

# 鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48

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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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情况.....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</b>
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华弘润混合	
场内简称	-	
基金主代码	001190	
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	2015 年 4 月 14 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,160,632,094.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华弘润混合 A 类	鹏华弘润混合 C 类
下属分级基金的交易代码	001190	001191
报告期末下属分级基金的 份额总额	1,155,143,983.71 份	5,488,111.03 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，严选安全边际较高的股票、债券等投资标的，力争实现绝对收益的目标。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平的增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等)，并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益指标。 2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下的分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上的评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股，力争基金资产的保值增值。 3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑

	乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活的调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券。4、股指期货、权证等投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。

注：无。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	010-67595096
传真	0755-82021126	010-66275853
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 楼	北京市西城区金融街 25 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 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	何如	田国立

### 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	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
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	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

### § 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（2018年01月01日-2018年06月30日）	
	鹏华弘润混合 A 类	鹏华弘润混合 C 类
本期已实现收 益	38,063,181.44	164,105.65
本期利润	11,042,198.21	51,580.99
加权平均基金 份额本期利润	0.0095	0.0100
本期加权平均 净值利润率	0.84%	0.90%
本期基金份额 净值增长率	0.85%	0.80%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末（2018年06月30日）	
期末可供分配 利润	149,895,956.25	624,790.61
期末可供分配 基金份额利润	0.1298	0.1138
期末基金资产 净值	1,305,039,939.96	6,112,901.64
期末基金份额 净值	1.1298	1.1138
3.1.3 累计期 末指标	报告期末（2018年06月30日）	
基金份额累计 净值增长率	12.98%	11.38%

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

鹏华弘润混合 A 类

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	-0.16	0.17	0.37	0.01	-0.53	0.16
过去三个月	0.00	0.14	1.12	0.01	-1.12	0.13
过去六个月	0.85	0.16	2.23	0.01	-1.38	0.15
过去一年	3.19	0.13	4.50	0.01	-1.31	0.12
过去三年	10.66	0.09	13.63	0.01	-2.97	0.08
自基金成立起至今	12.98	0.09	14.77	0.01	-1.79	0.08

鹏华弘润混合 C 类

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	-0.13	0.18	0.37	0.01	-0.50	0.17
过去三个月	0.01	0.14	1.12	0.01	-1.11	0.13

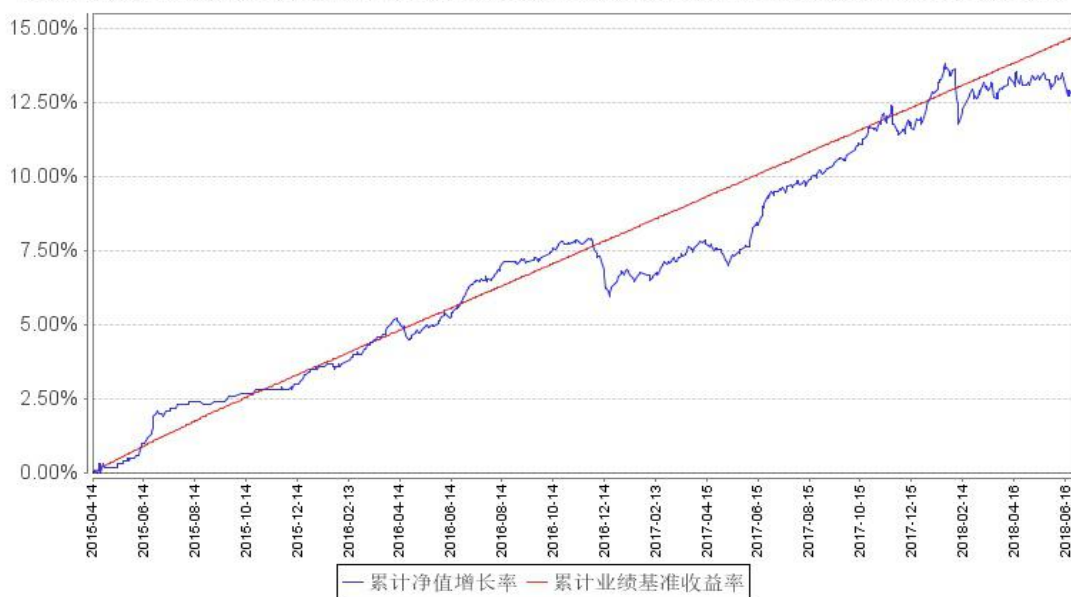


过去六个月	0.80	0.16	2.23	0.01	-1.43	0.15
过去一年	2.98	0.13	4.50	0.01	-1.52	0.12
过去三年	9.20	0.09	13.63	0.01	-4.43	0.08
自基金成立起至今	11.38	0.09	14.77	0.01	-3.39	0.08

注：业绩比较基准=一年期银行定期存款利率(税后)+3%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

鹏华弘润混合A类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华弘润混合C类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



## § 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2018年6月，公司管理资产总规模达到5,232.30亿元，管理152只公募基金、10只全国社保投资组合、3只基本养老保险投资组合。经过近20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		
李君	本基金基金经理	2015-05-22	-	9	李君女士，国籍中国，经济学硕士，9年金融证券从业经验。历任平安银行资金交易部银行账户管理岗，从事银行间市场资金交易工作；2010年8月加盟鹏华基金管理

