鹏华普天收益证券投资基金
2017 年半年度报告

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：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人交通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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 8
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 37
7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
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 51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 51
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 51
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 51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 51

7.12 投资组合报告附注.....52
§8 基金份额持有人信息.....53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....53
8.3 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.....53
§9 开放式基金份额变动.....54
§10 重大事件揭示.....55
10.1 基金份额持有人大会决议.....55
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.....55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....55
10.4 基金投资策略的改变.....55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....55
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.....55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....55
10.8 其他重大事件.....57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....61
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.....61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....61
§12 备查文件目录.....62
12.1 备查文件目录.....62
12.2 存放地点.....62
12.3 查阅方式.....62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华普天收益证券投资基金
基金简称	鹏华普天收益混合
场内简称	-
基金主代码	160603
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 12 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	424,999,924.73 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	以分享中国经济成长和资本长期稳健增值为宗旨，主要投资于连续现金分红股票及债券，通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金财产的长期稳定增值。
投资策略	（1）债券投资方法：本基金债券投资的目的是降低组合总体波动性从而改善组合风险构成。在债券的投资上，采取积极主动的投资策略，不对持续期作限制。持续期、期限结构、类属配置以及个券选择的动态调整都将是我们获得超额收益的重要来源。 （2）股票投资方法：本基金主要采用积极管理的投资方式。以鹏华股票池中连续两年分红股票以及三年内有两年分红记录的公司作为投资对象，适当集中投资。所有重点投资股票必须经过基金经理/研究员的调研，就企业经营、融资计划、分红能力、绝对价值、相对价值给出全面评估报告。
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	本基金属平衡型证券投资基金，为证券投资基金中的中等风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金，高于指数型基金、纯债券基金和国债。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	陆志俊
	联系电话	0755-82825720	95559
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006788999	95559
传真		0755-82021126	021-62701216
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		518048	200120
法定代表人		何如	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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	19,251,341.21
本期利润	5,424,426.45
加权平均基金份额本期利润	0.0124
本期加权平均净值利润率	0.97%
本期基金份额净值增长率	0.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	124,128,856.01
期末可供分配基金份额利润	0.2921
期末基金资产净值	549,128,780.74
期末基金份额净值	1.292
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	624.71%

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）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。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	5.30%	0.75%	3.80%	0.47%	1.50%	0.28%
过去三个月	-0.69%	0.76%	4.33%	0.44%	-5.02%	0.32%
过去六个月	0.94%	0.71%	7.51%	0.40%	-6.57%	0.31%
过去一年	7.23%	0.72%	11.46%	0.47%	-4.23%	0.25%
过去三年	68.98%	1.65%	57.35%	1.22%	11.63%	0.43%
自基金合同生效起至今	624.71%	1.39%	217.06%	1.23%	407.65%	0.16%

注：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%

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

鹏华普天收益混合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 2003 年 7 月 12 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		
张卓	本基金基金经理	2009 年 1 月 17 日	-	13	张卓先生，国籍中国，管理学硕士，13 年证券从业经验。2004 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，历任行业研究员、鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理助理，2007 年 8 月至 2009 年 1 月担任鹏华优质治理股票基金(LOF)基金经理，2011 年 1 月至 2013 年 3 月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2009 年 1 月起担任鹏华普天收益基金基金经理，2015 年 5 月起兼任鹏华外延成长混合基金基金经理。张卓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

基于 2016 年 10 月开始，国内政策转向货币收缩和地产压制，所以本基金对 2017 年的股票市场判断比较悲观，策略上偏向保守。不过整体市场存量资金较大，债市去杠杆也导致大量资金撤出，股票市场存量尤其新增力量主要由机构主导，所以导致整个股票市场大市值股票表现较优，17 年上半年股票市场的表现超预期，并且个股呈较大分化。一季度本基金布局了地方国企改革的个股和中小市值股票，但在家电、白酒等消费领域布局不够，虽后期针对周期性类股票、三四线城市的消费升级以及消费类电子的景气上升等机会做了改进调整，但总体净值表现一般。在充分分析市场后，本基金在 4 月份结构上做了较大幅度的调整，减持了绝大部分中小市值的股票，配置于家电、白酒、地产、消费电子、保险等行业个股，但是总体配置比例上还是略低于市场，同时基本没有参与雄安概念股，净值的表现难以超越市场。

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 0.94%，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

全球需求持续小幅放缓，数据显示，相比 4 月，5-6 月美国和新兴市场济数据进一步放缓，欧日经济表现相对较好，全球整体需求温和扩张。美国经济数据持续低于预期，多数国家通胀同

比延续自今年 2 月以来的放缓态势，而日本 CPI 增速略有上行。美联储如期加息，欧央行按兵不动。美联储短期继续加息可能性较低，但有可能以缩表的方式代替加息。总体来看美国经济走势对人民币汇率的冲击影响在逐步缩小。

国内 2 季度 GDP 增速温和回落，预计维持 6.7-6.8%。地产投资 5 月略有下滑，但 6/7 月因低基数及投资惯性，整体韧性仍足。消费+出口构成有利支撑。年初以来消费稳中有升，构成经济支撑项之一。出口增速持续维持高位，成为另一经济支撑动能。6 月 PMI 指数大幅反弹至 51.7（前值 51.2），为年内次高（最大值为 3 月的 51.8），超出市场预期，上半年工业的走势大幅强于预期。

需要关注的是，9 月之后基数效应影响加大，对于强景气数据增速都有所冲击，三季度是验证投资放缓是否对经济带来拖累的关键时点。

目前市场纠结于两个问题：1、长期且具有弹性的去杠杆政策对资本市场的冲击幅度；2、“漂亮 50”对比中小市值成长股的性价比。我们认为市场的方向难以判断，但是基于基本面的投资方向要得以坚持，要继续加大研究力度，发掘能回避周期影响，成长确定性强的公司，慢慢开始布局真成长的小市值股票，为持有者创造收益。

