鹏华金鼎保本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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 4 月 13 日(基金合同生效日)起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华金鼎保本混合	
场内简称	-	
基金主代码	002504	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年 4 月 13 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,556,006,274.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鹏华金鼎保本混合 A	鹏华金鼎保本混合 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	002504	002505
报告期末下属分级基金的份额总额	3,880,146,160.65 份	675,860,114.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	灵活运用投资组合保险策略,在保证本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。	
投资策略	本基金通过灵活运用投资组合保险策略,在本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。本基金的整体投资策略分为三个层次:第一层次,以保本为出发点的资产配置策略;第二层次,以追求本金安全和稳定的收益回报为目的的固定收益类资产投资策略;第三层次,以股票为主要投资对象的权益类资产投资策略。	
业绩比较基准	两年期定期存款税后利率× 1.5	
风险收益特征	本基金属于保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。	
下属分级基金的风险收益特征	鹏华金鼎保本混合 A	鹏华金鼎保本混合 C
	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	郭明
	联系电话	0755- 82825720	010- 66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@cbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755- 82021126	010- 66105798

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 4 月 13 日(基金合同生效日)- 2016 年 12 月 31 日	
	鹏华金鼎保本混合 A	鹏华金鼎保本混合 C
本期已实现收益	75, 866, 547.84	10, 036, 237.02
本期利润	- 77, 045, 152.71	- 16, 516, 017.53
加权平均基金份额本期利润	- 0.0192	- 0.0226
本期基金份额净值增长率	- 2.10%	- 2.60%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	
期末可供分配基金份额利润	- 0.0205	- 0.0256
期末基金资产净值	3, 800, 531, 593.37	658, 578, 135.14
期末基金份额净值	0.979	0.974

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。

(4)本基金基金合同于 2016 年 4 月 13 日生效,至 2016 年 12 月 31 日未满一年,故 2016 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

鹏华金鼎保本混合 A

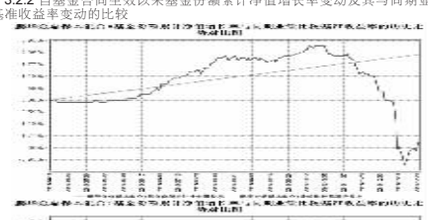
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	- 4.21%	0.24%	0.79%	0.01%	- 5.00%	0.23%
过去六个月	- 2.68%	0.18%	1.59%	0.01%	- 4.27%	0.17%
自基金合同生效起至今	- 2.10%	0.16%	2.27%	0.01%	- 4.37%	0.15%

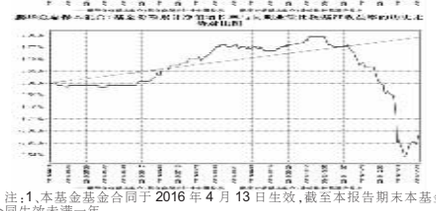
鹏华金鼎保本混合 C

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	- 4.42%	0.24%	0.79%	0.01%	- 5.21%	0.23%
过去六个月	- 2.99%	0.18%	1.59%	0.01%	- 4.58%	0.17%
自基金合同生效起至今	- 2.60%	0.16%	2.27%	0.01%	- 4.87%	0.15%

注:业绩比较基准 = 两年期定期存款税后利率× 1.5

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

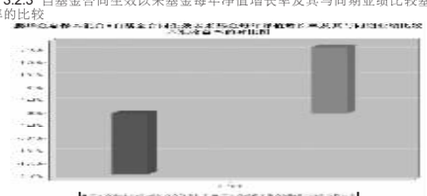


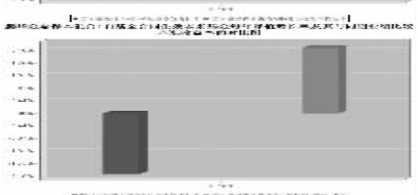


注:1、本基金基金合同于 2016 年 4 月 13 日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

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: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

