

鹏华动力增长混合型证券投资基金
(LOF)
2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华动力增长混合(LOF)
场内简称	鹏华动力
基金主代码	160610
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年1月9日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,754,197,822.19份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年3月9日

2.2 基金产品说明

投资目标	精选具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票,进行积极主动的投资管理,在有效控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	<p>(1) 股票投资:本基金股票投资采取“自上而下”和“自下而上”相结合的主动投资管理策略,策略分为战略性资产配置、动态资产配置和个股选择三个层次,重点投资具备高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票。</p> <p>(2) 债券投资:本基金债券投资的主要目的是规避股票投资部分的系统性风险,在投资过程中综合运用久期、收益率曲线、流动性、相对价值挖掘、套利等策略。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型(偏股型)基金,其预期风险和收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金中的偏债型基金,低于股票型基金,为证券投资基金中的中等风险品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	林葛

	联系电话	0755-82825720	010-66060069
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006788999	95599
传真		0755-82021126	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	66,503,517.79
本期利润	133,855,221.36
加权平均基金份额本期利润	0.0763
本期基金份额净值增长率	7.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0638
期末基金资产净值	1,866,055,408.00
期末基金份额净值	1.064

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6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

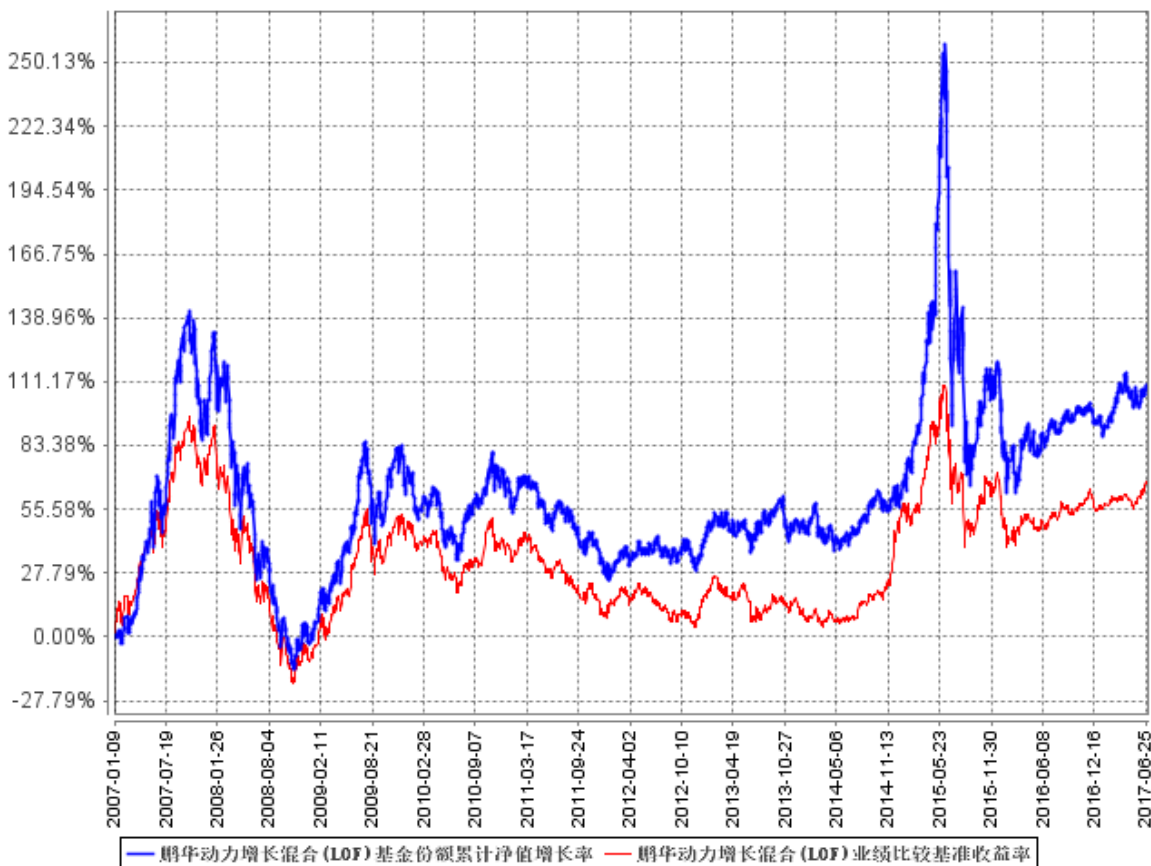
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	3.50%	0.65%	3.80%	0.47%	-0.30%	0.18%
过去三个月	0.66%	0.83%	4.33%	0.44%	-3.67%	0.39%
过去六个月	7.69%	0.75%	7.51%	0.40%	0.18%	0.35%
过去一年	10.14%	0.69%	11.46%	0.47%	-1.32%	0.22%
过去三年	44.15%	1.91%	54.42%	1.23%	-10.27%	0.68%
自基金合同生效起至今	108.80%	1.70%	67.23%	1.30%	41.57%	0.40%

