

# 鹏华丰泽债券型证券投资基金(LOF)2016 年年度报告摘要

2016年12月31日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                 |
|--------------|-----------------|
| 基金简称         | 鹏华丰泽债券(LOF)     |
| 场内简称         | 鹏华丰泽            |
| 基金主代码        | 160618          |
| 交易代码         | 160618          |
| 前端交易代码       | -               |
| 后端交易代码       | -               |
| 基金运作方式       | 上市开放式基金(LOF)    |
| 基金合同生效日      | 2011年12月8日      |
| 基金管理人        | 鹏华基金管理有限公司      |
| 基金托管人        | 中国邮政储蓄银行股份有限公司  |
| 报告期末基金份额总额   | 267,263,742.82份 |
| 基金合同存续期      | 不定期             |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所         |
| 上市日期         | 2014年12月25日     |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在适度控制风险的基础上，通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断，力争获取信用溢价，以最大程度上取得超越基金业绩比较基准的收益。   |
| 投资策略   | 本基金债券投资将主要采取信用策略，同时辅之以久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略，在适度控制风险的基础上，通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断，力争获取信用溢价，以最大程度上取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债总指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。   |

### 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            | 中国邮政储蓄银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 张戈                    | 田东辉                  |
|         | 联系电话 | 0755-82825720         | 010-68858113         |
|         | 电子邮箱 | zhangge@phfund.com.cn | tiantonghui@psbc.com |

|        |               |              |
|--------|---------------|--------------|
| 客户服务电话 | 4006788999    | 95580        |
| 传真     | 0755-82021126 | 010-68858120 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.phfund.com">http://www.phfund.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司                  |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016 年         | 2015 年         | 2014 年           |
|---------------|----------------|----------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 24,686,748.68  | 63,002,256.09  | 115,241,579.69   |
| 本期利润          | 20,982,299.18  | 39,323,241.27  | 214,286,602.87   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0381         | 0.0701         | 0.1663           |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.87%          | 7.52%          | 14.81%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末        | 2015 年末        | 2014 年末          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.3883         | 0.3442         | 0.2528           |
| 期末基金资产净值      | 301,498,221.50 | 437,054,242.82 | 1,429,721,888.02 |
| 期末基金份额净值      | 1.128          | 1.086          | 1.010            |

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

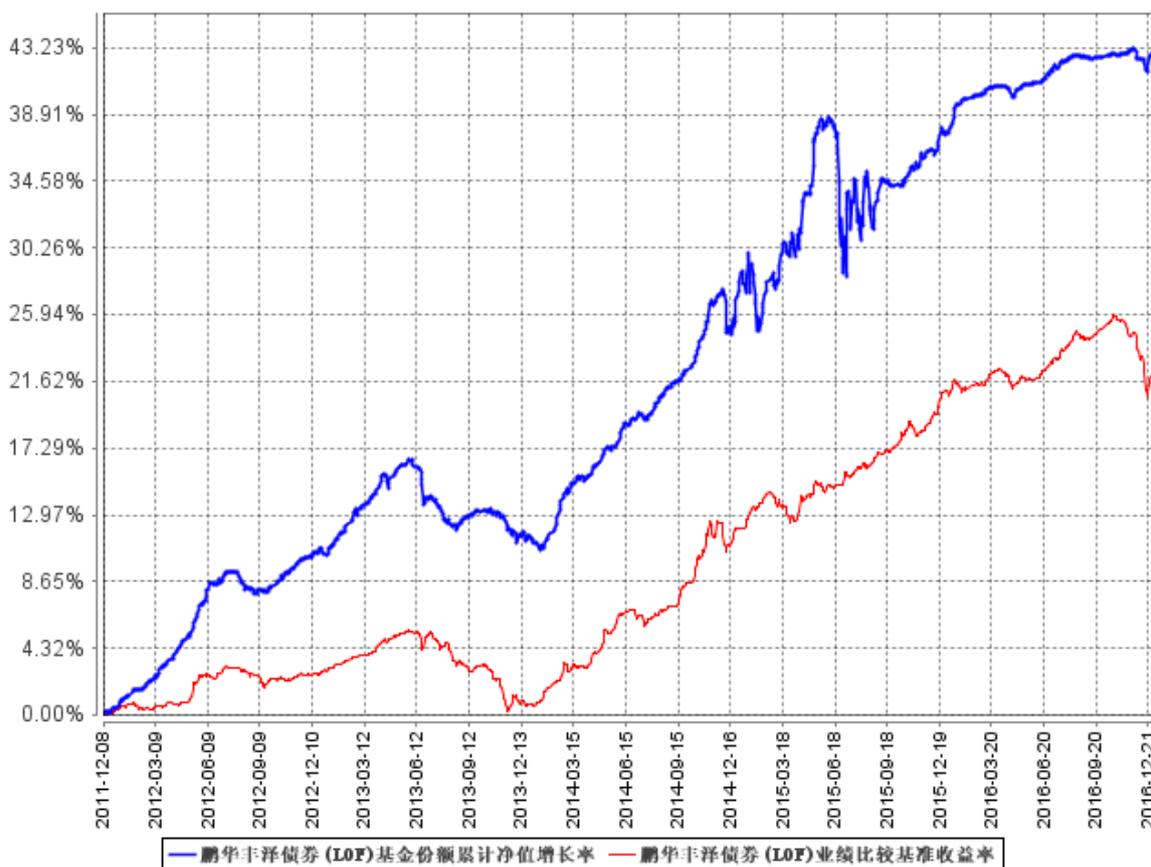
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.27%    | 0.09%       | -1.94%     | 0.20%         | 2.21% | -0.11% |

