

鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式  
证券投资基金  
2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 25 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 20 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 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 鹏华前海 REIT  |
| 场内简称       | 鹏华前海   |
| 交易代码       | 184801   |
| 前端交易代码     | -  |
| 后端交易代码     | -  |
| 基金运作方式     | 契约型封闭式<br>本基金合同生效后 10 年内（含 10 年）为基金封闭运作期，基金封闭运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）。  |
| 基金合同生效日    | 2015 年 7 月 6 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 29,995,915.35 份  |
| 投资目标       | 本基金通过投资于目标公司股权参与前海金融创新，力争在   |
| 投资策略       | 基金合同生效后，本基金根据与目标公司及其股东所签订的<br>目标公司股权至 2023 年 7 月 24 日，获取自 2015 年 1 月 1 日<br>当取得的除物业管理费收入之外的营业收入，营业收入依<br>公司的概况、增资入股情况、退出安排、交易结构、业绩<br>本基金投资目标公司之外的基金资产可投资于依法发行或<br>1、对于目标公司的投资策略<br>本基金将审慎论证宏观经济因素（就业、利率、人口结构等 |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>及其他可比投资资产项目的风险和预期收益率来判断目标公司基础上，基金将深入调研目标公司所持商业物业的基本面（现金流等）和运营基本面（包括定位、经营策略、租赁能力、增值潜力、预测现金流收入的规模和建立合适的估值模型。本基金将根据投资需要参与所投资项目商业运营并代表持有协议以及建立运营绩效保证机制，力争获取稳定的租金收入。</p> <p>2、固定收益资产投资策略</p> <p>本基金投资目标公司前的基金资产以及投资目标公司后的基金资产在按照本《基金合同》约定进行分配或支付前，可全部投资于固定收益资产。</p> <p>本基金将采用持有到期策略构建投资组合，以获取相对确定性，并在对封闭运作期内资金面进行判断的基础上，判断固定收益资产在封闭运作期内的持有期收益进行比较，确定配置比例。本基金将对整体固定收益组合久期做严格管理。投资决策委员会将定期或不定期召开会议，确定本基金固定收益资产投资标的。本基金将依据投资决策委员会决议和信用评级团队依托基金管理人信用分析系统评估债务风险，调整提供标的建议。本基金将依据投资决策委员会决议和信用评级团队依托基金管理人信用分析系统评估债务风险，调整提供标的建议。本基金将依据投资决策委员会决议和信用评级团队依托基金管理人信用分析系统评估债务风险，调整提供标的建议。</p> <p>3、权益类资产投资策略</p> <p>在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将根据市场情况，适当参与股票等权益类投资，以增加基金收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 十年期国债收益率+1.5%   |
| 风险收益特征 | 本基金在封闭运作期内投资于目标公司股权，以获取商业物业风险收益特征，本基金预期风险和收益高于债券型基金和货币型基金。  |
| 基金管理人  | 鹏华基金管理有限公司  |
| 基金托管人  | 上海浦东发展银行股份有限公司  |

### § 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（2017年7月1日—2017年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 61,631,618.79             |
| 2. 本期利润         | 26,841,434.50             |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.8948                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 3,080,192,387.25          |
| 5. 期末基金份额净值     | 102.687                   |

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，封闭式基金交易佣金等），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

