鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金

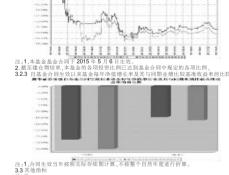
無事签字问题,并由董事未签定。 基金管例 4-中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定。于2017年3月27日复核了本报 艺术的经验制施,检查发现。利润分产组成。现务会计报告,投资组合报告等均等。保证复核内容不存 在基金管理人未说以城市信用,则数是增加的原理和应用基金的产但不保证基金一定备利。 基金管理人未说以城市信用,则数是增加的原理和应用基金产但不保证基金一定备利。 基金管理人来说以城市信用,数数是增加的原理和应用基金产的一位不保证是大量前应行相阅读本基 金的招募见时及其更新。 本年度增已指缀等顺由年度报告正文,投资者欲了解详细内容。应阅读年度报告正文 "管字先进中文会计师事务有特殊普通合伙;注册会计师对本基金出具了"都能无保留意见"的 。及。 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 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 2.1 基金基本情况

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5月6日			
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	翻华基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	720, 513, 941.46 fb			
基金合同存续期	不定期			
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所			
上市日期	2015年5月15日			
下属分级基金的基金简称	参高指基	寿尚 A 扱	寿尚 B 級	
下属分级基金的场内简称	参高指基	赤尚 A 扱	寿尚 B 級	
下屋分级基金的交易代码	160633	150235	150236	
报告期末下属分级基金份额总额	278. 163. 476.46 (1)	221, 175, 232,00 (1)	221, 175, 233.00 (†)	
2.2 基金产品说明	214,144,11414			
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求 内,年跟踪误差控制在4%	限踪偏离度和跟踪误差最小化,力争 以内。	将日均跟踪偏离度控制在 0.35%	
	致无法有效复制和跟踪标		兄导致流动性不足时,或其他原因5	

电子邮箱		zhangge@phfund.	zhangge@phfund.com.cn		tianqing1zh@ccb.com	
信息披露负责人	联系电话	0755- 828257			010- 67595096	
姓名		张戈			田青	
名称		鹏华基金管理有限公司		中国	建设银行股份有限公司	
项目		基金管理人		基金托管人		
2.3 基金管理人	(和基金托管)	A.				
下属分级基金的风险收益特征		本基金属于野菜金鱼。 用的 限步 致益全量。 是一野菜金鱼。 是一野菜金鱼。 是一野菜金鱼。 是一种。 是一一。 是一一。 是一一。 是一一。 是一一。 是一一。 是一一。 是一一。 是一一。 是一一。 是一。 是	鹏华证券 A 份	額为稳健收益类 风险且预期收益 征。	聯华证券 B 份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益 别对收高的特征。	
风险收益特征		有与标的指数以及标的指数所代	比表的公司相似的	于混合型基金、债 同时本基金为指数 的风险收益特征。	养型基金与货币市场基金,为证基金,通过跟踪标的指数表现,具	
业绩比较基准		中证全指证券公司指数收益率×	95%十高业银行	行活期存款利率(利	見后)×5%	
		本基金可以根据途由世野观察。 表現教養 利用局定的計不一下的投資施。 規模 利用局定的計不。 进行小岛进筹。 3、同生品投资股份制度,或证和其些处于 本基金投资投资制度,或证和其些处于 未基金投资股份制度,或证和其些处于 未基金投资股份制度。 基金管理。 从市场的发展, 基金管理。 从市场的发展, 基金管理。 从市场的发展, 基金管理。 从市场的发展, 发展, 是一个人员会。 从市场的发展, 本面的发展, 是一个人员会。 从市场的发展, 本面的发展, 是一个人员会。 从市场的发展, 本面的发展, 本面的发展, 是一个人员会。 从市场的发展, 本面的发展, 是一个人员会。 从市场的发展, 本面的发展,		济分析、资金面动 证则,以存作值依分别 以客作用,除产价值依 为则 权价组,及校均则 权力, 取股价组, 及校均则 有效。 有效 有效 有效 有效 并结合 数 次 次 形 所 的 成 形 用 , 以 形 的 的 的 。 是 不 的 的 的 , 的 , 的 的 的 的 的 的 的 的 的 的 的 的 的	向分析等判断未来利率变化,并 相同生产品。 目的,主要选择能动性好,交易忍助疑国的现金资产对投资债益的 的自因的。 的管理,从负责数据期债的投资 海被产并报道事会批准。 模型及价值按据策略,价差策略	

