

# 鹏华动力增长混合型证券投资基金 (LOF) 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华动力增长混合(LOF)
场内简称	鹏华动力
基金主代码	160610
交易代码	160610
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年1月9日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,762,332,719.21份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年3月9日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	精选具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票，进行积极主动的投资管理，在有效控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	(1) 股票投资：本基金股票投资采取“自上而下”和“自下而上”相结合的主动投资管理策略，策略分为战略性资产配置、动态资产配置和个股选择等三个层次，重点投资具备高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票。 (2) 债券投资：本基金债券投资的主要目的是规避股票投资部分的系统性风险，在投资过程中综合运用久期、收益率曲线、流动性、相对价值挖掘、套利等策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型(偏股型)基金，其预期风险和收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金中的偏债型基金，低于股票型基金，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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	林葛
	联系电话	0755-82825720	010-66060069
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006788999	95599
传真		0755-82021126	010-68121816

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com">http://www.phfund.com</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 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
本期已实现收益	-10,142,904.15	1,956,055,328.55	420,316,100.44
本期利润	-233,737,951.51	1,691,438,870.21	326,093,029.58
加权平均基金份额本期利润	-0.1088	0.7153	0.0774
本期基金份额净值增长率	-9.46%	31.50%	8.61%
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	-0.0125	0.4896	0.0736
期末基金资产净值	1,740,353,958.53	2,531,197,282.94	3,955,680,050.62
期末基金份额净值	0.988	1.490	1.186

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要低于所列数字。

（3）表中的“期末”均指报告期最后一日，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

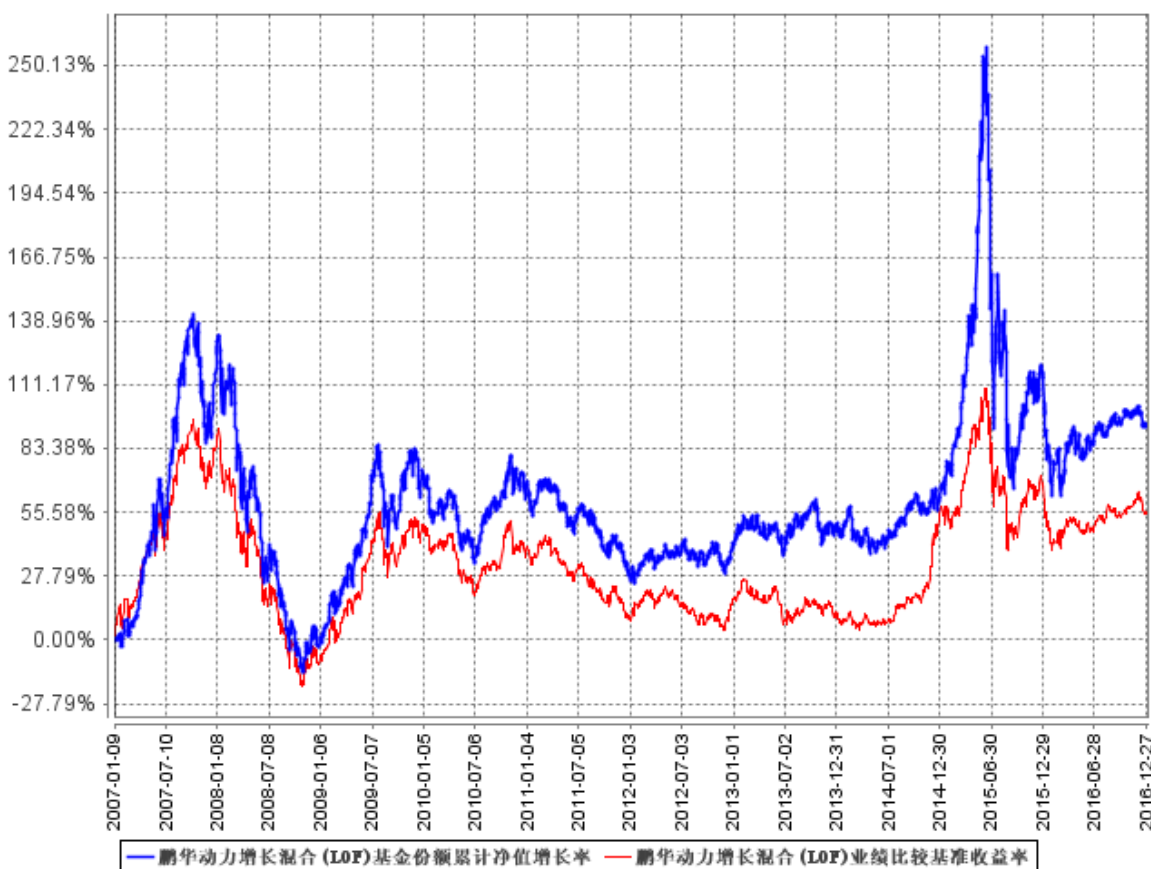
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.20%	0.59%	0.82%	0.51%	-1.02%	0.08%
过去六个月	2.28%	0.63%	3.68%	0.54%	-1.40%	0.09%
过去一年	-9.46%	1.46%	-6.98%	0.98%	-2.48%	0.48%
过去三年	29.32%	1.93%	38.82%	1.25%	-9.50%	0.68%
过去五年	48.96%	1.63%	40.73%	1.14%	8.23%	0.49%
自基金合同生效起至今	93.89%	1.74%	55.55%	1.33%	38.34%	0.41%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