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 124,128,856.01 元，期末基金份额净值 1.292 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

2017 年上半年度，基金托管人在鹏华普天收益证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年上半年度，鹏华基金管理有限公司在鹏华普天收益证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2017 年上半年度，由鹏华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关鹏华普天收益证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：鹏华普天收益证券投资基金

报告截止日： 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	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	6.4.7.1	9,100,839.55	6,293,760.37
结算备付金		41,242,606.79	42,737,111.31
存出保证金		241,304.25	220,283.99
交易性金融资产	6.4.7.2	499,855,396.74	517,214,432.66
其中：股票投资		384,756,896.74	397,296,992.62
基金投资		-	-
债券投资		115,098,500.00	119,917,440.04
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	8,991,089.88
应收利息	6.4.7.5	3,754,385.84	2,024,306.50
应收股利		-	-
应收申购款		59,516.27	7,448.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		554,254,049.44	577,488,433.63
负债和所有者权益	**附注号**	**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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,267,384.87	-
应付赎回款		710,643.32	453,705.68
应付管理人报酬		666,191.69	733,557.31
应付托管费		88,825.56	97,807.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,139,232.03	629,607.48
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	252,991.23	257,210.96
负债合计		5,125,268.70	2,171,889.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	424,999,924.73	449,618,494.34
未分配利润	6.4.7.10	124,128,856.01	125,698,050.24
所有者权益合计		549,128,780.74	575,316,544.58
负债和所有者权益总计		554,254,049.44	577,488,433.63

注：报告截止日 2017 月 6 月 30 日，基金份额净值 1.292 元，基金份额总额 424,999,924.73 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华普天收益证券投资基金

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		12,946,123.92	-83,737,188.98
1.利息收入		2,034,889.86	2,121,947.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	336,688.82	281,208.69
债券利息收入		1,698,201.04	1,840,738.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,720,774.75	-67,608,644.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,043,883.42	-69,366,245.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-119,502.70	-31,380.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	4,796,394.03	1,788,981.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-13,826,914.76	-18,287,771.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	17,374.07	37,279.23
减：二、费用		7,521,697.47	7,387,075.89
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	4,143,319.59	4,266,714.07
2．托管费	6.4.10.2.2	552,442.61	568,895.17
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	2,711,947.84	2,417,586.55

5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	6.4.7.20	113,987.43	133,880.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,424,426.45	-91,124,264.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,424,426.45	-91,124,264.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华普天收益证券投资基金

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）	449,618,494.34	125,698,050.24	575,316,544.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,424,426.45	5,424,426.45
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）	-24,618,569.61	-6,993,620.68	-31,612,190.29
其中：1.基金申购款	5,859,813.18	1,620,294.65	7,480,107.83
2.基金赎回款	-30,478,382.79	-8,613,915.33	-39,092,298.12
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）	424,999,924.73	124,128,856.01	549,128,780.74
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	499,818,199.47	204,299,665.02	704,117,864.49

金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-91,124,264.87	-91,124,264.87
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）	-26,134,237.73	-5,002,949.93	-31,137,187.66
其中：1.基金申购款	21,036,069.36	3,808,683.92	24,844,753.28
2.基金赎回款	-47,170,307.09	-8,811,633.85	-55,981,940.94
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）	473,683,961.74	108,172,450.22	581,856,411.96

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

鹏华普天系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)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 2003 第 61 号《关于同意鹏华普天系列开放式证券投资基金设立的批复》核准，由鹏华基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》)发起，并于 2003 年 7 月 12 日募集成立。本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设两个子基金，分别为普天收益证券投资基金(以下简称“本基金”)和普天债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,140,717,155.06 元，其中包括本基金 343,227,588.04 元和普天债券投资基金 797,489,567.02 元，经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 78 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金已按规定将《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》等法定文件报中国证监会备案。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具；具体投资于连续分红的股票和债券，对连续分红企业的投资不少于股票资产的 80%。在正常市场状况下，股票投资比例一般情况下为 70%，国债投资比例不低于 20%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资不低于基金资产的 5%。本基金的业绩比较基准为：中信标普 A 股综合指数涨跌幅 x70%＋中信标普国债指数涨跌幅×25%＋金融同业存款利率×5%。

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》、《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	9,100,839.55
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,100,839.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		349,194,692.00	384,756,896.74	35,562,204.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	4,992,500.00	4,994,500.00	2,000.00
	银行间市场	110,223,720.00	110,104,000.00	-119,720.00
	合计	115,216,220.00	115,098,500.00	-117,720.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		464,410,912.00	499,855,396.74	35,444,484.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,732.00
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	14,756.09
应收债券利息	3,737,800.01
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	97.74
合计	3,754,385.84

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,138,657.03
银行间市场应付交易费用	575.00
合计	1,139,232.03

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	342.51
预提费用	252,648.72
合计	252,991.23

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	449,618,494.34	449,618,494.34
本期申购	5,859,813.18	5,859,813.18
本期赎回(以"-"号填列)	-30,478,382.79	-30,478,382.79
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	424,999,924.73	424,999,924.73

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	187,414,763.77	-61,716,713.53	125,698,050.24
本期利润	19,251,341.21	-13,826,914.76	5,424,426.45
本期基金份额交易产生的变动数	-11,522,904.36	4,529,283.68	-6,993,620.68
其中：基金申购款	2,699,362.08	-1,079,067.43	1,620,294.65
基金赎回款	-14,222,266.44	5,608,351.11	-8,613,915.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	195,143,200.62	-71,014,344.61	124,128,856.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	24,109.19
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	310,924.62
其他	1,655.01
合计	336,688.82

注：其他包括申购款利息收入以及结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	904,718,340.82
减：卖出股票成本总额	884,674,457.40
买卖股票差价收入	20,043,883.42

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	-119,502.70

券到期兑付）差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-119,502.70

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	133,139,326.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	130,159,120.00
减：应收利息总额	3,099,708.91
买卖债券差价收入	-119,502.70