公司 何分配情况	会中心單 43 京曆年基金管理有限 金 鄉 邱 位 , 人 民, 5 月 6 日 福金台同生效日) - 2015 年 12 月 31 日 - 692,050,9145 - 804,531,7437
2015年 7622 5634	金 響 单 位: 人民 5月6日儒金合同生效日)-2015 年12月31日 - 692,050,9145 - 804,531,743.7
76.22 56.34	年 12 月 31 日 - 692, 050, 914.5 - 804, 531, 743.7
56.34	- 804, 531, 743.7
8349	- 0.373
3.01%	- 27.77%
	2015年末
.1043	- 0.365
35.95	5, 841, 433, 319.8
	0.70
	1.1043 135.95 0.955 他收入(不 价值变动)

据	和指标为非完 3.2 基金净值	整会计年度! 自表现	改据。			31 日未満一年	,故 2015 年的
	3.2.1 基金份				法准收益率的1	七较	
	阶段	份額净值增长率 ①	份额净值增长率 标准差②	业绩比较基准收 益率③	业绩比较基准收益 率标准差④	1)-3	2-4
	过去三个月	- 0.48%	1.12%	- 0.88%	1.12%	0.40%	0.00%
	过去六个月	- 0.28%	1.16%	- 2.21%	1.17%	1.93%	- 0.01%
	过去一年	- 16.01%	2.13%	- 17.66%	2.13%	1.65%	0.00%
	自基金合同生效起 至今	- 39.34%	235%	- 44.53%	292%	5.19%	- 0.57%
	注,业绩比较基准 = 中证全指证券公司指数收益率 *95% + 商业银行活期存款利率(税后)*5% 3.2.2 自基金合同生效以来基金份額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						
B3	的比较 國學是否分別其他學術所以完整的學術學術學術學術學術的學術學的學術學術學術學術學術學術學術學術學術學術學術學						



往:尤。
3.4 过去三年基金的利润分配情况
注:根据本基金基金合同约定,在存续期内,本基金(包括券商指基份額、券商A级、券商B级)不
进行收益分配。
§ 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

性名 取多 在限日期 发任日期 证券从仓车票 提到 证券从仓车票 提到 上京年证券从仓车票 经明本证 具在日期 上京年证券从仓车票 经现金 上京年证券从公托息,但任时下 抵职证券投价的股边,,且任政市 经股金额金额 经股份 计可以 电对象 计可以 电对象 化二甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基
土 等证的从处理机。但在对 超过是现代的证明。 在

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及
本基金基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基
础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,不存在违反基金合同和
损害基金份额持有人利益的行为。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度和控制方法

HILL 1/2 MARIN TO THE CONTROL OF THE
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《鹳华基金管理
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人公
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

4.3.2 公平交易制度的核斤情况 报告期内,未基金管理人产格执行公平交易制度,确保不同校资组合在研究、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申意见,的要求、公司对所管理组合的水同时间的同时负责的方式。未发现存在压定处平交易原则的要求。公司对所管理组合的水同时间的同时负责的。但是是一个企业的一个企业,发现在压止及平交易原为的专项股票,从后期内未发生的一个企业。 4.3.3 年常交易行为的专项股票。 4.3.3 年常交易行为。 报告期内,未基金来设生进进进程且并对基金材产造成损失的异常交易行为。 年代的期内基金管理人员管理的所以组合参与的公务所公产等价的目以向交易成交较少的 单边交易被赶进延延参与成交差的5%的交易次次数分4次、主要原因在于指数级分数交易不活跃 年度。

《 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

4.4.1 集化期内基金投资票略和运作分时 股份期内,基金投资票略和运作分的则。 报任期内,市场行情由于相定,投资管理操作正常开展。基金日均跟踪偏离度和跟踪误差都有较 的股票,按时继续工作基金使作品。 4.4.2 报任期内基金的设建的表现 格芒前末、基金份额净值为 9.855,累计净值为 0.609。本报告期基金份额净值增长率为-16.

