

鹏华添利宝货币市场基金 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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 | 鹏华添利宝货币 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 001666 |
| 前端交易代码 | - |
| 后端交易代码 | - |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年7月21日 |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 28,325,772,453.19份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | - |
| 上市日期 | - |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。 |
| 投资策略 | <p>本基金将综合宏观经济运行状况,货币政策、财政政策等政府宏观经济状况及政策,分析资本市场资金供给状况的变动趋势,预测市场利率水平变动趋势。在此基础上,综合考虑各类投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况,进行积极的投资组合管理。</p> <p>1、久期策略 结合宏观经济运行态势及利率预测分析,本基金将动态确定并调整基金组合平均剩余期限。预测利率将进入下降通道时,适当延长投资品种的平均期限;预测市场利率将进入上升通道时,适当缩短投资品种的平均期限。</p> <p>2、类属配置策略 在保证流动性的前提下,根据各类货币市场工具的市场规模、信用等级、流动性、市场供求、票息及付息频率等确定不同类别资产的具体配置比例。</p> <p>3、套利策略 本基金根据对货币市场变动趋势、各市场和品种之间的风险收益差异的充分研究和论证,适当进行跨市场或跨品种套利操作,力争提高资产收益率,具体策略包括跨市场套利和跨期限套利等。</p> <p>4、现金管理策略 本基金作为现金管理工具,具有较高的流动性要求,本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的</p> |

| | |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 动态预测,通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效分配基金的现金流,在保持充分流动性的基础上争取较高收益。 5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 |
| 业绩比较基准 | 活期存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。基于本基金的投资范围和投资比例限制,选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。 |

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 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张戈 | 张建春 |
| | 联系电话 | 0755-82825720 | 010-63639180 |
| | 电子邮箱 | zhangge@phfund.com.cn | zhangjianchun@cebbank.com |
| 客户服务电话 | | 4006788999 | 95595 |
| 传真 | | 0755-82021126 | 010-63639132 |

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 | http://www.phfund.com |
| 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 7 月 21 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|-------------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 482,820,518.26 | 6,384,154.75 |
| 本期利润 | 482,820,518.26 | 6,384,154.75 |
| 本期净值收益率 | 2.9651% | 1.5106% |

| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | 2015 年末 |
|---------------|-------------------|------------------|
| 期末基金资产净值 | 28,325,772,453.19 | 3,306,627,687.25 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

(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；

(4) 基金收益分配按日结转份额；

(5) 本基金基金合同于 2015 年 7 月 21 日生效，至 2015 年 12 月 31 日未满一年，故 2015 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

