

鹏华金城保本混合型证券投资基金

2016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、监事会在报告期间所存放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。
本基金年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，报中国证监会备案。
于 2017 年 3 月 27 日复核了本基金的财务状况、净值表现、定期报告、财务会计报告、投资组合报告等文件，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。
本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。

正文中“鹏华永道会计师事务所(特殊普通合伙)”指鹏华永道会计师事务所(特殊普通合伙)。

本报告期自 2016 年 6 月 1 日(基金合同生效日)起至 2016 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

| | |
|------------|------------------|
| 基金简称 | 鹏华金城保本 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 002714 |
| 前缀交易代码 | - |
| 赎回交易代码 | - |
| 基金投资方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年 6月 1日 |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 基金份额总额 | 4,583,378,567.75 |
| 基金合同存续期 | 不确定 |
| 基金的上市证券交易所 | - |
| 上市日期 | - |

2.2 基金产品说明

投资目标 通过投资组合保险策略，在保证本金的基础上追求基金的长期增值。

(2)特殊风险 估值风险。

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指导意见》，基金管理人应定期对旗下基金持有的股票投资估值，没有市价的股票品种按估值小组，成员由基金管理人、行业研究员、风险管理部、金融工程师、登记结算部等相关人员组成。

2.3 基金管理人和基金托管人

| | |
|--------|----------------------|
| 姓名 | 基金投资人 |
| 名称 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 性别 | 女 |
| 信披负责人 | 张文 |
| 联系电话 | 0755-82625720 |
| 电子邮箱 | zhangji@phfchina.com |
| 客户服务电话 | 4006788999 |
| 传真 | 95566 |

2.4 信息披露方式

基金年度报告在公告的互联网网址

http://www.phfchina.com

§ 3 主要财务指标、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 6月 1日基金份额 2016年 12月 31日 2015年 2014年

本期已实现收益 36,239,517.64 - -

本期利润 -53,455,958.75 - -

本期份额净值增长 率 -0.016% - -

3.1.2 期末数据

2016年末 2015年末 2014年末

本期可分配基金利润 -0.0117 - -

期末基金资产净值 4,529,846,363.60 - -

基金份额净值 0.998 - -

注：(1)本基金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)基金业报酬率不包括持有人交易本基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，计算采用最近收益水平低于折算例数。(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日的交易情况。

4.基金基准合同于 2016 年 6 月 1 日生效，至 2016 年 12 月 31 日未满一年，故 2016 年度数据为非完整会计年度数据。

3.2 基金的财务指标

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变动的比较

注：三年期定期存款利率(税后)

3.2.2 基金合同生效以来基金年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：基金合同生效以来基金年净值增长率=基金合同生效以来基金资产净值增长率-同期业绩比较基准收益率。

3.3 其他指标

3.4 去年三年基金的利润分配情况

注：本基金合同于 2016 年 6 月 1 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 基金管理人及基金经理情况：自 1998 年 12 月 22 日起，公司经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东为“Euronext 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。

公司原注册资金 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，后于 2004 年 12 月完成增资扩股，增至 18,000 万元人民币，后于 2006 年 6 月完成增资扩股，增至 20,000 万元人民币。

4.1.2 基金管理人(基金经理小组)及基金经理简介

注：(1)基金合同生效前，公司名称为“鹏华基金管理有限公司”，基金合同生效后，公司名称变更为“鹏华基金管理有限公司(以下简称“鹏华基金”)”。(2)鹏华基金管理有限公司(以下简称“鹏华基金”)的法定代表人、高级管理人员、基金经理等基金管理人员的个人信息，由公司根据中国证监会的有关规定向中国证监会报告。

4.2 管理人对报告期内公司运作的诚信声明

基金管理人保证本报告期内不存在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司运作情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和执行情况

根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》，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、养老金组合的交易研究、投资决策、投资组合、交易执行、业绩评价和投资运作等环节纳入公平交易制度的管理范围，从制度上保证公平交易制度的执行。

4.3.2 管理人对报告期内公司运作情况进行分析

注：(1)任职业日期和原任日期指公司决定正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任日期为基金合同生效日。

2.证券从业的人员从行业从业资格、从业经历、从业资格管理办法的相关规定。

4.4.1 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

4.4.1.1 基金管理人及基金经理情况：截至本报告期末，鹏华基金管理有限公司(以下简称“鹏华基金”)的法定代表人、高级管理人员、基金经理等基金管理人员的个人信息，由公司根据中国证监会的有关规定向中国证监会报告。