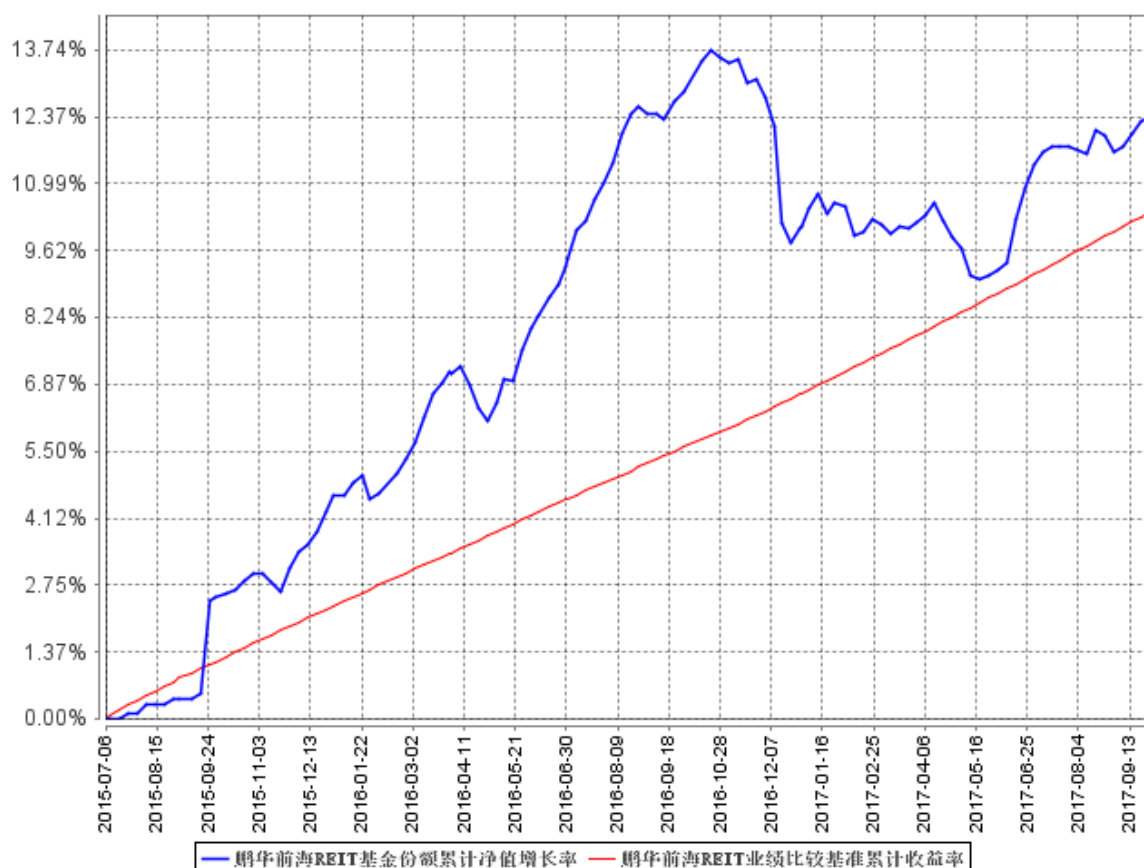
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段        | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|-----------|------------|---------------|----------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去三个<br>月 | 0.88%      | 0.06%         | 1.29%          | 0.01%                     | -0.41% | 0.05% |

注：业绩比较基准=十年期国债到期收益率+1.5%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华前海REIT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 7 月 6 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 |        |   |
| 尤柏年 | 本基金基金经理 | 2015年7月6日   | -    | 13     | 尤柏年先生，国籍中国，经济学博士，13年证券从业经验。历任澳大利亚 BConnect 公司 Apex 投资咨询团队分析师，华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理、华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职；2014年7月加盟鹏华基金管理有限公司，任职于国际业务部，2014年8月起担任鹏华全球高收益债（QDII）基金基金经理，2014年9月起兼任鹏华环球发现（QDII-FOF）基金基金经理，2015年7月起兼任鹏华前海万科 REITs 基金基金经理，2016年12月起兼任鹏华沪深港新兴成长混合基金基金经理，现同时担任国际业务部副总经理。尤柏年先生具备基金从业资格。 |
| 刘方正 | 本基金基金经理 | 2015年7月21日  | -    | 7      | 刘方正先生，国籍中国，理学硕士，7年证券从业经验。2010年6月加盟鹏华基金管理有限公司，   |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>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 月至 2017 年 1 月担任鹏华弘利混合基金基金经理，2015 年 3 月至 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 月至 2017 年 1 月兼任鹏华弘润混合基金基金经理，2015 年 5 月至 2017 年 1 月兼任鹏华弘益混合基金基金经理，2015 年 6 月至 2017 年 1 月兼任鹏华弘鑫混合基金基金经理，2015 年 8 月至 2017 年 1 月兼任鹏华弘泰混合基金基金经理，2016 年 3 月至 2017 年 5 月兼任鹏华弘实混合基金基金经理，2015 年 5 月起兼任鹏华弘和混合、鹏华弘华混合基金基金经理，2015 年 8 月起兼任鹏华前海万科 REITs 基金基金经理，2016 年 3 月起兼任鹏华弘信混合、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 月起兼任鹏华兴悦定期开放混合基金基金经理，2017 年 9 月起兼任</p> |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 鹏华兴益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。 |
|--|--|--|--|--|---|

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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金持有的项目公司物业万科前海企业公馆在 2017 年三季度完成总收入 4242 万元。其中公馆租赁收入占总收入的 96%，会议中心等其他收入合计占 4%。

