

# 鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

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

报告送出日期：2017 年 1 月 19 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 鹏华弘益混合   |
| 场内简称       | -  |
| 基金主代码      | 001336   |
| 交易代码       | 001336   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2015 年 5 月 29 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 1,591,453,730.53 份   |
| 投资目标       | 本基金在科学严谨的资产配置框架下，严选安全边际较高的股票、债券等投资标的，力争实现绝对收益的目标。  |
| 投资策略       | <p>1、资产配置策略</p> <p>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）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，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</p> |

|  |  |
|--|--|
|  | <p>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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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、中小企业私募债投资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。</p> <p>（1）久期策略</p> <p>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。</p> <p>（2）收益率曲线策略</p> <p>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。</p> <p>（3）骑乘策略</p> <p>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。</p> <p>（4）息差策略</p> <p>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。</p> <p>（5）个券选择策略</p> <p>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。</p> <p>（6）信用策略</p> <p>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，结合对类似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。</p> <p>（7）中小企业私募债投资策略</p> <p>中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信</p> |
|--|--|

|                 |  |                    |
|-----------------|--|--------------------|
|                 | <p>及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>4、股指期货、权证等投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> |                    |
| 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，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。   |                    |
| 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   |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 鹏华弘益混合 A   | 鹏华弘益混合 C           |
| 下属分级基金的场内简称     | -  | -                  |
| 下属分级基金的交易代码     | 001336   | 001337             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 23,743,673.99 份  | 1,567,710,056.54 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征   | 风险收益特征同上。  | 风险收益特征同上。          |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2016年10月1日—2016年12月31日） |                  |
|-----------------|-----------------------------|------------------|
|                 | 鹏华弘益混合 A                    | 鹏华弘益混合 C         |
| 1. 本期已实现收益      | 374,255.13                  | 21,064,394.59    |
| 2. 本期利润         | -159,236.99                 | -11,446,352.91   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0062                     | -0.0074          |
| 4. 期末基金资产净值     | 24,888,365.56               | 1,623,446,449.48 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0482                      | 1.0356           |

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

###### 鹏华弘益混合 A

| 阶段    | 净值增长率① | 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 | -0.61% | 0.12%     | 1.13%      | 0.02%         | -1.74% | 0.10% |

