鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年 12 月 31 日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
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	鹏华弘和混合	
场内简称	-	
基金主代码	001325	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月25日	
基金管理人	鹏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	1,411,641,570.49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	-	
下属分级基金的基金简称:	鹏华弘和混合 A	鹏华弘和混合 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	001325	001326
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	1,166,633,258.78份	245,008,311.71份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下,精选股票、债券等投资标的,力争实现绝对收益的目标。
投资策略	1.资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各国国家政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等),并结合美林时钟等投资产理论的资产配置框架,动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。 2.股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法把握优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等,并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股,力争实现组合的绝对收益。 (1)自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选,重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景,主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等;对行业利润前景,主要分析行业结构、特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断,为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。 (2)自下而上的个股选择 本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择:一方面是竞争力分析,通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析,选择具有可持续竞争优势的上市公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略,基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果;就核心竞争力,分析公司的现有核心竞争力,并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。 另一方面是管理层分析,在国内监管体系基后,公司治理结构不完善的基础上,上市公司的命运对管理团队的依赖度大大增加。本基金将着重考察公司的管理层以及管理制度。 (3)综合研判 本基金在自上而下和自下而上的基础上,结合信息分析,严选安全边际较高的个股,力争实现组合的绝对收益。通过对信息方法的选择和估值指数的比较,选择股价相对低估的股票。就估值方法而言,基于行业的特点确定对投资收益有影响力的关键估值方法(包括PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA等);就估值指数而言,通过业内比较、历史比较和增长性分析,确定具有上升基础的股价水平。 3.债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略,灵活地调整组合的券种搭配,精选安全边际较高的个券,力争实现组合的绝对收益。 (1)久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素,本基金将采用以"目标久期"为中心,自上而下的组合久期管理策略。 (2)收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据,本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配,并进行动态调整。 (3)骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略,以达到增强组合的持有期收益的目的。 (4)息差策略 本基金将采用息差策略,以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。 (5)个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素,确定其投资价值,选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。 (6)信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价,根据内、外部信用评级结果,结合对未来债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+3%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

下属分级基金的风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。	本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	田曹
	联系电话	0755- 82825720	010- 67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tiancao1@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010- 67595096
传真		0755- 82021126	010- 66275853

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年		2015年5月25日(基金合同生效日)-2015年12月31日	
	鹏华弘和混合 A	鹏华弘和混合 C	鹏华弘和混合 A	鹏华弘和混合 C
本期已实现收益	42,390,177.14	21,141,977.01	20,901,163.20	5,295,991.32
本期利润	22,728,251.46	6,301,316.85	29,145,086.69	13,235,541.49
加权平均基金份额本期利润	0.0223	0.0130	0.0130	0.0393
本期基金份额净值增长率	2.44%	1.95%	1.80%	1.50%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0428	0.0348	0.0107	0.0070
期末基金资产净值	1,216,545,976.34	253,535,582.58	1,023,713,542.96	1,550,376,837.14
期末基金份额净值	1.0428	1.0348	1.0180	1.0150

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"指报告期最后一日,即 12 月 31 日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4)本基金基金合同于 2015 年 5 月 25 日生效,至 2015 年 12 月 31 日未满一年,故 2015 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华弘和混合 A

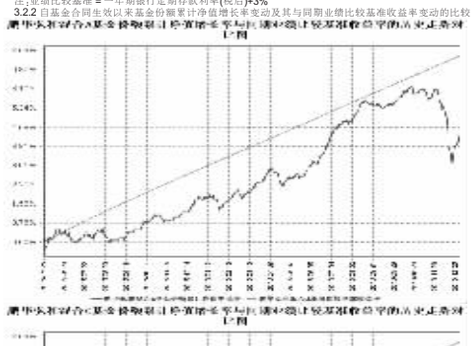
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	- 1.23%	0.16%	1.13%	0.02%	- 2.36%	0.14%
过去六个月	0.27%	0.12%	2.27%	0.01%	- 2.00%	0.11%
过去一年	2.44%	0.10%	4.51%	0.01%	- 2.07%	0.09%
自基金合同生效起至今	4.28%	0.09%	7.43%	0.01%	- 3.15%	0.08%

