

鹏华纯债债券型证券投资基金 2016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

基金管理人的董事会、董事声明本基金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本基金，但不保证基金一定盈利。

本基金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 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华纯债债券
场内简称	-
基金主代码	206015
前分红交易代码	-
后分红交易代码	-
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
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
报告期基金份额总额	175,984,392.89份
基金净值披露频率	不定期
基金销售机构的证券交易场所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险的基础上,通过严格的利息差分析和对利率曲线的分析,精选具有较高票息和收益水平,分散投资期限和品种,以获取超额收益。
投资策略	本基金将综合运用久期策略,同时利用利率走势,收益率曲线策略,收益平价策略,息差策略,波段操作策略,资产配置策略等分析和评估不同投资品种的性价比,并根据宏观经济形势,资金面状况,利率变化趋势,以及对市场利率的预期,选择买入或卖出,从而在不同投资品种之间进行资产配置。
业绩比较基准	中债总指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期收益风险低于股票型基金且具有较高的稳定收益特征。

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
信息披露负责人	张文	田青
联系电话	0755-8225720	010-67956096
电子邮箱	zhangw@phfund.com.cn	tianqing@cbcb.com
客户服务电话	4006788999	010-67956096
传真	0755-82021126	010-66275883

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金年度报告置地地点	深圳市福田区福华三路 168 号深国投商业中心 43 层 鹏华基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要统计数据和财务指标		
	金额单位：人民币元	
3.1.1 期间数据和指标	2016年 2015年 2014年	
本期已实现收益	3,931,688.41	67,007,276.94
本期利润	-11,112,188.88	44,138,748.43
加权平均基金份额利润	-0.0289	0.0104
本期基金份额净值增长率为	-3.46%	13.78%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末 2015年末 2014年末	
本期可供分配利润	0.0164	0.0057
期末基金资产价值	173,954,957.88	506,866,643.15
期末基金份额净值	0.984	1.071
货币资金余额	1,130	

(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) 所述业绩基准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),计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

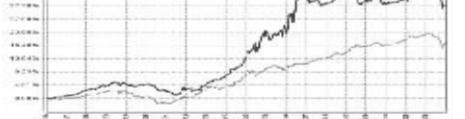
3.2.1 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1. 本基金合同于2012年9月3日生效。

2. 截至本基金定期结算,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。

3.2.2 自基金合同生效以来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



注:1. 本基金合同于2012年9月3日生效。

2. 截至本基金定期结算,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。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注:1. 本基金合同于2012年9月3日生效。

2. 截至本基金定期结算,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。

3.2.4 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10份基金份额现金分派金额	现金形式发放日	再投资形式发放日	备注
2016	0.5100	18,615,456.97	2,318,336.01	20,933,792.98
2015	20,030.00	54,127,804.49	6,736,454.50	
2014	0.3300	5,209,309.00	16,835,698.62	22,045,078.62
合计	28,700	77,952,570.46	11,762,684.04	109,715,253.0

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理的情况

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日,业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末,公司股东由中信集团有限公司、意大利利欧盛资本管理有限公司(Euronext Capital SGR S.p.A.)、深圳市北信源投资发展有限公司组成,公司性质为中外合资公司。公司注册资本人民币8,000万元人民币,其中后20年1月增加资本金人民币5,000万元,增至15,000万元人民币。截至本报告期末,公司管理12只基金和10只全国社保组合,经过18年投资管理基金,在基金投资、风险管理等方面积累了丰富经验。

4.2 基金经理的管理简况

4.2.1 基金经理的基本情况

4.2.2 基金经理的管理情况

4.2.3 基金经理薪酬情况

4.2.4 基金经理的从业情况

4.2.5 基金经理的诚信记录

4.2.6 基金经理薪酬情况

4.2.7 基金经理的其他情况

4.3 其他指标

4.4 报告期内本基金运作情况的说明

报告期内,本基金严格按照《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《鹏华纯债债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在合法合规的前提下,本基金积极履行受托责任,严格控制风险,努力追求基金资产的长期稳定增值。

4.5 公平交易制度和公平交易情况

4.5.1 公平交易制度的执行情况

4.5.2 公平交易制度执行情况的说明

4.5.3 公平交易制度执行效果的评价

4.5.4 公平交易制度执行结果的揭示

4.6 报告期内本基金的估值政策和程序

4.7 报告期内本基金的托管费计提情况

4.8 报告期内基金管理人对本基金持有的份额或基金资产净值调整情形的说明

4.9 报告期内基金管理人对本基金持有的份额或基金资产净值调整的情形

4.10 基金管理人对本基金的估值政策和程序

4.11 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.12 基金管理人对本基金的估值政策和程序

4.13 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.14 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.15 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.16 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.17 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.18 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.19 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.20 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.21 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.22 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.23 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.24 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.25 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.26 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.27 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.28 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.29 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.30 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.31 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.32 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.33 基金管理人对本基金的托管费计提情况

4.34 基金管理人对本基金的托管费计提情况