

鹏华普天收益证券投资基金 2016 年年度报告 告

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 重要提示及目录

1.1 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。

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 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	58
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.....	58
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.....	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
8.12 投资组合报告附注.....	59
§9 基金份额持有人信息.....	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
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.....	63
§10 开放式基金份额变动.....	63
§11 重大事件揭示.....	64
11.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
11.4 基金投资策略的改变.....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
11.8 其他重大事件.....	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§13 备查文件目录.....	76
13.1 备查文件目录.....	76
13.2 存放地点.....	76
13.3 查阅方式.....	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华普天收益证券投资基金
基金简称	鹏华普天收益混合
场内简称	鹏华收益
基金主代码	160603
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	2003 年 7 月 12 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	449,618,494.34 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	以分享中国经济成长和资本长期稳健增值为宗旨，主要投资于连续现金分红股票及债券，通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金财产的长期稳定增值。
投资策略	<p>(1) 债券投资方法：本基金债券投资的目的是降低组合总体波动性从而改善组合风险构成。在债券的投资上，采取积极主动的投资策略，不对持续期作限制。持续期、期限结构、类属配置以及个券选择的动态调整都将是获得超额收益的重要来源。</p> <p>(2) 股票投资方法：本基金主要采用积极管理的投资方式。以鹏华股票池中连续两年分红股票以及三年内两年分红记录的公司作为投资对象，适当集中投资。所有重点投资股票必须经过基金经理/研究员的调研，就企业经营、融资计划、分红能力、绝对价值、相对价值给出全面评估报告。</p>
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	本基金属平衡型证券投资基金，为证券投资基金中的中等风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金，高于指数型基金、纯债券基金和国债。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	陆志俊
	联系电话	0755-82825720	95559
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006788999	95559
传真		0755-82021126	021-62701216
注册地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		518048	200120
法定代表人		何如	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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	-48,408,311.85	645,239,322.62	233,722,153.82
本期利润	-56,533,853.49	515,166,062.04	347,092,457.55
加权平均基金份额本期利润	-0.1195	0.6673	0.2030
本期加权平均净值利润率	-9.83%	52.66%	24.21%

本期基金份额净值增长率	-7.41%	42.62%	27.58%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	125,698,050.24	204,299,665.02	-179,601,050.38
期末可供分配基金份额利润	0.2796	0.4087	-0.1287
期末基金资产净值	575,316,544.58	704,117,864.49	1,413,563,256.06
期末基金份额净值	1.280	1.409	1.013
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	617.98%	675.47%	443.74%

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）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。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	3.98%	0.69%	0.82%	0.51%	3.16%	0.18%
过去六个月	6.23%	0.73%	3.68%	0.54%	2.55%	0.19%
过去一年	-7.41%	1.49%	-6.98%	0.98%	-0.43%	0.51%
过去三年	68.46%	1.67%	45.94%	1.24%	22.52%	0.43%
过去五年	83.23%	1.44%	57.53%	1.13%	25.70%	0.31%
自基金合同生效起至今	617.98%	1.41%	194.92%	1.24%	423.06%	0.17%

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

鹏华普天收益混合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

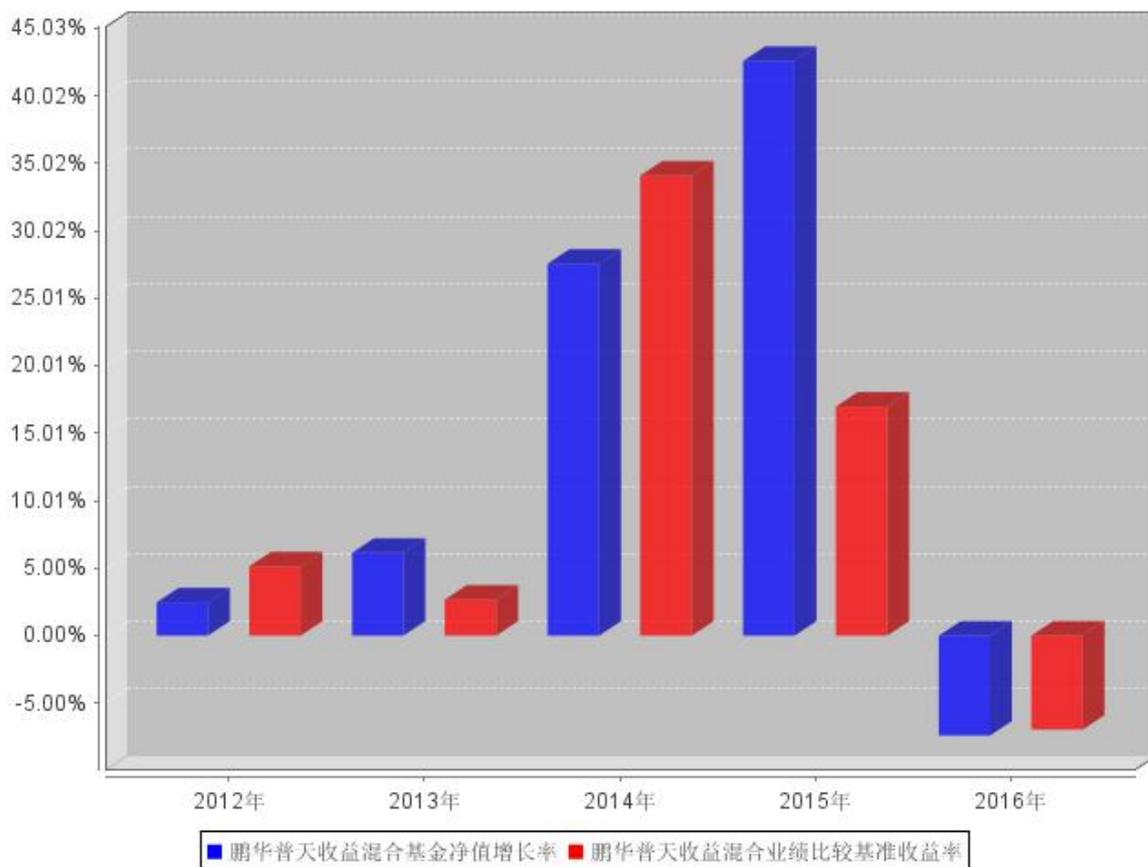


注：1、本基金合同于 2003 年 7 月 12 日生效。

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

鹏华普天收益混合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	0.2300	6,669,564.08	4,068,582.47	10,738,146.55	
2015	0.3200	10,654,176.68	5,962,622.37	16,616,799.05	
2014	-	-	-	-	
合计	0.5500	17,323,740.76	10,031,204.84	27,354,945.60	

§ 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		
张卓	本基金基金经理	2009 年 1 月 17 日	-	12	张卓先生，国籍中国，管理学硕士，12 年证券从业经验。2004 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，历任行业研究员、鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理助理，2007 年 8 月至 2009 年 1 月担任鹏华优质治理股票基金（LOF）基金经理，2011 年 1 月至 2013 年 3 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2009 年 1 月起担任鹏华普天收益基金基金经理，2015 年 5 月起兼任鹏华外延成长混合基金基金经理。张卓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 年总体来说，是“黑天鹅事件”较多，是自 2010 年以来政策波动最大的一年，A 股市场的剧烈波动显著高于历史水平。

