

# 鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 25 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 21 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华丰泰定期开放债券
场内简称	-
基金主代码	000289
交易代码	000289
基金运作方式	<p>契约型，本基金采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。</p> <p>本基金自基金合同生效之日（含）起或自每一开放期结束之日次日（含）起一年的期间封闭运作，不办理申购与赎回业务，也不上市交易。</p> <p>本基金自封闭期结束之后第一个工作日（含）起进入开放期，每个开放期原则上不少于五个工作日、不超过二十个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。</p>
基金合同生效日	2013 年 9 月 24 日
报告期末基金份额总额	2,573,008,635.79 份
投资目标	在有效控制风险的基础上，通过每年定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金债券投资将主要采取久期策略，同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略，

	在有效控制风险的基础上，通过每年定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。	
业绩比较基准	一年期定期存款税后利率+0.5%	
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏华丰泰 A	鹏华丰泰 B
下属分级基金的交易代码	000289	001950
报告期末下属分级基金的份额总额	2,568,173,105.94 份	4,835,529.85 份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上

### § 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（2016年7月1日—2016年9月30日）	
	鹏华丰泰 A	鹏华丰泰 B
1. 本期已实现收益	43,959,727.21	77,491.85
2. 本期利润	86,011,249.03	156,000.10
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0335	0.0323
4. 期末基金资产净值	2,799,419,512.03	5,222,314.68
5. 期末基金份额净值	1.0900	1.0800

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

鹏华丰泰 A

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	3.16%	0.08%	0.50%	0.00%	2.66%	0.08%

鹏华丰泰 B

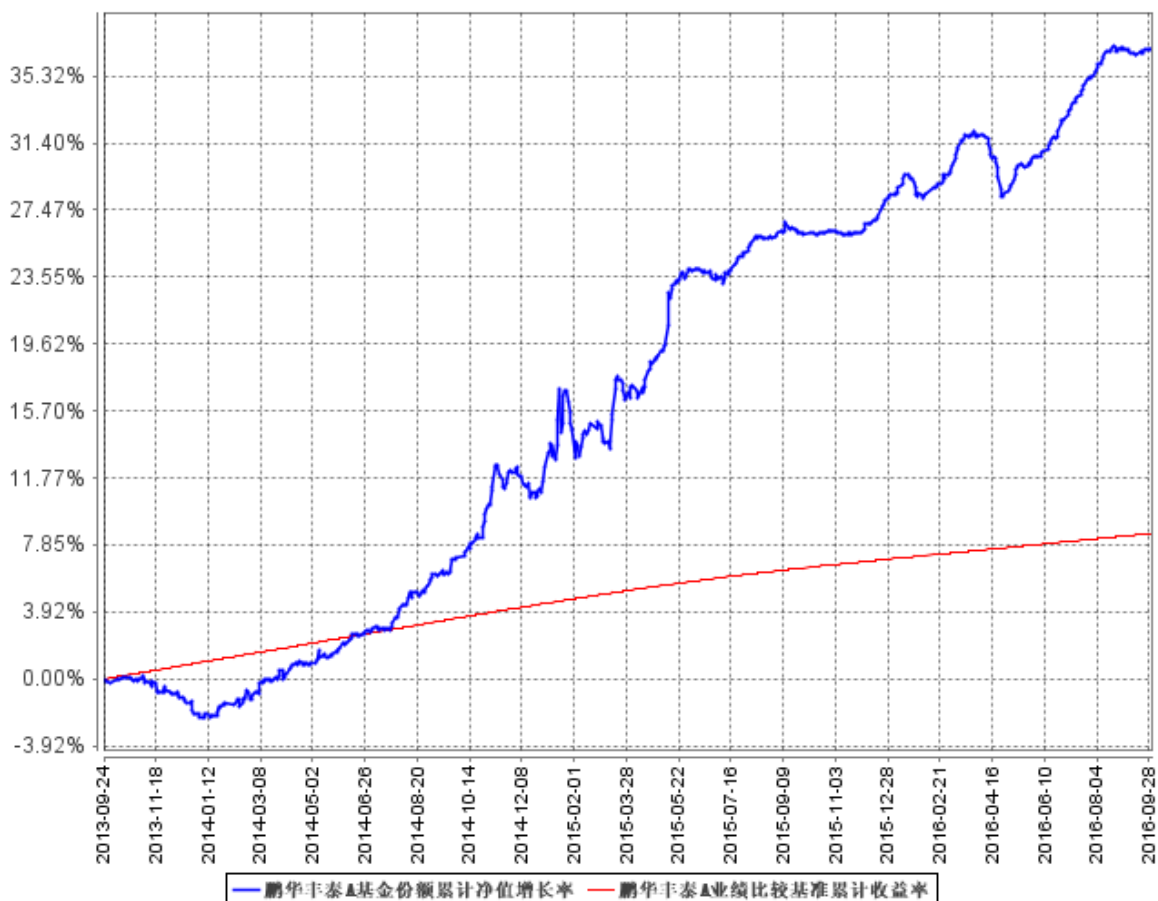
阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	①—③	②—④