鹏华弘和混合 C

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	- 1.31%	0.16%	1.13%	0.02%	- 2.44%	0.14%
过去六个月	0.13%	0.12%	2.27%	0.01%	- 2.14%	0.11%
过去一年	1.95%	0.10%	4.51%	0.01%	- 2.56%	0.09%
自基金合同生效起至今	3.48%	0.10%	7.43%	0.01%	- 3.95%	0.09%

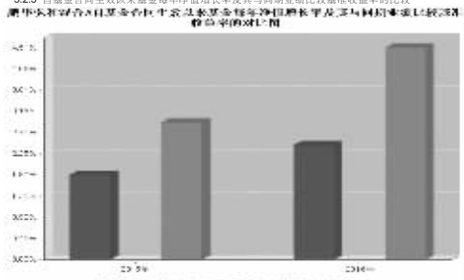
注:业绩比较基准 = 一年期银行定期存款利率(税后)+3%

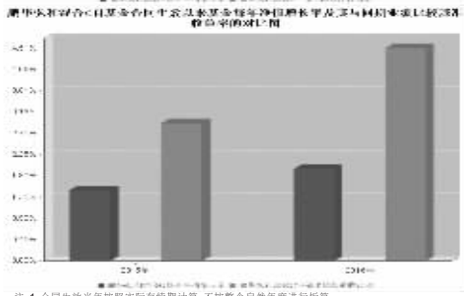
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金基金合同于 2015 年 5 月 25 日生效。
2.截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:1.合同生效当年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金基金合同于 2015 年 5 月 25 日生效。截止本报告期末,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		
刘方正	本基金基金经理	2015年5月25日	-	6	刘方正先生,国籍中国,理学硕士,6年证券从业经验。2010年6月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券研究工作,担任固定收益部高级研究员、基金经理助理,2015年3月至2017年1月担任鹏华弘利混合基金基金经理,2015年3月至2015年8月兼任鹏华行业成长基金(2015年8月已转型为鹏华弘泰混合基金)基金经理,2015年4月至2017年1月兼任鹏华弘润混合基金基金经理,2015年5月至2017年1月兼任鹏华弘益混合基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华弘和混合基金、鹏华弘华混合基金基金经理,2015年6月至2017年1月兼任鹏华弘鑫混合基金基金经理,2015年8月至2017年1月兼任鹏华弘泰混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华前海万科REITs基金基金经理,2016年3月起兼任鹏华弘实混合、鹏华弘信混合、鹏华弘锐混合基金基金经理,2016年8月起兼任鹏华弘达混合、鹏华弘嘉混合基金基金经理,2016年9月起兼任鹏华弘恩混合基金基金经理,2016年11月起兼任鹏华兴新定期开放混合基金基金经理,2016年11月起兼任鹏华兴裕定期开放混合基金基金经理,2016年12月起兼任鹏华鹏华兴悦定期开放混合基金基金经理,对方正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。
李俊怡	本基金基金经理	2015年7月23日	-	9	李俊怡女士,国籍中国,经济学硕士,9年证券从业经验。曾任职于广州证券股份有限公司投资管理总部,先后担任研究员、交易员和投资经理等职务,从事新股发行转债申购、定增项目等工作,2015年6月加盟鹏华基金出任基金经理,2016年9月起兼任鹏华兴泽定期开放混合基金基金经理,2016年7月起担任鹏华弘益混合基金、鹏华弘实混合基金、鹏华弘泰混合基金、鹏华弘鑫混合基金、鹏华弘华混合基金基金经理,2015年7月至2017年1月兼任鹏华弘锐混合基金、鹏华弘和混合基金基金经理,2016年8月起兼任鹏华弘盛混合基金、鹏华弘利混合基金基金经理,2016年9月起兼任鹏华弘惠混合基金基金经理,2017年1月起兼任鹏华兴惠定期开放混合基金基金经理,本报告期内本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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》,将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的投权、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流动,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投资股票库,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.严格执行投资授权规定,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,交易系统根据公启用公平交易功能,将基金份额分为不同的类别,不认本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;认本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%~95%;投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+3%。

7.4.2 会计政策的编制基础

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)》、中国证券投资基金协会(以下简称"中国基金协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金》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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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《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,金融业增值税应税为增值税,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、基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:1.本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。
2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国信证券	120,309,921.15	24.31%	289,707,403.33	30.78%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国信证券	5,344,849.15	12.27%	-	-