				<p>有限公司，担任集中交易室债券交易员，从事债券研究、交易工作；2013 年 01 月至 2014 年 05 月担任鹏华货币基金基金经理，2014 年 02 月至 2015 年 05 月担任鹏华增值宝货币基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华品牌传承混合基金基金经理，2015 年 05 月担任鹏华弘利混合基金基金经理，2015 年 05 月担任鹏华弘润混合基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘盛混合基金基金经理，2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘泽混合基金基金经理，2015 年 11 月担任鹏华弘安混合基金基金经理，2016 年 05 月担任鹏华兴利定期开放混合基金基金经理，2016 年 06 月担任鹏华兴华定期开放混合基金基金经理，2016 年 06 月担任鹏华兴益定期开放混合基金基金经理，2016 年 08 月担任鹏华兴盛定期开放混合基金基金经理，2016 年 09 月至 2017 年 11 月担任鹏华兴锐定期开放混合基金基金经理，2017 年 02 月担任鹏华兴康定期开放混合基金基金经理，2017 年 05 月担任鹏华聚财货币基金基</p>
--	--	--	--	--

					金经理，2017 年 09 月至 2018 年 5 月担任鹏华弘锐混合基金基金经理，2018 年 03 月担任鹏华尊惠定期开放混合基金基金经理。李君女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	---

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 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

2018 年上半年资本市场波动率明显加大，权益市场先上后下，波动率急剧放大，其中上证综指跌幅为 13.90%，深证成指下跌 15.04%，沪深 300 指数跌幅为 12.90%。债券市场一路走牛，信用利差走阔趋势明显，利率债以及高等级信用债收益率大幅下行，整体收益率回到了 17 年年初的水平，债强股弱是上半年的主基调。

组合配置方面，债券以高等级信用债为主，严格规避信用风险，追求绝对收益，权益以蓝筹

股、白马股以及低估值绩优股为主，并辅助以打新、转债的方式增强收益，追求净值的稳健增长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年上半年本基金 A、C 类产品的净值增长率分别为 0.85%、0.80%，同期业绩基准增长率为 2.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

贸易战和实体去杠杆是上半年影响资本市场的主要因素，对应的是股票的下跌和债券的上涨。展望下半年，宏观经济大概率仍处于下行通道，中美贸易战暂时告一段落，货币政策已经转向宽松，未来货币市场利率将维持低位，随着财政政策的发力，基建投资有望触底回升，短期内去杠杆让渡与稳增长，压制权益市场的两个主要因素得到释放，下半年权益市场可能会有一波反弹行情，但是因为宏观经济不确定性依旧存在，行情反转的概率不大。债券市场经历了上半年的大幅上涨，短期存在一定的调整压力，但是受益于宏观经济的走势，牛市格局依旧没变。

#### 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[2017]13号《中国证监会关于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. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 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 A 类份额期末可供分配利润为 149,895,956.25 元，期末基金份额净值 1.1298 元；本基金 C 类份额期末可供分配利润为 624,790.61 元，期末基金份额净值 1.1138 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	10,306,307.34	6,419,496.70
结算备付金		6,764,914.57	1,687,775.52
存出保证金		65,642.70	28,176.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,492,546,517.10	1,225,731,197.75
其中：股票投资		130,187,119.70	149,786,359.95
基金投资		-	-
债券投资		1,362,359,397.40	1,075,944,837.80
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	-	60,000,000.00
应收证券清算款		1,285,316.74	265,797.95
应收利息	6.4.7.5	20,489,016.17	17,963,113.87
应收股利		-	-
应收申购款		144,445.00	591.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,531,602,159.62	1,312,096,148.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		219,000,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		192,624.64	117,143.36
应付管理人报酬		647,161.80	666,653.15
应付托管费		269,650.74	277,772.16
应付销售服务费		1,403.42	1,619.67
应付交易费用	6.4.7.7	121,328.74	57,777.70
应交税费		72,119.25	-
应付利息		-53,325.90	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	198,355.33	565,000.00
负债合计		220,449,318.02	1,685,966.04
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,160,632,094.74	1,169,789,408.46
未分配利润	6.4.7.10	150,520,746.86	140,620,774.42
所有者权益合计		1,311,152,841.60	1,310,410,182.88
负债和所有者权益总计		1,531,602,159.62	1,312,096,148.92

注：报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,160,632,094.74 份，其中鹏华弘润混合 A 类基金份额的份额总额为 1,155,143,983.71 份，份额净值 1.1298 元，鹏华弘润混合 C 类基金份额的份额总额为 5,488,111.03 份，份额净值 1.1138 元

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		19,848,838.14	43,100,043.07
1. 利息收入		23,884,296.24	26,404,336.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	168,983.79	2,381,534.19
债券利息收入		23,475,496.85	23,839,146.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		239,815.60	183,655.85
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		23,090,515.15	13,284,216.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,589,077.30	14,305,856.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-729,026.79	-2,105,128.25
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	1,230,464.64	1,083,488.64
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-27,133,507.89	3,410,796.04



