

2016年年度报告摘要

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600919	江苏银行	8,428,000.00	0.70

2	601398	工商银行	6,362,000.00	0.58
3	600547	山东黄金	6,012,908.51	0.50
4	300144	连城演艺	5,831,564.12	0.49
5	002594	北亚集团	5,821,699.00	0.47
6	603986	好莱客	5,280,910.04	0.44
7	002013	中航机电	5,126,524.00	0.43
8	002518	科士达	5,094,004.56	0.42
9	601988	中国银行	4,852,000.00	0.40
10	000567	山东铝业	4,770,212.88	0.40
11	002475	立讯精密	4,632,800.42	0.39

12	302007	其他往来	3,779,747.722	0.31
13	302028	非货币性资产	3,750,576.00	0.32
14	301008	中间收款	3,630,790.00	0.30
15	302077	暂收应付款	3,175,126.60	0.26
16	302076	应付利息	3,139,696.00	0.26
17	606060	预缴所得税	3,127,500.00	0.26
18	300042	长期股权投资	2,940,130.76	0.25
19	002041	股权转让	2,774,550.34	0.23
20	001014	上汽集团	2,427,377.00	0.20

注：卖出金融资产未实现公允价值(或金融资产公允价值)增减，不考虑相关交易费用。

8.4.3 卖出金融资产的成本总额及卖出金融资产的收入总额

买入金融资产成本(或)总额	单位:人民币元
171,658,712.57	
卖出金融资产收入(或)总额	单位:人民币元
104,615,502.57	

注：买入金融资产成本、卖出金融资产均按买卖公允价值(或金融资产公允价值)增减，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按品种分类的证券投资组合

序号	证券品种	公允价值	占期末公允价值证券投资组合(%)
----	------	------	------------------

1	国家债券	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	79,880,000.00	6.66	6.66
	其中:政策性金融债	79,880,000.00	6.66	6.66
4	企业债券	86,636,000.00	6.72	6.72
5	企业短期融资券	40,765,000.00	4.05	4.05
6	中期票据	139,323,000.00	11.64	11.64
7	可转换债(含分离债)	-	-	-
8	银行存单	193,775,000.00	16.16	16.16
9	其他	-	-	-
10	合计	543,968,000.00	45.33	45.33

8.6 期末长期公允价值计量金融资产净值按大小排序的前五名投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	公允价值占净值比例(%)
1	111616154	16上海银行CD154	1,000,000	96,450,000.00	8.04
2	160414	16国开14债第14期	800,000	79,880,000.00	6.66

金额单位:人民币元

3	101653232	MTN001	700,000	66,697,000,000	4.80
4	136856	16年广核3	600,000	59,598,000,000	4.57
5	01198285	16年招商局 SCP001	500,000	49,740,000,000	4.15

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券明细
注:无。

8.8 报告期内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
注: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
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
8.11.2 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 本期国债期货投资政策
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
8.12 投资股指期货的投资政策
8.12.1
8.12.2
本基金投资的前十名证券之一为鹏盛(包商银行股份有限公司(以下简称“公司”或“我公司”)),
2015年12月31日,本基金前十名证券持有数量及公允价值以集中竞价交易方式买卖的
新股份16,734,810股,占“本新股份”总股本的5.16%。

在买入“新永股份”股达到5%时,公司及一致行动人没有及时向中国证监会和深交所提交报告和披露权益变动报告书,在履行报告和披露义务前没有及时买入“新永股份”股份,违反了《证券法》第一百六条和《上市公司收购管理办法》第三十三条的规定,属于《深圳证券交易所上市公司交易实施细则》第六十六条规定的情节严重的异常交易情形。

2016年2月23日,深圳证券交易所下发的《深圳证券交易所上市公司交易实施细则》,决定从上述期间起至2016年2月18日止对相关证券账户采取限制交易措施,限制相关账户在上述期间买入“新永股份”股份。

该情况发生后,本基金管理人就事件进行了及时分析和研究,认为该事件并未影响到公司的运营和公司的投资价值。公司管理稳定,运营正常,本基金管理人将继续对该公司进行跟踪

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 报告期内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	48,889.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,659,880.38

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,708,770.00

8.12.4 期末持有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
注：无。

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 基金净值持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构				份额单位:份		
份额类别	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

鹏华弘瑞混合 A	275	4,365,341.84	1,199,305,530.58	99.90%	1,163,474.69	0.10%
鹏华弘瑞混合 C	5	11,318.79	0.00	0.00%	56,593.93	100.00%
合计	280	4,287,591.43	1,199,305,530.58	99.90%	1,220,068.62	0.10%

9.2 期末基金管理人从业从业人员持有本基金会的情况

项目	任职期间	持有基金份额(股)	占基金总份额比例
基金管理人			
基金管理人高级管理人员			
基金管理人基金经理			

基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华弘腾混合 A	29.67	0.0000%
	鹏华弘腾混合 C	9.89	0.0175%
	合计	39.56	0.0000%

注：截至本报告期末，本基金基金经理人从业人员均符合持有本基金符合相关法律法规规定。

项目	份额类别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	鹏华弘瑞混合 A	-
	鹏华弘瑞混合 C	-

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华弘腾混合 A	-
	鹏华弘腾混合 C	-
	合计	0

注：(1) 本公司高级管理人员、基金投资和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。

项目	鹏华弘瑞混合 A	鹏华弘瑞混合 C
基金合同生效日 (2016 年 9 月 29 日) 基金份额总额	601,196,760.42	5,998.83
本报告期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至本报告期末基金总申购份额	599,275,112.27	50,595.10

减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,867.42	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,200,469,005.27	56,593.93

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

10.2.1 基金管理人的人事变动：

报告期内，因投资负责人变更事宜，原董事 Alessandro Varaldo 先生不再担任公司董事职务，根据股东欧利南资本资产管理股份有限公司推荐，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,原董事 Andreia Vismara 先生辞去公司监事职务。根据东欧利格森资本资产管理股份有限公司章程,并经本公司董事会审议通过,同意由 Andreia Vismara 先生担任本公司监事,Andreia Vismara 先生不再担任公司监事职务。Sandro Vesprini 先生自任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

经公司董事会会议审议通过,公司同意聘任叶亚庆先生担任 2016 年公司副总经理。聘任叶先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项向中国证券监督管理委员会深圳监管局、1022 基金托管人及重大人事变动。

2016 年 12 月,谢永林先生担任平安银行股份有限公司董事、董事长。上述人事变动已按相关规定报备,公

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 为基金提供审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所，本年度支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 40,500 元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为本基金合同生效日（2016 年 9 月 2 日）起至本报告期末，不超过 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受奖惩或处罚等情况

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行政处罚或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付给券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	
中信证券	1	129,958,100.00	47.04%	118,431.28	47.04%	本报告期

国泰君安	1	146,289,563.22	52.96%	133,312.37	52.96%	内新增 内新增
------	---	----------------	--------	------------	--------	------------

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,且其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)内部管理制度严格,具备健全的内部控制制度,并能满足基金运作保密的要求;
- (5)具备基金运作所需的高级、安全的技术条件,交易设施符合开展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。我公司及时部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评价,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其他量等情况,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

金额单位:人民币元

券商名称	交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
			0.0000			

国泰君安	61,217,180.82	100.00%	6,302,200,000.00	100.00%	-	-
------	---------------	---------	------------------	---------	---	---

鹏华基金管理有限公司
2017年3月30日
