

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：2016年3月30日

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。本年度报告经三分之二以上独立董事签字确认。

基金管理人根据《中国建设银行股份有限公司开放式基金合同》，于2016年3月26日复核了本报告的财务指标、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未来表现。投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本基金年度报告摘要能简要地反映正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）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1月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金的基本情况

基金简称 鹏华盛世创新混合

场内简称 鹏华创新

基金主代码 160613

交易代码 160613

基金的运作方式 上市开放式基金（LOF）

基金合同生效日 2008年10月10日

基金管理人 中国建设银行股份有限公司

基金报告期基金总资产 59,757,302,07

基金报告期基金总负债 不定期

基金总资产/负债的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2008-11-10

2.2 基金产品说明

精挑具有竞争力且比较优势和持续盈利能力的自上而下精选个股，通过行业配置和仓位控制，在板块轮动的背景下，为持有人创造长期稳定的回报。

本基金的资产配置分为两个层次，第一次是“自上而下的”资产配置，第二层次是“自下而上的”股票配置，即在资产配置的基础上，通过行业配置和仓位控制，把握行业景气度和盈利能力的主线，主动管理资产的配置比例，通过积极的股票选择，为基金的持有人带来长期稳定的资金增值。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%

风险收益特征 本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票基金，为证券投资基金中的中等风险品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 鹏华基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司

姓名 张文 田青

信息披露义务人 联系电话 0755-82625720 010-67095006

电子邮箱 zhangwe@phfund.com tianq@cboc.com

客户服务电话 4006789999 010-67095006

传真 0755-8221126 010-66275963

2.4 信息披露方式

基金年度报告公告的管理人互联网网址 http://www.phfund.com

基金年度报告披露地点 深圳市深南大道7010号中国建设银行大厦公司2楼

基金年度报告备查目录 第二期基金定期报告

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

3.1.1 年度数据图标示

2015年 2014年 2013年

本期已实现收益 96,071,100.40 40,271,494.00 86,075,562.00

本期利润 57,603,161.64 160,020,015.25 58,100,774.02

加权平均基金份额本期利润 0.0927 0.3116 0.1827

本期份额净值增长率 44.90% 30.01% 147.71%

2015年末 2014年末 2013年末

利润可分配基金份额利润 0.0921 0.3002 0.2094

期末基金资产净值 119,042,039.06 212,009,806.46 333,402,279.04

期末基金份额净值 1.902 1.617 1.365

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)扣除必要的费用后的余额，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)所述本基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用(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将有所下降。(3)本基金的“期间”均指报告期内每一日，即1月31日，无论该日是否为开放日或交易日的交易区间。

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 业绩比较基 准收益率差额(%) ①-③ ②-④

过去三个月 27.28% 18.95% 12.08% 14.30% 0.60%

过去六个月 -4.14% 3.03% -10.94% 2.01% 6.80% 1.02%

过去一年 44.90% 26.26% 7.71% 18.0% 37.28% 0.76%

过去五年 116.22% 18.0% 42.88% 1.34% 73.33% 0.46%

过去六年 58.26% 15.8% 23.2% 1.20% 39.94% 0.28%

自基金合同生 效起至今 164.68% 15.8% 81.77% 1.30% 62.81% 0.28%

注：本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

注：(1)本基金合同规定的业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用(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将有所下降。(2)本基金的“期间”均指报告期内每一日，即1月31日，无论该日是否为开放日或交易日的交易区间。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位：人民币元

姓名 附注号 2015年12月31日 2014年12月31日

资产 5,956,964.64 12,905,406.78

银行存款 106,020.90 43,794.92

结算备付金 57,728,489 75,999.67

库存现金 109,724,854.09 200,658,046.47

应收股利 109,724,854.09 200,219,046.47

应收利息 741,907.00 149,565.07

应收申购款 76,705.71

应付股利 2,271.40 4,394.12

应付利息 4,605,406.78

应付申购款 101,907,705.26 1,772,379.09

应付管理人报酬 143,230.61 270,203.15

应付托管费 23,872.62 46,533.86

应付交易服务费 129,742.09 326,340.42

应付交 易费用 129,742.09 326,340.42

应付税 费 129,742.09 326,340.42

应付利 息 129,742.09 326,340.42

应付 手续费 129,742.09 326,340.42

应付 佣金 129,742.09 326,340.42

应付 会议 费用 129,742.09 326,340.42

应付 交易 费用 129,742.09 326,340.42

应付 申购 费 129,742.09 326,340.42

应付 交易 费 129,742.09 326,340.42

应付 申购 费 129,742.09 326,340.4