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	7,534.64	694.16
减: 二、费用		8,755,058.94	7,900,700.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,908,764.13	4,110,903.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,628,651.70	1,712,876.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,520.86	69,575.12
4. 交易费用	6.4.7.19	465,696.40	183,747.22
5. 利息支出		2,460,671.51	1,596,163.45
其中: 卖出回购金融资产支出		2,460,671.51	1,596,163.45
6. 税金及附加		56,647.47	-
7. 其他费用	6.4.7.20	226,106.87	227,434.40
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,093,779.20	35,199,342.22
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,093,779.20	35,199,342.22

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	1,169,789,408.46	140,620,774.42	1,310,410,182.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,093,779.20	11,093,779.20
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)	-9,157,313.72	-1,193,806.76	-10,351,120.48
其中: 1. 基金申购款	2,130,541.44	248,096.09	2,378,637.53
2. 基金赎回款	-11,287,855.16	-1,441,902.85	-12,729,758.01
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)	1,160,632,094.74	150,520,746.86	1,311,152,841.60

项目	上年度可比期间		
	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
金净值)			
一、期初所有者权益(基金净值)	1,445,150,266.42	94,398,659.34	1,539,548,925.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	35,199,342.22	35,199,342.22
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)	-260,403,192.06	-17,203,407.81	-277,606,599.87
其中：1. 基金申购款	14,030,349.84	1,310,902.30	15,341,252.14
2. 基金赎回款	-274,433,541.90	-18,514,310.11	-292,947,852.01
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)	1,184,747,074.36	112,394,593.75	1,297,141,668.11

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

苏波

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

鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]438号《关于准予鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币879,137,508.23元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第312号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年4月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为879,295,094.50份基金份额,其中认购资金利息折合157,586.27

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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+3%。

#### 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（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 06 月 30 日的财务状况以及 2018 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

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下： (1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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 2018年6月30日
活期存款	10,306,307.34
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月及以上	-
其他存款	-
合计	10,306,307.34

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	144,532,254.94	130,187,119.70	-14,345,135.24	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	553,750,550.36	549,393,697.40	-4,356,852.96
	银行间市场	816,811,706.72	812,965,700.00	-3,846,006.72
	合计	1,370,562,257.08	1,362,359,397.40	-8,202,859.68
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,515,094,512.02	1,492,546,517.10	-22,547,994.92	

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

##### 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 2018年6月30日
应收活期存款利息	2,196.98
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	3,044.20
应收债券利息	20,483,745.49
应收资产支持证券利息	-
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	29.50
合计	20,489,016.17

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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	119,228.74
银行间市场应付交易费用	2,100.00
合计	121,328.74

## 6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.05
预提费用	198,354.28
合计	198,355.33

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

鹏华弘润混合 A 类

项目	本期
----	----

	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,164,159,287.45	1,164,159,287.45
本期申购	241,573.44	241,573.44
本期赎回 (以“-”号填列)	-9,256,877.18	-9,256,877.18
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,155,143,983.71	1,155,143,983.71

## 鹏华弘润混合 C 类

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,630,121.01	5,630,121.01
本期申购	1,888,968.00	1,888,968.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,030,977.98	-2,030,977.98
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	5,488,111.03	5,488,111.03

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

鹏华弘润混合 A 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	125,688,510.11	14,341,219.78	140,029,729.89
本期利润	38,063,181.44	-27,020,983.23	11,042,198.21
本期基金份额 交易产生的变 动数	-1,042,893.26	-133,078.59	-1,175,971.85
其中:基金申 购款	29,488.73	2,139.14	31,627.87
基金赎 回款	-1,072,381.99	-135,217.73	-1,207,599.72
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	162,708,798.29	-12,812,842.04	149,895,956.25
鹏华弘润混合 C 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	526,872.14	64,172.39	591,044.53

本期利润	164,105.65	-112,524.66	51,580.99
本期基金份额交易产生的变动数	-2,107.47	-15,727.44	-17,834.91
其中：基金申购款	227,224.75	-10,756.53	216,468.22
基金赎回款	-229,332.22	-4,970.91	-234,303.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	688,870.32	-64,079.71	624,790.61

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	138,479.36
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	30,090.58
其他	413.85
合计	168,983.79

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	156,698,187.30
减：卖出股票成本总额	134,109,110.00
买卖股票差价收入	22,589,077.30

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-729,026.79
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	-729,026.79



## 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
	2018年1月1日至 2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	518,305,654.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	510,516,672.78
减：应收利息总额	8,518,008.30
买卖债券差价收入	-729,026.79

## 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
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,230,464.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,230,464.64

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-27,133,507.89
股票投资	-40,696,226.00
债券投资	13,562,718.11
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减:应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-27,133,507.89

## 6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	7,515.99
转换费收入	18.65
合计	7,534.64

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	463,421.40
银行间市场交易费用	2,275.00
合计	465,696.40

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	8,792.59
账户维护费	18,360.00
其他	600.00
合计	226,106.87

注：其他为上交所账户查询费。

**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（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
国信证券	17,755,818.32	5.79	39,815,816.57	32.28

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
国信证券	29,872,800.00	9.62	1,170,114.83	7.54

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)
国信证券	887,000,000.00	16.76	489,000,000.00	5.01

## 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的 比例 (%)
国信证券	16,180.75	5.80	16,180.75	13.57
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的 比例 (%)
国信证券	36,284.32	32.28	999.39	3.35

注:1、佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

2、本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定,上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

#### 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 2018年1月1日至2018年6 月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	3,908,764.13
其中:支付销售机构的客户维护费	75,533.10	142,865.88

