

鹏华丰融定期开放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：交通银行股份有限公司

送出日期：2017年3月30日

§ 1重要提示

基金管理人的董事会、监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性、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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月27日复核了本报表中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等，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。

本年度报告摘要自年度报告正文、投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

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日起至2月31日止。

§ 2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	鹏华丰融定期开放债券
场内简称	-
基金主代码	000345
前端交易代码	-
后端交易代码	-

基金运作方式

契约型，开放式，定期开放式，摊余成本法估值，发起式基金。

本基金在封闭期内之后第一个工作日（含）起进入开放期，每个开放期期限为10个工作日，期间可申购和赎回，但不能进行转换交易。开放期结束后，基金恢复为定期开放式，开放期的具体时间由基金管理人公告为准，如发生不可抗力或其它特殊情况导致基金无法按时开放或依据基金合同约定暂停申购赎回时，基金管理人有权根据实际情况调整申购或赎回业务办理时间或暂停申购或赎回。

基金合同生效日

2013年11月19日

基金管理人

鹏华基金管理有限公司

基金托管人

交通银行股份有限公司

报告期末基金份额总额

97,701,591.39份

基金合同存续期

不定期

基金管理人的证券交易所

-

上市日期

-

22基金产品说明

投资目标 在有风险限制的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动，为客户提供超短期收益。

投资策略 本基金将主要采用久期策略，同时通过以收益曲线策略、骑乘策略、差价策略、债券选择策略等积极投资策略，在有效控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的稳定收益，力求取得超越基金净值增长基准的收益。

业绩比较基准 一年定期存款利率+0.05%

风险收益特征 本基金属于债券基金。其预期的收益率风险低于股票型基金，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。

23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 交通银行股份有限公司

姓名 张勇 陆正伟

信息披露负责人 联系电话 0755-82825270 95559

电子邮件 zhangj@phfund.com.cn lulz@bankcomm.com

客户服务电话 4006788999 95559

传真 0755-82021126 021-62701216

24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

基金年度报告备置地点 深圳市福田区福中三路100号深圳国际商会中心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主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标

2016年 2015年 2014年

本期利润 8,233,714.74 13,507,533.35 20,495,812.30

加权平均基金份额利润 0.0327 0.0973 0.1104

期末基金份额总额 292% 293% 105.56%

3.1.2期末数据和指标

2016年末 2015年末 2014年末

期末可供分配基金份额利润 0.0651 0.1257 0.0355

期末基金资产净值 113,822,697.44 115,772,920.53 166,234,794.52

期末基金份额净值 1.65 1.13 1.03

注：①本公司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。

③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将低于所列数字。

④表中的“期末”均指报告期最后一日，即2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 | 份额净值 | 份额净值 | 业绩比较基准 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④

过去三个月 -152% 0.13% 0.50% 0.01% -202% 0.12%

过去六个月 0.69% 0.11% 1.01% 0.01% -0.32% 0.10%

过去一年 2.92% 0.09% 2.01% 0.01% 0.91% 0.08%

过去三年 24.44% 0.12% 8.09% 0.01% 16.35% 0.11%

自基金合同生效日起至今 23.94% 0.12% 8.51% 0.01% 154% 0.11%

注：业绩比较基准=一年定期存款利率+0.05%

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

2016年 债券市场经历了三年半下跌、3季度上涨、4季度大跌，波动幅度极大，全年中债总财富指数上涨130%，其中，年中在英镑贬值、资金宽松的背景下，债市出现阶段性行情，二季度初因流动性影响，债市出现阶段性上涨，年底受资金紧张与金融监管政策加强影响出现阶段性大幅下跌。

在债券市场的配置上，本基金以中期高等级信用债为主，在债市大幅下跌的过程中表现较为稳健，此外，在年中本基金阶段性增加了长期利率债持仓，提升了组合久期，从而在收益率下行获得了较好的回报。

4.42报告期内基金的表决权表现

2016年基金的净值增长率为292%，同期业绩基准增长率为20%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年经济增速有望保持稳定，年内可能呈现高开低走的走势。当前中国经济消费和出口的贡献相对稳定，波动也较小。投资是目前影响经济波动的主要因素。由于房地产政策密集出台，内生投资需求偏弱，经济下行压力有所增加。在此情况下，积极财政政策可持续发力，但狭义财政空间相对有限，专项建设基金和PPP项目未来成为维持经济增长的重要手段，但总体上，可能无法完全对冲地产周期下行带来的压力，预计经济总体上半年平稳，下半年趋于好转和下行。