3.2 基金净值表现

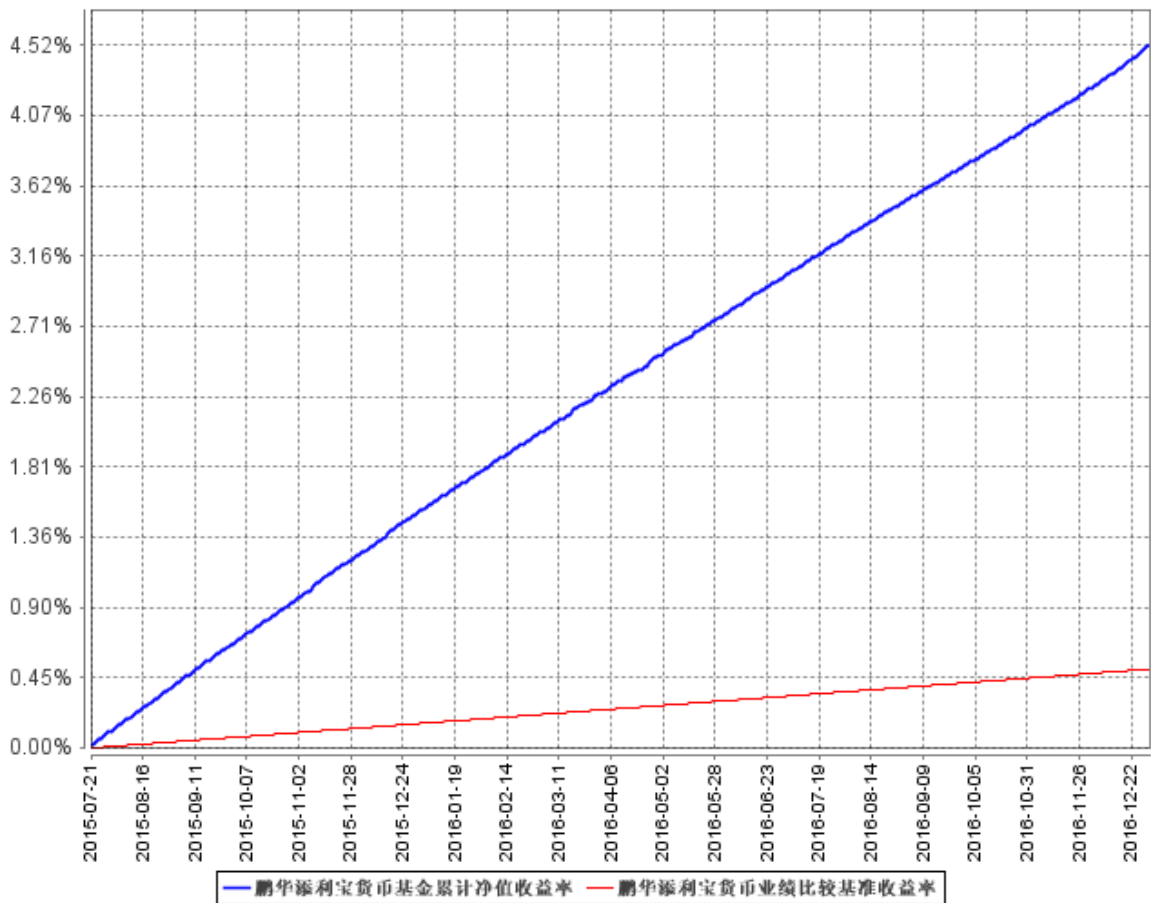
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 | 0.7457% | 0.0010% | 0.0882% | 0.0000% | 0.6575% | 0.0010% |
| 过去六个月 | 1.4554% | 0.0008% | 0.1764% | 0.0000% | 1.2790% | 0.0008% |
| 过去一年 | 2.9651% | 0.0020% | 0.3510% | 0.0000% | 2.6141% | 0.0020% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.5205% | 0.0020% | 0.5082% | 0.0000% | 4.0123% | 0.0020% |

注：业绩比较基准=一年期银行定期存款利率（税后）+3%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华添利宝货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