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0.60%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,628,651.70	1,712,876.70

注：支付基金托管人中国建设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。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘润混合 A 类	鹏华弘润混合 C 类	合计
中国建设银行	-	7,980.69	7,980.69
鹏华基金公司	-	47.78	47.78
合计	-	8,028.47	8,028.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘润混合 A 类	鹏华弘润混合 C 类	合计
中国建设银行	-	11,352.04	11,352.04
鹏华基金公司	-	57,760.96	57,760.96
合计	-	69,113.00	69,113.00

注：支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日计提，按月支付，A 类基金份额不收取销售服务费。日销售服务费=前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

## 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：无。

#### 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

注:无。

##### 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国建设银行	10,306,307.34	138,479.36	2,264,718.91	51,450.02

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

#### 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未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:无。

#### 6.4.12 期末(2018年06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
300713	英可瑞	2017年10月23日	2018年11月01日	新股流通受限	40.29	39.07	12,614	282,352.32	492,828.98	-
601138	工业富联	2018年05月28日	2019年06月08日	新股流通受限	13.77	16.40	140,613	1,936,241.01	2,306,053.20	-

		日	日							
603105	芯能科技	2018年06月29日	2018年07月09日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018年06月25日	2018年07月03日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年06月29日	2018年07月09日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 6.4.12.1.3 受限证券类别：权证

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1. 英可瑞于 2018 年 6 月 19 日实施权益分派方案，每 10 股转增 8 股。

2. 基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

## 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
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项	12.79	-	-	274,000	5,593,807.00	3,504,460.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项	10.24	-	-	163,300	3,068,724.00	1,672,192.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项	4.18	-	-	26,100	114,797.00	109,098.00	-
000793	华闻传媒	2018-02-01	重大事项	6.91	2018年7月16日	7.56	12,400	138,807.94	85,684.00	-



000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项	5.84	2018年7月17日	5.26	10,800	76,451.26	63,072.00	-
300072	三聚环保	2018-06-19	重大事项	23.28	2018年7月10日	24.00	2,550	81,209.77	59,364.00	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项	13.08	-	-	3,000	42,923.00	39,240.00	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大事项	15.38	2018年7月31日	16.50	1,900	22,903.00	29,222.00	-
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项	4.41	2018年8月7日	4.46	4,700	42,401.00	20,727.00	-

#### 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

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 219,000,000.00 元，于 2018 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算成标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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中国建设银行股份有限公司，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 2018 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券占基金净值比 89.4%（2017 年 12 月 31 日：76.02%）。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	20,080,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	70,156,000.00	19,894,000.00
合计	70,156,000.00	39,974,000.00

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债；A-1 以下包含未评级的超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年末未持有短期信用评级资产支持证券。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	260,320,000.00	236,413,000.00
未评级	-	-
合计	260,320,000.00	236,413,000.00

注:A-1 以下包含发行期限小于 1 年的同业存单。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	831,433,689.40	655,748,511.20
AAA 以下	80,354,508.00	83,904,326.60
未评级	120,095,200.00	59,905,000.00
合计	1,031,883,397.40	799,557,837.80

注:未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注:本基金本报告期末及上年末未持有长期信用评级资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注:本基金本报告期末及上年末未持有长期信用评级同业存单。

**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。除卖出回购金融资产款余额 219,000,000.00 元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有的全部金融负债的合同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。本基金所持有的全部金融负债的合同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

注:无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制），本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持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，部分基金资产流

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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 2018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	10,306,307.34	-	-	-	10,306,307.34

结算备付金	6,764,914.57	-	-	-	6,764,914.57
存出保证金	65,642.70	-	-	-	65,642.70
交易性金融资产	804,992,798.20	504,931,599.20	52,435,000.00	130,187,119.70	1,492,546,517.10
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	20,489,016.17	20,489,016.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	144,445.00	144,445.00
应收证券清算款	-	-	-	1,285,316.74	1,285,316.74
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	822,129,662.81	504,931,599.20	52,435,000.00	152,105,897.61	1,531,602,159.62
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	192,624.64	192,624.64
应付管理人报酬	-	-	-	647,161.80	647,161.80
应付托管费	-	-	-	269,650.74	269,650.74
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	219,000,000.00	-	-	-	219,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	1,403.42	1,403.42
应付交易费用	-	-	-	121,328.74	121,328.74
应付利息	-	-	-	-53,325.90	-53,325.90
应付税费	-	-	-	72,119.25	72,119.25
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	198,355.33	198,355.33
负债总计	219,000,000.00	-	-	1,449,318.02	220,449,318.02
利率敏感度缺口	603,129,662.81	504,931,599.20	52,435,000.00	150,656,579.59	1,311,152,841.60
上年度末 2017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	6,419,496.70	-	-	-	6,419,496.70
结算备付金	1,687,775.52	-	-	-	1,687,775.52
存出保证金	28,176.00	-	-	-	28,176.00
交易性金融资产	395,348,426.00	680,596,411.80	-	-149,786,359.95	1,225,731,197.75
买入返售金融资产	60,000,000.00	-	-	-	60,000,000.00
应收利息	-	-	-	17,963,113.87	17,963,113.87