新年初始阶段就遭遇股指熔断，市场快速大幅下跌，本基金一季度转为全面防守，降仓并增持了地产、金融类的大市值股票和维生素行业股票，减持了小市值股票。3 月起，A 股市场活跃度逐步和整个市场的风险偏好提升，本基金从 4 月开始提升仓位并增持了中小市值股票，积极发掘投资机会，但政策上证监会对于跨界并购的限制传闻以及规范借壳等政策限制导致中小市值股票

表现较弱，5月人民日报权威人士发言又导致市场剧烈波动。进入10月份，国内经济数据复苏的基础越来越扎实，一线城市房产价格持续飙升，引发宏观政策的转向，从货币政策、地产政策都大幅收紧，债券行业去杠杆引发债市大跌，英国“脱欧”和美国大选特朗普当选等国际事件也不断扰动市场，而中小市值股票受到证监会窗口指导和IPO明显加速都导致小市值股票机会较少，最终导致市场情绪由较为乐观变为全面悲观。本基金在今年的后半阶段，也在应对变化的局面，减持了部分中小市值股票，在4季度研究力度偏向国企改革等角度，但布局力度较小。

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-7.41%，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

我们认为，进入2017年，投资者应该降低收益率预期，同时更加关注风险。首先，大方向上看，2017年流动性偏紧。1、美国总统行政将导致全球资金回流美国。“特朗普新政”下，所主张的大规模减税政策与加大基础设施建设投资将进一步推动美元资本回流美国本土，同时美联储12月已经如期加息，明年上半年预计继续加息，增加国际资本进入美国套利。2、中国从16年10月开始回收流动性。中国16年末M2余额155万亿，较07年多发115万亿，治理影子银行、实体去杠杆已持续数年，15年的股灾、16年债市危机都是金融去杠杆的实例，央行3季度的货币措辞已变为中性略紧。第二，监管政策的严格和IPO的加速发行，将导致A股的壳价值降低和非上市公司出售意愿降低，从而中小市值股票机会难再。第三，17年下半年中国经济不确定性太大，特朗普针对中国的贸易摩擦政策效果难以预计，严控地产的政策在17年下半年可能有所显现。

总体来讲，17年全年股票市场难有较大机会。在复杂不确定局面的存量博弈市场中，没有估值约束的行业有机会，我们看好国企混改、军工。风格上看，大股票优于小股票，小股票的机会来源于过度下跌的机会和稀缺优质标的收购。本基金将加大调研力度和对优质基本面公司的挖掘，为基金持有人创造收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司不断更新完善业务流程和运营风险数据库，通过标准化业务流程将业务操作落实到岗，明

确业务流程与控制活动的关联关系，确定关键控制活动，以及各个业务操作所使用的相关文档或表单，并将业务操作与法律法规的相关法条建立关联，将控制活动与风险建立关联，将法律法规要求与信息披露报备规则建立关联。

2、继续优化内部控制措施

报告期内，公司继续完善内部控制措施，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，通过信息技术手段陆续实现了部分标准化操作流程手册的系统化，并不断优化。

3、持续改进投资监控的方法与手段，保证基金投资业务的合法合规性

报告期内，在投资日常合规监控工作方面，公司根据产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率；在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司加强了内幕交易风险的检查和防范，明确了内幕交易防范要求，多次开展有关内幕交易的培训，进一步强化全体投研人员对内幕交易行为和结果的认识。

4、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作，本报告期内没有出现主动违规行为。

5、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对基金投资管理、市场营销管理、财务费用管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现，提高了公司标准化操作流程手册的执行效力，优化了标准化操作流程手册，更新了风险控制矩阵。报告期内，公司没有发生重大风险事件。

4.7 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。

4.8 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 125,698,050.24 元，期末基金份额净值 1.280 元。

2、本基金于 2016 年 8 月 12 日对 2016 年年度可供分配利润进行分配，分配金额为 10,738,146.55 元。（详见本报告 3.4 及 7.4.11 部分）

4.9 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，基金托管人在鹏华普天收益证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2016 年度，鹏华基金管理有限公司在鹏华普天收益证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利

益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 10,738,146.55 元，符合基金合同的规定。

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

2016 年度，由鹏华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关鹏华普天收益证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21305 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华普天系列开放式证券投资基金下设的普天收益证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的鹏华普天系列开放式证券投资基金之普天收益证券投资基金(以下简称“普天收益基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是普天收益基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

	<p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	<p>我们认为，上述普天收益基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了普天收益基金 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。</p>	
注册会计师的姓名	单峰	陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国 上海市	
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏华普天收益证券投资基金

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	7.4.7.1	6,293,760.37	5,282,852.67
结算备付金		42,737,111.31	70,054,006.24
存出保证金		220,283.99	403,518.84
交易性金融资产	7.4.7.2	517,214,432.66	657,345,702.97
其中：股票投资		397,296,992.62	507,019,702.97
基金投资		-	-
债券投资		119,917,440.04	150,326,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		8,991,089.88	-
应收利息	7.4.7.5	2,024,306.50	2,498,567.31
应收股利		-	-
应收申购款		7,448.92	598,676.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		577,488,433.63	736,183,324.62
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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	28,278,470.51
应付赎回款		453,705.68	1,162,009.22
应付管理人报酬		733,557.31	887,829.78
应付托管费		97,807.62	118,377.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	629,607.48	1,367,899.79
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	257,210.96	250,873.52
负债合计		2,171,889.05	32,065,460.13
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	449,618,494.34	499,818,199.47
未分配利润	7.4.7.10	125,698,050.24	204,299,665.02
所有者权益合计		575,316,544.58	704,117,864.49
负债和所有者权益总计		577,488,433.63	736,183,324.62

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.280 元，基金份额总额 449,618,494.34 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华普天收益证券投资基金

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	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-42,426,202.97	542,424,007.88

1. 利息收入		3,867,472.24	9,371,766.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	507,294.62	795,893.50
债券利息收入		3,360,177.62	8,575,873.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-38,224,992.27	662,895,343.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-40,318,360.69	660,227,349.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-39,620.00	-346,150.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,132,988.42	3,014,144.58
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-8,125,541.64	-130,073,260.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	56,858.70	230,157.93
减：二、费用		14,107,650.52	27,257,945.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,630,526.02	14,724,687.13
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,150,736.73	1,963,291.63
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	4,099,758.74	10,298,625.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	226,629.03	271,341.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-56,533,853.49	515,166,062.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-56,533,853.49	515,166,062.04

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华普天收益证券投资基金

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（基金净值）	499,818,199.47	204,299,665.02	704,117,864.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-56,533,853.49	-56,533,853.49
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）	-50,199,705.13	-11,329,614.74	-61,529,319.87
其中：1. 基金申购款	32,066,614.04	6,511,067.21	38,577,681.25
2. 基金赎回款	-82,266,319.17	-17,840,681.95	-100,107,001.12
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）	-	-10,738,146.55	-10,738,146.55
五、期末所有者权益（基金净值）	449,618,494.34	125,698,050.24	575,316,544.58
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）	1,395,846,616.10	17,716,639.96	1,413,563,256.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	515,166,062.04	515,166,062.04
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）	-896,028,416.63	-311,966,237.93	-1,207,994,654.56
其中：1. 基金申购款	98,202,237.86	35,421,642.37	133,623,880.23
2. 基金赎回款	-994,230,654.49	-347,387,880.30	-1,341,618,534.79
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）	-	-16,616,799.05	-16,616,799.05
五、期末所有者权益（基金净值）	499,818,199.47	204,299,665.02	704,117,864.49

