

鹏华双债增利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：上海银行股份有限公司

送出日期：2017年 3月 30日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事声明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。

基金托管人上海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、利率分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以忠实信用、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。

本年度报告摘要自得年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

鹏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 12月 31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华双债增利债券
场内简称	-
基金主代码	000504
交易代码	000504
基金份额代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月13日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	411,826,208.28
基金份额净值	1.00
基金总资产的货币市场基金	-
上一日净值	-

2.2 基金产品说明

投资目标 在合理的风险预期下，保持适当流动性，以信用和可转债为主要投资品种，力争在基金资产中获得稳定的回报率。

大额存单 本基金将运用信用分析的手段，在对宏观经济进行充分分析的前提下，通过大额存单投资，提高资金的收益率，降低投资风险。

3.交易费用 本基金将根据基金经理的判断，发现基金管理人专业研究团队的研究能力、定期报告和定期报告中所列示的公司对本基金的评价，以及新老股东的评价，新股东或非公开定向增发股东依据公司《新股申购协议》，《固定收益投资管理规程》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发行过程进行严格监控。在交易监控、分析与评估环节，加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝违规操作，不平盘交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注交易的界定及对应的监控和评估机制，所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日向交易的交易对手和交易差价，不同投资组合进行委托交易的公平分配；如果相关基金经理选择以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统将自动按照“同价优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统将自动按照“价优优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统将自动按照“同价优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统将自动按照“价优优先”原则进行委托。

4.费用 交易费用包括但不限于：申购费、赎回费、银行间同业拆借交易对手交易费、2.2将公开交易作为投资组合业绩归因和分析及评价精度的主要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3.1监察核对部分别于每季度和年度编写《公平交易执行情况报告》，内包括关注交易盈亏情况，不同投资组合的整体收益差异分析和同向交易差价分析；《公平交易执行情况报告》需经公司基金经理批准后向公司监察稽核部报送。

5.业绩比较基准 三季报公开披露的折算后：1.15%；

风险收益特征 基金净值增长率与业绩基准的差额在-1.00%至1.00%之间波动。

6.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 上海银行股份有限公司
信息披露义务人 陈春雷 陈春雷
联系电话 0755-8232720 031-86479888
电子邮箱 zhongguo@phsfund.com www@phsfund.com
客户服务电话 4008-888888 95594
传真 0755-8221126 021-66476036

2.4 信息披露方式

基金年度报告通常于每年的4月30日前披露于基金管理人网站

http://www.phfund.com

基金年度报告备置地 深圳市福田区福华一路168号深国投广场43层鹏华基金管理有限公司

§ 3 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.11 利润数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,419,765.72	47,152,188.38	45,359,028.69
本期利润	15,795,607.21	51,647,194.44	103,570,618.01
加权平均基金份额本期利润	0.04847	0.1366	0.1918
期末基金资产净值	448.90	105.51	138.95
2016年 1月 1日至 2016年 12月 31日	2016年	2015年	2014年
当年利润	0.04848	0.1965	0.0807
期末基金份额净值	524,908,221.95	320,466,213.03	724,108,121.64
期末总资产净值	524,908,221.95	320,466,213.03	724,108,121.64
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)所涉基金业绩指标不包括持有人认购交易基金的各项目的费用(例如：开放式基金的申购赎回费、货币基金转换费等)，扣认费用后实际收益水平将低于所列数字。			
(3)表中的“期初”均指报告期最后一日，即 12月 31日，无论该日是否为开放日。			
3.2.2 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变动的比较			

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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-②	②-④
过去一个月	-0.42%	0.00%	10.75%	0.02%	-1.48%	0.05%
过去一季度	1.75%	0.00%	2.14%	0.01%	-0.44%	0.05%
过去一年	4.48%	0.10%	4.26%	0.01%	0.22%	0.09%
过去三年	9.54%	0.20%	14.89%	0.02%	-5.35%	0.08%
自基金合同生效日起至今	27.46%	0.19%	29.48%	0.02%	7.98%	0.17%

注：(1)本基金于 2013年 3月 13日生效。

2.截至建仓期结束，本基金的各项操作比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 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

3.2.4 基金净值表现

3.2.5 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.6 基金净值表现

3.2.7 基金净值表现

3.2.8 基金净值表现

3.2.9 基金净值表现

3.2.10 基金净值表现

3.2.11 基金净值表现

3.2.12 基金净值表现

3.2.13 基金净值表现

3.2.14 基金净值表现

3.2.15 基金净值表现

3.2.16 基金净值表现

3.2.17 基金净值表现

3.2.18 基金净值表现

3.2.19 基金净值表现

3.2.20 基金净值表现

3.2.21 基金净值表现

3.2.22 基金净值表现

3.2.23 基金净值表现

3.2.24 基金净值表现

3.2.25 基金净值表现

3.2.26 基金净值表现

3.2.27 基金净值表现

3.2.28 基金净值表现

3.2.29 基金净值表现

3.2.30 基金净值表现

3.2.31 基金净值表现

3.2.32 基金净值表现

3.2.33 基金净值表现

3.2.34 基金净值表现

3.2.35 基金净值表现

3.2.36 基金净值表现

3.2.37 基金净值表现

3.2.38 基金净值表现

3.2.39 基金净值表现

3.2.40 基金净值表现

3.2.41 基金净值表现

3.2.42 基金净值表现

3.2.43 基金净值表现

3.2.44 基金净值表现

3.2.45 基金净值表现

3.2.46 基金净值表现

3.2.47 基金净值表现

3.2.48 基金净值表现

3.2.49 基金净值表现

3.2.50 基金净值表现

3.2.51 基金净值表现

3.2.52 基金净值表现

3.2.53 基金净值表现

3.2.54 基金净值表现

3.2.55 基金净值表现

3.2.56 基金净值表现

3.2.57 基金净值表现

3.2.58 基金净值表现

3.2.59 基金净值表现

3.2.60 基金净值表现

3.2.61 基金净值表现

3.2.62 基金净值表现

3.2.63 基金净值表现

3.2.64 基金净值表现

3.2.65 基金净值表现

3.2.66 基金净值表现

3.2.67 基金净值表现

3.2.68 基金净值表现

3.2.69 基金净值表现

3.2.70 基金净值表现

3.2.71 基金净值表现

3.2.72 基金净值表现

3.2.73 基金净值表现