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。,

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,796,394.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,796,394.03

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-13,826,914.76
——股票投资	-14,021,024.72
——债券投资	194,109.96
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-13,826,914.76

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	14,565.24
转换费收入	2,808.83
合计	17,374.07

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,711,197.84
银行间市场交易费用	750.00
合计	2,711,947.84

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	28,264.96
信息披露费	74,383.76
银行汇划费	2,138.71
其他	200.00
账户维护费	9,000.00
合计	113,987.43

注：其他为上清所数字证书费。

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	4,143,319.59	4,266,714.07
其中：支付销售机构的客户维护费	1,009,413.48	1,044,118.46

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 1.5%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷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。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	552,442.61	568,895.17

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（ 2003 年 7 月 12 日 ）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	19,138,751.92	19,138,751.92
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,138,751.92	19,138,751.92
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.50%	4.04%

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	9,100,839.55	24,109.19	1,248,693.97	55,305.06

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（ 2017 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
600658	电子城	2016 年 9 月 5 日	2017 年 9 月 1 日	非公开发行流通受限	11.01	12.64	1,362,398	15,000,001.98	17,220,710.72	-
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	-

6.4.12.2 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
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	-
300510	金冠电气	2017年3月10日	重大事项	34.85	2017年7月11日	35.00	2,730	16,789.50	95,140.50	-

300088	长信科技	2016年9月12日	重大事项	15.75	2017年8月9日	14.50	3,900	12,000.00	61,425.00	-
603238	诺邦股份	2017年5月15日	重大事项	29.38	2017年8月23日	31.99	1,750	23,292.50	51,415.00	-
603016	新宏泰	2017年5月2日	重大事项	28.60	-	-	1,602	13,600.98	45,817.20	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	10.29	-	-	4,400	22,477.92	45,276.00	-
300267	尔康制药	2017年5月10日	重大事项	11.46	-	-	3,664	8,566.42	41,989.44	-
002856	美芝股份	2017年6月19日	重大事项	31.86	-	-	1,230	14,280.30	39,187.80	-
300149	量子高科	2016年12月15日	重大事项	19.37	-	-	1,540	9,195.01	29,829.80	-
002418	康盛股份	2017年3月20日	重大事项	9.31	2017年7月10日	9.30	2,400	9,990.00	22,344.00	-
002356	赫美集团	2017年6月14日	重大事项	25.41	-	-	297	4,378.77	7,546.77	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事项	11.32	-	-	335	3,059.24	3,792.20	-
002348	高乐股份	2017年5月11日	重大事项	7.01	2017年7月27日	6.70	198	1,308.74	1,387.98	-

000887	中鼎股份	2017年4月27日	重大事项	22.09	2017年7月14日	19.88	22	698.13	485.98	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理

人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2016 年 12 月 31 日：0.02%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,100,839.55	-	-	-	9,100,839.55
结算备付金	41,242,606.79	-	-	-	41,242,606.79
存出保证金	241,304.25	-	-	-	241,304.25
交易性金融资产	115,098,500.00	-	-	384,756,896.74	499,855,396.74
应收利息	-	-	-	3,754,385.84	3,754,385.84
应收申购款	-	-	-	59,516.27	59,516.27
资产总计	165,683,250.59	-	-	388,570,798.85	554,254,049.44
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,267,384.87	2,267,384.87
应付赎回款	-	-	-	710,643.32	710,643.32
应付管理人报酬	-	-	-	666,191.69	666,191.69
应付托管费	-	-	-	88,825.56	88,825.56
应付交易费用	-	-	-	1,139,232.03	1,139,232.03
其他负债	-	-	-	252,991.23	252,991.23
负债总计	-	-	-	5,125,268.70	5,125,268.70
利率敏感度缺口	165,683,250.59	-	-	383,445,530.15	549,128,780.74
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,293,760.37	-	-	-	6,293,760.37
结算备付金	42,737,111.31	-	-	-	42,737,111.31
存出保证金	220,283.99	-	-	-	220,283.99
交易性金融资产	119,803,000.00	-	114,440.04	397,296,992.62	517,214,432.66
应收证券清算款	-	-	-	8,991,089.88	8,991,089.88

应收利息	-	-	-	2,024,306.50	2,024,306.50
应收申购款	-	-	-	7,448.92	7,448.92
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	169,054,155.67	-	114,440.04	408,319,837.92	577,488,433.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	453,705.68	453,705.68
应付管理人报酬	-	-	-	733,557.31	733,557.31
应付托管费	-	-	-	97,807.62	97,807.62
应付交易费用	-	-	-	629,607.48	629,607.48
其他负债	-	-	-	257,210.96	257,210.96
负债总计	-	-	-	2,171,889.05	2,171,889.05
利率敏感度缺口	169,054,155.67	-	114,440.04	406,147,948.87	575,316,544.58

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2017 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2016 年 12 月 31 日 ）
	市场利率下降 25 个基点	55,329.29	100,710.07
	市场利率上升 25 个基点	-55,229.03	-100,537.93

注：

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过

程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金在正常市场状况下，股票投资比例一般情况下为 70%，国债投资比例不低于 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	384,756,896.74	70.07	397,296,992.62	69.06
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	384,756,896.74	70.07	397,296,992.62	69.06

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2017 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2016 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	23,297,027.10	26,716,403.42
	业绩比较基准下降 5%	-23,297,027.10	-26,716,403.42

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§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	384,756,896.74	69.42
	其中：股票	384,756,896.74	69.42
2	固定收益投资	115,098,500.00	20.77
	其中：债券	115,098,500.00	20.77
	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	-	-
	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	50,343,446.34	9.08
7	其他各项资产	4,055,206.36	0.73
8	合计	554,254,049.44	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	86,790.44	0.02
B	采矿业	6,159,263.68	1.12
C	制造业	220,517,041.95	40.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,464,162.80	2.63
E	建筑业	941,755.34	0.17
F	批发和零售业	593,170.69	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	27,084,513.88	4.93
H	住宿和餐饮业	306.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,316,962.07	0.24
J	金融业	902,769.12	0.16
K	房地产业	92,818,919.26	16.90
L	租赁和商务服务业	388,387.23	0.07
M	科学研究和技术服务业	459,240.65	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	311,945.52	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,570,257.84	1.74
R	文化、体育和娱乐业	9,141,410.27	1.66
S	综合	-	-
	合计	384,756,896.74	70.07