#### 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变动的比较

鹏华动力增长混合(LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

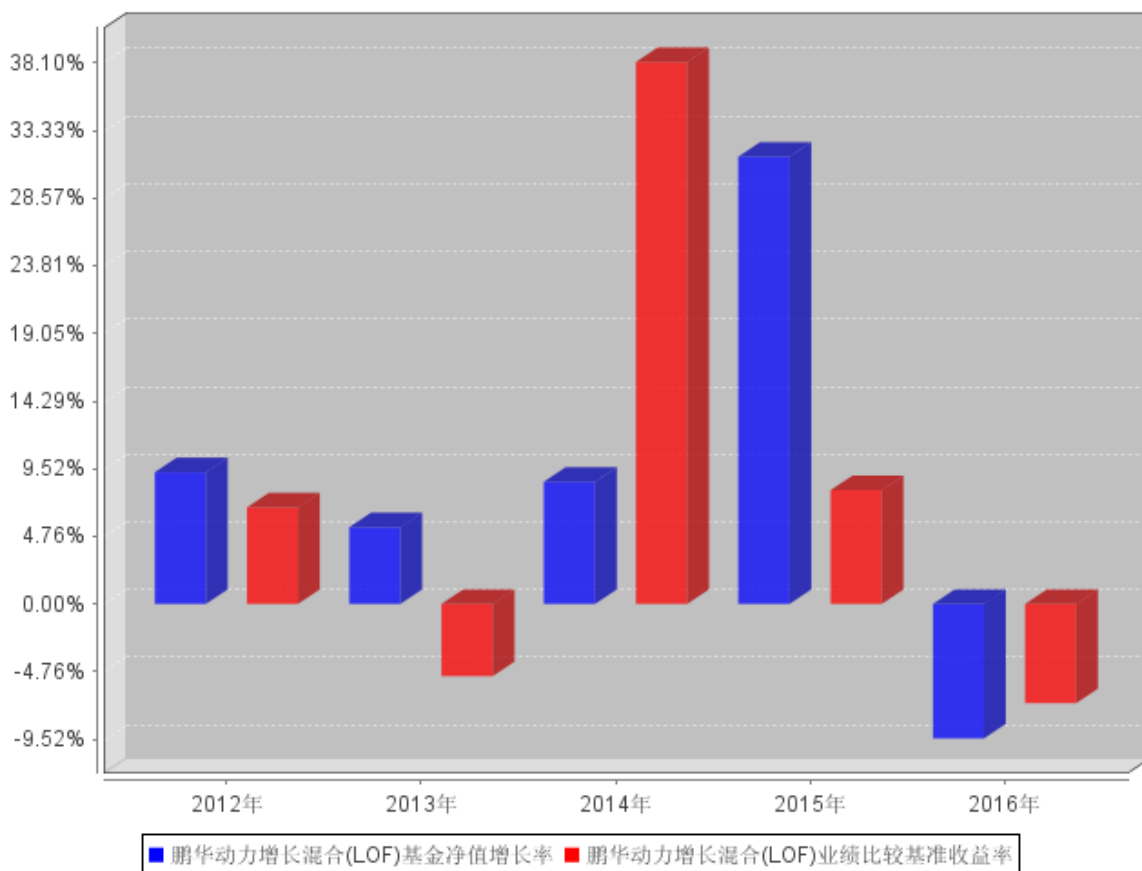


注：1、本基金合同于 2007 年 1 月 9 日生效。

2、截至本基金建仓期结束，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 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