注：本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

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

鹏华动力增长混合(LOF)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、本基金合同于2007年1月9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。

§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2017年6月，公司管理资产总规模达到4509.30亿元，管理149只公募基金、10只全国社保投资组合、2只基本养老保险投资组合。经过近19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		
郑川江	本基金基金经理	2016年6月24日	-	8	郑川江先生，国籍中国，经济学硕士，8年金融证券从业经验。历任鹏华基金管理有限公司研究员，长城证券研究所研究员、所长助理；2015年2月加盟鹏华基金管理有限公司，任职于研究部，从事行业研究工作，2015年6月起担任鹏华环保产业股票基金基金经理，2016年1月至2017年3月兼任鹏华健康环保混合基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华动力增长混合(LOF)基金基金经理，2017年4月起兼任鹏华新能源产业混合基金基金经理。郑川江先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，梁浩不再担任本基金基金经理。
梁浩	本基金基金经	2015年7月29日	2017年3月18日	9	梁浩先生，国籍中国，经济学博士，9年证券从业

	理			<p>经验。曾任职于信息产业部电信研究院，从事产业政策研究工作；2008年5月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，担任研究部高级研究员、基金经理助理，2014年3月至2015年12月兼任鹏华环保产业股票基金基金经理，2014年11月至2015年12月兼任鹏华先进制造股票基金基金经理，2011年7月起担任鹏华新兴产业混合基金基金经理，2015年7月起兼任鹏华动力增长混合(LOF)基金基金经理，2016年1月起兼任鹏华健康环保混合基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华医药科技股票基金基金经理，现同时担任研究部总经理、投资决策委员会成员。梁浩先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，梁浩不再担任本基金基金经理。</p>
--	---	--	--	---

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 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。本报告期内未发生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% 的情况。

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

二季度宏观经济的主基调是防范金融风险，金融体系的去杠杆担忧贯穿始终，4-5 月份利率逐步抬升，市场避险和抱团情绪比较严重，年初周期性行业产品涨价预期也在在二季度逐渐回落。经历了过去几年的供给收缩和供给侧改革，煤炭钢铁化工等行业供需格局显著改善，因为环保、金融等因素行业进入门槛不断攀升，龙头公司竞争优势进一步加强，A 股港股化的特点在加强，龙头公司估值折价情形在逐渐缩小。基金操作上减持了在利率上升环境中受损的环保板块，增加了金融板块、白酒、家电板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 7.69%，同期上证综指上涨 2.86%，深证成指上涨 3.46%，沪深 300 指数上涨 10.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济整体比较平稳，供给侧改革成效逐步体现，传统产业供需格局显著改善，产品价格稳定，行业集中程度明显提升，龙头公司盈利能力强。大气污染、水污染防治的压力倒逼下，政府对于污染源源头的控制力度将进一步加大，环保将成为大量高污染、高能耗行业发展的掣肘，周期性行业的龙头公司未来几年将保持高盈利状态。新能源汽车产业链下半年也将迎来相对的旺季，上游和电池材料的需求将继续旺盛，看好相关股票的投资机会。