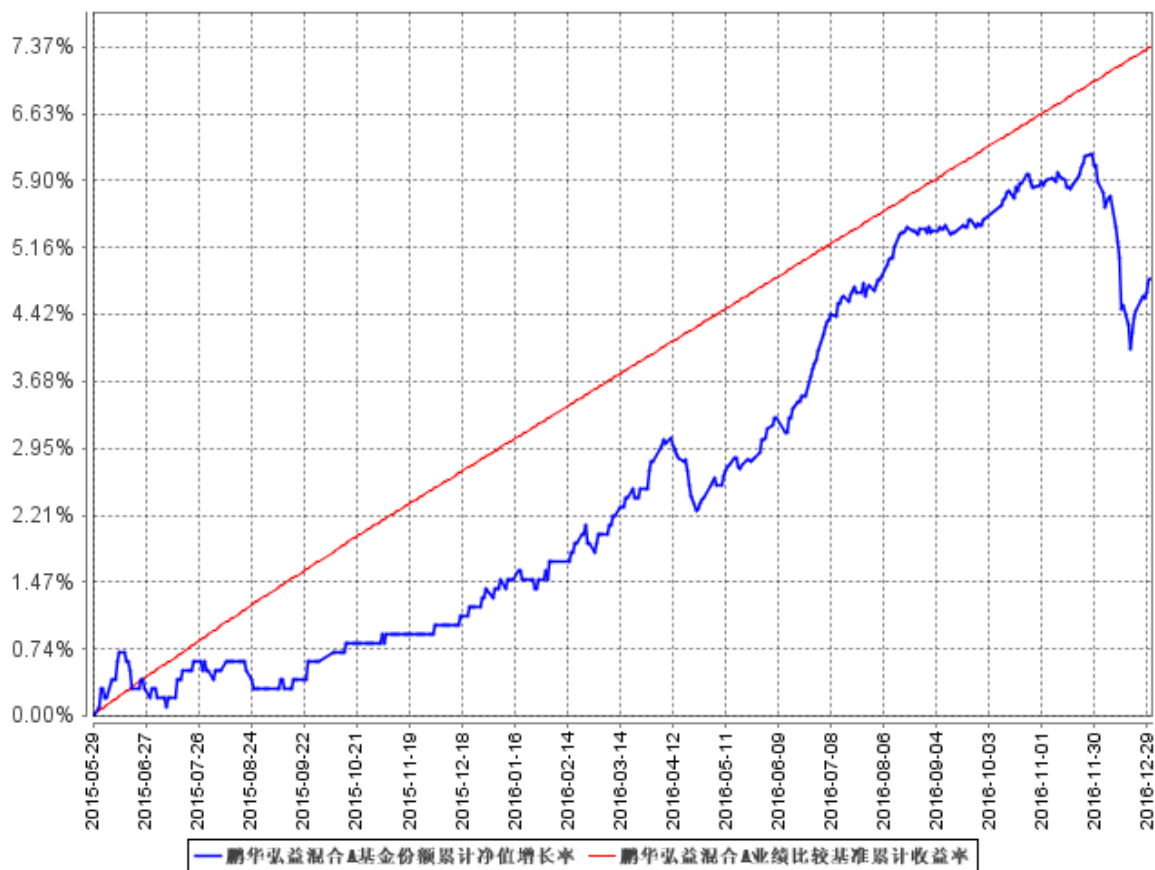
###### 鹏华弘益混合 C

| 阶段    | 净值增长率① | 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 | -0.67% | 0.12%     | 1.13%      | 0.02%         | -1.80% | 0.10% |

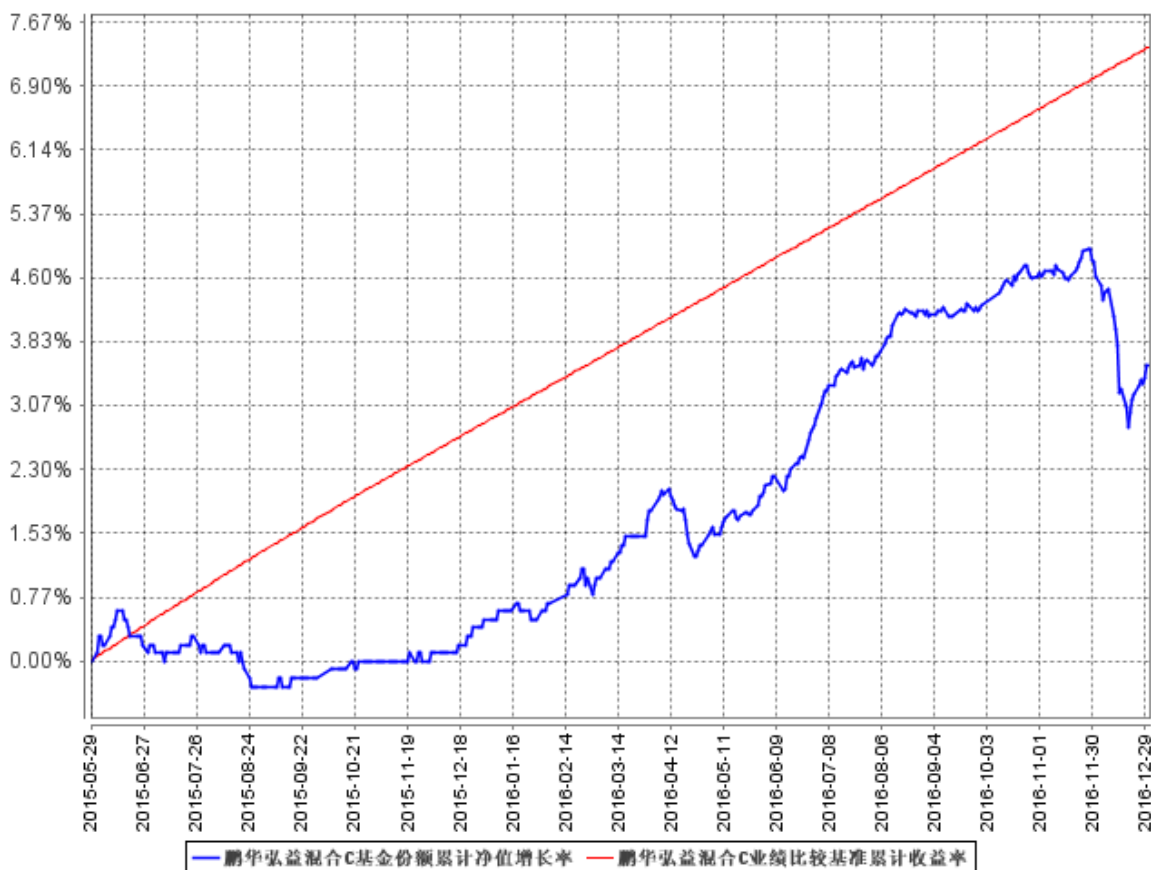
注：业绩比较基准=一年期银行定期存款利率(税后)+3%

### 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

鹏华弘益混合A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



鹏华弘益混合C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、本基金基金合同于 2015 年 5 月 29 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。