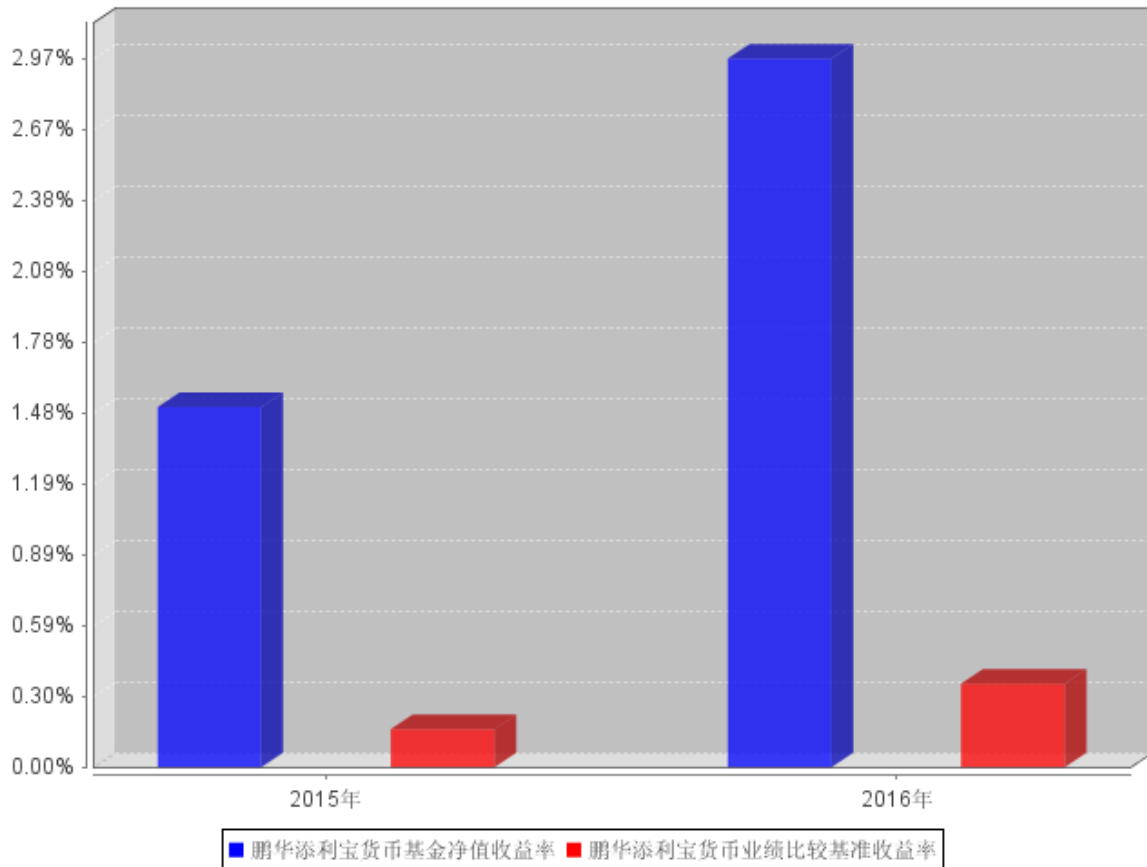


注：1、本基金基金合同于 2015 年 7 月 21 日生效。

2、截至建仓期结束,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 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

鹏华添利宝货币自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、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 | 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 年度利润 分配合计 | 备注 |
|------|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 2016 | 477,442,609.57 | - | 5,377,908.69 | 482,820,518.26 | |
| 2015 | 6,106,843.16 | - | 277,311.59 | 6,384,154.75 | |
| 合计 | 483,549,452.73 | - | 5,655,220.28 | 489,204,673.01 | |

§ 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 | | |
| 叶朝明 | 本基金基金经理 | 2015 年 7 月 21 日 | - | 8 | 叶朝明先生，国籍中国，工商管理硕士，8 年金融证券从业经验。曾任职于招商银行总行，从事本外币资金管理相关工作；2014 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事货币基金管理工作，2014 年 2 月担任鹏华增值宝货币基金基金经理，2015 年 1 月起兼任鹏华安盈宝货币基金基金经理，2015 年 7 月起兼任鹏华添利宝货币基金基金经理，2016 年 1 月起兼任鹏华添利交易型货币基金基金经理。叶朝明先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。 |

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合规守信情况的说明

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

2016 年经济基本面整体偏弱，全年通胀较低但 PPI 在全球大宗商品上涨影响下明显回升，年末再通胀预期有所提升。在强势美元下，汇率层面面临贬值压力，外汇占款持续流出，央行货币

政策因受制于汇率、资产价格等因素总体较为稳健，主要通过 MLF、逆回购投放流动性。8 月后央行逐渐缩短放长，资金面全年前松后紧。银行间 7 天回购利率均值为 2.55%，低于 2015 年 2.92% 的均值水平。

债券市场 2016 年呈现了高波动的特点，呈现了“W”型的震荡走势，收益率曲线全年趋于平坦化上行，其中 1 年期国开债收益率上行 78BP 左右，1 年期 AA+短融收益率则上行 97bp 左右。