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

鹏华普天系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)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 2003 第 61 号《关于同意鹏华普天系列开放式证券投资基金设立的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 7 月 12 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设两个子基金,分别为普天收益证券投资基金(以下简称“本基金”)和普天债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,140,717,155.06 元,其中包括本基金 343,227,588.04 元和普天债券投资基金 797,489,567.02 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道验字(2003)第 78 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金已按规定将《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》等法定文件报中国证监会备案。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市 的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具;具体投资于连续分红的股票和债券,对连续分红企业的投资不少于股票资产的 80%。在正常市场状况下,股票投资比例一般情况下为 70%,国债投资比例不低于 20%,现金或到期日在一年以内的政府债券投资不低于基金资产的 5%。本基金的业绩比较基准为:中信标普 A 股综合指数涨跌幅 \times 70%+中信标普国债指数涨跌幅 \times 25%+金融同业存款利率 \times 5%。

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》、《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

(4)金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(4.1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(4.2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(4.3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

(5)金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

(6)当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基

金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每份基金份额享有同等分配权；基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分

配；如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金方式，基金份额持有人可选择获取现金红利或将现金红利转为基金份额；若基金份额持有人未明示选择，则视为选择了获取现金红利方式。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 本基金根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	6,293,760.37	5,282,852.67
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	6,293,760.37	5,282,852.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	347,713,763.16	397,296,992.62	49,583,229.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	101,400.00	114,440.04
	银行间市场	120,127,870.00	119,803,000.00
	合计	120,229,270.00	119,917,440.04
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	467,943,033.16	517,214,432.66	49,271,399.50
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	449,909,141.83	507,019,702.97	57,110,561.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	150,039,620.00	286,380.00
	合计	150,039,620.00	286,380.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	599,948,761.83	657,345,702.97	57,396,941.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,454.90	1,251.68
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	14,320.67	18,326.40
应收债券利息	2,008,431.83	2,478,807.63
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	99.10	181.60
合计	2,024,306.50	2,498,567.31

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	629,607.48	1,367,724.79
银行间市场应付交易费用	-	175.00
合计	629,607.48	1,367,899.79

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	210.96	873.52
预提费用	257,000.00	250,000.00
合计	257,210.96	250,873.52

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	499,818,199.47	499,818,199.47
本期申购	32,066,614.04	32,066,614.04
本期赎回（以“-”号填列）	-82,266,319.17	-82,266,319.17
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	449,618,494.34	449,618,494.34

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	267,204,993.41	-62,905,328.39	204,299,665.02
本期利润	-48,408,311.85	-8,125,541.64	-56,533,853.49
本期基金份额交易产生的变动数	-20,643,771.24	9,314,156.50	-11,329,614.74

其中：基金申购款	13,822,331.64	-7,311,264.43	6,511,067.21
基金赎回款	-34,466,102.88	16,625,420.93	-17,840,681.95
本期已分配利润	-10,738,146.55	-	-10,738,146.55
本期末	187,414,763.77	-61,716,713.53	125,698,050.24

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	87,026.49	206,098.18
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	415,369.24	577,903.04
其他	4,898.89	11,892.28
合计	507,294.62	795,893.50

注：“其他”为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,387,678,067.54	3,790,216,671.68
减：卖出股票成本总额	1,427,996,428.23	3,129,989,322.40
买卖股票差价收入	-40,318,360.69	660,227,349.28

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-39,620.00	-346,150.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-39,620.00	-346,150.00

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	154,459,000.00	319,053,835.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	150,039,620.00	306,409,810.00
减：应收利息总额	4,459,000.00	12,990,175.34
买卖债券差价收入	-39,620.00	-346,150.00

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	2,132,988.42	3,014,144.58
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,132,988.42	3,014,144.58

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-8,125,541.64	-130,073,260.58
——股票投资	-7,527,331.68	-130,475,450.58
——债券投资	-598,209.96	402,190.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-8,125,541.64	-130,073,260.58

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	48,729.33	230,157.93
转换费收入	8,129.37	-

合计	56,858.70	230,157.93
----	-----------	------------

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	4,099,008.74	10,297,150.54
银行间市场交易费用	750.00	1,475.00
合计	4,099,758.74	10,298,625.54

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	57,000.00	100,000.00
信息披露费	150,000.00	150,000.00
银行汇划费	1,429.03	3,141.54
其他	200.00	200.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	226,629.03	271,341.54

注：“其他”为数字证书费。

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《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[2016]140号)，要求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，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的

补充通知》(财税[2017]2号), 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注: 无。

7.4.10.1.2 债券交易

注: 无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注: 无。

7.4.10.1.4 权证交易

注: 无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	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	8,630,526.02	14,724,687.13
其中：支付销售机构的客户维护费	2,116,866.99	3,690,394.22

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 1.5%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	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	1,150,736.73	1,963,291.63

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2003 年 7 月 12 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	19,138,751.92	19,138,751.92
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,138,751.92	19,138,751.92
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.2567%	3.8291%

注：本基金管理人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。

7.4.10.4.2 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：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		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
交通银行	6,293,760.37	87,026.49	5,282,852.67	206,098.18

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年 8 月 12 日	2016 年 8 月 12 日	2016 年 8 月 12 日	0.2300	6,669,564.08	4,068,582.47	10,738,146.55	

合计	-	-	0.2300	6,669,564.08	4,068,582.47	10,738,146.55	
----	---	---	--------	--------------	--------------	---------------	--

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
600658	电子城	2016年9月5日	2017年9月1日	非公开发行流通受限	11.01	11.72	1,362,398	15,000,001.98	15,967,304.56	-
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	-
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29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
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	2,597	60,146.52	60,146.52	-
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	-

注：截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券和权证。

7.4.12.2 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
002377	国创高新	2016年7月18日	重大事项	9.78	2017年1月19日	9.25	4,699,894	43,197,601.79	45,964,963.32	-
002159	三特索道	2016年12月29日	重大事项	32.00	2017年1月6日	31.60	20,000	467,600.12	640,000.00	-
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	-
002727	一心堂	2016年12月28日	重大事项	21.20	2017年1月5日	21.66	7,174	43,761.40	152,088.80	-
300518	盛讯达	2016年12月13日	重大事项	113.46	-	-	1,306	29,019.32	148,178.76	-
002795	永和智控	2016年12月2日	重大事项	91.60	2017年3月22日	82.44	1,450	21,532.50	132,820.00	-