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，本基金期末可供分配利润为 111,857,585.81 元，期末基金份额净值 1.064 元。

2. 本基金本报告期内未进行利润分配。

3. 根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—鹏华基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：		
银行存款	288,271,300.76	770,696,687.41
结算备付金	2,425,656.60	2,929,838.98
存出保证金	783,377.24	812,610.58
交易性金融资产	1,498,719,614.05	971,752,578.86
其中：股票投资	1,498,719,614.05	971,752,578.86
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	100,074,250.04	-
应收证券清算款	4,505,433.35	-
应收利息	88,292.54	159,972.29
应收股利	-	-
应收申购款	20,815.79	31,964.84
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,894,888,740.37	1,746,383,652.96
负债和所有者权益	本期末 2017年6月30日	上年度末 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	-	-
应付证券清算款	22,215,477.18	-
应付赎回款	1,884,960.72	983,824.28
应付管理人报酬	2,274,185.90	2,335,286.66
应付托管费	379,031.00	389,214.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,648,398.80	1,760,391.01
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	431,278.77	560,978.05
负债合计	28,833,332.37	6,029,694.43
所有者权益：		
实收基金	1,754,197,822.19	1,762,332,719.21
未分配利润	111,857,585.81	-21,978,760.68
所有者权益合计	1,866,055,408.00	1,740,353,958.53
负债和所有者权益总计	1,894,888,740.37	1,746,383,652.96

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.064 元，基金份额总额 1,754,197,822.19 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		155,646,359.30	-267,977,162.64
1.利息收入		1,924,564.52	2,266,055.02
其中：存款利息收入		1,827,746.31	2,208,594.46
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		96,818.21	57,460.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		86,329,521.12	-26,470,578.50
其中：股票投资收益		81,424,818.91	-34,582,260.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		4,904,702.21	8,111,681.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		67,351,703.57	-243,918,145.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		40,570.09	145,506.66
减：二、费用		21,791,137.94	23,228,700.57
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	13,415,841.91	15,654,563.55

2. 托管费	6.4.8.2.2	2,235,973.64	2,609,093.94
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		5,881,310.10	4,705,003.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		258,012.29	260,039.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		133,855,221.36	-291,205,863.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		133,855,221.36	-291,205,863.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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）	1,762,332,719.21	-21,978,760.68	1,740,353,958.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	133,855,221.36	133,855,221.36
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）	-8,134,897.02	-18,874.87	-8,153,771.89
其中：1.基金申购款	90,289,310.25	3,747,957.34	94,037,267.59
2.基金赎回款	-98,424,207.27	-3,766,832.21	-102,191,039.48
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）	1,754,197,822.19	111,857,585.81	1,866,055,408.00
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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)	1,699,232,345.61	831,964,937.33	2,531,197,282.94
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-291,205,863.21	-291,205,863.21
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)	682,442,158.52	8,731,392.13	691,173,550.65
其中：1.基金申购款	836,779,568.19	-495,090.30	836,284,477.89
2.基金赎回款	-154,337,409.67	9,226,482.43	-145,110,927.24
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)	-	-629,727,002.14	-629,727,002.14
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,381,674,504.13	-80,236,535.89	2,301,437,968.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)(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”)证监基金字[2006]第245号《关于同意鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,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《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定。本基金自2006年12月8日至2006年12月28日期间公开发售,首次设立募集不包括认购资金利息共募集11,014,840,003.30元,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入7,895,780.24元,经德勤华永会计师事务所有限公司德师(上海)报验字(07)第SZ001号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于2007年1月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为11,022,728,857.13份基金份