2016 年，基于对经济基本面、货币政策及资金面的预判，本基金适时调整组合剩余期限，在类属配置方面降低存单及短融的配置比例，并把握年末资金紧张，短期资产收益大幅提升的时机，在保证组合良好流动性的基础上，提高了组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年本基金的净值增长率为 2.9651%，同期业绩基准增长率为 0.3510%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，我们预计信用增速短期大概率保持较高水平，经济短期保持稳定。但伴随房地产投资逐步回落，财政支持力度有限，未来经济总体可能趋于温和下行。我们预计 2017 年全年 CPI 均值与 2016 年水平基本持平，PPI 较 2016 年有明显改善。债券市场方面总体可能仍然呈现震荡格局。货币政策方面，未来货币政策将注重抑制资产泡沫和防范风险，在国内和国际多方面因素影响下，货币政策将保持稳健中性，边际上可能相对偏紧，资金面波动性有所加剧，未来资金成本总体或有所抬升。

基于以上分析，本组合 2017 年将保持稳健操作，维持合理的剩余期限，合理安排组合的现金流分布，确保组合的安全性和流动性。同时我们将密切关注各类资产价格走势，捕捉市场出现的资产配置机会，在尽力保证组合安全的前提下力争提高组合的收益回报。

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：

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. 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。

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

本基金在本报告期累计分配收益 482,820,518.26 元，利润分配金额、方式等符合相关法规和本基金基金合同的规定。

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

2016 年度，中国光大银行股份有限公司在鹏华添利宝货币市场基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对鹏华添利宝货币市场基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2016 年度，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——鹏华基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基

金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——鹏华基金管理有限公司编制的“鹏华添利宝货币市场基金 2016 年年度报告”进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：鹏华添利宝货币市场基金

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 |
|------------|-----|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 13,514,856,632.53 | 2,651,137,428.93 |
| 结算备付金 | | 9,090,909.09 | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | | 7,343,510,088.08 | 730,697,330.61 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 7,343,510,088.08 | 730,697,330.61 |
| 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 | | 7,200,472,723.70 | 50,000,195.00 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | | 88,614,183.06 | 13,359,745.33 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 177,139,245.22 | 5,199,378.90 |

| | | | |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 28,333,683,781.68 | 3,450,394,078.77 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 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 | | - | 143,299,608.35 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | 500.04 |
| 应付管理人报酬 | | 565,931.83 | 22,277.62 |
| 应付托管费 | | 838,417.54 | 33,003.89 |
| 应付销售服务费 | | 524,011.00 | 20,627.43 |
| 应付交易费用 | | 173,747.84 | 14,720.03 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | 8,342.57 |
| 应付利润 | | 5,655,220.28 | 277,311.59 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 154,000.00 | 90,000.00 |
| 负债合计 | | 7,911,328.49 | 143,766,391.52 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 28,325,772,453.19 | 3,306,627,687.25 |
| 未分配利润 | | - | - |
| 所有者权益合计 | | 28,325,772,453.19 | 3,306,627,687.25 |
| 负债和所有者权益总计 | | 28,333,683,781.68 | 3,450,394,078.77 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 28,325,772,453.19 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华添利宝货币市场基金

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7月21日(基 金合同生效日)至 2015年12月31日 |
|--------|-----|---------------------------------|----------------------------------------------------|
| 一、收入 | | 500,701,650.64 | 6,769,105.98 |
| 1.利息收入 | | 500,058,978.16 | 6,644,074.88 |

| | | | |
|----------------------------|-----------|----------------|--------------|
| 其中：存款利息收入 | | 254,711,252.87 | 5,503,559.06 |
| 债券利息收入 | | 201,772,114.31 | 968,202.20 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 43,575,610.98 | 172,313.62 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 606,072.48 | 125,031.10 |
| 其中：股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 606,072.48 | 125,031.10 |
| 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 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 36,600.00 | - |
| 减：二、费用 | | 17,881,132.38 | 384,951.23 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.8.2.1 | 4,540,586.75 | 50,795.19 |
| 2. 托管费 | 7.4.8.2.2 | 6,726,795.36 | 75,252.04 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.8.2.3 | 4,204,246.96 | 47,032.54 |
| 4. 交易费用 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 2,232,778.29 | 118,371.46 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 2,232,778.29 | 118,371.46 |
| 6. 其他费用 | | 176,725.02 | 93,500.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 482,820,518.26 | 6,384,154.75 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 482,820,518.26 | 6,384,154.75 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华添利宝货币市场基金