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000651	格力电器	1,100,066	45,289,717.22	8.25
2	000568	泸州老窖	861,419	43,570,573.02	7.93
3	002244	滨江集团	3,849,901	26,641,314.92	4.85
4	603626	科森科技	299,927	19,549,241.86	3.56
5	600466	蓝光发展	2,223,281	19,186,915.03	3.49
6	002185	华天科技	2,600,000	18,824,000.00	3.43
7	600658	电子城	1,458,498	18,474,815.72	3.36
8	600340	华夏幸福	550,000	18,469,000.00	3.36
9	601006	大秦铁路	2,000,000	16,780,000.00	3.06
10	600236	桂冠电力	2,499,862	14,249,213.40	2.59
11	603833	欧派家居	122,329	13,439,063.94	2.45
12	002050	三花智控	800,000	13,056,000.00	2.38
13	601799	星宇股份	267,991	11,850,562.02	2.16
14	600343	航天动力	599,947	10,403,080.98	1.89
15	600048	保利地产	1,000,000	9,970,000.00	1.82
16	601111	中国国航	1,000,000	9,750,000.00	1.78
17	300244	迪安诊断	304,204	9,570,257.84	1.74
18	000529	广弘控股	1,000,003	9,150,027.45	1.67
19	300133	华策影视	799,924	8,959,148.80	1.63
20	603986	兆易创新	100,000	7,781,000.00	1.42
21	002876	三利谱	100,000	6,120,000.00	1.11
22	000968	蓝焰控股	400,000	5,784,000.00	1.05
23	002508	老板电器	130,000	5,652,400.00	1.03
24	002705	新宝股份	300,000	4,509,000.00	0.82
25	601939	建设银行	53,500	329,025.00	0.06

26	002045	国光电器	15,000	238,350.00	0.04
27	002544	杰赛科技	10,000	228,000.00	0.04
28	600919	江苏银行	24,215	224,957.35	0.04
29	600035	楚天高速	40,408	222,648.08	0.04
30	600270	外运发展	10,000	189,300.00	0.03
31	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.03
32	300210	森远股份	18,000	174,600.00	0.03
33	603017	中衡设计	9,596	168,697.68	0.03
34	002229	鸿博股份	14,866	166,499.20	0.03
35	300266	兴源环境	5,358	164,597.76	0.03
36	601997	贵阳银行	10,141	160,329.21	0.03
37	002271	东方雨虹	4,000	148,400.00	0.03
38	300518	盛讯达	1,306	147,969.80	0.03
39	600415	小商品城	20,000	144,800.00	0.03
40	600446	金证股份	8,106	142,503.48	0.03
41	603708	家家悦	7,636	125,612.20	0.02
42	603228	景旺电子	2,597	125,305.25	0.02
43	603816	顾家家居	2,105	123,731.90	0.02
44	603007	花王股份	6,060	118,412.40	0.02
45	603165	荣晟环保	1,767	117,240.45	0.02
46	603225	新凤鸣	3,197	115,667.46	0.02
47	603337	杰克股份	2,833	109,637.10	0.02
48	300164	通源石油	16,000	109,600.00	0.02
49	603027	千禾味业	5,808	107,389.92	0.02
50	002867	周大生	3,444	106,350.72	0.02
51	600859	王府井	6,500	104,975.00	0.02
52	600456	宝钛股份	5,000	102,600.00	0.02
53	300146	汤臣倍健	7,384	101,456.16	0.02
54	603098	森特股份	4,293	99,082.44	0.02
55	002242	九阳股份	5,000	98,350.00	0.02
56	002790	瑞尔特	3,022	97,943.02	0.02
57	002243	通产丽星	10,000	96,700.00	0.02
58	603660	苏州科达	2,353	96,355.35	0.02
59	603515	欧普照明	2,663	96,187.56	0.02
60	300510	金冠电气	2,730	95,140.50	0.02
61	002818	富森美	2,401	94,767.47	0.02
62	002791	坚朗五金	4,023	93,454.29	0.02
63	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.02
64	601858	中国科传	7,280	91,145.60	0.02

65	603358	华达科技	1,769	89,617.54	0.02
66	603393	新天然气	2,180	85,935.60	0.02
67	603737	三棵树	1,327	85,100.51	0.02
68	603798	康普顿	3,180	85,033.20	0.02
69	300511	雪榕生物	4,308	84,781.44	0.02
70	603058	永吉股份	3,869	83,957.30	0.02
71	603189	网达软件	3,898	83,729.04	0.02
72	300623	捷捷微电	1,242	83,462.40	0.02
73	300569	天能重工	2,365	83,129.75	0.02
74	603689	皖天然气	4,818	82,628.70	0.02
75	603345	安井食品	3,227	82,611.20	0.02
76	603658	安图生物	1,911	82,364.10	0.01
77	603133	碳元科技	2,445	82,054.20	0.01
78	603113	金能科技	3,496	81,526.72	0.01
79	603717	天域生态	2,490	81,198.90	0.01
80	603186	华正新材	1,874	80,150.98	0.01
81	603303	得邦照明	2,392	79,868.88	0.01
82	600499	科达洁能	10,000	79,400.00	0.01
83	300641	正丹股份	4,020	77,586.00	0.01
84	002789	建艺集团	1,500	76,950.00	0.01
85	300512	中亚股份	3,746	75,968.88	0.01
86	603577	汇金通	2,460	75,743.40	0.01
87	000608	阳光股份	10,000	75,700.00	0.01
88	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.01
89	002845	同兴达	1,048	75,246.40	0.01
90	300660	江苏雷利	946	74,979.96	0.01
91	002848	高斯贝尔	2,500	74,525.00	0.01
92	002872	天圣制药	2,003	74,050.91	0.01
93	603385	惠达卫浴	2,750	73,672.50	0.01
94	603032	德新交运	1,628	73,097.20	0.01
95	002815	崇达技术	2,180	72,027.20	0.01
96	300570	太辰光	3,258	71,513.10	0.01
97	002795	永和智控	2,900	70,151.00	0.01
98	603768	常青股份	2,755	70,087.20	0.01
99	603727	博迈科	2,172	70,068.72	0.01
100	603920	世运电路	3,125	70,062.50	0.01
101	300627	华测导航	1,498	69,806.80	0.01
102	603586	金麒麟	2,046	69,666.30	0.01
103	603421	鼎信通讯	2,480	69,415.20	0.01

