

鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金管理人

2013第四季度报告

2013年12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1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及其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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1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。

基金销售机构承诺在本报告期内不从事内幕交易、不公平交易及其他法律、行政法规禁止的行为。

基金经理的过往业绩并不代表其未来表现，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。

本报告期中财务数据未经审计。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华深证民营ETF联接			
基金代码	200610			
交易代码	200610			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2011年9月2日			
报告期末基金份额总额	106,516,011.31份			
投资目标	通过投资于深证民营ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。			
投资策略	本基金采用被动指数基金，以深证民营ETF作为主要投资标的，方特特别客户群通过本基金投资深证民营ETF的管理。			
业绩比较基准	深证成份指数收益率×0.95%+银行存款利率(税后)×5%			
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，为证券投资基金中较高风险品种。本基金的管理费率和托管费率为1.5%，深证民营ETF的管理费率和托管费率为0.2%，深证民营ETF的申购赎回费率为0.5%，赎回费率为0.5%，申购费率为0.5%。			
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			
2.1.1 目标基金基本情况	深圳证券交易所上市开放式指数证券投资基金			
基金代码	159911			
基金运作方式	交易型开放式			
基金合同生效日	2011年6月2日			
基金托管人名称	鹏华基金管理有限公司			
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司			
2.1.2 目标基金产品说明	深证成份指数基金，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。			
投资目标	本基金采用被动指数基金，按照成份股在标的指数中的基准权重进行配置，根据成份股的涨跌幅度对基金资产进行调整，以期在一定程度上减小因成份股波动而产生的跟踪误差。			
投资策略	本基金将采取完全复制法，即完全按照成份股在标的指数中的基准权重进行配置，根据成份股的涨跌幅度对基金资产进行调整，以期在一定程度上减小因成份股波动而产生的跟踪误差。			
业绩比较基准	深证成份指数收益率×0.95%+银行存款利率(税后)×5%			
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，为证券投资基金中较高风险品种。本基金的管理费率和托管费率为1.5%，深证民营ETF的管理费率和托管费率为0.2%，深证民营ETF的申购赎回费率为0.5%，赎回费率为0.5%，申购费率为0.5%。			
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			
2.1.3 主要财务指标	深证成份指数基金，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。			
单位:人民币元				
主要财务指标	报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)			
1.本期已实现收益	4,232,491.80			
2.本期利润	-4,641,511.69			
3.期初至报告期期末基金平均利润率	-0.0408%			
4.期末基金资产净值	104,334,769.81			
5.期末基金份额净值	0.9795			
注:1.本基金本期实现收益收入扣除应付赎回款后的余额为本期实现收益加上本期公允价值变动收益； 2.所列财务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),计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。 3.3.1 本基金本期份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较	本基金本期份额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① 净值增长率差②	业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④	①-③ ②-④	
过去三个月	-4.13% 1.26%	-3.83% -0.26%	-0.32% 0.00%	
注:1.本基金本期份额净值增长率=基金本期已实现收益收入扣除应付赎回款后的余额/期末基金资产净值； 2.截至报告期末,本基金的各投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。	注:1.本基金本期份额净值增长率=基金本期已实现收益收入扣除应付赎回款后的余额/期末基金资产净值； 2.截至报告期末,本基金的各投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。			
3.4 管理人报告	3.4.1 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较			
注:1.本基金合同于2011年9月21日生效。 2.截至报告期末,本基金的各投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。	注:1.本基金合同于2011年9月21日生效。 2.截至报告期末,本基金的各投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。			
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			
崔俊杰	本基金基金经理	2013年3月16日	-	崔俊杰先生,国籍中国,金融工程专业管理学硕士,5年证券基金从业经验。现任职于鹏华基金管理有限公司,所任产品规划部产品设计岗,量化投资部量化研究员。2013年7月起兼任鹏华深证300ETF基金经理,2013年7月起兼任鹏华深证300ETF基金经理,其联系电话:0755-83501750,电子邮箱:cuijj@phsfund.com。
基金管理人:鹏华基金管理有限公司	基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司	报告送出日期:2014年1月21日		
§1 重要提示				
基金管理人的董事会及其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。				
基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1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。				
基金管理人承诺在本报告期内不从事内幕交易、不公平交易及其他法律、行政法规禁止的行为。				
基金经理的过往业绩并不代表其未来表现，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。				
本报告期中财务数据未经审计。				
报告期自2013年10月1日起至12月31日止。				
§2 基金产品概况				
基金简称	鹏华深证民营ETF联接			
交易代码	160618			
基金运作方式	契约型基金,本基金合同生效三年(含三年)为基金分级运作,非涨停的开放日接受申购赎回,非涨停封闭运作并在深交所上市交易,基金分级运作到期后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。			
基金合同生效日	2011年12月8日			
报告期末基金份额总额	1,430,585,506.74份			
投资目标	本基金投资目标主要采取信用策略,同时辅之以久期策略,收益曲线策略,信用利差策略,息差策略,选择优质债券等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过严明的信用分析和对信用利差的把握,力争超越业绩基准。			
投资策略	本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,混合基金,高于货币市场基金。			
业绩比较基准	中债国债指数收益率			
风险收益特征	本基金在交易所行情系统净值提示中披露其他信息披露场合下,上市交易并封闭运作的基金份额可简称为“深证民营”。			
基金管理人	鹏华基金管理有限公司			
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司			
下属两级基金的基金简称	丰泽A 丰泽B			
下属两级基金的交易代码	160619 150061			
报告期末下属两级基金的份额总额	530,493,210.38份			
单位:人民币元	900,092,296.36			
注:1.本基金在交易所行情系统净值提示中披露其他信息披露场合下,上市交易并封闭运作的基金份额可简称为“丰泽B”。	注:1.本基金在交易所行情系统净值提示中披露其他信息披露场合下,上市交易并封闭运作的基金份额可简称为“丰泽B”。			
3.3 主要财务指标和基金净值表现	3.3.1 主要财务指标			
单位:人民币元				
主要财务指标	报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)			
1.本期已实现收益	42,147,939.70			
2.本期利润	-33,917,052.69			
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0183			
4.期末基金资产净值	1,609,408,648.12			
5.期末基金份额净值	1.125			
注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上期间公允价值变动收益,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。 2.所列财务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),计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。 3.2.1 本基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较	注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上期间公允价值变动收益,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。 2.所列财务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),计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。			
阶段	净值增长率① 净值增长率差②	业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④	①-③ ②-④	
过去三个月	-1.43% 0.13%	-2.37% 0.14%	0.92% -0.01%	
注:业绩比较基准=中债国债指数收益率。	注:业绩比较基准=中债国债指数收益率。			
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	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			

鹏华纯债债券型证券投资基金

2013第四季度报告

2013年12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1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及基金经理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和准确性承担个别及连带责任。

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1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。

基金管理人承诺在本报告期内不从事内幕交易、不公平交易及其他法律、行政法规禁止的行为。

基金经理的过往业绩并不代表其未来表现，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。

本报告期中财务数据未经审计。

报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
交易代码	200015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月3日
报告期末基金份额总额	879,858,137.31份

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,任职日期为基金经理就职日。

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。

3.2 管理人对报告期内本基金运作总体评价

报告期内,本基金秉承严格的风险控制原则,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。

本基金在运作过程中严格按照法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定,坚持谨慎稳健的投资风格,实现了较高的风险调整后收益。

本基金在运作过程中严格按照法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定,坚持