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 | 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 | 3,306,627,687.25 | - | 3,306,627,687.25 |

| | | | |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------|--------------------|
| 金净值) | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 482,820,518.26 | 482,820,518.26 |
| 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) | 25,019,144,765.94 | - | 25,019,144,765.94 |
| 其中:1.基金申购款 | 67,290,207,694.15 | - | 67,290,207,694.15 |
| 2.基金赎回款 | -42,271,062,928.21 | - | -42,271,062,928.21 |
| 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) | - | -482,820,518.26 | -482,820,518.26 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 28,325,772,453.19 | - | 28,325,772,453.19 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015年7月21日(基金合同生效日)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) | 236,402,974.82 | - | 236,402,974.82 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 6,384,154.75 | 6,384,154.75 |
| 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) | 3,070,224,712.43 | - | 3,070,224,712.43 |
| 其中:1.基金申购款 | 3,429,343,229.45 | - | 3,429,343,229.45 |
| 2.基金赎回款 | -359,118,517.02 | - | -359,118,517.02 |
| 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) | - | -6,384,154.75 | -6,384,154.75 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 3,306,627,687.25 | - | 3,306,627,687.25 |

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

鹏华添利宝货币市场基金(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”)证监许可[2015]第 1465 号《关于准予鹏华添利宝货币市场基金注册的批复》准予,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《鹏华添利宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 236,388,258.02 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 944 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华添利宝货币市场基金基金合同》于 2015 年 7 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 236,402,974.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,716.80 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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华添利宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规允许投资的金融工具,包括现金,期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于 2017 年 3 月 23 日批准报出。

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》、《鹏华添利宝货币市场基金基金合同》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、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司(“中国光大银行”) | 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7月21日(基金合同生效日) 至2015年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,540,586.75 | 50,795.19 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 27,681.32 | 680.63 |

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 0.27%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.27%÷当年天数。根据《鹏华基金管理有限公司关于鹏华添利宝货币市场基金开展费率优惠活动的公告》，自 2015 年 7 月 22 日起，管理费年费率调整为 0.027%，结束时间以本公司公告为准。

（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7月21日(基金合同生效日) 至2015年12月31日 |
|----------------|---------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,726,795.36 | 75,252.04 |

注：支付基金托管人中国光大银行股份有限公司的托管费年费率为 0.08%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.08%÷当年天数。根据《鹏华基金管理有限公司关于鹏华添利宝货币市场基金开展费率优惠活动的公告》，自 2015 年 7 月 22 日起，托管费年费率调整为 0.04%，结束时间以本公司公告为准。

7.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

| 获得销售服务费 各关联方名称 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | |
|-------------------|-------------------------------------------------------|--|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | |
| 鹏华基金公司 | 4,157,223.82 | |
| 国信证券 | 241.35 | |
| 合计 | 4,157,465.17 | |
| 获得销售服务费 各关联方名称 | 上年度可比期间 2015 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | |
| 鹏华基金公司 | 44,857.95 | |
| 合计 | 44,857.95 | |

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。本基金年基金销售服务费率为 0.25%。其计算公式为：计算日基金销售服务费=计算日前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。根据《鹏华基金管理有限公司关于鹏华添利宝货币市场基金开展费率优惠活动的公告》，自 2015 年 7 月 22 日起，基金销售服务费率调整为 0.025%，结束时间以本公司公告为准。

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

单位：人民币元

| 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | | | | | | |
|----------------------------------------|--------|------|-------|------|----------------|-----------|
| 银行间市场交易 的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国光大银行 | - | - | - | - | 190,000,000.00 | 11,642.95 |

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 | |
|-------|-------------------------|--------------------|--------------------------|--------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 |

| | | 比例 | | 比例 |
|------|------------------|---------|----------------|---------|
| 鹏华资产 | 43,441,725.32 | 0.1534% | - | 0.0000% |
| 国信证券 | 1,000,000,000.00 | 3.5300% | - | - |
| 光大银行 | 0.00 | 0.0000% | 100,901,308.54 | 3.0515% |

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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7月21日(基金合同生效日)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 |
| | 中国光大银行 | 1,941,856,632.53 | 15,554,436.96 | 201,137,428.93 |

