

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：中信银行股份有限公司
送出日期：2016年3月30日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事董事签署同意，并由董事长签发。

基金管理人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月25日核对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及其摘要。

本年度报告摘要须自年度报告正文发布之日起，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

1.1

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华丰实定期开放债券
场内简称	-
基金主代码	000296
基金运作方式	定期开放式基金
基金合同生效日	2013年10月1日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
报告期末基金资产总额	914,324,264.08份
基金合同终止日	不适用
下属分级基金的名称	鹏华丰实定期开放债券A
下属分级基金的交易代码	000296
报告期末基金资产的总额	495,758,662.98份

2.2 基金产品说明

投资目标 在有效控制风险的基础上，通过定期开放的模式保持适度流动，力求获得超越基金基准比例的收益。

本基金将投资于主要采取久期策略，通过以债券类资产配置策略、收益率曲线策略、利率策略、信用策略、套利策略和资产配置策略，在有效控制风险的基础上，通过定期开放的模式保持适度流动，力求取得超越基金基准比例的收益。

管理基准 0.5%+同期银行定期存款利率

风险收益特征 本基金属于债券型基金，其风险收益特征与货币市场基金、低于货币市场基金，为证券投资基金中风险较低的品种。

鹏华丰实定期开放债券A 鹏华丰实定期开放债券B

风险特征上 风险收益特征上

2.3 基金管理人和基金托管人

名称 鹏华基金管理有限公司 中信银行股份有限公司

住所 方圆

信息披露负责人 赖军 010-65500300

电子邮箱 dengxiaoqiang@phsfund.com fax@phsfund.com

客户服务电话 4006780999

传真 0755-26201236 010-65200024

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址 http://www.phsfund.com

深圳市民福田区福华三路168号深国投广场中心裙楼鹏华基金管理有限公司

基金年度报告备置地点 公司

北京市东城区建国门内大街9号北京万通大厦中信银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1.1 期间数据 2015年 2014年 2013年10月1日至2013年12月31日

报告期初基金资产总额 27,229,280.25 14,166,603.09 21,199,009.09

期末基金资产总额 26,066,026.64 32,516,024.23 34,207,408.21

报告期损益 -2,160,253.61 -2,790,276.08 -2,979,357.04

净值利润率 -0.042 -0.046 -0.041

本期利润 0.0069 0.1043 0.0882

0.0182 0.0103 -0.0376 -0.0390

利润总额 11.04% 10.65% 10.65% -3.00% -3.00%

1.1.2 期末数据 2015年末 2014年末 2013年末

报告期初基金份额总额 0.0389 0.0381 0.0406

期末基金份额总额 694,313,000.38 164,630,676.08 175,086,240.04

报告期基金净值增长率 26.01% 0.27% 7.17% 0.01% 18.30% 0.03%

注：(1)本期已实现收益指本基金本期利息收入、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，本期利润为期间实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2)所涉基金业绩指标不包括持有人认购本基金的费用(例如：开放式基金的申购费用、赎回费用、基金转换费用等)，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(3)表中的“期”均指报告期最后一日，即12月31日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4)本基金基金合同于2013年9月10日生效，至2013年12月31日未满一年，故2013年的数据和指标为非完整年度的数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华丰实定期开放债券A

3.3 期间数据和指标

3.3.1 期间数据和指标 份额净值增长率 算术平均数基准收益率 算术平均数基准收益率

① ② ③ ④

⑤ ⑥ ⑦ ⑧

⑨ ⑩ ⑪ ⑫

⑬ ⑭ ⑮ ⑯

⑰ ⑱ ⑲ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳ ⑳ ⑳ ⑳

⑳