鹏华动力增长混合(LOF)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对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	3.450	363,026,636.26	266,700,365.88	629,727,002.14	
2015	0.550	85,487,509.10	91,437,800.36	176,925,309.46	
2014	-	-	-	-	
合计	4.000	448,514,145.36	358,138,166.24	806,652,311.60	

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、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企业。公司原注册资本8,000万元人民币，后于2001年9月完成增资扩股，增至15,000万元人民币。截止本报告期末，公司管理129只基金和10只全国社保投资组合，经过18年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富的经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁浩	本基金基金经理	2015年7月29日	-	8	梁浩先生，国籍中国，经济学博士，8年证券从业经验。曾任职于信息产业部电信研究院，从事产业政策研究工作；2008年5月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，担任研究部高级研究员、基金经理助理，2014年3月至2015年12月兼任鹏华环保产业股票基金基金经理，2014年11月至2015年12月兼任鹏华先进制造股票基金基金经理，2011年7月起担任鹏华新兴产业混合基金基金经理，2015年7月起兼任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理，2016年1月起兼任鹏华健康环保混合基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华医药科技股票基金基金经理，现同时担

					任研究部总经理、投资决策委员会成员。梁浩先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘郑川江担任本基金基金经理。
郑川江	本基金基金经理	2016年6月24日	-	7	郑川江先生，国籍中国，经济学硕士，7年金融证券从业经验。历任鹏华基金管理有限公司研究员，长城证券研究所研究员、所长助理；2015年2月加盟鹏华基金管理有限公司，任职于研究部，从事行业研究工作，2015年6月起担任鹏华环保产业股票基金基金经理，2016年1月起兼任鹏华健康环保混合基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华动力增长混合(LOF)基金基金经理。郑川江先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘郑川江担任本基金基金经理。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。



## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，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授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围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根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，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，集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持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，交易系统自动按照“价格优先”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，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非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独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、为加强对日常投资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，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价

交易中同日同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、债券交易收益率偏离度、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交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本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、分配等各环节得到公平对待。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

#### 4.3.3 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并对基金财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所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 4 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度因为汇率和债券市场波动，资金面逐渐趋紧并逐步影响到股票市场。在操作上整体比较谨慎，基金仓位维持在相对较低的位置。对于长期景气向上的行业龙头，我们依然维持原有持仓，并适当增加了部分周期股的持仓。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-9.46%，同期上证综指下跌 12.31%，深证成指下跌 19.64%，沪深 300 指数下跌 11.28%。

### 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 年宏观经济仍面临较多困难，财政政策将保持持续宽松，货币政策也将做相应的配合。2017 年防范金融风险的主基调背景下，金融去杠杆行为将持续发酵。传统产业经过多年的去产

能以及 2016 年开始的供给侧改革后，龙头公司的效益出现了明显回收，带动对产业上下游景气复苏。我们对于 2017 年内全年保持谨慎乐观，积极选择具备中长期发展前景的行业和具备竞争力的公司。

#### 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、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，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，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。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帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，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。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

###### (2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，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、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值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商定估值原则和政策。

##### 3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

##### 4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为-21,978,760.68元，期末基金份额净值0.988元，不符合利润分配条件。

2、本基金于2016年1月20日对2015年年度可供分配利润进行分配，分配金额为629,727,002.14元。（详见本报告3.4及7.4.11部分）

#### **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。

## **§5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—鹏华基金管理有限公司2016年1月1日至2016年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## **§6 审计报告**

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。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		770,696,687.41	586,686,269.85
结算备付金		2,929,838.98	2,584,077.25
存出保证金		812,610.58	1,978,798.24
交易性金融资产		971,752,578.86	1,922,376,878.96
其中：股票投资		971,752,578.86	1,922,376,878.96
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	66,076,791.42
应收利息		159,972.29	130,768.17
应收股利		-	-
应收申购款		31,964.84	137,200.62
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,746,383,652.96	2,579,970,784.51
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	39,581,479.64
应付赎回款		983,824.28	3,193,821.58
应付管理人报酬		2,335,286.66	3,232,573.32