报告期内,本基金日均跟踪偏离度的绝对值为 0.05%,年化跟踪误差为 1.2%,均符合基金合同

7.1 资产负债表 会计主体, 翻华中证金指证券公司指数分级证券投资基金 报告截止日; 2016 年 12 月 31 日

			单位:人民币
资产	附注号	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015年 12 月 31 日
ř:			
行存款		35, 986, 552.50	301, 855, 488.81
算备付金		14, 278.30	24, 669, 126.54
出保证金		212, 887.29	1, 798, 503.87
易性金融资产		653, 595, 997.74	5, 484, 048, 863.80
中:股票投资		653, 595, 997.74	5, 484, 048, 863.80
金投资			
券投资			
产支持证券投资			
金属投资			
生金融资产			
人返售金融资产			
牧证券清算款		58, 830.65	
牧利息		8, 267.32	61, 676.82
牧股利			
牧申购款		180, 258.85	149, 882, 951.90
延所得税资产			
他资产			
产总计		690, 057, 072.65	5, 962, 316, 611.74
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
债:			
期借款			
易性金融负债			
生金融负债			
出回购金融资产款			
付证券清算款		-	107, 710, 085.27
付赎回款		663, 731.09	1, 638, 319.50
付管理人报酬		617, 959.22	3, 342, 658.83
付托管费		135, 951.03	735, 384.97
付销售服务费			
付交易费用		339, 653.64	7, 088, 709.4
交税费			

687, 742, 335.9 5, 841, 433, 319.80 指基份額 278,163 7.2 利润表 会计主体: 鹏华中证金指证券公司指数分级证券投资基金 本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

2, 314, 736.7

120, 883, 291.94

- 2, 249, 843, 578.5

单位:人民币元

			単位:人民市
項目	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5月6日(基金合同生效日)至 2015年12月31日
一、收入		- 1, 119, 591, 143.22	- 776, 661, 944.25
1.利息收入		750, 117.73	2, 145, 506.09
其中:存款利息收入		750, 117.73	2, 145, 506.09
债券利息收入			
资产支持证券利息收入			
买人返售金融资产收入			
其他利息收人			
2投资收益(损失以"-"填列)		- 1, 158, 855, 361.58	- 669, 429, 642.94
其中:股票投资收益		- 1, 181, 779, 759.10	- 675, 138, 295.75
基金投资收益			
债券投资收益			
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		22, 924, 397.52	5, 708, 652.81
3公允价值变动收益(损失以* - * 号填列)		31, 525, 719.88	- 112, 480, 829.17
4.汇兑收益(损失以*.*号填列)			
5.其他收入(损失以 - * 号填列)		6, 988, 380.75	3, 103, 021.77
减:二、费用		27, 429, 013.12	27, 869, 799.48
1. 管理人报酬	74.82.1	12, 823, 814.92	10, 399, 060.55
2. 托管费	74822	2, 821, 239.23	2, 287, 793.26
3. 销售服务费	74823		
 交易費用 		11, 034, 474.09	14, 648, 424.89
5. 利息支出			
其中:卖出回购金融资产支出			
6. 其他費用		749, 484.88	534, 520.78
三、利润总额(亏损总额以*。"号填列)		- 1, 147, 020, 156.34	- 804, 531, 743.73
减;所得税费用			
四、净利润(净亏损以*。*号填列)		- 1, 147, 020, 156.34	- 804, 531, 743.73

項目	20	本期 116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)	8,091,276,898.34	- 2, 249, 843, 578.54	5, 841, 433, 319.80
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期利润)		- 1, 147, 020, 156.34	- 1, 147, 020, 156.34
三、本期基金份額交易产生的基金 净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	- 6, 957, 224, 085.62	2, 950, 553, 258.11	- 4, 006, 670, 827.51
其中:1.基金申购款	2, 514, 814, 078.90	- 926, 422, 665.98	1, 588, 391, 412.92
2基金赎回款	- 9, 472, 038, 164.52	3, 876, 975, 924.09	- 5, 595, 062, 240.43
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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	1, 134, 052, 812.72	- 446, 310, 476.77	687, 742, 335.95
項目	2015年 5 月	上年度可比期间 6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)	1,030,790,724.11		1, 030, 790, 724.11
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期利润)		- 804, 531, 743.73	- 804, 531, 743.73
三、本期基金份額交易产生的基金 净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	7, 060, 486, 174.23	- 1, 445, 311, 834.81	5, 615, 174, 339.42
其中:1.基金申购款	10, 502, 386, 916.99	- 2, 407, 032, 188.74	8, 095, 354, 728.25
2基金赎回款	- 3, 441, 900, 742.76	961, 720, 353.93	- 2, 480, 180, 388.83
四、本期向基金份额持有人分配利 洞产生的基金净值变动(净值减少 以"-"号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	8,091,276,898.34	- 2, 249, 843, 578.54	5, 841, 433, 319.80
报表附注为财务报表的 本报告 7.1 至 7.4 财务	的组成部分。 ·报表由下列负责人签署	:	

