

鹏华纯债债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016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
送出日期:2017年3月30日

§1 重要提示
基金管理人承诺,基金管理人承诺不从事虚假记载、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法律责任。本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2017年3月27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。
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更新。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,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2016年1月1日至12月31日止。

2.1 基金基本情况
§2 基金简介

基金名称	鹏华纯债债券
场内简称	
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

基金名称	鹏华纯债债券
基金代码	200015
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	175,984,392.89份
基金合同生效日期	不定期
基金销售机构	深圳证券交易所
上市日期	-

(鹏华基金管理有限公司公平交易管理制度),将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的投资、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动纳入公平交易管理,在业务规则和制度层面,制定公平交易的内部控制制度和控制流程,建立公平交易的执行、监督及审核流程,严禁不同投资组合间的不当利益输送。在投资研究环节,1、公司使用同一研究团队发布研究报告和投资建议,确保各投资组合在获得投资建议、研究支持、投资建议和最终投资决策方面享有公平的机会;2、公司严格按照《股票库管理制度》(信用专项投资管理制度),执行股票及信用资产出入库及日常维护工作,确保相关证券库内资产严谨、观点明确的研究报告作为依据;3、在公司股票库基础上,各涉及及股票库资产组合根据各自的资产目标、投资风格、投资组合和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库,基金经理在股票库基础上进行资产配置,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;2、针对交易所公开竞价交易,集中交易室严格按照恒生交易系统集中的公平交易程序,交易系统则自动启用公平交易功能,由系统按照“要素数量”的比例对不同资产组合进行要素的公平分配;如果相关基金经理坚持不以同样的价格进行交易,且当前市场价格不能同时满足多个交易组合的指令价格要求时,交易系统自动按照“时间优先”原则进行执行,由市场竞价价格时确定各个资产组合的指令价格要求时,则交易系统自动按照“同一指令价格的公平交易”模式,进行公平分配交易量分配;3、银行间市场交易,交易所大宗交易等集中竞价交易需依据公司(股票投资交易流程)和(固定收益投资管理流程)的规定执行;银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前确立确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和(非公开定向增发流程)的规定执行,对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节,1、为加强对日常交易行为的监控和管理,杜绝利益输送,不公平交易等违规交易行为,防范日常交易违规,公司明确了关注交易的界定及对应的监控和评估措施,所监控的交易包括但不限于:交易所公开竞价交易不同时间向交易的交易时机和交易价差,不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券收益率曲线偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等;2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和投资考核评价的重要加分项,发现异常交易行为及时进行分析;3、监察稽核部门分别于每季度和每年度编制《公平交易执行情况报告》,内容包括关注交易监控执行情况,不同投资组合的整体收益差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

3.2 公平交易制度的执行
报告期内,本基金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、分配等各个环节得到公平对待。同时,根据《证券投资基金公平交易管理制度》的要求,公司对所管理组合的不同时间段的同向交易进行了价差专项测试,未发现在违反公平交易原则的现象。

3.3 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资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不同投资组合在交易前确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和(非公开定向增发流程)的规定执行,对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节,1、为加强对日常交易行为的监控和管理,杜绝利益输送,不公平交易等违规交易行为,防范日常交易违规,公司明确了关注交易的界定及对应的监控和评估措施,所监控的交易包括但不限于:交易所公开竞价交易不同时间向交易的交易时机和交易价差,不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券收益率曲线偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等;2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和投资考核评价的重要加分项,发现异常交易行为及时进行分析;3、监察稽核部门分别于每季度和每年度编制《公平交易执行情况报告》,内容包括关注交易监控执行情况,不同投资组合的整体收益差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

7.2 利润表
会计主体:鹏华纯债债券型证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日
单位:人民币元

项目	附注	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		-4,950,035.67	51,455,100.34
1.利息收入		16,748,755.47	26,557,689.59
其中:存款利息收入		327,243.45	568,475.66
债券利息收入		16,282,042.20	25,632,798.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		139,465.82	356,415.68
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-9,232,071.94	67,259,799.54
其中:股权投资收益		-	13,089,226.55
基金投资收益		-9,232,071.94	54,170,571.11
资产支持证券投资损益		-	-
公允价值变动损益		-	-
汇兑损益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)		-15,043,877.29	-42,868,520.51
4.汇兑收益(损失以“-”填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)		577,158.09	150,142.31
二、费用		6,162,153.71	7,320,354.61
1.管理费		748,211	2,355,037.41
2.托管费		74,822	785,013.35
3.销售服务费		74,822	785,013.35
4.交易费用		8,255.50	372,187.16
5.利息支出		2,589,248.15	2,691,552.78
其中:卖出回购金融资产支出		2,589,248.15	2,691,552.78
6.其他费用		414,600.07	412,186.99
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-11,112,188.88	44,138,743.43
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-11,112,188.88	44,138,743.43

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:鹏华纯债债券型证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日
单位:人民币元

项目	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	473,160,771.41	33,705,871.74
二、本期综合收益总额	-297,176,378.52	-4,549,324.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
四、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
五、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
六、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
七、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
八、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
九、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
十、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
十一、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
十二、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
十三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
十四、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
十五、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
十六、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
十七、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
十八、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
十九、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
二十、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
二十一、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
二十二、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
二十三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
二十四、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,324.79
二十五、本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期申购-赎回)	-297,176,378.52	-4,549,