600859	王府井	2016年9月27日	重大事项	16.28	-	-	6,500	219,902.45	105,820.00	-
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	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大事项	15.80	-	-	3,900	12,000.00	61,620.00	-
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	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	9.20	-	-	4,400	22,477.92	40,480.00	-
300149	量子高科	2016年12月15日	重大事项	19.42	-	-	1,540	9,195.01	29,906.80	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事项	11.42	-	-	335	3,059.24	3,825.70	-
600161	天坛生物	2016年12月6日	重大事项	39.40	2017年3月24日	43.34	35	1,432.12	1,379.00	-
000887	中鼎股份	2016年11月18日	重大事项	25.94	2017年2月15日	23.99	22	698.13	570.68	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有信用类债券占基金净值比 0.02%（2015 年 12 月 31 日：未持有）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,293,760.37	-	-	-	6,293,760.37
结算备付金	42,737,111.31	-	-	-	42,737,111.31
存出保证金	220,283.99	-	-	-	220,283.99
交易性金融资产	119,803,000.00	-	114,440.04	397,296,992.62	517,214,432.66
应收证券清算款	-	-	-	8,991,089.88	8,991,089.88
应收利息	-	-	-	2,024,306.50	2,024,306.50
应收申购款	-	-	-	7,448.92	7,448.92
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	169,054,155.67	-	114,440.04	408,319,837.92	577,488,433.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	453,705.68	453,705.68
应付管理人报酬	-	-	-	733,557.31	733,557.31
应付托管费	-	-	-	97,807.62	97,807.62
应付交易费用	-	-	-	629,607.48	629,607.48
其他负债	-	-	-	257,210.96	257,210.96
负债总计	-	-	-	2,171,889.05	2,171,889.05
利率敏感度缺口	169,054,155.67	-	114,440.04	406,147,948.87	575,316,544.58
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,282,852.67	-	-	-	5,282,852.67
结算备付金	70,054,006.24	-	-	-	70,054,006.24
存出保证金	403,518.84	-	-	-	403,518.84
交易性金融资产	150,326,000.00	-	-	507,019,702.97	657,345,702.97
应收利息	-	-	-	2,498,567.31	2,498,567.31
应收申购款	-	-	-	598,676.59	598,676.59
资产总计	226,066,377.75	-	-	510,116,946.87	736,183,324.62
负债					
应付证券清算款	-	-	-	28,278,470.51	28,278,470.51
应付赎回款	-	-	-	1,162,009.22	1,162,009.22
应付管理人报酬	-	-	-	887,829.78	887,829.78
应付托管费	-	-	-	118,377.31	118,377.31
应付交易费用	-	-	-	1,367,899.79	1,367,899.79
其他负债	-	-	-	250,873.52	250,873.52
负债总计	-	-	-	32,065,460.13	32,065,460.13
利率敏感度缺口	226,066,377.75	-	-	-478,051,486.74	704,117,864.49

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	100,710.07	172,442.85
市场利率上升 25 个基点	-100,537.93	-172,005.07	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金在正常市场状况下，股票投资比例一般情况下为 70%，国债投资比例不低于 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	397,296,992.62	69.06	507,019,702.97	72.01
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	397,296,992.62	69.06	507,019,702.97	72.01

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	26,716,403.42	19,565,694.19
	业绩比较基准下降 5%	-26,716,403.42	-19,565,694.19

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 333,277,706.78 元，属于第二层次的余额为 183,936,725.88 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 428,538,476.40 元，第二层次 228,807,226.57 元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	397,296,992.62	68.80
	其中：股票	397,296,992.62	68.80
2	固定收益投资	119,917,440.04	20.77
	其中：债券	119,917,440.04	20.77
	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	49,030,871.68	8.49
7	其他各项资产	11,243,129.29	1.95
8	合计	577,488,433.63	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	25,353,003.92	4.41
B	采矿业	9,487,217.22	1.65
C	制造业	258,458,130.84	44.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	337,580.26	0.06
E	建筑业	1,310,576.64	0.23
F	批发和零售业	956,477.35	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	18,787,222.48	3.27
H	住宿和餐饮业	435.60	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,455,242.35	0.95
J	金融业	2,711,875.80	0.47
K	房地产业	41,156,970.41	7.15

L	租赁和商务服务业	6,407,948.28	1.11
M	科学研究和技术服务业	501,283.30	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	644,152.24	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,334,528.00	3.36
R	文化、体育和娱乐业	6,394,347.93	1.11
S	综合	-	-
	合计	397,296,992.62	69.06

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所有股票投资明细

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	002377	国创高新	4,699,894	45,964,963.32	7.99
2	600658	电子城	3,262,398	41,066,304.56	7.14
3	603518	维格娜丝	1,162,717	38,846,374.97	6.75
4	002611	东方精工	2,299,788	38,613,440.52	6.71
5	000529	广弘控股	2,199,903	25,958,855.40	4.51
6	002086	东方海洋	2,200,000	25,212,000.00	4.38
7	002435	长江润发	1,099,950	22,955,956.50	3.99
8	300244	迪安诊断	604,204	19,334,528.00	3.36
9	600035	楚天高速	2,999,908	18,479,433.28	3.21
10	002173	*ST 创疗	900,000	18,045,000.00	3.14
11	600520	*ST 中发	399,981	10,795,487.19	1.88
12	600562	国睿科技	349,910	10,644,262.20	1.85
13	600963	岳阳林纸	1,100,000	8,987,000.00	1.56
14	002683	宏大爆破	1,000,000	8,880,000.00	1.54
15	603519	立霸股份	250,000	7,507,500.00	1.30
16	603968	醋化股份	300,000	7,278,000.00	1.27
17	002341	新纶科技	300,000	6,327,000.00	1.10
18	603729	龙韵股份	79,933	5,931,827.93	1.03
19	000802	北京文化	300,000	5,802,000.00	1.01

20	600750	江中药业	150,000	4,623,000.00	0.80
21	300025	华星创业	300,000	3,300,000.00	0.57
22	601229	上海银行	33,096	770,474.88	0.13
23	002159	三特索道	20,000	640,000.00	0.11
24	600909	华安证券	39,964	501,548.20	0.09
25	603328	依顿电子	11,296	361,246.08	0.06
26	601939	建设银行	53,500	291,040.00	0.05
27	002544	杰赛科技	10,000	281,400.00	0.05
28	601611	中国核建	15,731	270,415.89	0.05
29	002269	美邦服饰	50,000	250,500.00	0.04
30	603160	汇顶科技	2,417	248,322.58	0.04
31	002792	通宇通讯	4,520	245,255.20	0.04
32	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.04
33	002229	鸿博股份	9,911	233,304.94	0.04
34	600919	江苏银行	24,215	233,190.45	0.04
35	601500	通用股份	9,572	229,440.84	0.04
36	300506	名家汇	4,548	219,713.88	0.04
37	601127	小康股份	8,162	218,251.88	0.04
38	603017	中衡设计	9,596	209,000.88	0.04
39	600977	中国电影	9,045	208,849.05	0.04
40	600926	杭州银行	9,897	207,342.15	0.04
41	603919	金徽酒	6,604	205,186.28	0.04
42	600446	金证股份	8,106	203,703.78	0.04
43	603528	多伦科技	3,112	203,369.20	0.04
44	603986	兆易创新	1,133	201,640.01	0.04
45	002045	国光电器	15,000	186,750.00	0.03
46	603708	家家悦	5,874	185,794.62	0.03
47	603888	新华网	2,169	184,104.72	0.03
48	601595	上海电影	4,412	174,803.44	0.03
49	600415	小商品城	20,000	173,000.00	0.03
50	601020	华钰矿业	4,377	171,490.86	0.03
51	300164	通源石油	16,000	165,440.00	0.03
52	600270	外运发展	10,000	165,400.00	0.03
53	300558	贝达药业	2,172	160,293.60	0.03
54	601997	贵阳银行	10,141	160,024.98	0.03
55	603900	通灵珠宝	4,064	156,464.00	0.03
56	300527	华舟应急	5,601	155,539.77	0.03
57	603868	飞科电器	3,293	154,309.98	0.03
58	002831	裕同科技	2,219	153,554.80	0.03