会计主体: 鹳华中证金指证券公司指数分级证券投资基金本报告期;2016年1月1日至2016年12月31日

不召明 高鵬 郝文高 恭全等理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构则如介人 14 基金法情况 14 基金法情况 14 基金基本情况 照华申止专准证券公司指数分级证券投资基金(以下简称"本基金") 於中国证券监督管理委员会 (以下简称"本国证券公司指数分级证券投资基金(以下简称"本国证券公司指数分级证券投资基金进的税股 54 株工 15 基金 15 美工 15 生产 16 生产 17 生产 18 生产

国证监会参案、《翻华中证金相证参与而非数分局证率的设备金融金合同》,于2015年5月,6日正正,4位、混金合用数日的基金的影影等,103979。224.11分组合6份。其中以简金和显示6名7、066.16 份适金份额。未发验的基金管理多种。2015年5月,6日正正,406.16 份适金份额。未发验的基金管理多种。2011年20、2012年5月,1030年6月,

7.4.2 会计报表的编制基础 未基金的转分报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的(企业会计准则产基本准则)。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《证券投资基金信息报案 XBRL 粮废第3号《年度设务和半年度报告》),中国证券投资基金业协会(以下商标·中国基金业协会)新的《证券投资基金》的《证券投资基金》的《证券投资基金》的《证券投资基金》的《证券投资基金》的《证券投资基金》的《证券投资基金》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》》的《证券投资》的《证券发表》的《证券发 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

基金管理人的股东

上年度可比期间 2015年5月6日(基金合同生效日)至2015年12月31 关联方名称 图信证券 7.4.8.1.2 债券交

7.4.8.1.3 债券回购交易 7.4.8.1.4 权证交易 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金 本期 2016年 1 月 1 日至 2016年 12 月 31 日 期末应付佣金余额 关联方名称

图证证 89、5950 764% 775, 1987. 1 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 12,823,81492 11,399,08055

天教。
(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 基础版一定比例的客户库护费,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。
74.8.2.2 基金托管费

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5月6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	2, 821, 239.23	2, 287, 793.26			
法:支付基金托管人中填建设银行的托管费早费率为 0.22%,逐日计量,按月支付。日托管费 = 一月基金资净净值 × 0.22% 当年天数。 7.4.8.2.3 销售服务费 注: 元。 7.4.8.3 与关联方进行银行间回业市场的债券(会回购)交易 注: 元。 7.4.8.4 与关联方进守板后					
7-48.4 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。					

关联方名称	2016年12	т. Л 31 ⊞	2015年 1		
7040.72-0149	持有的 基金份額	持有的基金份額 占基金总份額的比例	持有的 基金份額	持有的基金份額 占基金总份額的比例	
国信证券股份有限公 司		0.0000	% 767, 100.00	0.0204%	
	侵告期末除基金管理人 《方保管的银行存款余			基金份額。	
7.4.0.0 E X4	C/J 14: IB 10 BC 11 17: BC 30	180 (20, 11 991) 12 11 2	THEN	单位:人民币	π
关联方	本期 2016年1月1日至2016	6年12月31日	上年度可比 2015年5月6日(基金合同生類	七期间 (日)至 2015年 12 月 31 日	

				単位:人民市	
关联方 名称	本月 2016年 1 月 1 日至 2	別 1016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
6110	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收人	
中国建设银行	35, 986, 552.50	648, 125.79	301, 855, 488.81	2, 052, 677.97	
注:无。	金在承销期内参与关		况		
7.4.8.7 其他 5 无。	关联交易事项的说明				
7.4.9 期末(20	016年12月31日)				

 证券
 证券
 成功
 可液速
 液通受
 认购
 期末估值
 数量
 期末
 期末估值

 代司
 名称
 认购日
 日
 股类型
 价格
 单价
 (单位、股)
 或本品额
 基本品额

7.4.8.7 兵恺大联父	· 约 \$P ·贝 [17] [22 [9]	
无。		
7.4.9 期末(2016年	12月31日)本基金持有的流通受限	证券
	/ 增发证券而于期末持有的流通受限	

17.69	-6310	NORTH IN	3-4	196 (4) (16)	D1 102	4-11	(TEL100)	100 100 100	191	l
601375	中原证券	2016年 12 月 20 日	2017年 1月3 日	折 股 液 通受限	4.00	4.00	26, 695	106, 780.00	106, 780.00	-
603228	景 旺 电子	2016年 12 月 28 日	2017年 1月6 日	新 股 流 通受限	23.16	23.16	3, 117	72, 189.72	72, 189.72	-
603877	太平岛	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	折 股 流 通受限	40.29	4029	1, 582	63, 738.78	63, 738.78	-
603689	皖 天 然气	2016年 12 月 30 日	2017年 1月10 日	折 股 液 通受限	7.87	7.87	4, 818	37, 917.66	37, 917.66	-
603035	意 熟 前汽	2016年 12 月 27 日	2017年 1月5 日	折 股 液 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	折 股 液 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	道思股份	2016年 12 月 28 日	2017年 1月6 日	折 股 液 通受限	15.28	1528	681	10, 405.68	10, 405.68	-
603186	华 王 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	折 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	折 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	照 菱 信息	2016年 12 月 27 日	2017年 1月5 日	折 股 流 通受限	4.94	4.94	1, 380	6, 817.20	6,817.20	
7.4.9).2 期	末持有的	暂时包	戶牌等流	通受限	股票			全额的位	A FR si