104	601899	紫金矿业	20,000	68,600.00	0.01
105	002851	麦格米特	1,708	68,097.96	0.01
106	300508	维宏股份	970	67,318.00	0.01
107	603208	江山欧派	1,221	65,970.63	0.01
108	300534	陇神戎发	3,486	65,780.82	0.01
109	603843	正平股份	4,642	65,684.30	0.01
110	603179	新泉股份	1,495	65,645.45	0.01
111	000488	晨鸣纸业	5,000	64,500.00	0.01
112	603639	海利尔	1,206	64,062.72	0.01
113	002832	比音勒芬	1,158	63,771.06	0.01
114	300529	健帆生物	2,150	63,554.00	0.01
115	603728	鸣志电器	2,719	63,434.27	0.01
116	603138	海量数据	1,425	63,384.00	0.01
117	002793	东音股份	2,826	63,358.92	0.01
118	300610	晨化股份	2,694	63,228.18	0.01
119	300600	瑞特股份	1,124	62,606.80	0.01
120	603609	禾丰牧业	6,540	62,522.40	0.01
121	603569	长久物流	1,853	61,945.79	0.01
122	603779	威龙股份	2,808	61,439.04	0.01
123	300088	长信科技	3,900	61,425.00	0.01
124	300526	中潜股份	1,968	61,421.28	0.01
125	603958	哈森股份	2,372	60,533.44	0.01
126	002811	亚泰国际	2,469	60,441.12	0.01
127	603638	艾迪精密	1,675	59,764.00	0.01
128	603826	坤彩科技	3,299	59,579.94	0.01
129	603966	法兰泰克	2,590	59,518.20	0.01
130	300602	飞荣达	1,254	59,301.66	0.01
131	300601	康泰生物	2,109	59,178.54	0.01
132	603101	汇嘉时代	3,563	59,145.80	0.01
133	603887	城地股份	1,751	58,413.36	0.01
134	603987	康德莱	3,754	57,961.76	0.01
135	603615	茶花股份	2,915	57,687.85	0.01
136	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.01
137	603637	镇海股份	1,802	56,474.68	0.01
138	002847	盐津铺子	1,553	56,218.60	0.01
139	603955	大千生态	1,250	55,850.00	0.01
140	603667	五洲新春	2,404	55,628.56	0.01
141	603060	国检集团	2,201	54,540.78	0.01
142	603096	新经典	1,270	53,822.60	0.01

143	603585	苏利股份	1,561	53,776.45	0.01
144	300630	普利制药	1,488	53,716.80	0.01
145	300611	美力科技	2,402	53,684.70	0.01
146	300565	科信技术	2,382	53,356.80	0.01
147	603877	太平鸟	1,900	53,181.00	0.01
148	603177	德创环保	2,779	52,967.74	0.01
149	603505	金石资源	2,570	52,967.70	0.01
150	603690	至纯科技	3,106	52,895.18	0.01
151	603663	三祥新材	1,826	52,607.06	0.01
152	603067	振华股份	2,616	52,555.44	0.01
153	603203	快克股份	1,363	52,461.87	0.01
154	002802	洪汇新材	1,629	52,453.80	0.01
155	002855	捷荣技术	3,056	52,440.96	0.01
156	603803	瑞斯康达	2,245	52,016.65	0.01
157	002846	英联股份	1,492	51,921.60	0.01
158	603238	诺邦股份	1,750	51,415.00	0.01
159	603928	兴业股份	2,670	51,264.00	0.01
160	002861	瀛通通讯	1,664	51,201.28	0.01
161	603959	百利科技	2,815	50,782.60	0.01
162	600491	龙元建设	4,696	50,388.08	0.01
163	603977	国泰集团	3,010	50,236.90	0.01
164	603028	赛福天	3,309	50,098.26	0.01
165	300596	利安隆	2,319	49,997.64	0.01
166	002827	高争民爆	2,059	49,621.90	0.01
167	603929	亚翔集成	2,193	49,386.36	0.01
168	603903	中持股份	1,031	49,271.49	0.01
169	603726	朗迪集团	1,361	49,254.59	0.01
170	603081	大丰实业	2,582	49,006.36	0.01
171	603050	科林电气	1,256	48,933.76	0.01
172	603159	上海亚虹	1,438	48,834.48	0.01
173	300520	科大国创	926	48,605.74	0.01
174	002774	快意电梯	3,441	48,174.00	0.01
175	300657	弘信电子	1,021	48,089.10	0.01
176	300515	三德科技	2,708	48,012.84	0.01
177	300588	熙菱信息	1,380	48,010.20	0.01
178	603665	康隆达	1,185	47,577.75	0.01
179	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
180	603029	天鹅股份	1,618	47,002.90	0.01
181	603035	常熟汽饰	2,316	46,760.04	0.01