59	002727	一心堂	7,174	152,088.80	0.03
60	300518	盛讯达	1,306	148,178.76	0.03
61	603777	来伊份	2,789	148,068.01	0.03
62	300266	兴源环境	2,679	147,023.52	0.03
63	002791	坚朗五金	2,682	146,437.20	0.03
64	002790	瑞尔特	3,022	145,358.20	0.03
65	300516	久之洋	1,473	143,263.98	0.02
66	603189	网达软件	3,898	141,848.22	0.02
67	002818	富森美	2,401	140,818.65	0.02
68	300511	雪榕生物	2,872	138,889.92	0.02
69	002812	创新股份	2,211	137,966.40	0.02
70	601163	三角轮胎	4,038	137,090.10	0.02
71	002243	通产丽星	10,000	136,400.00	0.02
72	300505	川金诺	1,893	135,500.94	0.02
73	601985	中国核电	19,000	134,140.00	0.02
74	002795	永和智控	1,450	132,820.00	0.02
75	300533	冰川网络	1,111	132,764.50	0.02
76	300569	天能重工	1,314	131,452.56	0.02
77	600936	广西广电	9,882	130,936.50	0.02
78	603027	千禾味业	2,904	130,592.88	0.02
79	603313	恒康家居	3,371	129,412.69	0.02
80	603007	花王股份	2,424	128,884.08	0.02
81	603861	白云电器	4,056	128,088.48	0.02
82	603556	海兴电力	2,832	127,326.72	0.02
83	300503	昊志机电	1,863	126,833.04	0.02
84	300512	中亚股份	3,746	124,854.18	0.02
85	601966	玲珑轮胎	4,602	123,747.78	0.02
86	601128	常熟银行	11,878	123,174.86	0.02
87	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.02
88	002807	江阴银行	11,222	121,422.04	0.02
89	603779	威龙股份	2,808	121,305.60	0.02
90	002789	建艺集团	1,500	118,215.00	0.02
91	300508	维宏股份	970	117,845.30	0.02
92	603159	上海亚虹	1,438	115,730.24	0.02
93	603393	新天然气	2,180	115,540.00	0.02
94	300568	星源材质	1,310	107,262.80	0.02
95	300528	幸福蓝海	3,314	106,942.78	0.02
96	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.02
97	603658	安图生物	1,911	106,232.49	0.02

98	600859	王府井	6,500	105,820.00	0.02
99	300526	中潜股份	984	105,317.52	0.02
100	603339	四方冷链	2,793	104,123.04	0.02
101	603098	森特股份	4,293	103,332.51	0.02
102	603727	博迈科	2,172	103,235.16	0.02
103	603515	欧普照明	2,663	102,552.13	0.02
104	603798	康普顿	1,590	101,521.50	0.02
105	300529	健帆生物	2,150	101,179.00	0.02
106	601811	新华文轩	4,549	101,124.27	0.02
107	603323	吴江银行	6,475	100,103.50	0.02
108	300570	太辰光	1,810	100,093.00	0.02
109	603421	鼎信通讯	2,480	100,018.40	0.02
110	603816	顾家家居	2,105	99,650.70	0.02
111	002815	崇达技术	2,180	98,710.40	0.02
112	603843	正平股份	4,642	97,714.10	0.02
113	603737	三棵树	1,327	96,897.54	0.02
114	600908	无锡银行	8,808	96,271.44	0.02
115	603887	城地股份	1,751	95,079.30	0.02
116	300510	金冠电气	2,730	94,731.00	0.02
117	300565	科信技术	2,382	94,517.76	0.02
118	002793	东音股份	1,413	93,837.33	0.02
119	002802	洪汇新材	1,629	93,602.34	0.02
120	002811	亚泰国际	2,469	92,538.12	0.02
121	002242	九阳股份	5,000	90,150.00	0.02
122	603101	汇嘉时代	3,563	89,751.97	0.02
123	000608	阳光股份	10,000	89,700.00	0.02
124	300146	汤臣倍健	7,384	88,164.96	0.02
125	603028	赛福天	3,309	87,523.05	0.02
126	002820	桂发祥	1,772	86,934.32	0.02
127	002271	东方雨虹	4,000	86,760.00	0.02
128	603609	禾丰牧业	6,540	84,562.20	0.01
129	600456	宝钛股份	5,000	82,650.00	0.01
130	603977	国泰集团	3,010	82,624.50	0.01
131	603569	长久物流	1,853	81,161.40	0.01
132	603959	百利科技	2,815	80,874.95	0.01
133	603987	康德莱	2,503	80,821.87	0.01
134	603878	武进不锈	2,000	80,000.00	0.01
135	603667	五洲新春	2,404	79,548.36	0.01
136	603029	天鹅股份	1,618	78,586.26	0.01

137	603060	国检集团	2,201	77,849.37	0.01
138	300552	万集科技	1,349	76,785.08	0.01
139	300556	丝路视觉	1,226	76,453.36	0.01
140	603660	苏州科达	2,353	75,813.66	0.01
141	603928	兴业股份	2,670	74,359.50	0.01
142	603067	振华股份	2,616	74,215.92	0.01
143	603585	苏利股份	1,041	72,578.52	0.01
144	300541	先进数通	1,467	71,883.00	0.01
145	002798	帝王洁具	1,056	70,752.00	0.01
146	300520	科大国创	926	70,672.32	0.01
147	603958	哈森股份	2,372	70,638.16	0.01
148	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01
149	603726	朗迪集团	1,361	69,724.03	0.01
150	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.01
151	300517	海波重科	1,446	69,494.76	0.01
152	300515	三德科技	1,354	69,433.12	0.01
153	002389	南洋科技	3,000	69,240.00	0.01
154	603336	宏辉果蔬	1,471	69,239.97	0.01
155	603016	新宏泰	1,602	68,902.02	0.01
156	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
157	603819	神力股份	1,698	67,580.40	0.01
158	601899	紫金矿业	20,000	66,800.00	0.01
159	603663	三祥新材	1,826	66,685.52	0.01
160	603203	快克股份	1,048	65,929.68	0.01
161	002813	路畅科技	1,296	65,888.64	0.01
162	603090	宏盛股份	1,371	65,355.57	0.01
163	300548	博创科技	754	63,773.32	0.01
164	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01
165	603069	海汽集团	3,388	63,660.52	0.01
166	300534	陇神戎发	996	63,544.80	0.01
167	300088	长信科技	3,900	61,620.00	0.01
168	002819	东方中科	1,293	61,559.73	0.01
169	002827	高争民爆	2,059	60,905.22	0.01
170	002803	吉宏股份	1,165	60,323.70	0.01
171	603228	景旺电子	2,597	60,146.52	0.01
172	603859	能科股份	1,121	59,895.03	0.01
173	603033	三维股份	1,160	59,821.20	0.01
174	300532	今天国际	838	58,936.54	0.01
175	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.01