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	591.13	591.13
应收证券清算款	-	-	-	265,797.95	265,797.95
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	463,483,874.22	680,596,411.80	-	168,015,862.90	1,312,096,148.92
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	117,143.36	117,143.36
应付管理人报酬	-	-	-	666,653.15	666,653.15
应付托管费	-	-	-	277,772.16	277,772.16
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	1,619.67	1,619.67
应付交易费用	-	-	-	57,777.70	57,777.70
应付利息	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	565,000.00	565,000.00
负债总计	-	-	-	1,685,966.04	1,685,966.04
利率敏感度缺口	463,483,874.22	680,596,411.80	-	-166,329,896.86	1,310,410,182.88

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。		
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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）	
分析	市场利率上升 25 个基点	-4,295,373.71	-3,754,735.33
	市场利率下降 25 个基点	4,339,722.82	3,793,623.36

注:无。

#### 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。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。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产比例为 0%~95%，权证市值不得超过基金资产净值的 3%。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 2018年6月30日		上年度末 2017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	130,187,119.70	9.93	149,786,359.95	11.43
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	130,187,119.70	9.93	149,786,359.95	11.43

注:无。



**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

注:于 2018 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值比例为 9.93% (2017 年 12 月 31 日: 11.43%) 因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日: 同)。

**6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

注: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**

无。

**§ 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	130,187,119.70	8.50
	其中: 股票	130,187,119.70	8.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,362,359,397.40	88.95
	其中: 债券	1,362,359,397.40	88.95
	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	17,071,221.91	1.11
8	其他各项资产	21,984,420.61	1.44
9	合计	1,531,602,159.62	100.00

**7.2 报告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**

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	436,968.00	0.03
B	采矿业	2,581,913.00	0.20
C	制造业	67,318,668.64	5.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	510,343.85	0.04

E	建筑业	3,546,232.32	0.27
F	批发和零售业	7,158,616.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	918,475.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,119,538.50	0.62
J	金融业	17,966,008.80	1.37
K	房地产业	20,216,952.00	1.54
L	租赁和商务服务业	1,086,837.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	83,284.45	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	156,448.14	0.01
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	85,684.00	0.01
S	综合	1,150.00	0.00
	合计	130,187,119.70	9.93

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000581	威孚高科	257,600	5,695,536.00	0.43
2	601398	工商银行	945,000	5,027,400.00	0.38
3	600887	伊利股份	160,000	4,464,000.00	0.34
4	600048	保利地产	336,600	4,106,520.00	0.31
5	600383	金地集团	400,000	4,076,000.00	0.31
6	601318	中国平安	67,100	3,930,718.00	0.30
7	002463	沪电股份	1,029,300	3,849,582.00	0.29
8	002051	中工国际	274,000	3,504,460.00	0.27
9	600325	华发股份	400,000	3,092,000.00	0.24
10	601607	上海医药	127,900	3,056,810.00	0.23
11	601988	中国银行	805,000	2,906,050.00	0.22
12	000069	华侨城A	393,600	2,845,728.00	0.22
13	601288	农业银行	824,000	2,834,560.00	0.22
14	000030	富奥股份	370,000	2,745,400.00	0.21
15	600340	华夏幸福	100,000	2,575,000.00	0.20

16	000661	长春高新	11,100	2,527,470.00	0.19
17	601138	工业富联	140,613	2,306,053.20	0.18
18	600089	特变电工	332,140	2,301,730.20	0.18
19	002185	华天科技	400,000	2,256,000.00	0.17
20	000028	国药一致	45,000	2,245,500.00	0.17
21	000338	潍柴动力	242,200	2,119,250.00	0.16
22	300577	开润股份	50,540	2,083,258.80	0.16
23	600584	长电科技	120,000	2,032,800.00	0.16
24	300047	天源迪科	130,000	2,028,000.00	0.15
25	600718	东软集团	150,200	1,961,612.00	0.15
26	600036	招商银行	72,400	1,914,256.00	0.15
27	001979	招商蛇口	99,800	1,901,190.00	0.15
28	000651	格力电器	40,000	1,886,000.00	0.14
29	002048	宁波华翔	143,600	1,770,588.00	0.14
30	300351	永贵电器	140,000	1,754,200.00	0.13
31	600485	信威集团	163,300	1,672,192.00	0.13
32	601225	陕西煤业	200,000	1,644,000.00	0.13
33	300446	乐凯新材	84,900	1,563,009.00	0.12
34	601933	永辉超市	200,800	1,534,112.00	0.12
35	002241	歌尔股份	150,000	1,528,500.00	0.12
36	601989	中国重工	331,000	1,337,240.00	0.10
37	600699	均胜电子	50,000	1,284,500.00	0.10
38	600885	宏发股份	42,000	1,256,640.00	0.10
39	603678	火炬电子	50,000	1,246,000.00	0.10
40	300183	东软载波	80,000	1,229,600.00	0.09
41	000423	东阿阿胶	22,819	1,227,890.39	0.09
42	002705	新宝股份	118,800	1,160,676.00	0.09
43	002223	鱼跃医疗	58,900	1,147,961.00	0.09
44	002013	中航机电	150,000	1,135,500.00	0.09
45	300166	东方国信	77,000	1,134,210.00	0.09
46	000002	万科A	40,700	1,001,220.00	0.08
47	600138	中青旅	50,000	996,500.00	0.08
48	002557	洽洽食品	64,700	986,675.00	0.08
49	002838	道恩股份	50,000	961,500.00	0.07
50	300059	东方财富	72,000	948,960.00	0.07
51	000776	广发证券	70,200	931,554.00	0.07
52	600487	亨通光电	42,000	926,100.00	0.07
53	300136	信维通信	30,000	921,900.00	0.07
54	601231	环旭电子	100,000	907,000.00	0.07
55	600562	国睿科技	52,000	891,800.00	0.07
56	600028	中国石化	132,900	862,521.00	0.07
57	002468	申通快递	50,000	857,500.00	0.07