额，其中认购资金利息折合 7,888,853.83 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2007]第 26 号文审核同意，本基金 632,516,873.00 份基金份额于 2007 年 3 月 9 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过本基金代销机构赎回或通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后进行上市交易。

根据《证券投资基金法》及相关法律法规以及《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)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，包括国内依法发行的各类股票、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。本基金股票的主要投资方向为具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的增长型股票，本基金对这部分股票的投资比例不低于本基金股票资产的 80%。股票资产占基金资产比例为 30%-95%；债券资产占基金资产比例为 0%-65%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在 1 年以内政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准原为：新华富时 600 成长指数收益率 X 70%+中证综合债指数收益率 X 30%。根据本基金的基金管理人 2009 年 5 月 22 日发布的《鹏华基金管理有限公司修改旗下动力增长基金基金合同中“业绩比较基准”定义的公告》，本基金的业绩比较基准修改为：沪深 300 指数收益率 X 70%+中证综合债指数收益率 X 30%。

6.4.2 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年上半年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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期本基金没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补充政策的通知》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。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注：无。

6.4.8.1.2 债券交易

注：无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,415,841.91	15,654,563.55

其中：支付销售机构的客户维护费	3,147,821.28	3,052,062.70
-----------------	--------------	--------------

注：（1）支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

（2）根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,235,973.64	2,609,093.94

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费年费率为0.25%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除本基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国农业银行	288,271,300.76	1,791,690.08	756,264,965.14	2,128,181.92
--------	----------------	--------------	----------------	--------------

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

603331	百达精工	2017年 6月 27日	2017年 7月 5日	新股流 通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年 6月 27日	2017年 7月 5日	新股流 通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年 6月 23日	2017年 7月 3日	新股流 通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注：截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证等其他证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002076	雪莱特	2017年 3月 20日	重大 事项	7.07	-	-	3,144,886	20,753,255.31	22,234,344.02	-
601919	中远海控	2017年 5月 17日	重大 事项	5.35	2017年 7月 26日	5.89	4,009,300	25,009,248.12	21,449,755.00	-
601028	玉龙股份	2017年 6月 23日	重大 事项	8.40	-	-	2,149,400	22,887,598.67	18,054,960.00	-
002025	航天电器	2016年 9月 12日	重大 事项	23.69	2017年 7月 4日	22.46	473,000	12,191,954.69	11,205,370.00	-
300518	盛讯达	2016年 12月 13日	重大 事项	113.30	2017年 7月 10日	101.97	1,306	29,019.32	147,969.80	-
603238	诺邦股	2017年 5月	重大 事	29.38	2017年 8月	31.99	1,750	23,292.50	51,415.00	-

	份	15日	项		23日				
--	---	-----	---	--	-----	--	--	--	--

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,498,719,614.05	79.09
	其中：股票	1,498,719,614.05	79.09
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	100,074,250.04	5.28
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	290,696,957.36	15.34
7	其他各项资产	5,397,918.92	0.28
8	合计	1,894,888,740.37	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	63,465,373.80	3.40
C	制造业	1,002,671,337.18	53.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	126,306,827.59	6.77
E	建筑业	44,566,778.24	2.39
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	21,449,755.00	1.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,633,127.61	1.86
J	金融业	95,773,447.31	5.13
K	房地产业	8,771,802.20	0.47
L	租赁和商务服务业	26,034,487.12	1.40
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	56,628,000.00	3.03
R	文化、体育和娱乐业	18,418,678.00	0.99
S	综合	-	-
	合计	1,498,719,614.05	80.31

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300156	神雾环保	3,731,233	122,235,193.08	6.55
2	000651	格力电器	1,810,380	74,533,344.60	3.99
3	600309	万华化学	2,290,900	65,611,376.00	3.52
4	000968	蓝焰控股	4,389,030	63,465,373.80	3.40
5	000858	五粮液	1,035,536	57,637,933.76	3.09
6	300244	迪安诊断	1,800,000	56,628,000.00	3.03
7	000915	山大华特	1,425,258	52,549,262.46	2.82
8	600236	桂冠电力	9,181,772	52,336,100.40	2.80
9	600030	中信证券	3,010,600	51,240,412.00	2.75
10	600809	山西汾酒	1,408,900	48,874,741.00	2.62