注: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 2016 年 4 月 13 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		
王宗合	本基金基金经理	2016年 4 月 13 日	-	10	王宗合先生,国籍中国,金融学硕士,10 年证券从业经验。曾经在招商基金从事食品饮料、商业零售、农林牧渔、纺织服装、汽车等行业的研究。2009 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司,从事食品饮料、农林牧渔、商业零售、造纸包装等行业的研究工作,担任鹏华动力增长混合(LOF)基金基金经理助理,2010 年 12 月起担任鹏华消费优选混合基金基金经理,2012 年 6 月起兼任鹏华金刚保本混合基金基金经理,2014 年 7 月起兼任鹏华品牌传承混合基金基金经理,2014 年 12 月起兼任鹏华养老产业股票基金基金经理,2016 年 4 月起兼任鹏华金鼎保本混合基金基金经理,2016 年 6 月起兼任鹏华金城保本混合基金基金经理,现同时担任权益投资二部总经理、投资决策委员会成员。王宗合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。本基金为本期内新成立基金。
戴嗣	本基金基金经理	2016年 4 月 13 日	-	14	戴嗣先生,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 月起兼任鹏华中小企业纯债债券(2015 年 11 月已转型为鹏华丰和债券(LOF)基金)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 月起兼任鹏华丰益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,2016 年 4 月起兼任鹏华金鼎保本混合基金基金经理,2016 年 8 月起兼任鹏华丰铼定期开放债券基金基金经理,现同时担任他对收益投资部副总经理。戴嗣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。本基金为本期内新成立基金。

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、银行间债券交易对于交易等;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《证券投资基金管理公司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 年债券市场先扬后抑,全年来看中债总财富指数上涨 1.30%。受整体经济较为疲软的影响,债市在前三季度仍处于上涨阶段。不过进入四季度,随着 PPI 的不断走高以及政府对金融去杠杆的要求,央行在货币政策上开始有所收紧。这导致了债券市场的全面跟踪,进而造成了债市的大幅度调整。

2016 年股票市场整体下跌,沪深 300 指数下跌了 11.28%。不过风格分化明显,中小创指数跌幅更为明显。

组合投资整体上以高评级信用债为主,并适度的采取了杠杆策略。并根据市场状况,适度配置了部分权益资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年金鼎 A 基金的净值增长率为 -2.10%,金鼎 C 基金的净值增长率为 -2.60%,同期业绩基准增长率为 2.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年,短期来看,宏观面仍将较为平稳,而 PPI 水平在一季度仍将冲高,因此央行中性货币政策取向转变的可能性较低。

但从宏观面来看,随着地产限购政策的发酵以及去杠杆政策的推行,经济下行的压力也在增大,时点上应该会出现在二季度。此时央行的货币政策很可能会开始出现转向,重新趋于宽松,债券市场将迎来转机。

对于权益市场,我们仍将严格控制权益仓位,积极把握右侧的投资机会。

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,鹏华金鼎保本 A 可供分配利润为 -79,614,567.28 元,期末基金份额净值 0.979 元;鹏华金鼎保本 C 本可供分配利润为 -17,281,979.18 元,期末基金份额净值元 0.974 元,不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

注: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, 中国工商银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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:鹏华金鼎保本混合型证券投资基金

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 2016年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款		5, 030, 027.18
结算备付金		421, 746, 440.17
存出保证金		225, 432.32
交易性金融资产		8, 159, 692, 862.28
其中:股票投资		455, 590.98
基金投资		-
债券投资		8, 159, 237, 271.30
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		1, 717, 180.56
应收利息		119, 488, 054.00
应收股利		-
应收申购款		297.48
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		8, 707, 900, 293.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年 12 月 31 日
负 债:		
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		4, 238, 900, 000.00
应付证券清算款		955, 165.91
应付赎回款		2, 506, 842.42
应付管理人报酬		4, 590, 372.96
应付托管费		765, 062.16
应付销售服务费		454, 809.91
应付交易费用		190, 491.20
应交税费		-
应付利息		88, 733.36
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		339, 087.56
负债合计		4, 248, 790, 565.48
所有者权益:		
实收基金		4, 556, 006, 274.97
未分配利润		- 96, 896, 546.46
所有者权益合计		4, 459, 109, 728.51
负债和所有者权益总计		8, 707, 900, 293.99

注:(1)报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额总额 4,556,006,274.97,其中鹏华金鼎保本混合证券投资基金 A 类基金份额的份额总额为 3,880,146,160.65 份,份额净值 0.979 元, 鹏华金鼎保本混合证券投资基金 B 类基金份额的份额总额为 675,860,114.32 份,份额净值 0.974 元。