|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月      | 0.98%  | 0.07% | -0.05% | 0.15% | 1.03%  | -0.08% |
| 过去一年       | 3.87%  | 0.07% | 1.30%  | 0.12% | 2.57%  | -0.05% |
| 过去三年       | 28.22% | 0.32% | 21.72% | 0.13% | 6.50%  | 0.19%  |
| 过去五年       | 42.27% | 0.26% | 22.15% | 0.12% | 20.12% | 0.14%  |
| 自基金合同生效起至今 | 42.98% | 0.26% | 22.61% | 0.12% | 20.37% | 0.14%  |

注：业绩比较基准为中债总指数收益率。

### 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

鹏华丰泽债券(LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

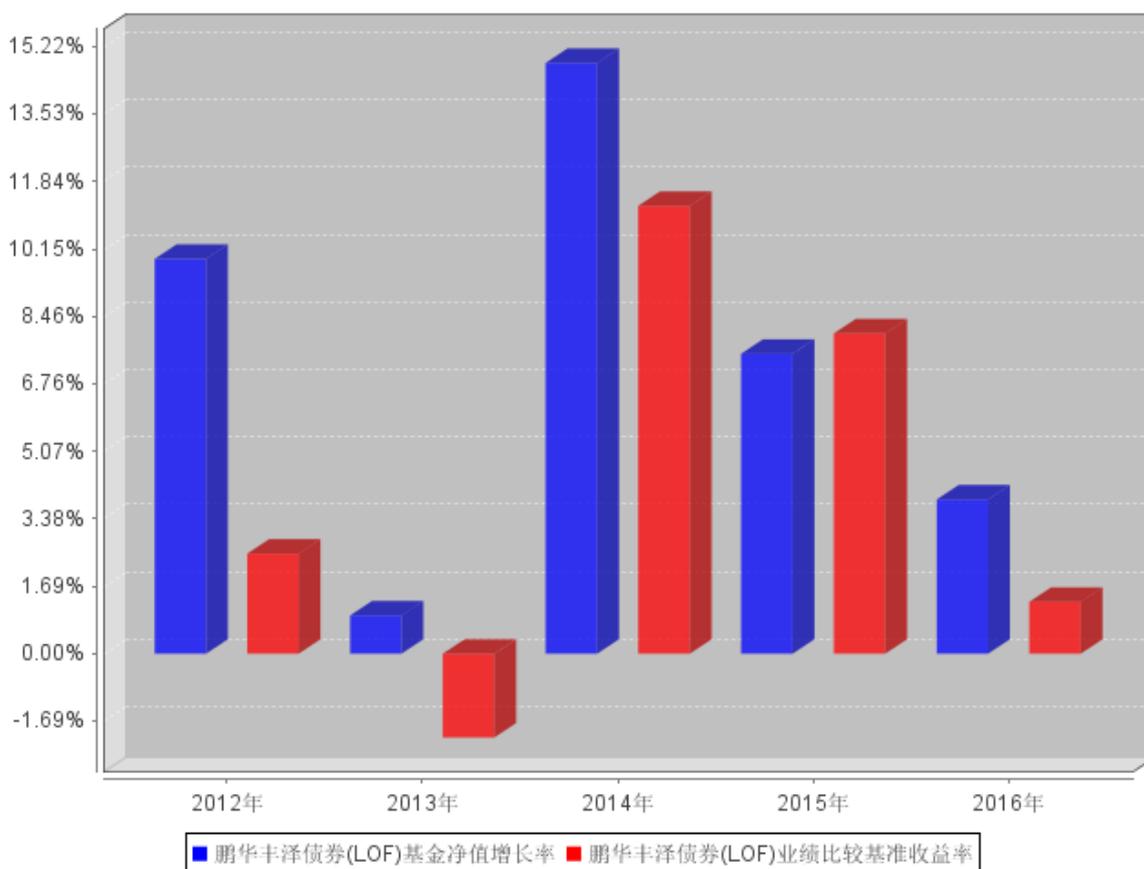


注：1、本基金合同于2011年12月8日生效。

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 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

鹏华丰泽债券(LOF)过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：截至本报告期末，本基金未进行利润分配。

## § 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

| 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      |        |  |
| 戴钢  | 本基金基金经理 | 2011年12月8日      | 2016年2月4日 | 14     | 戴钢先生，国籍中国，经济学硕士，14年证券从业经验。曾就职于广东民安证券研究发展部，担任研究员；2005年9月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任债券研究员、专户投资经理等职；2011年12月至2016年2月担任鹏华丰泽债券(LOF)基金基金经理，2012年6月起担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2012年11月起兼任鹏华丰和债券(LOF)基金基金经理，2013年9月起兼任鹏华丰实定期开放债券基金基金经理，2013年9月起兼任鹏华丰泰定期开放债券基金基金经理，2013年10月起兼任鹏华丰信分级债券基金基金经理，2016年3月起兼任鹏华丰尚定期开放债券基金基金经理，现同时担任绝对收益投资部副总经理。戴钢先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，戴钢不再担任本基金基金经理，由周恩来担任本基金基金经理。 |