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com> 的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002616	长青集团	87,595,128.89	5.03
2	600309	万华化学	82,481,145.51	4.74
3	600519	贵州茅台	73,873,821.41	4.24
4	000858	五粮液	71,791,846.55	4.13
5	601328	交通银行	70,608,288.00	4.06
6	600809	山西汾酒	65,030,266.80	3.74
7	000651	格力电器	61,891,389.06	3.56
8	600236	桂冠电力	59,477,775.77	3.42
9	600026	中远海能	56,100,113.94	3.22
10	000968	蓝焰控股	53,821,633.76	3.09
11	600030	中信证券	51,535,306.11	2.96
12	300332	天壕环境	49,897,020.23	2.87
13	002121	科陆电子	49,798,034.19	2.86
14	000915	山大华特	48,549,839.93	2.79
15	300033	同花顺	46,027,052.89	2.64
16	601668	中国建筑	45,185,612.91	2.60
17	601991	大唐发电	40,246,559.77	2.31
18	601628	中国人寿	38,818,932.41	2.23
19	000582	北部湾港	38,193,161.20	2.19
20	601336	新华保险	37,810,325.89	2.17
21	600038	中直股份	36,437,869.73	2.09
22	600642	申能股份	36,299,375.99	2.09
23	603589	口子窖	35,228,867.00	2.02
24	000568	泸州老窖	35,001,893.23	2.01
25	300068	南都电源	34,901,862.66	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000820	神雾节能	143,654,905.50	8.25
2	002616	长青集团	101,280,751.10	5.82
3	601328	交通银行	71,808,492.58	4.13
4	300244	迪安诊断	56,860,379.99	3.27

5	600016	民生银行	54,391,568.98	3.13
6	600026	中远海能	54,312,695.93	3.12
7	002343	慈文传媒	50,488,790.33	2.90
8	600519	贵州茅台	50,456,517.07	2.90
9	600566	济川药业	43,498,844.00	2.50
10	601991	大唐发电	41,475,437.84	2.38
11	300332	天壕环境	41,208,728.90	2.37
12	601336	新华保险	40,783,446.57	2.34
13	300033	同花顺	38,835,706.84	2.23
14	600642	申能股份	36,676,267.51	2.11
15	300156	神雾环保	35,118,204.61	2.02
16	603589	口子窖	34,391,092.00	1.98
17	000625	长安汽车	33,980,927.56	1.95
18	600690	青岛海尔	33,622,964.09	1.93
19	600038	中直股份	32,614,699.13	1.87
20	600027	华电国际	32,334,907.10	1.86

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,213,979,866.77
卖出股票收入（成交）总额	1,835,789,354.06

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

注：无。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券之一的中信证券股份有限公司（以下简称“公司”）于2017年5月25日公告，2015年，公司曾公告收到中国证监会调查通知书（稽查总队调查通字153121号），该次调查的范围是公司在融资融券业务开展过程中，存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”规定之嫌（详见公司于2015年11月26日、2015年11月29日香港交易及结算所有限公司披露易网站 <http://www.hkexnews.hk>，次日上海证券交易所网站 <http://www.sse.com.cn>、《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》）。日前，就前述调查，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]57号），主要内容如下：2011年2月23日，司度（上海）贸易有限公司（以下简称“司度”）在中信证券开立普通证券账户，一直未从事证券交易。根据《中信证券股份有限公司融资融券业务客户征信授信实施细则》（2010年3月发布，沿用至2013年3月25日，以下简称“《实施细则》”）的规定，“在公司开户满半年（试点期间，开户满18个月）”为开立信用账户的条件之一，中信证券在司度从事证券交易时间连续计算不足半年的情况下，为司度提供融资融券服务，于2012年3月12日为其开立了信用证券账户。2012年3月19日，中信证券与司度签订