			H	通受限			1, 380	6,817.2	0 6,817.2	
7.4.9	.2 期 :	₹持有I	的暂时任	亨牌等流	通受阿	艮股票			金額单位	人:
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 成本总額	期末估值总额	各
000166	申万宏	2016年 12月 21日	重大事項	6.25	2017 年 1 月 26 日	629	3, 872, 926	28, 457, 029.80	24, 205, 787.50	
000750	田海证券	2016年 12月 15日	重大事項	6.97	2017 年 1 月 20 日	627	1, 920, 584	15, 245, 934.96	13, 386, 470.48	-

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 8.1 期末基金资产组合情况 \$ 8 投资组合报告

序号	項目	金額	占基全总资产的比例 (%)
1	权益投资	653, 595, 997.74	94.72
	其中:股票	653, 595, 997.74	94.7
2	固定收益投资		
	其中:债券		
	资产支持证券		
3	贵金属投资	-	
4	金融衍生品投资		
5	买人返售金融资产		
	其中:买新式回购的买人返售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	36,000,830.80	5.2
7	其他各项资产	460, 244.11	0.0
8	合计	690, 057, 072,65	100.0

			金額单位
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值 (%)
Α	农、林、牧、渔业	-	
В	采矿业	-	
С	制造业	-	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	
Ε	建筑业	-	
F	批发和零售业	-	
G	交通运输、仓储和邮政业	-	
Н	住宿和餐饮业	-	
1	信息传输、软件和信息技术服务业	-	
J	金融业	647, 063, 036.23	
K	房地产业	-	
L	租赁和尚务服务业	-	
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业		
0	居民服务、修理和其他服务业		
Р	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业	-	
S	综合	-	
	合计	647, 063, 036.23	

金额单位:人民币元

2016年年度报告摘要

祠	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
Α	衣、林、牧、差业		-
В	采矿业		-
С	制造业	731, 000.74	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37, 917.66	0.01
Ε	建筑业	15, 592.23	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
Н	住宿和餐饮业	-	-
1	信息传输、软件和信息技术服务业	241, 692.20	0.04
J	소원호	5, 497, 300.00	080
K	房地产业	-	-
L	租赁和尚务服务业	-	-
М	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业		-
S	総合		-
	合计	6, 532, 961.51	0.95

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	600837	海通证券	5, 205, 545	81, 987, 333.75	11.92
2	600030	中信证券	5, 062, 943	81, 310, 864.58	11.82
3	601211	因泰君安	2, 943, 002	54, 710, 407.18	7.96
4	601688	华泰证券	2, 101, 064	37, 525, 003.04	5.46
5	000776	广发证券	1, 903, 907	32, 099, 872.02	4.67
6	600958	东方证券	2, 002, 577	31, 100, 020.81	4.52
7	002736	田信证券	1, 582, 660	24, 610, 363.00	3.58
8	000166	申万宏源	3, 872, 926	24, 205, 787.50	3.52
9	600999	招商证券	1, 471, 690	24, 032, 697.70	3.49
10	601377	兴业证券	3, 015, 110	23, 065, 591.50	3.35

	.,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,			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	002797	第一创业	154, 900	5, 390, 520.00	0.78
2	600996	贵广网络	12,500	234, 875.00	0.03
3	603823	百合花	3,762	123, 167.88	0.02
4	601375	中原证券	26, 695	106, 780.00	0.02
5	603228	景旺电子	3, 117	72, 189.72	0.01
站 http:// 8.4 指	//www.phfur 是告期内股票	nd.com 的年度报行 《投资组合的重大	告正文。 变动	明细,应阅读登载于鹏华基 20名的股票明细	金管理有限公司