应付托管费		389,214.43	538,762.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,760,391.01	1,753,872.41
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		560,978.05	472,992.40
负债合计		6,029,694.43	48,773,501.57
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		1,762,332,719.21	1,699,232,345.61
未分配利润		-21,978,760.68	831,964,937.33
所有者权益合计		1,740,353,958.53	2,531,197,282.94
负债和所有者权益总计		1,746,383,652.96	2,579,970,784.51

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.988 元，基金份额总额

1,762,332,719.21 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）

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	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-186,579,466.63	1,775,836,913.99
1. 利息收入		4,761,224.56	3,627,247.62
其中：存款利息收入		4,601,748.50	3,509,122.70
债券利息收入		-	118,124.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		159,476.06	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,492,665.97	2,035,657,907.24
其中：股票投资收益		22,588,898.29	1,987,754,531.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	30,596,750.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		8,903,767.68	17,306,625.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-223,595,047.36	-264,616,458.34

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		761,690.20	1,168,217.47
<b>减：二、费用</b>		47,158,484.88	84,398,043.78
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	31,482,949.21	54,021,523.80
2. 托管费	7.4.8.2.2	5,247,158.18	9,003,587.29
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		9,914,213.28	20,832,616.63
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		514,164.21	540,316.06
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-233,737,951.51	1,691,438,870.21
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-233,737,951.51	1,691,438,870.21

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）

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	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,699,232,345.61	831,964,937.33	2,531,197,282.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-233,737,951.51	-233,737,951.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	63,100,373.60	9,521,255.64	72,621,629.24
其中：1. 基金申购款	864,395,421.29	-643,173.86	863,752,247.43
2. 基金赎回款	-801,295,047.69	10,164,429.50	-791,130,618.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”	-	-629,727,002.14	-629,727,002.14

”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	1,762,332,719.21	-21,978,760.68	1,740,353,958.53
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,336,609,780.89	619,070,269.73	3,955,680,050.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,691,438,870.21	1,691,438,870.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,637,377,435.28	-1,301,618,893.15	-2,938,996,328.43
其中: 1. 基金申购款	877,961,290.10	472,869,181.04	1,350,830,471.14
2. 基金赎回款	-2,515,338,725.38	-1,774,488,074.19	-4,289,826,799.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-176,925,309.46	-176,925,309.46
五、期末所有者权益(基金净值)	1,699,232,345.61	831,964,937.33	2,531,197,282.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

\_\_\_\_\_  
邓召明

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
高鹏

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
郝文高

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第245号《关于同意鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定。本基金自2006年12月8日至2006年12月28日期间公开发售,首次设立募集不包括认购资金利息共募集11,014,840,003.30元,本基金设立募集期内认购资金产生的利息



收入 7,895,780.24 元, 经德勤华永会计师事务所有限公司德师(上海)报验字(07)第 SZ001 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2007 年 1 月 9 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 11,022,728,857.13 份基金份额, 其中认购资金利息折合 7,888,853.83 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司, 基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2007]第 26 号文审核同意, 本基金 632,516,873.00 份基金份额于 2007 年 3 月 9 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过本基金代销机构赎回或通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后进行上市交易。

根据《证券投资基金法》及相关法律法规以及《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行的各类股票、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。本基金股票的主要投资方向为具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的增长型股票, 本基金对这部分股票的投资比例不低于本基金股票资产的 80%。股票资产占基金资产比例为 30%-95%; 债券资产占基金资产比例为 0%-65%; 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%; 现金或到期日在 1 年期以内政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准原为: 新华富时 600 成长指数收益率 X 70%+中证综合债指数收益率 X 30%。根据本基金的基金管理人 2009 年 5 月 22 日发布的《鹏华基金管理有限公司修改旗下动力增长基金基金合同中“业绩比较基准”定义的公告》, 本基金的业绩比较基准修改为: 沪深 300 指数收益率 X 70%+中证综合债指数收益率 X 30%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策变更等说明、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

#### 7.4.4.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.4.4.2 会计估计变更的说明

无。

### 7.4.5 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关

增值税费用。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

注：无。

###### 7.4.8.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

**7.4.8.1.4 权证交易**

注：无。

**7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无。

**7.4.8.2 关联方报酬****7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	31,482,949.21	54,021,523.80
其中：支付销售机构的客户维护费	6,257,907.01	11,315,795.02