182	603016	新宏泰	1,602	45,817.20	0.01
183	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
184	002826	易明医药	2,181	45,670.14	0.01
185	002803	吉宏股份	1,165	45,435.00	0.01
186	300597	吉大通信	2,646	45,405.36	0.01
187	002129	中环股份	4,400	45,276.00	0.01
188	002849	威星智能	1,060	45,262.00	0.01
189	603758	秦安股份	2,441	45,036.45	0.01
190	300639	凯普生物	1,046	44,894.32	0.01
191	300552	万集科技	1,349	44,247.20	0.01
192	600790	轻纺城	6,495	44,230.95	0.01
193	603909	合诚股份	1,095	44,183.25	0.01
194	603886	元祖股份	2,241	43,968.42	0.01
195	300633	开立医疗	2,324	43,272.88	0.01
196	000528	柳　　工	5,000	43,200.00	0.01
197	300658	延江股份	1,110	43,101.30	0.01
198	603819	神力股份	1,698	42,959.40	0.01
199	002798	帝王洁具	1,056	42,789.12	0.01
200	300541	先进数通	1,467	42,763.05	0.01
201	300591	万里马	3,116	42,689.20	0.01
202	300267	尔康制药	3,664	41,989.44	0.01
203	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.01
204	603855	华荣股份	2,728	41,792.96	0.01
205	300517	海波重科	1,446	41,673.72	0.01
206	603668	天马科技	2,821	41,581.54	0.01
207	002819	东方中科	1,293	41,518.23	0.01
208	002875	安奈儿	1,158	41,514.30	0.01
209	603069	海汽集团	3,388	40,689.88	0.01
210	603797	联泰环保	2,137	40,688.48	0.01
211	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.01
212	002813	路畅科技	1,296	40,383.36	0.01
213	603033	三维股份	1,624	40,096.56	0.01
214	300593	新雷能	1,519	40,086.41	0.01
215	002866	传艺科技	1,488	40,071.84	0.01
216	603767	中马传动	1,785	39,751.95	0.01
217	002825	纳尔股份	1,139	39,352.45	0.01
218	300539	横河模具	2,536	39,231.92	0.01
219	002856	美芝股份	1,230	39,187.80	0.01
220	603090	宏盛股份	1,371	39,087.21	0.01

221	300622	博士眼镜	1,280	38,950.40	0.01
222	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.01
223	300587	天铁股份	1,438	38,567.16	0.01
224	002842	翔鹭钨业	932	38,118.80	0.01
225	300606	金太阳	1,228	38,080.28	0.01
226	002860	星帅尔	777	37,995.30	0.01
227	300621	维业股份	1,758	37,867.32	0.01
228	601882	海天精工	2,148	37,332.24	0.01
229	002865	钧达股份	1,246	36,881.60	0.01
230	603926	铁流股份	1,082	36,712.26	0.01
231	600011	华能国际	5,000	36,700.00	0.01
232	300592	华凯创意	1,583	36,678.11	0.01
233	002838	道恩股份	1,021	36,551.80	0.01
234	002863	今飞凯达	2,249	36,343.84	0.01
235	002877	智能自控	1,436	36,302.08	0.01
236	603787	新日股份	1,849	36,184.93	0.01
237	300548	博创科技	754	36,154.30	0.01
238	603383	顶点软件	811	36,138.16	0.01
239	603859	能科股份	1,121	36,006.52	0.01
240	603811	诚意药业	953	35,918.57	0.01
241	002868	绿康生化	1,234	35,872.38	0.01
242	300532	今天国际	1,508	35,618.96	0.01
243	300609	汇纳科技	1,037	35,537.99	0.01
244	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
245	603559	中通国脉	1,349	35,195.41	0.01
246	300626	华瑞股份	1,208	35,140.72	0.01
247	002870	香山股份	1,046	35,093.30	0.01
248	603042	华脉科技	1,232	35,013.44	0.01
249	603389	亚振家居	1,963	34,607.69	0.01
250	603633	徕木股份	1,258	34,179.86	0.01
251	300620	光库科技	986	34,095.88	0.01
252	603320	迪贝电气	958	34,066.48	0.01
253	300537	广信材料	1,638	33,775.56	0.01
254	601113	华鼎股份	4,000	33,720.00	0.01
255	603388	元成股份	892	33,512.44	0.01
256	603538	美诺华	1,122	33,480.48	0.01
257	300643	万通智控	2,026	33,165.62	0.01
258	002808	苏州恒久	1,805	33,031.50	0.01
259	603196	日播时尚	2,083	32,682.27	0.01

260	603089	正裕工业	1,087	32,544.78	0.01
261	002799	环球印务	1,620	32,238.00	0.01
262	603488	展鹏科技	1,837	32,074.02	0.01
263	603496	恒为科技	912	31,354.56	0.01
264	603041	美思德	1,034	31,340.54	0.01
265	002810	山东赫达	957	30,901.53	0.01
266	300652	雷迪克	966	30,863.70	0.01
267	603319	湘油泵	721	30,822.75	0.01
268	300663	科蓝软件	1,293	30,812.19	0.01
269	300536	农尚环境	876	30,747.60	0.01
270	300637	扬帆新材	1,313	30,619.16	0.01
271	300647	超频三	1,244	30,602.40	0.01
272	300542	新晨科技	988	30,598.36	0.01
273	300635	达安股份	949	30,178.20	0.01
274	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.01
275	300149	量子高科	1,540	29,829.80	0.01
276	300632	光莆股份	1,237	29,811.70	0.01
277	002816	和科达	1,000	29,500.00	0.01
278	300589	江龙船艇	1,189	29,201.84	0.01
279	002805	丰元股份	971	29,197.97	0.01
280	300605	恒锋信息	916	29,128.80	0.01
281	603128	华贸物流	3,362	28,778.72	0.01
282	600307	酒钢宏兴	10,000	28,500.00	0.01
283	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.01
284	002385	大北农	4,499	28,298.71	0.01
285	300586	美联新材	1,006	28,117.70	0.01
286	300514	友讯达	1,024	27,535.36	0.01
287	603139	康惠制药	910	27,181.70	0.00
288	300659	中孚信息	776	27,175.52	0.00
289	002828	贝肯能源	1,042	27,123.26	0.00
290	300191	潜能恒信	1,000	26,620.00	0.00
291	603229	奥翔药业	1,340	26,558.80	0.00
292	300655	晶瑞股份	873	25,814.61	0.00
293	002498	汉缆股份	6,975	25,528.50	0.00
294	002014	永新股份	2,000	25,220.00	0.00
295	002370	亚太药业	850	24,922.00	0.00
296	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
297	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
298	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00