58	002465	海格通信	104,900	842,347.00	0.06
59	000768	中航飞机	50,000	782,000.00	0.06
60	600419	天润乳业	40,000	761,200.00	0.06
61	000895	双汇发展	26,000	686,660.00	0.05
62	002230	科大讯飞	20,000	641,400.00	0.05
63	600686	金龙汽车	50,000	624,500.00	0.05
64	002050	三花智控	30,000	565,500.00	0.04
65	002648	卫星石化	50,000	551,500.00	0.04
66	000938	紫光股份	8,800	550,880.00	0.04
67	002092	中泰化学	53,000	510,920.00	0.04
68	300713	英可瑞	12,614	492,828.98	0.04
69	000725	京东方 A	135,400	479,316.00	0.04
70	600674	川投能源	50,000	436,000.00	0.03
71	601155	新城控股	13,700	424,289.00	0.03
72	300498	温氏股份	19,000	418,380.00	0.03
73	000921	海信科龙	37,000	383,320.00	0.03
74	002045	国光电器	42,500	303,875.00	0.02
75	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.02
76	000063	中兴通讯	14,500	188,935.00	0.01
77	000963	华东医药	3,600	173,700.00	0.01
78	600861	北京城乡	21,200	145,644.00	0.01
79	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
80	000540	中天金融	26,100	109,098.00	0.01
81	300745	欣锐科技	1,304	107,032.32	0.01
82	603486	科沃斯	1,639	105,338.53	0.01
83	000425	徐工机械	24,700	104,728.00	0.01
84	002466	天齐锂业	1,840	91,245.60	0.01
85	000793	华闻传媒	12,400	85,684.00	0.01
86	002456	欧菲科技	5,250	84,682.50	0.01
87	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.01
88	300746	汉嘉设计	2,318	79,391.50	0.01
89	000876	新希望	12,300	77,982.00	0.01
90	300070	碧水源	5,400	75,222.00	0.01
91	002594	比亚迪	1,500	71,520.00	0.01
92	000630	铜陵有色	31,800	70,278.00	0.01
93	000977	浪潮信息	2,900	69,165.00	0.01
94	000060	中金岭南	13,650	66,339.00	0.01
95	000415	渤海金控	10,800	63,072.00	0.00
96	600176	中国巨石	5,916	60,520.68	0.00
97	300072	三聚环保	2,550	59,364.00	0.00
98	000983	西山煤电	7,600	57,076.00	0.00
99	000709	河钢股份	19,300	56,935.00	0.00

100	000778	新兴铸管	12,900	55,212.00	0.00
101	300024	机器人	3,100	53,940.00	0.00
102	000402	金融街	6,700	53,935.00	0.00
103	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
104	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
105	002007	华兰生物	1,500	48,240.00	0.00
106	002928	华夏航空	1,640	46,330.00	0.00
107	002065	东华软件	5,200	44,720.00	0.00
108	601166	兴业银行	3,100	44,640.00	0.00
109	002049	紫光国微	1,000	44,120.00	0.00
110	000917	电广传媒	7,100	40,896.00	0.00
111	002310	东方园林	3,000	39,240.00	0.00
112	002673	西部证券	5,040	38,052.00	0.00
113	000800	一汽轿车	4,900	36,652.00	0.00
114	002470	金正大	4,400	30,272.00	0.00
115	300146	汤臣倍健	1,900	29,222.00	0.00
116	000718	苏宁环球	7,600	27,892.00	0.00
117	002183	怡亚通	4,100	27,265.00	0.00
118	600000	浦发银行	2,600	24,856.00	0.00
119	002153	石基信息	800	23,200.00	0.00
120	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
121	002500	山西证券	3,400	22,916.00	0.00
122	002385	大北农	5,200	21,476.00	0.00
123	000008	神州高铁	4,700	20,727.00	0.00
124	002152	广电运通	3,450	20,286.00	0.00
125	601169	北京银行	3,360	20,260.80	0.00
126	300033	同花顺	500	19,435.00	0.00
127	002299	圣农发展	1,200	18,588.00	0.00
128	002174	游族网络	900	17,910.00	0.00
129	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00
130	601766	中国中车	2,000	15,400.00	0.00
131	601818	光大银行	3,700	13,542.00	0.00
132	002131	利欧股份	6,325	13,282.50	0.00
133	600015	华夏银行	1,440	10,728.00	0.00
134	601006	大秦铁路	1,300	10,673.00	0.00
135	601688	华泰证券	700	10,479.00	0.00
136	601009	南京银行	1,120	8,657.60	0.00
137	601088	中国神华	400	7,976.00	0.00
138	300085	银之杰	600	7,788.00	0.00
139	600660	福耀玻璃	300	7,713.00	0.00
140	601857	中国石油	1,000	7,710.00	0.00
141	600031	三一重工	800	7,176.00	0.00