| 周恩来 | 本基金基金经理 | 2016年2月4日       | -         | 4      | 周恩来先生，国籍中国，经济学博士，4年金融证券从业经验。2012年6   |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资研究工作，担任固定收益部基金经理助理/高级债券研究员，2016年2月起担任鹏华丰泽债券(LOF)基金基金经理，2016年2月起兼任鹏华弘泽混合基金基金经理，2016年9月起兼任鹏华丰饶定期开放债券、鹏华弘腾混合、鹏华弘康混合基金基金经理，2016年10月起兼任鹏华弘尚混合基金基金经理。周恩源先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，戴钢不再担任本基金基金经理，由周恩源担任本基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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《证券投资基金管理人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年债券市场大起大落，波动幅度极大，全年中债总财富指数上涨1.30%，其中，3、4月份受信用风险事件影响，11、12月份受资金紧张与金融监管政策加强影响均出现阶段性大幅下跌，年中在英国脱欧、资金宽松的背景下，债市出现阶段性上涨行情。

在债券资产的配置上，本基金以中短期中高等级信用债为主，在债市大幅下跌的过程中表现较为稳健，此外，在年中本基金阶段性增加了长期利率债持仓，提升了组合久期，从而在收益率下行过程中获得了较好的回报。

### 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3.87%，同期业绩基准增长率为1.30%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年经济增速有望基本保持稳定，年内可能呈前高后低的走势。总需求方面：1)消费有望保持稳定；2)出口可能因前期人民币实际有效汇率的贬值而在一季度有阶段性改善，但其后仍面临较大不确定性；3)投资方面，制造业投资增速有望因企业利润改善而保持稳定，房地产投资增速大概率因调控政策持续而有所下滑，基建投资则可能基本保持去年力度。考虑到房地产调控政策与货币政策调控对实体经济的滞后效应，预计2017年下半年经济走势可能弱于上半年。