注：（1）支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

（2）根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,247,158.18	9,003,587.29

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费年费率为0.25%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

**7.4.8.2.3 销售服务费**

注：无。

**7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无。

**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金本年度及上年度可比报告期管理人未投资、持有本基金。

**7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资、持有本基金。

**7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国农业银行	770,696,687.41	4,494,818.38	586,686,269.85

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月	2017年1月	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-

		29日	6日							
603689	皖天然气	2016年 12月 30日	2017 年1月 10日	新股流 通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟 汽饰	2016年 12月 27日	2017 年1月 5日	新股流 通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙 股份	2016年 12月 30日	2017 年1月 10日	新股流 通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁 股份	2016年 12月 28日	2017 年1月 5日	新股流 通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002838	道恩 股份	2016年 12月 28日	2017 年1月 6日	新股流 通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正 新材	2016年 12月 26日	2017 年1月 3日	新股流 通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新 交运	2016年 12月 27日	2017 年1月 5日	新股流 通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联 新材	2016年 12月 26日	2017 年1月 4日	新股流 通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里 马	2016年 12月 30日	2017 年1月 10日	新股流 通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱 信息	2016年 12月 27日	2017 年1月 5日	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量(股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
300098	高新兴	2016年 11月 17日	重大事 项	14.02	2017年 1月 23日	14.26	2,088,400	33,238,304.56	29,279,368.00	-

002025	航天电 器	2016年 9月 12日	重大事 项	25.20	-	-	473,000	12,191,954.69	11,919,600.00	-
603986	兆易创 新	2016年 9月 19日	重大事 项	177.97	2017年 3月 13日	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-
300518	盛讯达	2016年 12月 13日	重大事 项	113.46	-	-	1,306	29,019.32	148,178.76	-
300526	中潜股 份	2016年 12月 7日	重大事 项	107.03	-	-	984	10,332.00	105,317.52	-
002798	帝王洁 具	2016年 11月 2日	重大事 项	67.00	2017年 1月 17日	60.34	1,056	11,161.92	70,752.00	-
300537	广信材 料	2016年 10月 12日	重大事 项	48.79	2017年 1月 13日	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	971,752,578.86	55.64
	其中：股票	971,752,578.86	55.64
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	773,626,526.39	44.30
7	其他各项资产	1,004,547.71	0.06
8	合计	1,746,383,652.96	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	601,391,287.59	34.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,784,651.26	3.49
E	建筑业	118,924.74	0.01
F	批发和零售业	185,794.62	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,570,890.40	1.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,909,013.52	3.16
J	金融业	54,586,780.00	3.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,481,120.00	6.64
R	文化、体育和娱乐业	58,724,116.73	3.37
S	综合	-	-



	合计	971,752,578.86	55.84
--	----	----------------	-------

## 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300156	神雾环保	4,661,879	116,593,593.79	6.70
2	000820	神雾节能	4,000,000	115,600,000.00	6.64
3	300244	迪安诊断	3,608,785	115,481,120.00	6.64
4	603686	龙马环卫	2,000,000	66,240,000.00	3.81
5	002343	慈文传媒	1,300,069	58,724,116.73	3.37
6	600016	民生银行	6,000,000	54,480,000.00	3.13
7	600201	生物股份	1,546,004	48,838,266.36	2.81
8	600566	济川药业	1,448,280	45,273,232.80	2.60
9	000423	东阿阿胶	723,800	38,991,106.00	2.24
10	300332	天壕环境	3,302,844	31,046,733.60	1.78

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com> 的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000820	神雾节能	141,322,475.35	5.58
2	300156	神雾环保	105,392,892.87	4.16
3	601988	中国银行	103,100,773.65	4.07
4	002372	伟星新材	95,372,777.93	3.77
5	603686	龙马环卫	95,245,724.32	3.76
6	002616	长青集团	86,329,330.78	3.41
7	600016	民生银行	79,994,782.03	3.16

8	600919	江苏银行	73,837,550.60	2.92
9	000541	佛山照明	72,439,926.83	2.86
10	002508	老板电器	70,739,789.77	2.79
11	300011	鼎汉技术	62,977,493.81	2.49
12	002343	慈文传媒	61,727,321.88	2.44
13	002671	龙泉股份	56,994,007.78	2.25
14	000892	欢瑞世纪	54,163,844.48	2.14
15	600019	宝钢股份	52,476,314.00	2.07
16	000802	北京文化	48,328,431.15	1.91
17	600104	上汽集团	46,752,231.84	1.85
18	000423	东阿阿胶	46,316,747.05	1.83
19	600362	江西铜业	46,310,073.00	1.83
20	002271	东方雨虹	43,418,022.76	1.72