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率计息。

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 (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

注：无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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 | 固定收益投资 | 7,343,510,088.08 | 25.92 |
| | 其中:债券 | 7,343,510,088.08 | 25.92 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 7,200,472,723.70 | 25.41 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 13,523,947,541.62 | 47.73 |
| 4 | 其他各项资产 | 265,753,428.28 | 0.94 |
| 5 | 合计 | 28,333,683,781.68 | 100.00 |

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 2.61 | |
| | 其中:买断式回购融资 | - | |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注:本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 51 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 74 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 8 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1 | 30 天以内 | 45.56 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 17.04 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 20.84 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—120 天 | 2.46 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天(含)—397 天(含) | 13.18 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.09 | - |

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|------------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,581,943,697.58 | 5.58 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,581,943,697.58 | 5.58 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 189,989,153.71 | 0.67 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 5,571,577,236.79 | 19.67 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 7,343,510,088.08 | 25.93 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 160209 | 16 国开 09 | 7,500,000 | 749,989,373.51 | 2.65 |
| 2 | 111609442 | 16 浦发 CD442 | 5,000,000 | 498,487,443.27 | 1.76 |
| 2 | 111607229 | 16 招行 CD229 | 5,000,000 | 498,487,443.27 | 1.76 |
| 2 | 111608353 | 16 中信 CD353 | 5,000,000 | 498,487,443.27 | 1.76 |
| 3 | 111610558 | 16 兴业 CD558 | 4,500,000 | 449,619,063.76 | 1.59 |
| 4 | 111607237 | 16 招行 CD237 | 4,000,000 | 398,616,751.80 | 1.41 |
| 5 | 111681773 | 16 嘉兴银行 CD065 | 2,000,000 | 199,757,211.87 | 0.71 |
| 6 | 111698486 | 16 宁波银行 CD211 | 2,000,000 | 199,747,697.43 | 0.71 |
| 7 | 111697007 | 16 宁夏银行 CD041 | 2,000,000 | 198,989,371.66 | 0.70 |
| 8 | 111610670 | 16 兴业 CD670 | 2,000,000 | 197,947,991.06 | 0.70 |
| 9 | 111699347 | 16 河北银行 CD067 | 2,000,000 | 197,897,800.51 | 0.70 |
| 9 | 111699340 | 16 汉口银行 CD124 | 2,000,000 | 197,897,800.51 | 0.70 |
| 10 | 111699417 | 16 重庆银行 CD043 | 2,000,000 | 197,841,908.33 | 0.70 |

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1801% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.1150% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0415% |

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 投资组合报告附注

8.8.1

基金计价方法说明

- (1) 基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；
- (2) 基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；
- (3) 基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，

每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(4) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

(5) 基金持有的资产支持证券视同债券，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况

本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本不存在超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

8.8.2

本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.8.3 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 88,614,183.06 |
| 4 | 应收申购款 | 177,139,245.22 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 265,753,428.28 |

8.8.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、本基金的投资决策流程主要包括：久期决策、期限结构策略、类属配置策略和个券选择策略。其中久期区间决策由投资决策委员会负责制定，基金经理在设定的区间内根据市场情况自行调整；期限结构配置和类属配置决策由固定收益小组讨论确定，由基金经理实施该决策并选择相

应的个券进行投资。

2、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 |
| 86,394 | 327,867.36 | 25,825,514,096.03 | 91.17% | 2,500,258,357.16 | 8.83% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 3,567,718.61 | 0.0126% |

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

9.3 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

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

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（2015年7月21日）基金份额总额 | 236,402,974.82 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,306,627,687.25 |
| 本报告期基金总申购份额 | 67,290,207,694.15 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 42,271,062,928.21 |
| 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 | 28,325,772,453.19 |
|-------------|-------------------|

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

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。

报告期内基金托管人的重大人事变动：无。

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

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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 54,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的年限为 2 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 | |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |

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 |
| 中金公司 | - | - | 27,500,000,000.00 | 100.00% | - | - |

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期没有发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

鹏华基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日