299	300086	康芝药业	2,250	23,445.00	0.00
300	603269	海鸥股份	795	23,357.10	0.00
301	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
302	002418	康盛股份	2,400	22,344.00	0.00
303	000825	太钢不锈	5,000	21,750.00	0.00
304	002416	爱施德	2,000	21,580.00	0.00
305	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
306	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
307	300084	海默科技	2,200	20,284.00	0.00
308	601218	吉鑫科技	4,400	19,316.00	0.00
309	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
310	002398	建研集团	1,429	18,376.94	0.00
311	300067	安诺其	2,880	18,115.20	0.00
312	600808	马钢股份	5,000	17,700.00	0.00
313	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
314	002580	圣阳股份	2,016	16,107.84	0.00
315	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
316	002404	嘉欣丝绸	1,950	15,034.50	0.00
317	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
318	600089	特变电工	1,411	14,575.63	0.00
319	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
320	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
321	002011	盾安环境	990	11,236.50	0.00
322	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
323	002220	天宝股份	1,200	10,104.00	0.00
324	601369	陕鼓动力	1,500	9,930.00	0.00
325	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
326	600812	华北制药	1,572	9,416.28	0.00
327	000993	闽东电力	1,000	9,110.00	0.00
328	002065	东华软件	400	8,716.00	0.00
329	002403	爱仕达	650	8,567.00	0.00
330	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
331	002356	赫美集团	297	7,546.77	0.00
332	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
333	002386	天原集团	840	5,989.20	0.00
334	000963	华东医药	104	5,168.80	0.00
335	300070	碧水源	237	4,420.05	0.00
336	600436	片仔癀	64	3,906.56	0.00
337	600655	豫园商城	335	3,792.20	0.00

338	000025	特　力Ａ	61	3,156.14	0.00
339	002195	二三四五	435	3,110.25	0.00
340	002452	长高集团	408	2,802.96	0.00
341	300310	宜通世纪	212	2,802.64	0.00
342	002672	东江环保	163	2,753.07	0.00
343	300153	科泰电源	180	2,671.20	0.00
344	002592	八菱科技	70	2,078.30	0.00
345	300197	铁汉生态	141	1,872.48	0.00
346	000581	威孚高科	71	1,838.90	0.00
347	002497	雅化集团	186	1,804.20	0.00
348	600161	天坛生物	46	1,785.26	0.00
349	603118	共进股份	130	1,771.90	0.00
350	600566	济川药业	46	1,749.38	0.00
351	002482	广田集团	180	1,618.20	0.00
352	000619	海螺型材	159	1,493.01	0.00
353	002348	高乐股份	198	1,387.98	0.00
354	600536	中国软件	72	1,379.52	0.00
355	600690	青岛海尔	88	1,324.40	0.00
356	600697	欧亚集团	47	1,323.52	0.00
357	300002	神州泰岳	149	1,242.66	0.00
358	300094	国联水产	168	1,234.80	0.00
359	600198	大唐电信	92	1,174.84	0.00
360	000002	万　科Ａ	47	1,173.59	0.00
361	000957	中通客车	92	1,076.40	0.00
362	300115	长盈精密	32	933.76	0.00
363	000062	深圳华强	30	795.90	0.00
364	600594	益佰制药	52	793.52	0.00
365	600073	上海梅林	82	783.10	0.00
366	300143	星河生物	28	774.20	0.00
367	000928	中钢国际	73	690.58	0.00
368	002084	海鸥卫浴	76	675.64	0.00
369	002687	乔治白	78	600.60	0.00
370	300335	迪森股份	30	575.10	0.00
371	300031	宝通科技	28	514.92	0.00
372	600312	平高电气	37	508.38	0.00
373	002048	宁波华翔	24	500.64	0.00
374	000887	中鼎股份	22	485.98	0.00
375	002511	中顺洁柔	36	476.28	0.00
376	603008	喜临门	25	445.25	0.00

377	002322	理工环科	18	431.28	0.00
378	002004	华邦健康	53	414.99	0.00
379	002182	云海金属	44	404.36	0.00
380	000001	平安银行	41	384.99	0.00
381	000793	华闻传媒	35	354.20	0.00
382	600761	安徽合力	27	353.70	0.00
383	000709	河钢股份	80	335.20	0.00
384	000428	华天酒店	60	306.00	0.00
385	002157	正邦科技	60	273.00	0.00
386	002194	武汉凡谷	30	265.50	0.00
387	601098	中南传媒	14	260.96	0.00
388	002104	恒宝股份	22	206.58	0.00
389	000066	中国长城	22	198.22	0.00
390	002154	报 喜 鸟	42	155.82	0.00
391	000157	中联重科	32	143.68	0.00
392	300082	奥克股份	20	138.00	0.00
393	600015	华夏银行	14	129.08	0.00
394	300039	上海凯宝	17	123.59	0.00
395	601311	骆驼股份	6	84.96	0.00
396	000925	众合科技	4	83.08	0.00
397	600678	四川金顶	6	73.62	0.00
398	002327	富安娜	8	66.48	0.00
399	002351	漫步者	4	44.28	0.00
400	601208	东材科技	6	42.24	0.00
401	300045	华力创通	1	10.20	0.00

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	000568	泸州老窖	39,024,308.12	6.78
2	000651	格力电器	34,986,083.59	6.08
3	603626	科森科技	30,665,704.79	5.33
4	002244	滨江集团	28,112,550.75	4.89
5	600466	蓝光发展	27,928,832.19	4.85