176	002799	环球印务	1,080	54,291.60	0.01
177	603909	合诚股份	1,095	54,257.25	0.01
178	601882	海天精工	2,148	54,215.52	0.01
179	600491	龙元建设	4,696	54,191.84	0.01
180	002825	纳尔股份	1,139	53,521.61	0.01
181	000488	晨鸣纸业	5,000	51,800.00	0.01
182	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.01
183	300539	横河模具	1,153	51,642.87	0.01
184	603633	徕木股份	1,258	51,590.58	0.01
185	300542	新晨科技	988	50,783.20	0.01
186	300537	广信材料	1,024	49,960.96	0.01
187	002805	丰元股份	971	48,676.23	0.01
188	603559	中通国脉	899	48,447.11	0.01
189	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.01
190	300267	尔康制药	3,664	47,815.20	0.01
191	002817	黄山胶囊	839	47,797.83	0.01
192	603389	亚振家居	1,963	47,327.93	0.01
193	002816	和科达	1,000	47,280.00	0.01
194	600790	轻纺城	6,495	46,764.00	0.01
195	002810	山东赫达	957	46,605.90	0.01
196	002808	苏州恒久	1,128	46,101.36	0.01
197	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.01
198	601113	华鼎股份	4,000	42,320.00	0.01
199	300536	农尚环境	876	41,233.32	0.01
200	603319	湘油泵	721	40,736.50	0.01
201	002129	中环股份	4,400	40,480.00	0.01
202	002828	贝肯能源	1,042	40,221.20	0.01
203	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.01
204	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
205	000528	柳工	5,000	36,550.00	0.01
206	000088	盐田港	5,000	35,650.00	0.01
207	600011	华能国际	5,000	35,250.00	0.01
208	300191	潜能恒信	1,000	34,400.00	0.01
209	603128	华贸物流	3,362	33,620.00	0.01
210	300269	联建光电	1,450	33,524.00	0.01
211	002014	永新股份	2,000	32,000.00	0.01
212	002385	大北农	4,499	31,942.90	0.01
213	300086	康芝药业	2,250	31,320.00	0.01
214	002498	汉缆股份	6,975	29,992.50	0.01

215	300149	量子高科	1,540	29,906.80	0.01
216	002416	爱施德	2,000	29,460.00	0.01
217	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
218	600307	酒钢宏兴	10,000	27,300.00	0.00
219	300082	奥克股份	3,120	26,364.00	0.00
220	300084	海默科技	2,200	25,630.00	0.00
221	002370	亚太药业	850	24,905.00	0.00
222	002418	康盛股份	2,400	24,552.00	0.00
223	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
224	601218	吉鑫科技	4,400	23,628.00	0.00
225	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
226	002580	圣阳股份	1,260	22,566.60	0.00
227	300067	安诺其	2,400	20,640.00	0.00
228	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
229	000825	太钢不锈	5,000	19,700.00	0.00
230	002398	建研集团	1,429	19,405.82	0.00
231	002404	嘉欣丝绸	1,950	17,628.00	0.00
232	002220	天宝股份	1,200	16,188.00	0.00
233	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
234	002419	天虹商场	1,000	15,020.00	0.00
235	000993	闽东电力	1,000	14,210.00	0.00
236	600808	马钢股份	5,000	14,150.00	0.00
237	600089	特变电工	1,220	11,138.60	0.00
238	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
239	601369	陕鼓动力	1,500	10,275.00	0.00
240	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
241	600812	华北制药	1,572	9,840.72	0.00
242	002403	爱仕达	650	9,503.00	0.00
243	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
244	002011	盾安环境	990	9,424.80	0.00
245	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
246	002065	东华软件	400	9,320.00	0.00
247	002386	天原集团	840	7,585.20	0.00
248	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
249	002356	赫美集团	297	7,187.40	0.00
250	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
251	300070	碧水源	237	4,152.24	0.00
252	002452	长高集团	408	3,835.20	0.00
253	600655	豫园商城	335	3,825.70	0.00

254	000963	华东医药	52	3,747.64	0.00
255	000025	特力A	61	3,371.47	0.00
256	300153	科泰电源	180	3,263.40	0.00
257	600436	片仔癀	64	2,930.56	0.00
258	002195	二三四五	256	2,897.92	0.00
259	300310	宜通世纪	118	2,872.12	0.00
260	002672	东江环保	163	2,868.80	0.00
261	603118	共进股份	59	2,321.65	0.00
262	002592	八菱科技	70	2,125.90	0.00
263	000619	海螺型材	159	1,920.72	0.00
264	300197	铁汉生态	141	1,787.88	0.00
265	600536	中国软件	72	1,732.32	0.00
266	002482	广田集团	180	1,665.00	0.00
267	000651	格力电器	66	1,624.92	0.00
268	000581	威孚高科	71	1,593.24	0.00
269	002348	高乐股份	198	1,526.58	0.00
270	600697	欧亚集团	47	1,505.41	0.00
271	000957	中通客车	92	1,460.04	0.00
271	600198	大唐电信	92	1,460.04	0.00
272	600566	济川药业	46	1,437.96	0.00
273	300094	国联水产	168	1,399.44	0.00
274	600161	天坛生物	35	1,379.00	0.00
275	300002	神州泰岳	149	1,376.76	0.00
276	002497	雅化集团	186	1,275.96	0.00
277	000002	万科A	47	965.85	0.00
278	600073	上海梅林	82	938.90	0.00
279	002687	乔治白	78	932.10	0.00
280	600690	青岛海尔	88	869.44	0.00
281	600594	益佰制药	52	865.80	0.00
282	000062	深圳华强	30	852.30	0.00
283	300115	长盈精密	32	833.92	0.00
284	002084	海鸥卫浴	76	817.00	0.00
285	000928	中钢国际	41	718.73	0.00
286	300143	星河生物	28	714.56	0.00
287	000568	泸州老窖	19	627.00	0.00
288	300031	宝通科技	28	590.24	0.00
289	600312	平高电气	37	577.94	0.00
290	000887	中鼎股份	22	570.68	0.00
291	002048	宁波华翔	24	531.36	0.00

292	300335	迪森股份	30	522.60	0.00
293	002004	华邦健康	53	480.71	0.00
294	002511	中顺洁柔	24	477.60	0.00
295	603008	喜临门	25	457.50	0.00
296	000428	华天酒店	60	435.60	0.00
297	002322	理工环科	18	429.48	0.00
298	002182	云海金属	22	409.42	0.00
299	002157	正邦科技	60	399.60	0.00
300	000793	华闻传媒	35	395.15	0.00
301	002194	武汉凡谷	30	385.80	0.00
302	000001	平安银行	41	373.10	0.00
303	600761	安徽合力	27	343.44	0.00
304	000066	长城电脑	22	273.68	0.00
305	000709	河钢股份	80	267.20	0.00
306	002104	恒宝股份	22	259.38	0.00
307	601098	中南传媒	14	233.24	0.00
308	002154	报喜鸟	42	227.64	0.00
309	000157	中联重科	32	145.28	0.00
310	300039	上海凯宝	13	132.99	0.00
311	600015	华夏银行	12	130.20	0.00
312	000925	众合科技	4	98.28	0.00
313	601311	骆驼股份	6	97.98	0.00
314	600678	四川金顶	6	91.86	0.00
315	002327	富安娜	8	70.40	0.00
316	002351	漫步者	4	47.60	0.00
317	601208	东材科技	6	46.14	0.00
318	300045	华力创通	1	13.27	0.00