### 3.3 其他指标

注：无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务      | 任本基金的基金经理期限     |      | 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 29 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 月起担任鹏华弘利混合基金基金经理，2015 年 3 月至 |

|     |         |                 |   |  |
|-----|---------|-----------------|---|--|
|     |         |                 |   | <p>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 月起兼任鹏华弘润混合基金基金经理，2015 年 5 月起兼任鹏华弘和混合基金、鹏华弘华混合基金、鹏华弘益混合基金基金经理，2015 年 6 月起兼任鹏华弘鑫混合基金基金经理，2015 年 8 月起兼任鹏华弘泰混合基金、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 月起兼任鹏华弘惠混合基金基金经理，2016 年 11 月起兼任鹏华兴裕定期开放混合、鹏华兴泰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。刘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。</p> |
| 李韵怡 | 本基金基金经理 | 2015 年 7 月 23 日 | - | <p>9</p> <p>李韵怡女士，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，从事新股及可转债申购、定增项目等工作；2015 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事投研工作，2015 年 7 月起担任鹏华弘益混合基金、鹏华弘信混合基金、鹏华弘鑫混合基金、鹏华弘实混合基金、</p>   |



|     |         |                 |   |   |   |
|-----|---------|-----------------|---|---|---|
|     |         |                 |   |   | 鹏华弘锐混合基金、鹏华弘华混合基金、鹏华弘和混合基金基金经理，2016 年 6 月起兼任鹏华兴泽定期开放混合基金基金经理，2016 年 9 月起兼任鹏华兴润定期开放混合、鹏华兴合定期开放混合、鹏华兴安定期开放混合、鹏华兴实定期开放混合基金基金经理，2016 年 12 月起担任鹏华弘樽混合基金基金经理。李韵怡女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。                                 |
| 张栓伟 | 本基金基金经理 | 2016 年 8 月 24 日 | - | 5 | 张栓伟先生，国籍中国，工学硕士，5 年金融证券从业经验。历任中山证券固定收益部交易员，鹏华基金管理有限公司集中交易室高级债券交易员，财富证券有限责任公司资产管理部投资主办；2016 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事投研工作，2016 年 8 月起担任鹏华弘益混合基金基金经理，2016 年 11 月起担任鹏华弘康混合、鹏华弘尚混合、鹏华弘腾混合基金基金经理。张栓伟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。 |

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基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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 公平交易专项说明

#### 4.3.1 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。

#### 4.3.2 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 2 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年四季度，经济增速维持平稳，通胀抬头，整体保持温和滞胀的格局。宏观经济方面，投资低位企稳，基建和地产成为投资的主力，制造业投资动能依旧较弱；消费平稳，社会消费品零售总额同比增速维持 10% 以上，进出口总额同比增速依旧是负增长，呈现衰退式顺差。受益于供给侧改革，工业企业利润同比回升明显，经济呈现宏观差、微观好的局面。物价方面，受限产影响，煤炭、钢铁价格出现大幅上涨，PPI 同比增速转正，通胀预期抬头。

债券市场方面，四季度市场出现大幅下跌，中债总财富指数累计下跌 1.96%。四季度以来，资金面持续收紧，央行在公开市场维持缩短放长操作，资金成本不断抬升。特朗普上台后，大规模财政刺激的预期升温，美元持续走强，人民币面临较大的贬值压力，进一步压缩货币政策的放松空间。流动性冲击和外围市场的双重影响下，债券收益率持续走高。12 月初，国海证券债券代持事件爆发，利率风险叠加交易对手的信用风险，市场信心遭受重创，收益率出现大幅上行，随后央行向市场注入流动性，恐慌情绪才得以缓解。四季度股票市场，呈现先涨后跌的震荡走势，国庆节后，一带一路和国企改革板块表现较强，之后受保险举牌和一带一路等相关概念带动，银行、周期和基建板块表现强势，12 月后，受保险资金投资监管趋严，债券市场大幅调整所影响，前期强势板块出现下跌。四季度，板块之间的走势分化严重，上证指数走势明显强于中小板和创业板指数。

本基金以追求稳定收益为主要投资策略，控制基金净值回撤幅度。在资产配置方面，我们维持中高等级、中短久期的信用债配置主体，严控投资品种的信用资质，并维持一定比例的杠杆操作，在严格控制整体仓位的前提下，少量参与股票二级市场投资，同时，积极参与新股、可转债、