142	600999	招商证券	500	6,840.00	0.00
143	601628	中国人寿	300	6,756.00	0.00
144	002568	百润股份	500	6,755.00	0.00
145	600958	东方证券	700	6,391.00	0.00
146	601600	中国铝业	1,400	5,376.00	0.00
147	600570	恒生电子	100	5,295.00	0.00
148	600010	包钢股份	3,080	4,774.00	0.00
149	601788	光大证券	400	4,392.00	0.00
150	600115	东方航空	600	3,972.00	0.00
151	603259	药明康德	41	3,892.95	0.00
152	600332	白云山	100	3,805.00	0.00
153	600535	天士力	140	3,614.80	0.00
154	600085	同仁堂	100	3,528.00	0.00
155	600208	新湖中宝	700	2,674.00	0.00
156	600583	海油工程	500	2,630.00	0.00
157	600170	上海建工	833	2,532.32	0.00
158	600804	鹏博士	200	2,400.00	0.00
159	600839	四川长虹	800	2,288.00	0.00
160	600008	首创股份	500	2,110.00	0.00
161	601633	长城汽车	200	1,964.00	0.00
162	600118	中国卫星	100	1,910.00	0.00
163	600061	国投资本	200	1,856.00	0.00
164	601258	庞大集团	1,000	1,830.00	0.00
165	600873	梅花生物	400	1,672.00	0.00
166	600737	中粮糖业	200	1,508.00	0.00
167	600376	首开股份	200	1,406.00	0.00
168	600060	海信电器	100	1,339.00	0.00
169	601718	际华集团	300	1,206.00	0.00
170	600895	张江高科	100	1,150.00	0.00
171	600827	百联股份	100	1,020.00	0.00
172	603712	七一二	31	878.54	0.00
173	603000	人民网	100	830.00	0.00
174	600021	上海电力	100	674.00	0.00
175	603348	文灿股份	8	295.36	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	601988	中国银行	7,016,850.00	0.54

2	601318	中国平安	5,593,810.00	0.43
3	000338	潍柴动力	5,504,657.46	0.42
4	601607	上海医药	5,194,315.00	0.40
5	600340	华夏幸福	5,187,427.74	0.40
6	600383	金地集团	4,487,121.00	0.34
7	600029	南方航空	4,143,867.00	0.32
8	600036	招商银行	4,121,513.00	0.31
9	601288	农业银行	3,604,777.00	0.28
10	002463	沪电股份	3,504,598.00	0.27
11	600718	东软集团	3,427,175.00	0.26
12	600038	中直股份	3,240,413.00	0.25
13	300047	天源迪科	3,235,308.28	0.25
14	600887	伊利股份	3,216,791.00	0.25
15	600325	华发股份	3,155,593.00	0.24
16	002048	宁波华翔	3,050,747.04	0.23
17	600176	中国巨石	2,964,591.30	0.23
18	002185	华天科技	2,941,522.60	0.22
19	601933	永辉超市	2,878,203.00	0.22
20	601138	工业富联	2,766,048.75	0.21

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

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	600887	伊利股份	13,773,705.00	1.05
2	601318	中国平安	7,494,201.00	0.57
3	600030	中信证券	6,630,781.00	0.51
4	600004	白云机场	6,284,767.65	0.48
5	000661	长春高新	5,454,473.00	0.42
6	600028	中国石化	5,229,482.10	0.40
7	601288	农业银行	4,840,000.00	0.37
8	600176	中国巨石	4,775,957.58	0.36
9	002081	金螳螂	4,683,047.00	0.36
10	600029	南方航空	4,295,670.00	0.33
11	601988	中国银行	4,165,388.00	0.32
12	000338	潍柴动力	3,541,833.00	0.27
13	002223	鱼跃医疗	3,410,616.00	0.26
14	600089	特变电工	3,364,016.00	0.26
15	601601	中国太保	3,296,882.60	0.25
16	601607	上海医药	3,168,167.00	0.24
17	600436	片仔癀	3,043,661.00	0.23

18	000538	云南白药	2,864,777.00	0.22
19	600038	中直股份	2,813,376.00	0.21
20	002727	一心堂	2,486,230.00	0.19

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	155,206,095.75
卖出股票收入(成交)总额	156,698,187.30

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	270,095,200.00	20.60
	其中:政策性金融债	190,251,200.00	14.51
4	企业债券	533,774,898.20	40.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	297,242,000.00	22.67
7	可转债(可交换债)	927,299.20	0.07
8	同业存单	260,320,000.00	19.85
9	其他	-	-
10	合计	1,362,359,397.40	103.91

#### 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	136175	16 搜候债	800,000	78,920,000.00	6.02
2	180205	18 国开 05	500,000	52,435,000.00	4.00
3	180404	18 农发 04	500,000	50,150,000.00	3.82
4	112674	18 亚迪 01	500,000	49,875,000.00	3.80
5	136239	16 国联 01	500,000	49,435,000.00	3.77

#### 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: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:无。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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

**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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形**

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

**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	65,642.70

2	应收证券清算款	1,285,316.74
3	应收股利	-
4	应收利息	20,489,016.17
5	应收申购款	144,445.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,984,420.61

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132005	15 国资 EB	710,791.20	0.05