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	600658	电子城	43,741,055.19	6.21
2	002377	国创高新	43,197,601.79	6.13
3	002611	东方精工	40,435,706.08	5.74
4	300387	富邦股份	39,447,731.51	5.60

5	603518	维格娜丝	38,593,797.88	5.48
6	600048	保利地产	27,301,575.01	3.88
7	600074	保千里	26,079,548.00	3.70
8	002435	长江润发	25,690,385.37	3.65
9	000529	广弘控股	25,234,438.36	3.58
10	603017	中衡设计	25,229,656.73	3.58
11	300008	天海防务	25,086,954.64	3.56
12	600778	友好集团	24,508,856.97	3.48
13	002086	东方海洋	24,151,519.38	3.43
14	300069	金利华电	23,897,806.19	3.39
15	002650	加加食品	23,698,008.78	3.37
16	300234	开尔新材	23,553,827.80	3.35
17	002235	安妮股份	23,361,297.10	3.32
18	600203	福日电子	22,014,948.10	3.13
19	000949	新乡化纤	21,792,249.26	3.09
20	000069	华侨城A	21,270,742.48	3.02
21	002001	新和成	20,757,655.16	2.95
22	603686	龙马环卫	19,702,601.04	2.80
23	600816	安信信托	19,234,162.50	2.73
24	002591	恒大高新	17,688,216.09	2.51
25	600035	楚天高速	16,839,851.92	2.39
26	300078	思创医惠	16,741,636.91	2.38
27	002173	*ST 创疗	16,542,325.20	2.35
28	002303	美盈森	16,483,105.93	2.34
29	600880	博瑞传播	16,219,158.81	2.30
30	002368	太极股份	16,089,858.20	2.29
31	600900	长江电力	15,821,506.00	2.25
32	000421	南京公用	15,630,268.83	2.22
33	000687	华讯方舟	15,427,525.00	2.19
34	600050	中国联通	14,568,639.35	2.07

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	300387	富邦股份	44,975,813.43	6.39
2	002530	丰东股份	33,173,230.07	4.71
3	603017	中衡设计	30,914,550.95	4.39
4	300198	纳川股份	30,388,278.00	4.32
5	600074	保千里	30,371,624.00	4.31
6	002368	太极股份	29,395,352.33	4.17
7	600048	保利地产	27,911,942.02	3.96
8	600778	友好集团	27,038,482.06	3.84
9	002001	新和成	26,722,249.97	3.80
10	300008	天海防务	26,444,351.78	3.76
11	600860	京城股份	24,203,415.62	3.44
12	002235	安妮股份	24,203,042.65	3.44
13	002650	加加食品	24,030,026.26	3.41
14	000949	新乡化纤	22,406,370.80	3.18
15	002591	恒大高新	22,345,135.96	3.17
16	300069	金利华电	22,159,149.64	3.15
17	000069	华侨城A	21,988,073.36	3.12
18	600602	云赛智联	21,935,689.21	3.12
19	300234	开尔新材	21,620,421.00	3.07
20	000890	法尔胜	19,905,644.53	2.83
21	603686	龙马环卫	19,811,774.37	2.81
22	600816	安信信托	19,678,675.88	2.79
23	600880	博瑞传播	19,376,301.02	2.75
24	000802	北京文化	18,465,770.00	2.62
25	600203	福日电子	18,079,476.81	2.57
26	300078	思创医惠	18,025,983.44	2.56
27	600419	天润乳业	17,427,460.50	2.48
28	000687	华讯方舟	16,914,128.50	2.40
29	002543	万和电气	16,852,746.49	2.39
30	002303	美盈森	16,431,953.01	2.33
31	600900	长江电力	15,938,342.00	2.26
32	600986	科达股份	15,534,209.05	2.21
33	600240	华业资本	15,025,820.14	2.13
34	002402	和而泰	15,023,152.06	2.13
35	000421	南京公用	14,703,121.70	2.09

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	1,325,801,049.56
卖出股票收入（成交）总额	1,387,678,067.54

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,803,000.00	20.82
	其中：政策性金融债	119,803,000.00	20.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	114,440.04	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	119,917,440.04	20.84

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160211	16 国开 11	1,100,000	109,813,000.00	19.09
2	160209	16 国开 09	100,000	9,990,000.00	1.74
3	128013	洪涛转债	1,014	114,440.04	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

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

组合投资的前十名证券之一的长江润发的发行主体长江润发机械股份有限公司（以下简称“公司”）收到了深圳证券交易所中小板公司管理部《关于对长江润发机械股份有限公司的监管函》（中小板监管函【2016】第3号），指出“2015年7月7日，你公司因筹划重大事项申请股票停牌，2015年10月21日，确认该重大事项为重大资产重组并申请股票继续停牌，同时承诺于2016年1月7日停牌期限届满前披露符合相关要求的重大资产重组预案或报告书。截至目前，你公司尚未在承诺的停牌期限届满前披露符合要求的重大资产重组预案等相关文件。”

收到监管函后，公司董事会对此高度重视，及时向公司董事、监事、高级管理人员以及责任部门进行了传达，并针对监管函中指出的问题及时提出整改措施。

对该股票的投资决策程序的说明：根据公司公告，公司董事会将督促各方加快沟通，消除不确定因素，完善及完成相关工作，于2016年1月15日前披露本次重大资产重组的预案。本基金管理人长期跟踪研究该股票，该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，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一的广东广弘控股股份有限公司（简称“广弘控股”或“公司”）于 2016 年 11 月 11 日公告，中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称“广东证监局”）于 2016 年 9 月 18 日至 9 月 30 日对公司进行了年报现场检查，对公司定期报告、股东大会、董事会、监事会等三会材料、内部控制和信息披露程序等情况进行了详尽和全面的检查。近日，公司收到了广东证监局《关于对广东广弘控股股份有限公司采取责令改正措施的决定》（【2016】53 号，以下简称“《决定书》”），现将主要内容公告如下：

一、重大损失未及时披露。

2015 年 12 月 24 日，公司对子公司广东广弘粤桥食品有限公司进行存货盘点，盘点结果确认存货盘亏净额 2203.93 万元，占公司 2014 年净利润 15349.3 万元的 14.36%，公司未及时披露。上述行为不符合《上市公司信息披露管理办法》第十三条、《深圳证券交易所股票上市规则》第 9.2 条、第 11.11.3 条等相关规定。

《决定书》要求公司按时提交书面整改计划，明确整改措施及整改时限，并于 2016 年 11 月 30 日前完成整改。

公司董事会和管理层高度重视广东证监局在《决定书》中所提及的事项，将按要求制定整改计划，并在规定的时限内向广东监管局上报书面整改报告、完成整改。

公司于 2016 年 11 月 24 日公告，公司于 2016 年 11 月 9 日收到中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称“广东证监局”）发来的《关于对广东广弘控股股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2016]53 号，以下简称“《决定书》”），详见公司于 2016 年 11 月 11 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网（<http://www.cninfo.com.cn>）上的《关于收到广东证监局责令改正措施决定的公告》（公告编号：2016-37）。

