰收债券
场内简称	
基金代码	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
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
报告期末基金份额总额	1,468,827,194.15份
基金合同期限	不定期
2.2 基金产品说明	
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回报。
投资策略	(1) 股票投资:股票投资采用“行业配置”与“个股选择”双轮驱动的投资策略,并通过灵活的仓位调整等手段来避免市场中的系统风险。 (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;通过对债券市场估值情况的分析判断,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
风险特征	本基金为债券型基金,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,属于证券投资基金中的较低风险品种。

2.3 基金管理人、基金托管人	
项目	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
名称	鹏华基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 张义 联系电话 0755-82825720 电子邮箱 zhangy@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999 010-62795996
传真	0755-82012126 010-64275853
2.4 信息披露方式	
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心4层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区南口大街1号1号楼中国建设银行股份有限公司

3.1 主要会计数据和财务指标	
3.1.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

3.2 基金净值表现					
3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率标准差③	①-③	②-④
过去一个月	0.89%	0.07%	0.68%	0.09%	-0.02%
过去三个月	3.54%	0.09%	3.51%	0.11%	-0.02%
过去六个月	4.07%	0.11%	6.08%	0.13%	-0.06%
过去一年	-2.27%	0.12%	1.63%	0.12%	-0.06%
过去三年	10.41%	0.13%	11.37%	0.10%	-0.06%
自基金合同生效至今	40.60%	0.18%	26.19%	0.13%	14.41%
注:①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					

3.3 主要会计数据和财务指标	
3.3.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
3.3.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

3.4 主要会计数据和财务指标	
3.4.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
3.4.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

3.5 主要会计数据和财务指标	
3.5.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
3.5.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

3.6 主要会计数据和财务指标	
3.6.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
3.6.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

3.7 主要会计数据和财务指标	
3.7.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
3.7.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

3.8 主要会计数据和财务指标	
3.8.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
3.8.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.1 基金管理人、基金托管人

4.1.1 基金管理人

鹏华基金管理有限公司

4.1.2 基金托管人

中国建设银行股份有限公司

4.2 基金产品说明

4.2.1 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回报。

4.2.2 投资策略

(1) 股票投资:股票投资采用“行业配置”与“个股选择”双轮驱动的投资策略,并通过灵活的仓位调整等手段来避免市场中的系统风险。
(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;通过对债券市场估值情况的分析判断,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,获取收益率曲线的形变所带来的投资收益。

4.2.3 业绩比较基准

中债总指数收益率

4.2.4 风险特征

本基金为债券型基金,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,属于证券投资基金中的较低风险品种。

4.3 主要会计数据和财务指标

4.3.1 期间数据指标

报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)

本期已实现收益: -6,996,047.61

本期利润: 39,934,485.28

加权平均基金份额本期利润: 0.0272

本期基金份额净值增长率: 4.07%

4.3.2 期末数据和指标

报告期末(2014年6月30日)

期末可供分配基金份额利润: -0.0168

期末基金资产净值: 1,504,497,899.94

期末基金份额净值: 1.024

4.4 主要会计数据和财务指标	
4.4.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.4.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.5 主要会计数据和财务指标	
4.5.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.5.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.6 主要会计数据和财务指标	
4.6.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.6.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.7 主要会计数据和财务指标	
4.7.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.7.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.8 主要会计数据和财务指标	
4.8.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.8.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.9 主要会计数据和财务指标	
4.9.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.9.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.1 基金管理人、基金托管人

4.1.1 基金管理人

鹏华基金管理有限公司

4.1.2 基金托管人

中国建设银行股份有限公司

4.2 基金产品说明

4.2.1 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回报。

4.2.2 投资策略

(1) 股票投资:股票投资采用“行业配置”与“个股选择”双轮驱动的投资策略,并通过灵活的仓位调整等手段来避免市场中的系统风险。
(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;通过对债券市场估值情况的分析判断,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,获取收益率曲线的形变所带来的投资收益。

4.2.3 业绩比较基准

中债总指数收益率

4.2.4 风险特征

本基金为债券型基金,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,属于证券投资基金中的较低风险品种。

4.3 主要会计数据和财务指标

4.3.1 期间数据指标

报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)

本期已实现收益: -6,996,047.61

本期利润: 39,934,485.28

加权平均基金份额本期利润: 0.0272

本期基金份额净值增长率: 4.07%

4.3.2 期末数据和指标

报告期末(2014年6月30日)

期末可供分配基金份额利润: -0.0168

期末基金资产净值: 1,504,497,899.94

期末基金份额净值: 1.024

4.4 主要会计数据和财务指标	
4.4.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.4.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.5 主要会计数据和财务指标	
4.5.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.5.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.6 主要会计数据和财务指标	
4.6.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.6.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.7 主要会计数据和财务指标	
4.7.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.7.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.8 主要会计数据和财务指标	
4.8.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.8.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

4.9 主要会计数据和财务指标	
4.9.1 期间数据指标	报告期末(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-6,996,047.61
本期利润	39,934,485.28
加权平均基金份额本期利润	0.0272
本期基金份额净值增长率	4.07%
4.9.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	1,504,497,899.94
期末基金份额净值	1.024

7.3 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	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	5,900,000	20,001,000.00	1.33

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细					
序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	5,900,000	20,001,000.00	1.33

7.5 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					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	5,900,000	20,001,000.00	1.33

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	5,900,000	20,001,000.00	1.33

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	5,900,000	20,001,000.00	1.