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	(%)
1	600030	中信证券	153, 284, 576,48	2.62
2	600837	海通证券	136, 896, 316.40	234
3	601377	兴业证券	85, 173, 012.74	1.46
4	601211	国泰君安	70,765,007.98	121
5	601688	华泰亚券	65, 540, 862.64	1.12
6	600958	东方证券	59, 903, 451.45	1.03
7	600999	招尚证券	57, 935, 828.08	0.99
8	000776	广发证券	55, 472, 127.90	0.95
9	002736	国信证券	48,656,923.75	0.83
10	601099	太平洋	47, 316, 789.47	0.81
11	000166	申万宏源	43,846,908.73	0.75
12	000783	长江证券	38, 830, 624.57	98.0
13	002673	西部证券	36, 137, 575.01	0.62
14	601901	方正证券	36, 122, 749.77	0.62
15	600061	围投安信	33, 248, 644.39	0.57
16	601788	光大证券	32, 367, 124.42	0.55
17	601555	东吴证券	31, 562, 724.92	0.54
18	601198	东兴证券	30, 486, 522.83	0.52
19	000712	缩龙股份	30, 118, 186.90	0.52
20	600109	国金证券	29, 220, 459.63	0.50

0.4.2	MC ht locittimes	90 KML LLI 1991 (5-0 Min MC 30C 30C)	14 BE 2700CHQ 20 41107 EX 98 913B	金额单位:人民币:
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	600030	中信证券	737, 336, 650.89	12.62
2	600837	海通证券	637, 273, 57271	10.91
3	601688	华泰证券	304, 856, 697.25	5.22
4	600999	扭商证券	289, 697, 905.53	4.96
5	000776	广发证券	273, 504, 778.35	4.68
6	000166	申万宏源	224, 616, 940.82	3.85
7	601377	共业证券	212, 275, 71322	3.63
8	000783	长江证券	197, 866, 629.19	3.39
9	601901	方正证券	181, 607, 228.23	3.11
10	601211	国泰君安	169, 531, 200.89	2.90
11	002673	西部证券	167, 651, 344.60	2.87
12	601099	太平洋	165, 248, 633.35	2.83
13	601555	东吴证券	154, 930, 183.09	2.65
14	600109	国金证券	134, 375, 641.65	2.30
15	600369	西南证券	132, 707, 267.09	2.27
16	002736	国信证券	129, 705, 379.78	2.22
17	600958	东方证券	127, 588, 162.19	2.18
18	000728	国元证券	120, 996, 576.65	2.07
19	601788	光大证券	119, 739, 135.01	2.05
20	000686	东北证券	94, 372, 47620	1.62

2票收人(或欠)总额 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,不考虑相美交易 。 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合注;无。 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 注:无。 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 在: 2。 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 在: 元。 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

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

8.9 期末接公允价值占基金資产单值比例火力排产的前五名权证投资明明 追求。第10.1 报告期末本基金投资的股指期货息的投资。 6.10.1 报告期末本基金投资的股指期货息的投资。 第10.2 年基金投资的股指期货息的股货票 第10.2 年基金投资的股指期货息的股货票 第10.2 年基金投资的股指期货息的股货票 第10.2 年基金投资的股指期货息的证明,操作股票仓在则需调整的交易成本和跟踪 形式使取得制物的保险和销售机保风险需要的原则,以多期保值力目的,主要选择能动性好、交易活跃 的股指期份合约。本基金力争利用股前期货的比较价度 8.11.1 年期国施自己的总量 第11.2 报告期间,在11.2 报告的总量的。 8.11.2 报告期间。在12.3 报告的总量的。 8.11.2 报告期间。在12.3 报告的总量的,提及的自己的。 8.11.3 未期国债的股赁度指的未包含国债期货投资。 8.11.3 未期国债的股赁度指的未包含国债期货投资。 8.11.3 未期国债的股赁度指的未包含国债期货投资。 8.12.1 报告股票。 8.12.1 报告股票。 8.12.1 报告股票。 8.12.2 报告股票。 8.12.1 报告股票。 8.12.2 报告股票。 8.12.2 报告股票。 8.12.3 报告股票。 8.12.3 报告股票。 8.12.3 报告股票。 8.12.3 报告股票。 8.12.3 报告股票。 8.12.4 报告股票。 8.12.5 报告股票。 8.12.6 报告股票。 8.12.6 报告股票。 8.12.6 报告股票。 8.12.7 报告股票。 8.12.8 报告股票。 9.12.8 报告股票。 9.12.8 报告股票。 9.12.8 报票股票。 10.12.8 报告股票。 9.12.8 报票股票。 10.12.8 报票股票。 10.12.8 报票股票。 10.12.8 报告股票。 10.12.8 报告股票。 10.12.8 报告股票。 10.12.8 报票。 10.12.8 报票股票。 10.12.8 报票股票, 10.12.8 报票股票。 10.12.8 报票。 10.12.8 报

o.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

序号	名称	金額
1	存出保证金	212, 887.29
2	应收证券清算款	58, 830.65
3	应收股利	-
4	应收利息	8, 267.32
5	应收申购款	180, 258.85
6	其他应收款	
7	待摊费用	-
8	共他	-
9	合计	460, 244.11