收到《决定书》后，公司高度重视，及时向董事、监事、高级管理人员及公司的控股股东、实际控制人进行了通报、传达，并召开了专题会议，对《决定书》涉及的问题进行了认真的梳理和分析，制定了切实的整改措施，形成了《关于广东证监局责令改正措施决定的整改报告》，并于 2016 年 11 月 23 日提交公司 2016 年第二次临时董事会会议和 2016 年第二次临时监事会会议审议通过。现将整改报告公告如下：

一、存在问题

重大损失未及时披露。2015 年 12 月 24 日，公司对子公司广东广弘粤桥食品有限公司进行存

货盘点,盘点结果确认存货盘亏净额 2203.93 万元,占公司 2014 年净利润 15349.3 万元的 14.36%,公司未及时披露。上述行为不符合《上市公司信息披露管理办法》第三十条、《深圳证券交易所股票上市规则》第 9.2 条、第 11.11.3 条等相关规定。

二、情况说明和整改措施

1. 情况说明: 2015 年 12 月 24 日,根据公司内控制度的有关规定,公司子公司广东广弘粤桥食品有限公司进行了存货盘点,结果为存货盘点短缺净额为 2203.93 万元。对于上述事项该公司按规定履行其公司相关审批程序后,进行了相关账务处理:其中存货盘亏金额为 496 万元,占公司 2014 年净利润 15349.3 万元的 3.23%,该事项在 2015 年度按规定进行了账务处理,并在 2015 年度财务审计报告中进行了披露;部分调整转入“其他应收款”科目,并对其中的其他应收款项 1323.45 万元全额计提减值准备,并计入 2015 年度财务报告,该事项也已于 2016 年 1 月 29 日经公司 2016 年第一次临时董事会和 2016 年第一次临时监事会审议通过,并对外进行了披露;部分调整转入“应收账款”科目金额为 130.24 万元,该应收账款至 2015 年 12 月 31 日已全部收回,未发生损失。上述事项由于公司相关部门和下属子公司对信息披露有关政策的理解有偏差,造成公司未及时对该事项进行信息披露。

2. 整改措施: 公司已对上述存货盘点有关事项进行了整改。该事项不会对公司 2016 年度财务报告产生影响,不会影响公司未来发展。上述问题的发生,对公司全体董事、监事、高级管理人员、相关管理部门和下属子公司是极大的警示和教育。公司将要求董事、监事、高级管人员、相关部门及下属子公司加强对相关法律法规和规范性文件的学习,特别是重点加强《上市公司信息披露管理办法》、《深圳证券交易所股票上市规则》等规定的学习,提高相关人员履职意识,提升对信息披露的认识与理解,切实提高公司规范化运作水平,保证公司信息披露真实、准确、完整、及时、公平,杜绝类似情况再次发生。

3. 整改完成时间: 至公告日整改完毕,持续规范。

本次现场检查对进一步提高公司信息披露质量、完善内部控制起到了重要的指导和推动作用。公司将认真对待检查,落实各项整改措施,严格按照监管机构的要求,加强董事、监事、高级管理人员、相关部门及下属企业对《公司法》、《证券法》、《上市公司信息披露管理办法》、《深交所股票上市规则》、《公司章程》等法律法规和规范性文件的学习,切实履行义务和职责,不断提高信息披露质量,完善公司治理和规范运作水平,确保公司持续、健康、稳定发展。

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	220,283.99
2	应收证券清算款	8,991,089.88
3	应收股利	-
4	应收利息	2,024,306.50
5	应收申购款	7,448.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,243,129.29

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002377	国创高新	45,964,963.32	7.99	重大事项
2	600658	电子城	15,967,304.56	2.78	非公开发行

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
27,426	16,393.88	42,862,363.74	9.53%	406,756,130.6	90.47%

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	81.14	0.0000%

注：截止本报告期末，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

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（2003年7月12日）基金份额总额	343,260,931.46
本报告期期初基金份额总额	499,818,199.47
本报告期基金总申购份额	32,066,614.04
减：本报告期基金总赎回份额	82,266,319.17
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	449,618,494.34

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：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 57,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 14 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	
东北证券	1	801,161,433.89	29.76%	746,117.02	30.18%	-
长江证券	1	515,108,379.70	19.13%	469,418.60	18.99%	-
海通证券	1	499,253,079.31	18.54%	454,969.76	18.40%	-
国金证券	1	411,959,378.44	15.30%	375,418.62	15.18%	-
国泰君安	1	311,584,147.61	11.57%	283,946.67	11.48%	-
兴业证券	1	153,155,273.47	5.69%	142,632.01	5.77%	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-

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，最近二年未因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

注：本基金本报告期内未通过券商交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月5日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月5日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月6日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月6日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月8日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月9日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月12日

8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 14 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 16 日
10	2015 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 21 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 21 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 22 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 26 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 27 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 28 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 29 日
17	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与平安证券申	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 29 日

	购费率优惠活动的公告	报》	
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月17日
19	鹏华普天系列开放式证券投资基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月22日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月23日
21	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购最低金额及赎回持有最低份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月24日
22	关于旗下基金所持金亚科技(300028)估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月24日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月26日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月27日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月1日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月3日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2016年3月19日

	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月22日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月24日
30	关于旗下基金所持沃森生物(300142)估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月29日
31	2015年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月30日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月30日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月6日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月7日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月12日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月14日

	变更的提示性公告	报》	
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 14 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海陆金所资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 18 日
39	2016 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
40	鹏华基金管理有限公司关于增加江苏江南农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 21 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 22 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 5 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 10 日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 11 日

	变更的提示性公告	报》	
46	鹏华基金关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行“基金通”申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月17日
47	鹏华基金管理有限公司关于增加中国民族证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月30日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国民生银行股份有限公司开通定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月31日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月1日
50	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月8日
51	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月14日
52	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户的证件类型公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月18日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月28日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月30日

	行、手机银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	报》	
55	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在上海陆金所资产管理有限责任公司开通基金定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月1日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月2日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月5日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月7日
59	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月8日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月12日
61	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月13日
62	鹏华基金管理有限公司关于增加华融证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月15日
63	2016年第二季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月21日

		报》	
64	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 28 日
65	鹏华基金管理有限公司关于鹏华普天收益证券投资基金 2016 年第 1 次分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 8 月 9 日
66	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 8 月 16 日
67	鹏华普天系列开放式证券投资基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 8 月 20 日
68	2016 年半年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 8 月 29 日
69	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 9 月 6 日
70	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的更正公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 9 月 7 日
71	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 9 月 9 日
72	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 9 月 20 日

73	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年9月28日
74	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年10月19日
75	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年10月22日
76	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年10月25日
77	2016年第三季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年10月25日
78	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年11月11日
79	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年11月14日
80	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年11月15日
81	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京新浪仓石基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年11月24日
82	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2016年11月29日

	部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	海证券报》、《证券时报》	
83	鹏华基金关于旗下部分开放式基金参与中国民生银行直销银行“基金通”定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年11月30日
84	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京汇成基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年12月3日
85	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年12月3日
86	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年12月8日
87	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京蛋卷基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年12月9日
88	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年12月13日
89	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年12月20日
90	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年12月22日

	渠道基金申购费率优惠活动的公告	报》	
91	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 24 日
92	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华普天系列开放式证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华普天收益证券投资基金 2016 年年度报告》(原文)。

13.2 存放地点

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。

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(<http://www.phfund.com>)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日