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国信证券	4,953,900,000.00	5.85%	50,000,000.00	0.13%

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券	109,638.72	24.31%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国信证券	257,724.88	30.71%	45,819.72	43.33%

注:(1)佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金 = 买(卖)成交金额× 1%- 买(卖)经手费 - 买(卖)证管费

深圳证券交易所的交易佣金 = 买(卖)成交金额× 1%- 买(卖)经手费 - 买(卖)证管费 (佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

(2)本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》,根据协议规定,上述单位证期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,364,587.03	10,648,114.84
其中:支付销售机构的客户维护费	1,262.91	4,230.66

注:1.支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值× 1.00%÷ 当年天数。

2.根据《鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金开展费率优惠活动的公告》的相关规定,本基金于 2015 年 7 月 10 日起管理费年费率调整为 0.60%,年费率调整结束时间鹏华基金公司将另行通知。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月25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	2,341,146.84	2,333,731.15

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值× 0.15%÷ 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	鹏华弘和混合 A	鹏华弘和混合 C	合计
鹏华基金	0.00	1,510,172.15	1,510,172.15
合计	0.00	1,510,172.15	1,510,172.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘和混合 A	鹏华弘和混合 C	合计
鹏华基金	-	591,284.92	591,284.92
合计	-	591,284.92	591,284.92

注:(1)支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给鹏华基金公司,再由鹏华基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

(2)根据《鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金开展费率优惠活动的公告》的相关规定,本基金于 2015 年 7 月 10 日起年费率调整为 0.30%,年费率调整结束时间鹏华基金公司将另行通知。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金本年度及上年度可比报告期管理人未投资、持有本基金。

本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一.收入		52,739,668.35	58,875,605.79
1.利息收入		55,934,486.18	37,530,083.93
其中:存款利息收入		1,132,483.83	5,050,516.46
债券利息收入		54,195,002.92	29,177,831.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		606,999.43	3,301,735.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		31,307,564.05	2,430,020.26
其中:股票投资收益		25,669,457.34	-787,989.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益		4,933,745.10	3,086,046.85
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		704,361.61	131,963.03
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-34,502,585.84	16,183,473.66
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		203.96	2,732,027.94
减:二.费用		23,710,100.04	16,494,977.61
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	9,364,587.03	10,648,114.84
2.托管费	7.4.8.2.2	2,341,146.84	2,333,731.15
3.销售服务费	7.4.8.2.3	1,510,418.21	592,064.21
4.交易费用		752,394.50	1,419,596.77
5.利息支出		9,274,094.50	1,218,739.83
其中:卖出回购金融资产支出		9,274,094.50	1,218,739.83
6.其他费用		467,458.96	282,730.81
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		29,029,568.31	42,380,628.18
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		29,029,568.31	42,380,628.18

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金

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)	2,533,186,763.84	40,903,616.26	2,574,090,380.10
二.本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	29,029,568.31	29,029,568.31
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-1,121,545,193.35	-11,493,196.14	-1,133,038,389.49
其中:1.基金申购款	1,913,074,926.65	85,104,014.97	1,998,178,941.62
2.基金赎回款	-3,034,620,120.00	-96,597,211.11	-3,131,217,331.11
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)	1,411,641,570.49	58,439,988.43	1,470,081,558.92
项目	上年度可比期间 2015年5月25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)	2,331,507,740.94	0.00	2,331,507,740.94
二.本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	0.00	42,380,628.18	42,380,628.18
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	201,679,022.90	-1,477,011.92	200,202,010.98
其中:1.基金申购款	2,083,617,704.40	11,832,385.92	2,095,450,090.32
2.基金赎回款	-1,881,938,681.50	-13,309,397.84	-1,895,248,079.34
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)	2,533,186,763.84	40,903,616.26	2,574,090,380.10

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 高鹏 郝文高

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

鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]910 号《关于准予鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集,本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,331,507,740.94 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 578 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,331,507,740.94 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据销售服务费收费模式的不同,将基金份额分为不同的类别,不认本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;认本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华弘和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%~95%;投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+3%。

7.4.9 期末(2016 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002791	坚朗五金