#### 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	002051	中工国际	3,504,460.00	0.27	重大事项

#### 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

份额级别	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 (%)
鹏华弘润混合 A 类	626	1,845,277.93	1,130,926,164.39	97.90	24,217,819.32	2.10
鹏华弘润混合	1,540	3,563.71	-	-	5,488,111.03	100.00

C 类						
合计	2,166	535,841.23	1,130,926,164.39	97.44	29,705,930.35	2.56

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	鹏华弘润混合 A 类	38,008.17	0.0033
	鹏华弘润混合 C 类	-	-
	合计	38,008.17	0.0033

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

项目	鹏华弘润混合 A 类	鹏华弘润混合 C 类
基金合同生效日（2015 年 4 月 14 日）基金份额总额	715,594,779.79	163,700,314.71
本报告期期初基金份额总额	1,164,159,287.45	5,630,121.01
本报告期基金总申购份额	241,573.44	1,888,968.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,256,877.18	2,030,977.98
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	1,155,143,983.71	5,488,111.03

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：基金管理人本报告期内无重大人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 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

无。

## 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	1	121,120,312.79	39.49%	110,375.55	39.59%	-
安信证券	2	55,999,198.45	18.26%	51,032.20	18.31%	-
方正证券	2	26,655,915.96	8.69%	24,291.68	8.71%	-

国金证券	1	19,773,642.4 1	6.45%	18,019.61	6.46%	-
国信证券	2	17,755,818.3 2	5.79%	16,180.75	5.80%	-
天风证券	1	11,001,614.4 9	3.59%	10,025.65	3.60%	-
中金公司	2	10,953,136.5 4	3.57%	9,981.50	3.58%	-
国泰君安	2	8,495,120.61	2.77%	7,741.32	2.78%	-
中信证券	1	8,196,934.57	2.67%	7,470.00	2.68%	-
东海证券	1	7,275,846.00	2.37%	5,902.80	2.12%	-
广发证券	1	5,826,996.00	1.90%	5,310.29	1.90%	-
长城证券	1	5,587,292.00	1.82%	5,091.72	1.83%	-
兴业证券	1	4,124,348.00	1.34%	3,758.67	1.35%	-
海通证券	2	3,265,250.00	1.06%	2,975.55	1.07%	-
中信建投	2	631,713.58	0.21%	575.65	0.21%	-
长江证券	1	40,359.76	0.01%	36.79	0.01%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	本报告期新增

东方财富 证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
华西证券	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,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

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
华创证券	48,914,100.00	15.76%	2,471,900,000.00	46.72%	-	-
安信证券	-	-	50,000,000.00	0.94%	-	-
方正证券	-	-	677,200,000.00	12.80%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	29,872,800.00	9.62%	887,000,000.00	16.76%	-	-
天风证券	66,200,898.20	21.32%	103,000,000.00	1.95%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	4,000,000.00	0.08%	-	-
中信证券	165,456,500.00	53.30%	334,400,000.00	6.32%	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	219,000,000.00	4.14%	-	-
长城证券	-	-	413,900,000.00	7.82%	-	-
兴业证券	-	-	2,000,000.00	0.04%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	129,000,000.00	2.44%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

## 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国际金融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》	2018年01月12日
2	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》	2018年01月17日
3	2017年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年01月22日
4	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》	2018年01月24日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开展基金转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年01月30日
6	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》	2018年02月02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》	2018年02月03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》	2018年02月06日
9	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》	2018年02月07日
10	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》	2018年02月08日
11	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》	2018年02月10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》	2018年03月02日
13	鹏华基金管理有限公司关于增加西安银行股份有限公司为旗下部分基金销	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年03月05日



	售机构的公告		
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》	2018年03月10日
15	鹏华基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年03月14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》	2018年03月21日
17	关于鹏华旗下139只基金修改基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年03月23日
18	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》	2018年03月24日
19	2017年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年03月29日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司手机银行基金认/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》	2018年03月31日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年04月09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》	2018年04月11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》	2018年04月14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》	2018年04月18日
25	2018年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年04月21日
26	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》	2018年04月24日
27	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年05月09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》	2018年05月09日

29	鹏华弘润灵活配置混合型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》	2018 年 05 月 26 日
30	鹏华基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 28 日
31	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》	2018 年 05 月 29 日
32	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购工业富联首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 30 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变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 31 日
34	鹏华基金管理有限公司关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 01 日
35	鹏华基金关于调整旗下部分基金单笔最低定投金额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 08 日
36	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》	2018 年 06 月 12 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票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》	2018 年 06 月 15 日
38	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》	2018 年 06 月 16 日
39	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》	2018 年 06 月 20 日
40	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》	2018 年 06 月 22 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票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》	2018 年 06 月 22 日
42	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》	2018 年 06 月 27 日
43	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》	2018 年 06 月 28 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金	《中国证券报》、《上海	2018 年 06 月 29 日

	持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	证券报》、《证券时报》	
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年06月30日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司网上银行渠道基金定投手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年06月30日

注:无。

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20180101~20180630	1,117,902,016.88	-	-	1,117,902,016.88	96.32
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注:1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投;

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、场内卖出份额和指数分级基金拆份额。

### 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)《鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金 2018 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 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行股份有限公司

### 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.cn>)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

2018 年 08 月 27 日