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002508	老板电器	143,255,660.08	5.66
2	000802	北京文化	137,345,020.22	5.43
3	002152	广电运通	120,163,275.96	4.75
4	000709	河钢股份	116,415,259.63	4.60
5	002450	康得新	108,228,756.59	4.28
6	601988	中国银行	104,999,842.50	4.15
7	002372	伟星新材	101,718,216.92	4.02
8	002616	长青集团	97,052,833.53	3.83
9	000820	神雾节能	95,082,567.45	3.76
10	300376	易事特	78,360,383.45	3.10
11	002572	索菲亚	77,908,306.16	3.08
12	002400	省广股份	75,774,686.15	2.99
13	000541	佛山照明	74,869,517.67	2.96
14	600919	江苏银行	74,116,407.00	2.93
15	002343	慈文传媒	70,025,760.89	2.77
16	600138	中青旅	64,562,151.86	2.55
17	300011	鼎汉技术	60,620,277.71	2.39
18	002250	联化科技	60,349,292.25	2.38

19	600872	中炬高新	56,830,754.76	2.25
20	600019	宝钢股份	55,499,340.00	2.19
21	002200	云投生态	55,102,534.60	2.18
22	002671	龙泉股份	53,173,339.72	2.10
23	000892	欢瑞世纪	50,799,153.75	2.01

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,807,052,894.68
卖出股票收入（成交）总额	3,556,671,045.71

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的前十名证券之一的金宇生物技术股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 12 月 3 日公告，2016 年 12 月 1 日，公司收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局（以下简称“内蒙古证监局”）《关于对金宇生物技术股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2016] 7 号，以下简称“《决定书》”）。现将《决定书》主要内容公告如下：

“近期，我局对你公司进行了现场检查，发现你公司存在如下问题：

一、公司会计估计变更未披露。根据财税[2014]75 号文件，2015 年，公司子公司金宇保灵生物药品有限公司本期将 100 万元以下研发用固定资产折旧一次性进费用，子公司扬州优邦生物制药有限公司对生物制药专用设备采用加速折旧，两家子公司固定资产折旧方法与生物股份年报披露的固定资产折旧政策不一致（公司 2015 年年报中披露的固定资产折旧方法为年限平均法），共计影响当期固定资产折旧金额 1,557.39 万元，上述事项应属会计估计变更。公司未对上述会计估计变更事项进行披露，年报中在重要会计政策和会计估计变更中选定为不适用。违反《上市公司信息披露管理办法》第三十条规定。

二、公司财务报表列报不准确。公司 2015 年年报中，将预付技术使用费 1,196 万元和外购用友 ERP 系统费用 268.27 万元在“在建工程”项目进行核算。合并现金流量表时，将销售费用中技术推广费、疫苗补偿费等现金流出 7,375.68 万元计入“购买商品接受劳务支付的现金”。上述行为与《企业会计准则第 30 号—财务报表列报》第九条不符，违反《上市公司信息披露管理办法》第二条规定。

三、内幕信息知情人登记执行不到位。公司没有对分配股利、董事及三分之一以上监事发生变化的情况制作内幕信息知情人档案；2015 年进行非公开发行时未制作重大事项进程备忘录；没有对内幕信息知情人买卖本公司股票进行自查的相关记录，内幕信息知情人登记制度中也没有

规定进行自查的相关条款。违反《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第六条、第十条、第十二条的规定。

针对上述问题，根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的行政监管措施。

你公司应当在收到本决定书之日起 30 日内向我局提交书面整改报告，我局将适时组织检查验收。

如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。”

公司董事会对上述问题高度重视，将按照《决定书》要求在规定时间内提交整改报告，同时进一步规范公司治理，并根据相关规定及时履行信息披露义务。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该股票，从监管措施公告中知悉，相关问题对于公司经营并不构成重大实质性影响。对公司的财务状况及经营成果并不产生重大实质性影响。本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券之慈文传媒股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 12 月 16 日收到中国证券监督管理委员会浙江监管局（本公告中称“浙江证监局”）作出的《关于对慈文传媒股份有限公司采取责令改正措施的决定》（〔2016〕36 号，以下简称“《决定书》”）。现将《决定书》主要内容公告如下：