					金額单位
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
1	000166	申万宏源	24, 205, 787.50	3.52	重大事項
8.12	.5.2 期末形	极投资前五:	名股票中存在流通受限情况	兄的说明	
					金額单位
					322 494 °F* 112
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
序号	股票代码 601375	股票名称 中原证券	液通受限部分的公允价值 106,780.00		

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五人的原因,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

9.1 期本:	公安 (方) 御(行)	日人尸奴及行有	人站构			
						份额单位
				持有	人结构	
份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份	机构投资省		个人投资者	1
	,	额	持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比例
养真指基	10, 272	27, 079.78	36, 650, 776.79	13.18%	241, 512, 699.67	86.82%
赤斑 A 级	508	435, 384.31	199, 912, 509.0	90.39%	21, 262, 723.0	9.61%
非商 B 级	11,541	19, 164.3	19, 302, 019.0	873%	201, 873, 214.0	91.27%
合计	22, 321	32, 279.64	255, 865, 304.79	35.51%	464, 648, 636.67	64.49%
9.2 期末	上市基金前	十名持有人				

9.2 期	末上市基金前十名持有人		
	券直	有指基	
序号	持有人名称	持有份額(份)	占上市总份额比例
1	英大泰和财产保险股份有限公司 - 自有资金	1,087,328.00	10.13%
2	何玄	635, 199.00	5.92%
3	张素珍	635, 188.00	5.92%
4	英大泰和人寿保险股份有限公司—团险万能	612,809.00	5.71%
5	王瑛	404, 119.00	3.77%
6	张晓峰	263, 863.00	2.46%
7	李少岳	261, 653.00	2.44%
8	林毅红	227, 602.00	2.12%
9	瑞士信贷(香港)有限公司	200,000.00	1.86%
10	27 (6 %	161 64700	4 540/

10	张宇英	161, 647.00	1.51%
	券直	FA級	
序号	持有人名称	持有份額(份)	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红 - 个人分红	55, 394, 429.00	25.05%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险 产品	47, 954, 051.00	21.68%
3	英大泰和人寿保险股份有限公司—团险万能	16, 907, 761.00	7.64%
4	中国银河证券股份有限公司	16, 186, 155.00	7.32%
5	李怡名	12, 944, 861.00	5.85%
6	上海明底投资管理有限公司一明底 CTA 五号私慕投资 基金	8,000,000.00	3.62%
7	百年人寿保险股份有限公司一万能保险产品	6, 224, 305.00	2.81%
8	中信证券—农行—中信证券保盈量化 1 号集合资产管 理计划	5, 558, 204.00	2.51%
9	富国基金一广州农商银行一民生证券股份有限公司	5,000,000.00	2.26%
10	富田基金-田泰君安证券-共业財富资产管理有限公 司	3,950,618.00	1.79%

序号	持有人名称	持有份額(份)	占上市总份额比
1	李怡名	12, 319, 751.00	
2	中国石油天然气集团公司企业年金计划—中国工商银 行股份有限公司	10, 215, 502.00	
3	刘军	3,714,873.00	
4	林升理	2,998,000.00	
5	上海明汯投资管理有限公司一明汯全天候一号基金	2, 339, 441.00	
6	郭培	2, 256, 420.00	
7	郭梓峰	2, 188, 001.00	
8	张焕廷	1,825,482.00	
9	唐中明	1,793,633.00	
10	衰速折	1,700,000.00	

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 注:截止米程序期末、基金管理见所有从业人局未持有本基金份额。 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 注:(1)本公司或偿管理人员、基金研究部门负责人本报告期末未持有本基金份额。 (2)本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。 § 10 开放式基金份额变动

358, 183, 733.11 336, 303, 495.00 336, 303, 496.0 736, 176, 877.06 3, 759, 777, 480.00 3, 759, 777, 481.0 6, 011, 739, 30299 3, 814, 411, 629.26 - 3, 538, 602, 248.00 - 3, 538, 602, 248.0 221, 175, 232.00 221, 175, 233.0 278, 163, 476.46 順之间的配对转換份 § 11 重大事件揭示