2017 年三季度，宏观经济延续前期小幅回落走势，工业数据略低于预期，投资方面也有所回落，地产销售和 investment 有一定趋缓迹象，消费维持相对稳定，整体下行速率较慢。工业产品价格方面仍有一定波动，处于高位震荡阶段，可持续性存在不确定性，受“供给侧”改革影响供给端严格受限的行业产品价格仍有继续维持高位的可能，环保压力也逐步显现，未来进一步冲高可能性较低，但整体工业品价格回落速度预计相对缓慢。金融数据方面，M2 仍然延续回落趋势，

“去杠杆”政策成效显现，考虑政府融资和其他口径的实际融资后，广义社会融资和广义信用的同比增速也呈缓慢回落走势，但绝对水平仍明显高于 M2 增速，以此来判断表外信贷和融资对经

济仍有一定程度的支撑作用。需求来看，房地产和基建仍是主要构成部分，其中基建的作用逐步加强，房地产随着销量的放缓未来有一定走弱可能，实体经济的其他部门处于有限扩张阶段，并未有大规模投资增长趋势出现，年初以来的出口走强是今年增量贡献的主力部分，海外需求回暖对国内经济支撑作用仍在增强。

三季度资本市场表现稳定，权益市场方面，随着工业品价格波动周期行业股价大起大落，贡献了较大的波动率，上证 50 及沪深 300 指数表现稳健上行，金融及家电等大盘股上行过程中有所震荡，食品饮料等行业稳定上行，中小盘延续前期的反弹走势。债券市场波澜不惊，宏观经济短周期反弹高点已现，月度数据已有疲弱迹象，基本面向有利于债市的方向发展，但央行相对偏紧的货币政策以及银行较低水平的超储率使资金面处于大幅波动阶段，银行间体系内流动资金不足，市场新增配置需求缓慢，整体收益率曲线处于高位震荡阶段，大幅上行的概率较低，但下行窗口尚未开启。

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。在操作上，保持稳健的中短久期债券资产配置，以固定收益类资产为主要方向，在严格控制整体仓位的前提下，适时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

截止 2017 年 9 月 30 日，基金净值为 102.687 元，较期初上涨 0.88%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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        | 108,771,967.46   | 1.94         |
|    | 其中：股票       | 108,771,967.46   | 1.94         |
| 2  | 基金投资        | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资      | 4,096,339,629.70 | 72.89        |
|    | 其中：债券       | 4,096,339,629.70 | 72.89        |
|    | 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    | -                | -            |
|    | 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 | 259,150,068.09   | 4.61   |
| 8 | 其他资产         | 1,155,345,463.29 | 20.56  |
| 9 | 合计           | 5,619,607,128.54 | 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              | 72,756.00      | 0.00         |
| C  | 制造业              | 89,644,702.06  | 2.91         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,728,570.00   | 0.15         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -              | -            |
| J  | 金融业              | 371,717.00     | 0.01         |
| K  | 房地产业             | 3,216,600.00   | 0.10         |
| 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    | 9,482,522.40   | 0.31         |
| 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        | 1,255,100.00   | 0.04         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 108,771,967.46 | 3.53         |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

## 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  | 002507 | 涪陵榨菜 | 1,160,000 | 17,249,200.00 | 0.56         |
| 2  | 002531 | 天顺风能 | 2,571,780 | 15,893,600.40 | 0.52         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 3  | 600031 | 三一重工 | 1,600,000 | 12,240,000.00 | 0.40 |
| 4  | 601877 | 正泰电器 | 568,828   | 11,245,729.56 | 0.37 |
| 5  | 600416 | 湘电股份 | 809,717   | 9,991,907.78  | 0.32 |
| 6  | 600054 | 黄山旅游 | 561,096   | 9,482,522.40  | 0.31 |
| 7  | 002250 | 联化科技 | 403,204   | 5,197,299.56  | 0.17 |
| 8  | 600151 | 航天机电 | 679,966   | 5,188,140.58  | 0.17 |
| 9  | 002241 | 歌尔股份 | 249,936   | 5,058,704.64  | 0.16 |
| 10 | 600027 | 华电国际 | 1,000,000 | 4,400,000.00  | 0.14 |

#### 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      | -                | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -                | -            |
| 4  | 企业债券      | 3,961,178,800.00 | 128.60       |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 124,743,000.00   | 4.05         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 10,417,829.70    | 0.34         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 4,096,339,629.70 | 132.99       |