(2)本基金基金合同于 2016 年 4 月 13 日生效,无上年度末数据。

7.2 利润表

会计主体:鹏华金鼎保本混合型证券投资基金

本报告期:2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		18, 719, 548.75
1.利息收入		174, 441, 819.81
其中:存款利息收入		9, 671, 427.63
债券利息收入		162, 826, 148.12
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1, 944, 244.06
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		21, 584, 968.65
其中:股票投资收益		12, 702, 714.45
基金投资收益		-
债券投资收益		8, 617, 709.26
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		264, 544.94
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		- 179, 463, 955.10
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		2, 156, 715.39
减:二、费用		112, 280, 718.99
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	41, 112, 695.61
2. 托管费	7.4.8.2.2	6, 852, 116.02
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	4, 222, 673.69
4. 交易费用		682, 467.96
5. 利息支出		59, 054, 746.89
其中:卖出回购金融资产支出		59, 054, 746.89
6. 其他费用		356, 018.82
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		- 93, 561, 170.24
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		- 93, 561, 170.24

注:(1)报告实际编制期间为 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

(2)本基金基金合同于 2016 年 4 月 13 日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华金鼎保本混合型证券投资基金

本报告期:2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2016年 4 月 13 日(基金合同生效日)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)	4, 832, 115, 498.18	-	4, 832, 115, 498.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	- 93, 561, 170.24	- 93, 561, 170.24
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)	- 276, 109, 223.21	- 3, 335, 376.22	- 279, 444, 599.43
其中:1.基金申购款	7, 987, 225.97	135, 480.93	8, 122, 706.90
2.基金赎回款	- 284, 096, 449.18	- 3, 470, 857.15	- 287, 567, 306.33
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)	4, 556, 006, 274.97	- 96, 896, 546.46	4, 459, 109, 728.51

注:(1)报告实际编制期间为 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

(2)本基金基金合同于 2016 年 4 月 13 日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

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

鹏华金鼎保本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[2016]364 号《关于准予鹏华金鼎保本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《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。根据《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金为契约型开放式,存续期限不定,第一个保本期自本基金基金合同生效之日(即 2016 年 4 月 13 日)起至三十个月后对应日(即 2018 年 10 月 13 日)止,如该日为非工作日,则保本期到期日顺延至下一个工作日,其后的保本周期及起讫日见基金管理人届时公告。本基金第一个保本期由北京首创融资担保有限公司作为保证人提供连带责任保证。第一个保本期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续并进入下一保本期。如第一个保本期到期后,本基金未能符合保本基金存续条件,则将变更为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为"鹏华金鼎灵活配置混合型证券投资基金"。如果第一个保本期到期后本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求,则本基金将根据基金合同的规定终止。

本基金自 2016 年 3 月 21 日起至 2016 年 4 月 11 日止期间内向社会公开募集,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,830,084,237.99 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(2016)第 408 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,832,115,498.18 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,031,260.19 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的第一个保本期为三十个月,本基金第一个保本期的保本额为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额所对应的认购金额及募集期利息收入之和。在第一个保本期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的保本金额,则基金管理人应补足该差额,并最迟在保本期到期日后 20 个工作日内将该差额支付给基金份额持有人,保证人对此提供连带责任保证。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的,赎回或转换转出部分不适用保本条款;未经保证人书面同意提供保证,基金份额持有人在保本期申购或转换转入的基金份额也不适用保本条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华金鼎保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,本基金可以投资于股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、各类债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、资产支持证券、中小企业私募债以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、货币市场工具、权证、国债期货、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例由优化的 CPPI 策略决定,并对比例范围有如下限制:权益类资产占基金资产的比例不超过 40%;债券、货币市场工具及其它资产的比例合计不低于基金资产的 60%,其中基金保留的现金以及投资于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%。本基金的业绩比较基准为:两年期定期存款税后利率× 1.5。

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》、《鹏华金鼎保本混合证券投资基金基金合同》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 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的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 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(中国工商银行")	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(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

本基金基金合同于 2016 年 4 月 13 日生效,截止本报告期末不满一年。无上年度可比期间和数据。

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 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国信证券	192, 840, 753.51	45.56%

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 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国信证券	3, 172, 168, 350.66	90.17%

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 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 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
国信证券	200