11.1 基金(份額持有人大会决议
本基金本报告期内	为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,因 并经本公司股东分 Vismara 先生任事 报告期内,原 意由 Sandro Vesp 日起。 经公司董事会 本公司已将上	从从原生人类型会) 经数方原品等产品。原要 Alessandro Variado 先生不同任任公司信息符合,是现在这种信息主席广告程序协会间语言 参考区域上,现金 Andrew Visman 生生任在公司信息,Alessandro Variado 先生不再担任公司信息等形态。Andre 旧程的2006年2月 2日起,同意等形态,但就是这种情况也不同时,是可能是一个企业的企业的企业。 显著 Andrew Visman 走生自去公司信息符合,是现在的成功的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的企业的
11.3 涉及;	基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情态

金额单位:人民币5

本基金閏月人基长程人級及托管业务科购及其高管理利用在报告制约未受到任何籍查或处罚。 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

中信確投	2	1, 301, 569, 722.28	21.31%	1, 186, 118,04	21.31%	
中泰证券	2	1, 240, 489, 105.58	20.31%	1, 130, 454,60	20.31%	-
中航证券	2	1, 109, 066, 210.74	18.16%	1, 010, 691.18	18.16%	-
海通证券	2	739, 975, 823.24	12.12%	674, 335.89	12.12%	本报告期前 增1个
方正证券	1	431, 624, 616.55	7.07%	393, 343.54	7.07%	All 1-7:
田信证券	2	355, 202, 948.24	5.82%	323, 697.09	5.82%	本报告期前 增1个
长江证券	1	281, 076, 526.14	4.60%	256, 137.12	4.60%	-
中金公司	2	223, 519, 574.83	3.66%	203, 694,46	3.66%	本报告期新 增1个
方财富证券	1	109, 863, 196.62	1.80%	100, 115.07	1.80%	本报告期制
光大证券	- 1	72, 593, 735.94	1.19%	66, 150.04	1.19%	
华创证券	1	54, 247, 174.78	0.89%	49, 427.84	0.89%	
平安证券	2	36, 437, 297.76	0.60%	33, 206.19	0.60%	
共业证券	- 1	35, 616, 007.28	0.58%	32, 457.70	0.58%	
田泰君安	2	33, 008, 092.70	0.54%	30,080.04	0.54%	
天风证券	1	24, 050, 043.55	0.39%	21, 917.40	0.39%	-
长城证券	1	23, 734, 799.35	0.39%	21,629.45	0.39%	-
安信证券	2	23, 403, 575.80	0.38%	21, 32720	0.38%	-
招商证券	1	11, 042, 586.48	0.18%	10,048.56	0.18%	-
德邦证券	1					本报告期制措
中技证券	1			-		
西部证券	1					本报告期新
瑞银证券	1	-				本报告期制
田金正券	1			-		
华西证券	1					
中信证券	1					
银河证券	1					
宏源证券	1					
湘财证券	1					
东方证券	1					
广发证券	1					
瑞信方正	1					本报告期部

(1)基金管理人负债差释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,选择的标础是。 1次表力编厚,信誉程序;提带资本不少于3亿元人民币。 2)财务状反任务,基则财务指标显示公司签收收风稳定。 3)经营行为规范,截近二年来因重大进规行为而受到中国证监会处罚。 4)内部管理规范,"格,其备债金的时间制度,并能满足益金担价高度保密的要求。 5)具备基金运作所需的效、资金的细讯保养、及动能排符合代理本基金进行证券交易的需要。

	194 50*	A-10	04 52 65 8	3.A.W	14.60.7	C 00
赤阎名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券回 购 成交总额的比 例	成交金額	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-		
中泰证券	-	-	-	-		
中航证券	-	-	-	-		
海通证券	-	-	-	-		
方正证券	-	-	-	-		
因信证券						
长江证券						
中金公司	-		-			
东方财富证券	-		-			
光大证券	-		-	-		
华创证券	-		-	-		
平安证券	-	-	-	-		
兴业证券	-	-	-	-		
因泰君安	-	-	-	-		
天风证券	-	-	-	-		
长城证券	-	-	-	-		
安信证券	-	-	-	-		
招尚证券	-	-	-	-		
德邦证券	-					
中投证券	-		-	-		
西部证券	-		-	-		
瑞银证券	-		-	-		
国金证券	-	-	-	-		
华西证券	-			-	-	
中信证券	-	-	-	-		
银河证券	-	-	-	-		
宏源证券	-	-	-	-		
湘财证券			-	-		
东方证券	-	-	-	-		
广发证券	-	-	-	-		
瑞信方正	-					