《融资融券业务合同》，致使司度得以开展融券交易。《实施细则》由当时中信证券信用交易管理部负责人宋成牵头制定，由分管副总经理笪新亚签批实施。截至2015年10月22日，中信证券向司度收取融券收益人民币52,886,294.80元，融券成本人民币47,263,484.17元，净融券收益人民币5,622,810.63元；截至2015年10月10日，中信证券向司度收取交易佣金人民币89,428,768.96元，扣除交易所规费人民币33,395,729.81元，净佣金收益人民币56,033,039.15元；共计收益人民币61,655,849.78元。上述行为违反了《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告[2011]31号）第二十一条“对未按照要求提供有关情况、在本公司及与本公司具有控制关系的其他证券公司从事证券交易的时间连续计算不足半年，证券公司不得向其融资、融券”的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同”所述行为。对上述行为直接负责的主管人员为笪新亚、其他直接责任人员为宋成。依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项的规定，中国证监会拟决定：一、责令中信证券改正，给予警告，没收违法所得人民币61,655,849.78元，并处人民币308,279,248.90元罚款；二、对笪新亚、宋成给予警告，并分别处以人民币10万元罚款。

此事件发生以来的近两年间，在监管机构的指导下，公司持续完善相关内控机制，今后公司将进一步加强日常经营管理，依法合规地开展各项业务。目前，公司的经营情况正常。后续进展情况（如，公司收到中国证监会正式行政处罚决定书），公司将按相关规定进一步刊发公告。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该股票，从监管措施公告中知悉，相关问题对于公司经营并不构成重大实质性影响。对公司的财务状况及经营成果并不产生重大实质性影响。本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名的其它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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	783,377.24

2	应收证券清算款	4,505,433.35
3	应收股利	-
4	应收利息	88,292.54
5	应收申购款	20,815.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,397,918.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
91,976	19,072.34	49,619,538.98	2.83%	1,704,578,283.21	97.17%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	李珍林	1,000,440.00	1.86%
2	胡文明	720,968.00	1.34%
3	殷丽萍	680,183.00	1.26%
4	山东金岭铁矿	600,168.00	1.11%
5	缪灿衍	570,100.00	1.06%
6	贾晶	498,841.00	0.93%
7	楚喜兰	457,735.00	0.85%
8	李兆稀	441,431.00	0.82%
9	杭州雷峰塔文化旅游发展有 限公司	425,190.00	0.79%
10	修桂珍	324,690.00	0.60%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	911.96	0.0001%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年1月9日）基金份额总额	11,022,728,857.13
本报告期期初基金份额总额	1,762,332,719.21
本报告期基金总申购份额	90,289,310.25
减：本报告期基金总赎回份额	98,424,207.27
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,754,197,822.19

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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，经公司董事会审议通过，公司聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自2017年3月22日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的重大人事变动：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
华泰证券	2	1,100,764,177.43	27.21%	1,003,128.54	27.21%	-
光大证券	1	947,128,896.64	23.41%	863,122.20	23.41%	-
长江证券	1	680,380,907.42	16.82%	620,031.73	16.82%	-
中信证券	1	434,094,798.63	10.73%	395,590.67	10.73%	-
海通证券	1	291,149,860.28	7.20%	265,322.51	7.20%	-
东兴证券	2	194,707,311.65	4.81%	177,436.46	4.81%	-
中金公司	1	153,984,132.08	3.81%	140,325.81	3.81%	-
宏源证券	2	93,426,419.90	2.31%	85,139.63	2.31%	-
广发证券	1	79,288,153.94	1.96%	72,255.48	1.96%	-
申万宏源	1	70,565,189.71	1.74%	64,303.53	1.74%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-

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，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理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
- (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。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，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质量等情况，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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期内未通过券商交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

鹏华基金管理有限公司

2017年8月28日