4.4.1.2 基金管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

注：(1)任职业日期和原任日期指公司决定正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任日期为基金合同生效日。

2.证券从业的人员从行业从业资格、从业经历、从业资格管理办法的相关规定。

4.4.2 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

4.4.2.1 公平交易制度和执行情况

根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》，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、养老金组合的交易研究、投资决策、投资组合、交易执行、业绩评价和投资运作等环节纳入公平交易制度的管理范围，从制度上保证公平交易制度的执行。

4.4.2.2 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

注：(1)任职业日期和原任日期指公司决定正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任日期为基金合同生效日。

2.证券从业的人员从行业从业资格、从业经历、从业资格管理办法的相关规定。

4.4.3 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

4.4.3.1 公平交易制度和执行情况

根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》，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、养老金组合的交易研究、投资决策、投资组合、交易执行、业绩评价和投资运作等环节纳入公平交易制度的管理范围，从制度上保证公平交易制度的执行。

4.4.3.2 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

注：(1)任职业日期和原任日期指公司决定正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任日期为基金合同生效日。

2.证券从业的人员从行业从业资格、从业经历、从业资格管理办法的相关规定。

4.4.4 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

4.4.4.1 公平交易制度和执行情况

根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》，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、养老金组合的交易研究、投资决策、投资组合、交易执行、业绩评价和投资运作等环节纳入公平交易制度的管理范围，从制度上保证公平交易制度的执行。

4.4.4.2 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

注：(1)任职业日期和原任日期指公司决定正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任日期为基金合同生效日。

2.证券从业的人员从行业从业资格、从业经历、从业资格管理办法的相关规定。

4.4.5 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

4.4.5.1 公平交易制度和执行情况

根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》，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、养老金组合的交易研究、投资决策、投资组合、交易执行、业绩评价和投资运作等环节纳入公平交易制度的管理范围，从制度上保证公平交易制度的执行。

4.4.5.2 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

注：(1)任职业日期和原任日期指公司决定正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任日期为基金合同生效日。

2.证券从业的人员从行业从业资格、从业经历、从业资格管理办法的相关规定。

4.4.6 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

4.4.6.1 公平交易制度和执行情况

根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》，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、养老金组合的交易研究、投资决策、投资组合、交易执行、业绩评价和投资运作等环节纳入公平交易制度的管理范围，从制度上保证公平交易制度的执行。

4.4.6.2 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

注：(1)任职业日期和原任日期指公司决定正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任日期为基金合同生效日。

2.证券从业的人员从行业从业资格、从业经历、从业资格管理办法的相关规定。

4.4.7 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

4.4.7.1 公平交易制度和执行情况

根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》，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、养老金组合的交易研究、投资决策、投资组合、交易执行、业绩评价和投资运作等环节纳入公平交易制度的管理范围，从制度上保证公平交易制度的执行。

4.4.7.2 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

注：(1)任职业日期和原任日期指公司决定正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任日期为基金合同生效日。

2.证券从业的人员从行业从业资格、从业经历、从业资格管理办法的相关规定。

4.4.8 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

4.4.8.1 公平交易制度和执行情况

根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》，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、养老金组合的交易研究、投资决策、投资组合、交易执行、业绩评价和投资运作等环节纳入公平交易制度的管理范围，从制度上保证公平交易制度的执行。

4.4.8.2 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

注：(1)任职业日期和原任日期指公司决定正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任日期为基金合同生效日。

2.证券从业的人员从行业从业资格、从业经历、从业资格管理办法的相关规定。

4.4.9 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

4.4.9.1 公平交易制度和执行情况

根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》，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、养老金组合的交易研究、投资决策、投资组合、交易执行、业绩评价和投资运作等环节纳入公平交易制度的管理范围，从制度上保证公平交易制度的执行。

4.4.9.2 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

注：(1)任职业日期和原任日期指公司决定正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任日期为基金合同生效日。

2.证券从业的人员从行业从业资格、从业经历、从业资格管理办法的相关规定。

4.4.10 管理人对报告期内公司运作情况进行分析的说明

4.4.10.1 公平交易制度和执行情况

根据中国证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定