债券市场方面，预计总体仍然呈震荡市。一方面，在当前货币政策名义稳健中性、实际边际收紧，以及金融监管政策逐步加码的情况下，预计债市仍然面临调整压力。另一方面，随着债市

收益率上行, 以及下半年可能出现经济走弱, 年内仍有望看到债市风险收益比较好的投资时点。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责, 基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体, 独立建账、独立核算, 保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理; 每日按时接收成交数据及权益数据, 进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式, 每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对; 每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外, 还设有基金会计复核岗位, 负责基金会计核算的日常事后复核工作, 确保基金净值核算无误。

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

###### (2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定, 本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组, 成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论, 发表相关意见和建议, 与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末, 本基金期末可供分配利润为 103, 780, 966. 44 元, 期末基金份额净值 1. 128 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

#### **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**

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在鹏华丰泽债券型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### **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**

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## **§ 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：鹏华丰泽债券型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2016年12月31日         | 上年度末<br>2015年12月31日         |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                            |                             |
| 银行存款            |            | 5,098,505.31               | 5,112,429.73                |
| 结算备付金           |            | 6,706,141.22               | 40,749,016.79               |
| 存出保证金           |            | 49,892.51                  | 205,611.28                  |
| 交易性金融资产         |            | 356,499,231.20             | 780,271,464.70              |
| 其中：股票投资         |            | -                          | -                           |
| 基金投资            |            | -                          | -                           |
| 债券投资            |            | 356,499,231.20             | 780,271,464.70              |
| 资产支持证券投资        |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产          |            | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        |            | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         |            | 60,092,222.20              | 49,637,976.86               |
| 应收利息            |            | 8,210,022.18               | 17,198,318.10               |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | 15,868.60                  | 161,074.31                  |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            |            | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 436,671,883.22             | 893,335,891.77              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2015年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                            |                             |
| 短期借款            |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          |            | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 74,100,000.00              | 453,700,000.00              |
| 应付证券清算款         |            | 40,019,533.41              | 1,412,158.15                |
| 应付赎回款           |            | 20,096,695.30              | 239,394.17                  |
| 应付管理人报酬         |            | 217,470.05                 | 270,381.02                  |
| 应付托管费           |            | 62,134.31                  | 77,251.71                   |
| 应付销售服务费         |            | 108,735.05                 | 135,190.49                  |
| 应付交易费用          |            | 5,227.65                   | 2,000.00                    |
| 应交税费            |            | -                          | -                           |
| 应付利息            |            | 19,852.60                  | 13,755.10                   |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            |            | 544,013.35                 | 431,518.31                  |
| 负债合计            |            | 135,173,661.72             | 456,281,648.95              |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            |            | 195,318,317.80             | 294,172,592.89              |

|            |  |                |                |
|------------|--|----------------|----------------|
| 未分配利润      |  | 106,179,903.70 | 142,881,649.93 |
| 所有者权益合计    |  | 301,498,221.50 | 437,054,242.82 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 436,671,883.22 | 893,335,891.77 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.128 元，基金份额总额 267,263,742.82 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华丰泽债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号       | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|-----------|---|--|
| <b>一、收入</b>                |           | 31,835,152.01                             | 53,287,158.69                                  |
| 1. 利息收入                    |           | 36,028,403.81                             | 48,527,551.08                                  |
| 其中：存款利息收入                  |           | 440,213.10                                | 1,526,225.70                                   |
| 债券利息收入                     |           | 35,165,323.83                             | 46,127,300.06                                  |
| 资产支持证券利息收入                 |           | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入                 |           | 422,866.88                                | 874,025.32                                     |
| 其他利息收入                     |           | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |           | -596,739.60                               | 28,410,595.01                                  |
| 其中：股票投资收益                  |           | -   | 13,759,202.96                                  |
| 基金投资收益                     |           | -   | -  |
| 债券投资收益                     |           | -596,739.60                               | 14,651,392.05                                  |
| 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）     |           | -3,704,449.50                             | -23,679,014.82                                 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |           | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         |           | 107,937.30                                | 28,027.42                                      |
| <b>减：二、费用</b>              |           | 10,852,852.83                             | 13,963,917.42                                  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.8.2.1 | 4,328,159.83                              | 4,155,520.73                                   |
| 2. 托管费                     | 7.4.8.2.2 | 1,236,617.06                              | 1,187,291.63                                   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.8.2.3 | 2,164,079.90                              | 2,077,760.30                                   |
| 4. 交易费用                    |           | 22,352.39                                 | 775,920.82                                     |
| 5. 利息支出                    |           | 2,642,693.65                              | 5,318,423.94                                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |           | 2,642,693.65                              | 5,318,423.94                                   |
| 6. 其他费用                    |           | 458,950.00                                | 449,000.00                                     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | 20,982,299.18                             | 39,323,241.27                                  |
| 减：所得税费用                    |           | -   | -  |