债券方面，预计仍将呈现大幅度的震荡市。一方面，在当前货币政策政策调整和外部因素的影响下，收益率将有所下行，以及下半年可能出现经济走弱，年内仍有希望对债市形成支撑作用。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力及相关工作经历的描述

(1)日常估值流程

基金的估值由基金管理负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账，独立核算，保证不同基金之间名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录方面相互独立，基金会计独立于公司其他会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及财务处理；每日按时接收交易数据及权益数据，进行基金估值；基金会计采用估值模型对公司与托管银行共同独立核算，相互校对的方式，每日就其会计的基金估值、基金净值值与托管银行进行核对；每日估值结果须与托管行核对一致后才能对外公开。基金会计除设有专门的基金核算核算外，还有基金会计复核岗，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计会计算和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握丰富的知识和经验，熟悉了解基金估值法规、政策和方法。

(2)特别估值制度

根据中国证监会公告[2003]8号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理参与并结合小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同审定估值价格。

3.本公司按估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.4本公司没有进行任何衍生品交易的签约。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1.截至目前可供分配利润为6,810,605元，期末基金份额净值1.65元。

2.基金利润公告未进行利润分配。

3.本公司相关法律条文及基金合同的有关规定，基金管理人将综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

3.3其他指标

无。

3.4过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

3.4.1管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

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。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Euron Capital SGRSpA)、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资公司。本公司原注册资本8000万元人民币，已于2009年9月底完成股权转让，增至5000万元人民币。截止本报告期末，公司管理资产规模约1200亿元人民币。

4.2基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司于2004年1月1日经中国证监会批准，正式从事基金的募集、管理、销售、研究、投资、估值、会计、清算、核算、估值、信息披露、客户服务等业务。

4.3基金管理人及旗下基金的从业资质

鹏华基金管理有限公司已取得基金业协会颁发的私募基金管理人登记证，成为私募基金管理人。

4.4基金管理人及旗下基金的诚信情况

鹏华基金管理有限公司不存在违反《基金法》和中国证监会及其他部门颁布的规章、规范性文件及自律规则，受到相关部门处罚的情况。

4.5基金管理人及旗下基金的合规经营情况

鹏华基金管理有限公司不存在违反《基金法》和中国证监会及其他部门颁布的规章、规范性文件及自律规则，受到相关部门处罚的情况。

4.6基金管理人及旗下基金的公平交易情况

鹏华基金管理有限公司不存在违反《基金法》和中国证监会及其他部门颁布的规章、规范性文件及自律规则，受到相关部门处罚的情况。

4.7基金管理人及旗下基金的内部控制情况

鹏华基金管理有限公司不存在违反《基金法》和中国证监会及其他部门颁布的规章、规范性文件及自律规则，受到相关部门处罚的情况。

4.8基金管理人及旗下基金的公平对待客户情况

鹏华基金管理有限公司不存在违反《基金法》和中国证监会及其他部门颁布的规章、规范性文件及自律规则，受到相关部门处罚的情况。

4.9基金管理人及旗下基金的关联交易情况

鹏华基金管理有限公司不存在违反《基金法》和中国证监会及其他部门颁布的规章、规范性文件及自律规则，受到相关部门处罚的情况。

4.10基金管理人及旗下基金的监察稽核情况

鹏华基金管理有限公司不存在违反《基金法》和中国证监会及其他部门颁布的规章、规范性文件及自律规则，受到相关部门处罚的情况。

4.11基金管理人及旗下基金的信息披露情况

鹏华基金管理有限公司不存在违反《基金法》和中国证监会及其他部门颁布的规章、规范性文件及自律规则，受到相关部门处罚的情况。

4.12基金管理人及旗下基金的内部控制制度

鹏华基金管理有限公司不存在违反《基金法》和中国证监会及其他部门颁布的规章、规范性文件及自律规则，受到相关部门处罚的情况。

4.13基金管理人及旗下基金的公平交易制度

鹏华基金管理有限公司不存在违反《基金法》和中国证监会及其他部门颁布的规章、规范性文件及自律规则，受到相关部门处罚的情况。

4.14基金管理人及旗下基金的异常交易行为