可交换债的网下申购获取增强收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，A、C 类产品分别上涨-0.61%、-0.67%，同期业绩比较基准为 1.13%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注：无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 139,808,229.42   | 8.32         |
|    | 其中：股票             | 139,808,229.42   | 8.32         |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,366,107,056.00 | 81.29        |
|    | 其中：债券             | 1,366,107,056.00 | 81.29        |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | 90,000,000.00    | 5.36         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 66,290,017.50    | 3.94         |
| 8  | 其他资产              | 18,255,092.55    | 1.09         |
| 9  | 合计                | 1,680,460,395.47 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 3,485,000.00  | 0.21         |
| C  | 制造业              | 69,917,846.77 | 4.24         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,504,899.32 | 1.18         |
| E  | 建筑业              | 2,404,992.23  | 0.15         |
| F  | 批发和零售业           | 4,560,260.00  | 0.28         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 9,458.68      | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |

|   |                 |                |      |
|---|-----------------|----------------|------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 12,472,496.85  | 0.76 |
| J | 金融业             | 23,066,616.91  | 1.40 |
| K | 房地产业            | 1,826,000.00   | 0.11 |
| L | 租赁和商务服务业        | -              | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      | -              | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -              | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -              | -    |
| P | 教育              | -              | -    |
| Q | 卫生和社会工作         | -              | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 2,560,658.66   | 0.16 |
| S | 综合              | -              | -    |
|   | 合计              | 139,808,229.42 | 8.48 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

### 5.3 报告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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 600900 | 长江电力 | 1,359,786 | 17,214,890.76 | 1.04         |
| 2  | 002791 | 坚朗五金 | 121,285   | 6,622,161.00  | 0.40         |
| 3  | 002792 | 通宇通讯 | 116,431   | 6,317,546.06  | 0.38         |
| 4  | 002142 | 宁波银行 | 300,000   | 4,992,000.00  | 0.30         |
| 5  | 002415 | 海康威视 | 200,000   | 4,762,000.00  | 0.29         |
| 6  | 000625 | 长安汽车 | 315,420   | 4,712,374.80  | 0.29         |
| 7  | 600637 | 东方明珠 | 200,000   | 4,660,000.00  | 0.28         |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 200,000   | 4,150,000.00  | 0.25         |
| 9  | 002518 | 科士达  | 179,984   | 3,849,857.76  | 0.23         |
| 10 | 601939 | 建设银行 | 600,000   | 3,264,000.00  | 0.20         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 79,960,000.00  | 4.85         |
|    | 其中：政策性金融债 | 79,960,000.00  | 4.85         |
| 4  | 企业债券      | 498,000,000.00 | 30.21        |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
| 5  | 企业短期融资券   | 119,292,000.00   | 7.24  |
| 6  | 中期票据      | 652,292,000.00   | 39.57 |
| 7  | 可转债（可交换债） | 16,563,056.00    | 1.00  |
| 8  | 同业存单      | -                | -     |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 1,366,107,056.00 | 82.88 |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称               | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 136041    | 15 渝信 01           | 600,000 | 59,802,000.00 | 3.63         |
| 2  | 011698575 | 16 广晟<br>SCP006    | 600,000 | 59,622,000.00 | 3.62         |
| 3  | 101455035 | 14 中建材<br>MTN002   | 500,000 | 50,295,000.00 | 3.05         |
| 4  | 101660003 | 16 建安投<br>资 MTN001 | 500,000 | 49,580,000.00 | 3.01         |
| 5  | 136175    | 16 搜候债             | 500,000 | 49,550,000.00 | 3.01         |

### 5.6 报告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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：无。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 27,974.55     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 18,225,750.31 |
| 5  | 应收申购款   | 1,367.69      |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 18,255,092.55 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 128012 | 辉丰转债 | 4,045,078.40 | 0.25         |
| 2  | 113009 | 广汽转债 | 3,135,240.00 | 0.19         |
| 3  | 128010 | 顺昌转债 | 1,777,950.00 | 0.11         |
| 4  | 110033 | 国贸转债 | 1,031,400.00 | 0.06         |
| 5  | 127003 | 海印转债 | 778,335.60   | 0.05         |

|   |        |      |            |      |
|---|--------|------|------------|------|
| 6 | 113010 | 江南转债 | 762,660.00 | 0.05 |
| 7 | 123001 | 蓝标转债 | 708,789.20 | 0.04 |
| 8 | 128011 | 汽模转债 | 514,120.00 | 0.03 |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值<br>(元) | 占基金资产净值比例<br>(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|----------|
| 1  | 002791 | 坚朗五金 | 6,622,161.00       | 0.40             | 新股锁定     |
| 2  | 002792 | 通宇通讯 | 6,317,546.06       | 0.38             | 新股锁定     |

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 鹏华弘益混合 A      | 鹏华弘益混合 C         |
|---------------------------|---------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 28,107,368.16 | 1,501,012,918.04 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 723,004.88    | 66,842,468.35    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 5,086,699.05  | 145,329.85       |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             | -                |
| 报告期期末基金份额总额               | 23,743,673.99 | 1,567,710,056.54 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：截止本报告期末，本基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金管理人本报告期末申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华弘益灵活配置混合型证券投资基金 2016 年度第 4 季度报告》（原文）。

### 8.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层鹏华基金管理有限公司

深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦招商银行股份有限公司

### 8.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司  
2017 年 1 月 19 日