|                   |  |               |               |
|-------------------|--|---------------|---------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 20,982,299.18 | 39,323,241.27 |
|-------------------|--|---------------|---------------|

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华丰泽债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>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）                        | 294,172,592.89                   | 142,881,649.93  | 437,054,242.82    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 20,982,299.18   | 20,982,299.18     |
| 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）      | -98,854,275.09                   | -57,684,045.41  | -156,538,320.50   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 528,918,398.05                   | 276,192,392.21  | 805,110,790.26    |
| 2. 基金赎回款                               | -627,772,673.14                  | -333,876,437.62 | -961,649,110.76   |
| 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）                        | 195,318,317.80                   | 106,179,903.70  | 301,498,221.50    |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 1,034,417,074.57                 | 395,304,813.45  | 1,429,721,888.02  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 39,323,241.27   | 39,323,241.27     |
| 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）      | -740,244,481.68                  | -291,746,404.79 | -1,031,990,886.47 |

|  |                 |                 |                   |
|--|-----------------|-----------------|-------------------|
| 其中：1. 基金申购款                            | 103,145,355.58  | 46,658,804.91   | 149,804,160.49    |
| 2. 基金赎回款                               | -843,389,837.26 | -338,405,209.70 | -1,181,795,046.96 |
| 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）                        | 294,172,592.89  | 142,881,649.93  | 437,054,242.82    |

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：

|                                |                               |                                |
|--------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| <u>          邓召明          </u> | <u>          高鹏          </u> | <u>          郝文高          </u> |
| 基金管理人负责人                       | 主管会计工作负责人                     | 会计机构负责人                        |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鹏华丰泽分级债券型证券投资基金(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[2011]1707号《关于核准鹏华丰泽分级债券型证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型证券投资基金,存续期限不定。本基金自2011年11月2日至2011年12月2日期间公开发售,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,897,311,225.52元,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入1,100,365.38元,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(2011)第448号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金合同》于2011年12月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,898,411,590.90份基金份额,其中认购资金利息折合1,100,365.38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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金《基金合同》生效之日起3年内,本基金通过基金收益分配的安排,将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别,即丰泽A基金份额(基金份额简称“丰泽A”)和丰泽B基金份额(基金份额简称“丰泽B”)。除收益分配、基金合同终止时的基金清算财产分配和基金转换运作方式时的基金份额折算外,每份丰泽A和每份丰泽B享有同等的权利和义务。丰泽A和丰泽B分别募集并按照基金合同约定的比例进行初始配比,所募集的两级基金的基金资产合并运作。其中,丰泽A根据《基金合同》的规定获取约定收益,并自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,接受申购与赎回,在丰泽A

的每次开放日，基金管理人将对丰泽 A 进行基金份额折算，丰泽 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的丰泽 A 份额数按折算比例相应增减；本基金在扣除丰泽 A 的应计收益后的全部剩余收益归丰泽 B 享有，亏损以丰泽 B 的资产净值为限由丰泽 B 承担；丰泽 B 在《基金合同》生效后封闭运作，封闭期为 3 年。3 年届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