	率①	标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去三个月	3.08%	0.08%	0.50%	0.00%	2.58%	0.08%

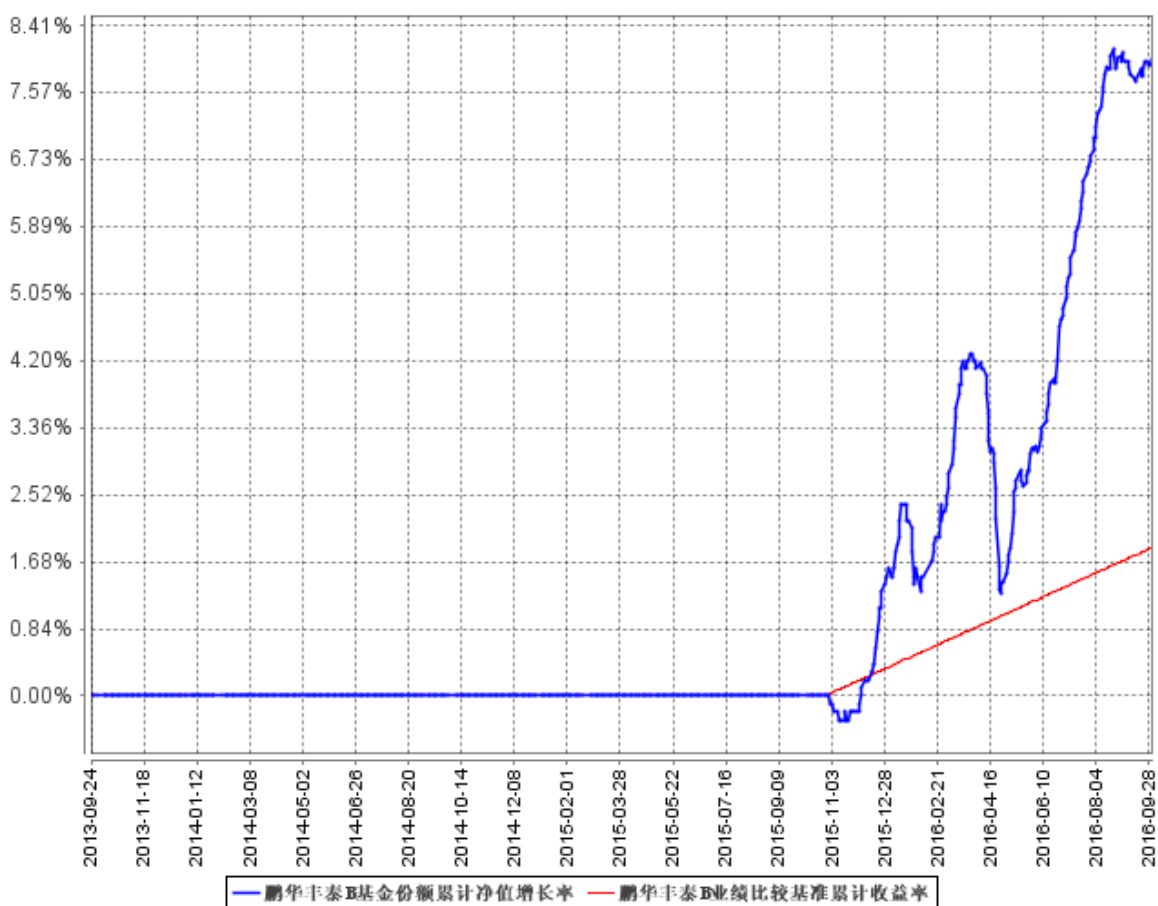
注：业绩比较基准=一年期定存款税后利率+0.5%

### 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

鹏华丰泰A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华丰泰B基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2013 年 9 月 24 日生效，2015 年 10 月 28 日鹏华丰泰 B 类份额成立。  
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。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 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		
戴钢	本基金基金经理	2013 年 9 月 24 日	-	14	戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，14 年证券从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部，担任研究员；2005 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任债券研究员、专户投资经理等职；2011 年 12 月至 2016 年 2 月担任鹏