“你公司合并范围内控股子公司于 2016 年 4 月 20 日就其投资摄制的电视剧与湖南广播电视台卫视频道签订了《电视剧中国大陆独家首轮播映权转让协议》，合同总金额为 2.58 亿元，占你公司上年度经审计总收入的 30.14%，但是你公司未披露该重大经营合同。

你公司的上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第三十条、第三十一条和第三十三条的规定。按照《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，现责令你公司作出如下整改：

一、立即披露公司签订的上述重大经营合同。

二、加强相关法律法规学习，做好信息披露工作。

此外，你公司应及时披露本决定书，并于完成整改后 15 个工作日内向我局提交书面整改报告。

如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。”

公司董事会对《决定书》提出的问题高度重视，将针对上述问题认真进行核查、分析和整改，按照《决定书》要求在规定时间内提交整改报告，并根据相关规定及时履行信息披露义务。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该股票，从监管措施公告中知悉，相关问题对于公司经营并不构成重大实质性影响。对公司的财务状况及经营成果并不产生重大实质性影响。本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

#### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	812,610.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	159,972.29
5	应收申购款	31,964.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,004,547.71

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：无。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：无。

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
95,456	18,462.25	1,723,402.61	0.10%	1,760,609,316.6	99.90%

**9.2 期末上市基金前十名持有人**

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	李珍林	1,000,440.00	1.75%
2	胡文明	720,968.00	1.26%
3	殷丽萍	680,183.00	1.19%
4	山东金岭铁矿	600,168.00	1.05%
5	缪灿衍	570,100.00	1.00%
6	贾晶	498,841.00	0.87%
7	楚喜兰	457,735.00	0.80%
8	杭州雷峰塔文化旅游发展有 限公司	425,190.00	0.74%
9	修桂珍	324,590.00	0.57%
10	李兆稀	291,467.00	0.51%

注：持有人为场内持有人。

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年1月9日）基金份额总额	11,022,728,857.13
本报告期期初基金份额总额	1,699,232,345.61
本报告期基金总申购份额	864,395,421.29
减：本报告期基金总赎回份额	801,295,047.69
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,762,332,719.21

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

### §11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内基金管理人的重大人事变动：

报告期内，因股东方更换董事代表，原董事 Alessandro Varaldo 先生不再担任公司董事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Andrea Vismara 先生担任本公司董事，Alessandro Varaldo 先生不再担任本公司董事职务。Andrea Vismara 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

报告期内，原监事 Andrea Vismara 先生辞去公司监事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Sandro Vesprini 先生担任本公司监事，Andrea Vismara 先生不再担任本公司监事职务。Sandro Vesprini 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

经公司董事会审议通过，公司同意聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。



2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 100,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 10 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	1,235,862,658.97	19.45%	1,126,242.77	19.44%	-
华泰证券	2	917,118,025.50	14.43%	835,769.64	14.42%	本报告期新增 1 个
中金公司	1	803,919,229.69	12.65%	732,612.64	12.64%	-
光大证券	1	703,002,198.81	11.06%	640,648.85	11.06%	-
中信证券	1	553,207,160.29	8.71%	504,136.99	8.70%	-
中银国际	1	479,730,007.73	7.55%	437,179.57	7.55%	-

东兴证券	2	438,103,912.44	6.90%	399,241.59	6.89%	本报告期新增1个
宏源证券	2	407,754,744.17	6.42%	371,587.62	6.41%	-
中信建投	1	343,730,156.72	5.41%	313,241.38	5.41%	本报告期新增
安信证券	1	178,447,831.07	2.81%	166,188.34	2.87%	-
海通证券	1	161,181,095.99	2.54%	146,883.58	2.54%	-
国金证券	1	57,711,926.19	0.91%	52,592.79	0.91%	-
广发证券	1	51,953,493.48	0.82%	47,345.32	0.82%	-
申万宏源	1	22,196,962.60	0.35%	20,227.36	0.35%	-
长江证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
东方证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
国都证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
东北证券	1	-	-	-	-	本报告期新增

注：交易单元选择的标准和程序

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需  
要，并能为本基金提供全面的信息服  
务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期

对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

鹏华基金管理有限公司  
2017年3月30日