经深圳证券交易所深证上[2011]383 号文审核同意，丰泽 B 基金份额于 2011 年 12 月 26 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据基金合同的规定及本基金的基金管理人发布的《鹏华丰泽分级债券型证券投资基金分级运作期届满与基金份额转换的公告》，本基金的封闭期自 2011 年 12 月 8 日（基金合同生效日）起至 2014 年 12 月 8 日止。自 2014 年 12 月 9 日起，鹏华丰泽分级债券型证券投资基金自动转为上市开放式基金（LOF），并更名为鹏华丰泽债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“鹏华丰泽债券基金（LOF）”）。于 2014 年 12 月 8 日，本基金的基金管理人将根据丰泽 A 和丰泽 B 基金份额转换比例对基金份额持有人基金份额转换日登记在册的基金份额实施转换。以份额转换后 1.000 元的基金份额净值为基准，丰泽 A、丰泽 B 按照各自的基金份额净值转换成鹏华丰泽债券基金（LOF）份额。丰泽 A、丰泽 B 的场外份额将转换为鹏华丰泽债券基金（LOF）场外份额，丰泽 B 的场内份额将转换为鹏华丰泽债券基金（LOF）场内份额。转换后，基金份额持有人持有的基金份额数将按照转换规则相应增加或减少。《鹏华丰泽分级债券型证券投资基金基金合同》中除仅适用于鹏华丰泽分级债券型证券投资基金的条款外，继续适用于转换后的鹏华丰泽债券基金（LOF）。

根据深交所深证上[2014]454 号《终止上市同意书》，原鹏华丰泽分级债券型证券投资基金于 2014 年 12 月 8 日终止上市权利登记。根据深交所深证上[2014]476 号文审核同意，鹏华丰泽债券基金（LOF）362,169,362.00 份额 2014 年 12 月 25 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过本基金代销机构赎回或通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

本基金的投资范围主要为固定收益类品种，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、债券回购等。本基金不直接买入股票、权证等权益类金融工具，因所持可转换公司债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证，在其可上市交易后不超过 10 个交易日的时间内卖出。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金对包含金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券等在内的非国家信用债券的投资比例不低于基金资产的 80%；分级运作期内对主体信用

评级为 AA+、AA、AA-级别的金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券等在内的非国家信用债券的投资比例不低于基金投资上述债券资产的 80%（分级运作期届满后不受此限制）；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金整体的业绩比较基准为：中债总指数收益率。

#### **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》、《鹏华丰泽债券型证券投资基金（LOF）基金合同》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

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

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

##### **7.4.4.1 会计政策变更的说明**

无。

##### **7.4.4.2 会计估计变更的说明**

无。

#### **7.4.5 差错更正的说明**

无。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策

的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                      | 与本基金的关系         |
|----------------------------|-----------------|
| 鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）       | 基金管理人、基金销售机构    |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”） | 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           | 基金管理人的股东        |

|                              |           |
|------------------------------|-----------|
| (Eurizon Capital SGR S.p.A.) |           |
| 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                    | 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  | 4,328,159.83          | 4,155,520.73          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 246,825.12            | 272,561.32            |

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 0.70%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.70%÷当年天数。

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

客户维护费从基金管理费中列支。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                    | 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 | 1,236,617.06          | 1,187,291.63          |

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行的托管费年费率为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。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

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        | 1,749,513.62          |
| 国信证券          | 102.67                |
| 邮政储蓄银行        | 129,328.35            |
| 合计            | 1,878,944.64          |
| 获得销售服务费各关联方名称 | 上年度可比期间               |
|               | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
|               | 当期发生的基金应支付的销售服务费      |
| 鹏华基金公司        | 1,529,399.51          |
| 国信证券          | 116,234.98            |
| 邮政储蓄银行        | 236,812.75            |
| 合计            | 1,882,447.24          |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.35%的年费率计提，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日基金资产净值×0.35%÷当年天数。

#### 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     |
| 中国邮政储蓄银行              | -      | -    | -     | -    | 100,000,000.00 | 5,729.45 |
| 上年度可比期间               |        |      |       |      |                |          |

| 2015年1月1日至2015年12月31日      |        |      |                |           |       |      |
|----------------------------|--------|------|----------------|-----------|-------|------|
| 银行间市场<br>交易的<br>各关联方名<br>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 |
| 中国邮政储蓄<br>银行               | -      | -    | 140,000,000.00 | 12,582.60 | -     | -    |

#### 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

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（2011年12月8日）持有的基金份额 | -                     | -                     |
| 期初持有的基金份额                  | 27,085,662.92         | 27,085,662.92         |
| 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                  | 27,085,662.92         | 27,085,662.92         |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例          | 10.1344%              | 6.7292%               |

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。

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

注：本基金本报告期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。

##### 7.4.8.5 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                    |            | 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     |
| 中国邮政储蓄<br>银行 | 5,098,505.31          | 190,849.45 | 5,112,429.73          | 260,718.81 |