					<p>华丰泽债券（LOF）基金基金经理，2012 年 6 月起担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2012 年 11 月起兼任鹏华中小企业纯债债券（2015 年 11 月已转型为鹏华丰和债券（LOF）基金）基金基金经理，2013 年 9 月起兼任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理，2013 年 9 月起兼任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理，2013 年 10 月起兼任鹏华丰信分级债券基金基金经理，2016 年 3 月起兼任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理，2016 年 4 月起兼任鹏华金鼎保本混合基金基金经理，2016 年 8 月起兼任鹏华丰饶定期开放债券基金基金经理，现同时担任绝对收益投资部副总经理。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p>
--	--	--	--	--	---

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，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，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 2 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度债券市场整体涨幅明显，中债总财富指数涨幅 1.92%。虽然 7 月份的宏观经济数据明显低于预期，但其中更多是由于天气因素的扰动。随着扰动因素的消除，8 月和 9 月的宏观数据都显示目前的经济整体较为平稳，因此央行保持了中性的货币政策。由于外汇占款的持续流出，三季度资金面的波动也更为明显。但是资金面的波动并没有使得债券市场出现明显压力，反而在机构配置需求的作用下，长端利率还出现了明显的下行。

在组合的资产配置上，我们对债券资产仍然维持了以中期高评级信用债为主的投资策略，并维持了较高的杠杆水平。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2016 年三季度丰泰 A 基金的净值增长率为 3.16%，丰泰 B 基金的净值增长率为 3.08%，同期业绩基准增长率为 0.50%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,149,800,785.72	91.64
	其中：债券	5,149,800,785.72	91.64
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	278,429,605.62	4.95

8	其他资产	191,277,902.29	3.40
9	合计	5,619,508,293.63	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

## 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

注：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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,342,921,434.02	154.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	805,588,000.00	28.72
7	可转债（可交换债）	1,291,351.70	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,149,800,785.72	183.62

## 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	136042	15 渝信 02	2,000,000	209,000,000.00	7.45
2	112277	15 金街 03	2,000,000	207,880,000.00	7.41
3	101551101	15 深能源 MTN001	2,000,000	206,900,000.00	7.38
4	136062	15 大连港	2,000,000	205,800,000.00	7.34
5	136022	15 东吴债	1,500,000	156,060,000.00	5.56



## 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

注：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

注：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

注：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

注：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

15 东吴债发行主体东吴证券于 2015 年 1 月 23 日、2015 年 7 月 29 日收到上海证监局分别下发了沪证监决字【2015】17 号、沪证监决字【2015】57 号《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》（以下简称“东吴基金”），指出东吴基金存在内部控制执行不严，人员权限管理有待加强、人员行为管理存在疏漏、投资权限管理内控不健全等问题，并责令其进行整改。在收到上述《决定》之后，东吴基金召开专题会议，按照要求，逐条对照，制定并落实具体的、可行的改进措施和方案，进行全面改进和提高。主要整改措施如下：切实完善内部控制及人员管理，强化制度执行机制；全面落实各项整改计划，强化检查力度与频度；从系统风险控制和制度执行机制等多方面着手开展运营管理的规范化建设。针对上述问题，东吴基金分别于 2015 年 2 月 26 日、2015 年 8 月 5 日向中国证监会上海监管局报送了《东吴基金管理有限公司关于责令改正情况的报告》。

2015 年 7 月 29 日，上海证监局下发了沪证监决字【2015】53 号《关于对上海新东吴优胜资产管理有限责任公司采取责令改正措施的决定》（以下简称“新东吴优胜”），指出新东吴优胜在业务开展中存在销售适当性管理不充分、关联方相关制度不健全等问题。在收到上述《决定》之后，

对照《决定》要求，全面落实整改要求；进一步完善销售适当性管理，确保销售适当性管理符合监管规定并得到有效执行；严格对关联交易的管理，不断提高管理水平。新东吴优胜于 2015 年 8 月 4 日向上海证监局报送了《上海新东吴优胜资产管理有限公司关于公司销售适当性管理、关联交易存在问题的整改报告》。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响，对该公司债券的投资价值不产生重大影响。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。

### 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	138,471.33
2	应收证券清算款	100,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	91,139,430.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	191,277,902.29

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：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

项目	鹏华丰泰 A	鹏华丰泰 B
报告期期初基金份额总额	2,568,173,105.94	4,835,529.85

报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	2,568,173,105.94	4,835,529.85

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

#### 7.1.1 基金管理人持有 A 基金份额变动情况

注:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

#### 7.1.2 基金管理人持有 B 基金份额变动情况

注:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金管理人本报告期末申购、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)《鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金 2016 年第 3 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 43 层鹏华基金管理有限公司

上海市中山东一路 12 号上海浦东发展银行股份有限公司

### 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  
2016 年 10 月 25 日