6	601669	中国电建	25,284,952.00	4.39
7	600977	中国电影	23,206,976.11	4.03
8	601318	中国平安	22,922,405.80	3.98
9	002043	兔 宝 宝	22,538,786.74	3.92
10	600340	华夏幸福	18,339,466.28	3.19
11	600664	哈药股份	17,264,594.46	3.00
12	000498	山东路桥	16,900,728.54	2.94
13	601006	大秦铁路	16,727,722.38	2.91
14	002185	华天科技	16,491,548.00	2.87
15	601012	隆基股份	16,163,683.80	2.81
16	603898	好莱客	15,613,687.00	2.71
17	600362	江西铜业	15,298,110.32	2.66
18	600104	上汽集团	15,179,631.00	2.64
19	600236	桂冠电力	14,802,600.32	2.57
20	600567	山鹰纸业	14,481,677.00	2.52
21	600176	中国巨石	13,166,013.52	2.29
22	603833	欧派家居	12,983,390.32	2.26
23	600887	伊利股份	12,830,700.08	2.23
24	600343	航天动力	12,434,746.25	2.16
25	002236	大华股份	12,052,183.00	2.09

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	002377	国创高新	49,266,911.20	8.56
2	002611	东方精工	40,498,030.10	7.04
3	603518	维格娜丝	33,642,356.67	5.85
4	601318	中国平安	26,328,925.00	4.58
5	600658	电子城	25,629,043.48	4.45
6	601669	中国电建	25,110,768.00	4.36
7	002086	东方海洋	24,618,447.10	4.28
8	002043	兔 宝 宝	21,134,649.53	3.67
9	002435	长江润发	21,102,191.75	3.67
10	600977	中国电影	21,078,548.75	3.66
11	600035	楚天高速	17,483,469.00	3.04

12	000498	山东路桥	17,011,706.00	2.96
13	600362	江西铜业	16,579,529.00	2.88
14	002173	创新医疗	16,451,874.95	2.86
15	600104	上汽集团	15,255,194.00	2.65
16	600567	山鹰纸业	15,139,160.00	2.63
17	002683	宏大爆破	15,039,885.88	2.61
18	601012	隆基股份	14,828,097.53	2.58
19	603898	好莱客	14,712,559.85	2.56
20	603626	科森科技	14,434,010.50	2.51
21	600176	中国巨石	13,417,057.60	2.33
22	600887	伊利股份	13,120,911.94	2.28
23	000529	广弘控股	12,714,272.92	2.21
24	600664	哈药股份	12,611,636.00	2.19
25	002060	粤 水 电	12,297,814.14	2.14

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	886,155,386.24
卖出股票收入（成交）总额	904,718,340.82

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,994,500.00	0.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,104,000.00	20.05
	其中：政策性金融债	110,104,000.00	20.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	115,098,500.00	20.96

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	070215	07 国开 15	1,000,000	100,100,000.00	18.23
2	150409	15 农发 09	100,000	10,004,000.00	1.82
3	019546	16 国债 18	50,000	4,994,500.00	0.91

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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：本基金本报告期末未持有贵金属。

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：本基金本报告期末未持有权证。

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

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

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

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	241,304.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,754,385.84
5	应收申购款	59,516.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,055,206.36

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600658	电子城	17,220,710.72	3.14	非公开发行

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
25,824	16,457.56	42,862,363.74	10.09%	382,137,560.99	89.91%

8.2 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	81.14	0.00%

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。

8.3 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（ 2003 年 7 月 12 日 ）基金份额总额	343,260,931.46
本报告期期初基金份额总额	449,618,494.34
本报告期基金总申购份额	5,859,813.18
减:本报告期基金总赎回份额	30,478,382.79
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	424,999,924.73

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		股票交易	应支付该券商的佣金	

	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	备注
兴业证券	1	746,853,922.24	41.80%	695,539.50	42.21%	-
长江证券	1	586,897,143.16	32.85%	534,840.70	32.45%	-
海通证券	1	208,095,727.87	11.65%	189,637.31	11.51%	-
华西证券	1	170,751,287.46	9.56%	159,020.41	9.65%	-
东北证券	1	74,022,349.31	4.14%	68,937.51	4.18%	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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，最近二年未因发生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，分别向长江证券股份有限公司、信达证券股份有限公司（由汉唐证券有限责任公司交易单元更名）、国元证券股份有限公司、华林证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、华西证券有限责任公司租用交易单元作为基金专用交易单元，并从 2003 年 7 月开始陆续使用。本报告期内撤销了财富证券一个基金专用

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
兴业证券	4,992,500.00	97.93%	-	-	-	-
长江证券	105,326.21	2.07%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行“2017 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 3 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京肯特瑞财富投资管理有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 10 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 14 日
4	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购江苏张家港农村商业银行股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 17 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 17 日

6	2016 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 19 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 2 月 10 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 2 月 11 日
9	鹏华基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 2 月 15 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 2 月 23 日
11	鹏华普天系列开放式证券投资基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 2 月 27 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 8 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与浙江同花顺基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 20 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 22 日
15	鹏华基金管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 22 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 23 日
17	基金高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 23 日
18	鹏华基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 30 日
19	2016 年年度度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2017 年 3 月 30 日

		报》	
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 31 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司网上交易及手机委托系统申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 10 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 12 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 18 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 20 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 22 日
26	2017 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 24 日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 25 日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 9 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 11 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 13 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 15 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 20 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2017 年 5 月 23 日

	变更的提示性公告	报》	
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 24 日
35	鹏华普天债券证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 24 日
36	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购金龙羽首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 16 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 27 日
38	鹏华基金管理有限公司关于网上直销交易系统升级切换及启用新版网上直销交易系统的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 27 日

§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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华普天系列开放式证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华普天收益证券投资基金 2017 年半年度报告》（原文）。

12.2 存放地点

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

上海市仙霞路 18 号交通银行股份有限公司

12.3 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 8 月 28 日