**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：无。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

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

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**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 74,100,000.00 元，于 2016 年 1 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

**§ 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<br>(%) |
|----|---------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资    | -              | -                |
|    | 其中：股票   | -              | -                |
| 2  | 固定收益投资  | 356,499,231.20 | 81.64            |
|    | 其中：债券   | 356,499,231.20 | 81.64            |
|    | 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      | 11,804,646.53  | 2.70   |
| 7 | 其他各项资产            | 68,368,005.49  | 15.66  |
| 8 | 合计                | 436,671,883.22 | 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

注：无。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：无。

## 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

注：无。

### 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

注：无。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：无。

## 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      | 74,281,500.00  | 24.64        |
|    | 其中：政策性金融债 | 74,281,500.00  | 24.64        |
| 4  | 企业债券      | 211,862,731.20 | 70.27        |
| 5  | 企业短期融资券   | 50,253,000.00  | 16.67        |
| 6  | 中期票据      | 20,102,000.00  | 6.67         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |

|    |      |                |        |
|----|------|----------------|--------|
| 8  | 同业存单 | -              | -      |
| 9  | 其他   | -              | -      |
| 10 | 合计   | 356,499,231.20 | 118.24 |

### 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  | 140401 | 14 农发 01 | 500,000 | 50,065,000.00 | 16.61        |
| 2  | 112074 | 12 华茂债   | 258,740 | 26,037,006.20 | 8.64         |
| 3  | 112045 | 11 宗申债   | 250,000 | 25,522,500.00 | 8.47         |
| 4  | 136721 | 16 中石 01 | 250,000 | 24,402,500.00 | 8.09         |
| 5  | 122782 | 11 宁农债   | 198,100 | 20,560,799.00 | 6.82         |

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

#### 8.10.3 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。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

本基金投资的前十名证券中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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 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   | 49,892.51     |
| 2  | 应收证券清算款 | 60,092,222.20 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 8,210,022.18  |
| 5  | 应收申购款   | 15,868.60     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 68,368,005.49 |

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 8.11.6 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
|-------|-----------|----------------|------------|---------------|------------|
| 2,862 | 93,383.56 | 216,082,560.36 | 80.85%     | 51,181,182.46 | 19.15%     |

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                           | 持有份额（份）       | 占上市总份额<br>比例 |
|----|---------------------------------|---------------|--------------|
| 1  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品       | 19,655,692.00 | 32.86%       |
| 2  | 工银瑞信基金公司—农行—中国农业银行离退休人员福利负债     | 16,205,464.00 | 27.09%       |
| 3  | 中国农业银行股份有限公司企业年金计划—中国银行股份有限公司   | 14,725,013.00 | 24.62%       |
| 4  | 中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限   | 5,479,012.00  | 9.16%        |
| 5  | 安盛天平财产保险股份有限公司—自有资金             | 2,455,823.00  | 4.11%        |
| 6  | 中国民生银行股份有限公司企业年金计划—中国民生银行股份有限公司 | 350,972.00    | 0.59%        |
| 7  | 工银瑞信基金公司—建行—中国建设银行股份有限公司        | 332,373.00    | 0.56%        |
| 8  | 黄贤民                             | 158,015.00    | 0.26%        |
| 9  | 中铁快运股份有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司   | 91,884.00     | 0.15%        |
| 10 | 金挺                              | 35,523.00     | 0.06%        |

注：持有人为场内持有人。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 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 | 13,541.32 | 0.0051%  |

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。

**9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

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

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2011年12月8日）基金份额总额 | 2,898,411,590.90 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 402,508,288.50   |
| 本报告期基金总申购份额               | 723,758,139.25   |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 859,002,684.93   |
| 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               | 267,263,742.82   |

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：

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

本基金本报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 57,000.00 元，该审计机构为本基金提供审计服务的期间为 6 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 银河证券 | 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 |
| 银河证券 | 1,106,256,057.47 | 100.00%      | 25,146,903,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

注：1、本基金本报告期末通过券商交易单元进行股票交易及佣金支付。

## 2、交易单元选择的标准和程序

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

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

## 2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

鹏华基金管理有限公司  
2017 年 3 月 30 日