#### 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  | 139014 | 16 普湾债   | 2,600,000 | 250,640,000.00 | 8.14         |
| 2  | 122450 | 15 齐鲁债   | 2,500,000 | 248,125,000.00 | 8.06         |
| 3  | 122465 | 15 广越 01 | 2,130,000 | 211,296,000.00 | 6.86         |
| 4  | 112271 | 15 中粮 01 | 2,000,000 | 200,200,000.00 | 6.50         |
| 5  | 112273 | 15 金街 01 | 1,940,000 | 192,816,600.00 | 6.26         |

#### 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：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

### 5.9.2 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。

## 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

15 华泰 G1 发行主体华泰证券股份有限公司（以下简称公司）于 2016 年 11 月收到 2016 年 11 月 28 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]126 号），由于未按照《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项。

2017 年 1 月 18 日，华泰证券股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）行政监管措施决定书《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2017]3 号），存在利用同名微信公众号、官方网站向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品的问题。同日，华泰证券控股子公司华泰联合证券有限责任公司（以下简称“华泰联合证券”）收到中国证监会行政监管措施决定书《关于对华泰联合证券有限责任公司采取出具警示函措施的决定》（[2017]4 号），存在对标的资产主要客户和供应商的核查不充分的问题。决定书责令公司改正。

上述处罚事项可能会给公司业务开展等带来一定影响，但不会从根本上影响公司的正常经营。公司将按照相关规定和中国证监会的要求，认真进行整改，并进一步加强日常经营管理和风险管理，依法合规地开展各项业务。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司债券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证券中的其它证券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   | 82,475.07        |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,074,929.14     |
| 3  | 应收股利    | -                |
| 4  | 应收利息    | 51,509,000.46    |
| 5  | 应收申购款   | -                |
| 6  | 其他应收款   | -                |
| 7  | 待摊费用    | 126,989.62       |
| 8  | 其他      | 1,102,552,069.00 |
| 9  | 合计      | 1,155,345,463.29 |

注：其他为物业收益权投资。

#### 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  | 128010 | 顺昌转债     | 1,767,150.00 | 0.06         |
| 2  | 128012 | 辉丰转债     | 1,621,870.00 | 0.05         |
| 3  | 120001 | 16 以岭 EB | 1,128,217.00 | 0.04         |
| 4  | 127003 | 海印转债     | 896,277.60   | 0.03         |
| 5  | 113010 | 江南转债     | 706,999.20   | 0.02         |
| 6  | 123001 | 蓝标转债     | 687,077.60   | 0.02         |
| 7  | 128013 | 洪涛转债     | 177,082.50   | 0.01         |

### 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(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 601877 | 正泰电器 | 11,245,729.56  | 0.37         | 非公开发行    |
| 2  | 600416 | 湘电股份 | 4,995,947.72   | 0.16         | 非公开发行(注) |
| 3  | 002250 | 联化科技 | 5,197,299.56   | 0.17         | 非公开发行    |

注：根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》（证监会公告〔2017〕9号）和《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》（上证发〔2017〕24号），持有上市公司非公开发行股份的股东，通过集中竞价交易减持该部分股份的，自股份解除限售之日起12个月内，减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%。

### 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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          |            |
|--------------------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 100,027.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -          |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -          |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 100,027.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.33       |

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。

### 6.2 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内未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

## §7 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目        | 持有份额总数     | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数     | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-----------|------------|-----------------|------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 100,027.00 | 0.33            | 100,027.00 | 0.33            | 三年         |

|             |              |       |            |      |    |
|-------------|--------------|-------|------------|------|----|
| 基金管理人高级管理人员 | -            | -     | -          | -    | -  |
| 基金经理等人员     | -            | -     | -          | -    | -  |
| 基金管理人股东     | -            | -     | -          | -    | -  |
| 其他          | 3,000,405.00 | 10.00 | -          | -    | 二年 |
| 合计          | 3,100,432.00 | 10.34 | 100,027.00 | 0.33 | -  |

注：(1) 本基金自 2015 年 6 月 26 日至 2015 年 7 月 1 日止期间公开发售，于 2015 年 7 月 6 日基金合同正式生效。

(2) 本基金管理人在募集期间认购本基金份额 10,002,700.27 份，2015 年 9 月 18 日本基金经折算后的份额为 100,027 份。

(3) 本基金基石投资人前海金控在募集期间认购本基金份额 300,040,500.13 份，2015 年 9 月 18 日本基金经折算后的份额为 3,000,405 份。

(4) 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。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金基金合同》；
  - (二) 《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金托管协议》；
  - (三) 《鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金 2017 年第 3 季度报告》
- (原文)。

## 9.2 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

上海市中山东一路 12 号上海浦东发展银行股份有限公司

## 9.3 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 10 月 25 日