

鹏华精选成长混合型证券投资基金 2017 年 年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 29 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华精选成长混合
场内简称	-
基金主代码	206002
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	2009 年 9 月 9 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	121,262,899.27 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	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，自下而上精选具有良好持续成长潜力的上市公司，力争基金资产的长期增值。
投资策略	1. 资产配置策略 本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场技术指标、市场资金构成及流动性情况，运用定性和定量相结合的分析手段，对证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2. 股票投资策略 本基金对股票的投资采用自下而上的个股精选策略，对成长性股票进行筛选，结合定性分析与定量分析构建投资组合，并进行定期和不定期调整。 3. 债券投资策略 本基金将采取久期策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现债券组合增值。 4. 权证投资策略 本基金在进行权证投资时，将通过对其标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币型基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中具有中高风险、中高收益的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	17,961,051.78	-54,749,947.07	216,612,612.64
本期利润	43,032,442.73	-75,335,113.82	186,177,470.78
加权平均基金份额本期利润	0.2476	-0.3956	0.7395
本期基金份额净值增长率	21.48%	-25.02%	46.17%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.4421	0.1868	0.5826
期末基金资产净值	174,867,909.78	216,780,715.96	308,518,918.60

期末基金份额净值	1.442	1.187	1.583
----------	-------	-------	-------

注: (1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入 (不含公允价值变动收益) 扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用 (例如, 开放式基金的申购赎回费、基金转换费等), 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 表中的“期末”均指报告期最后一日, 即 12 月 31 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

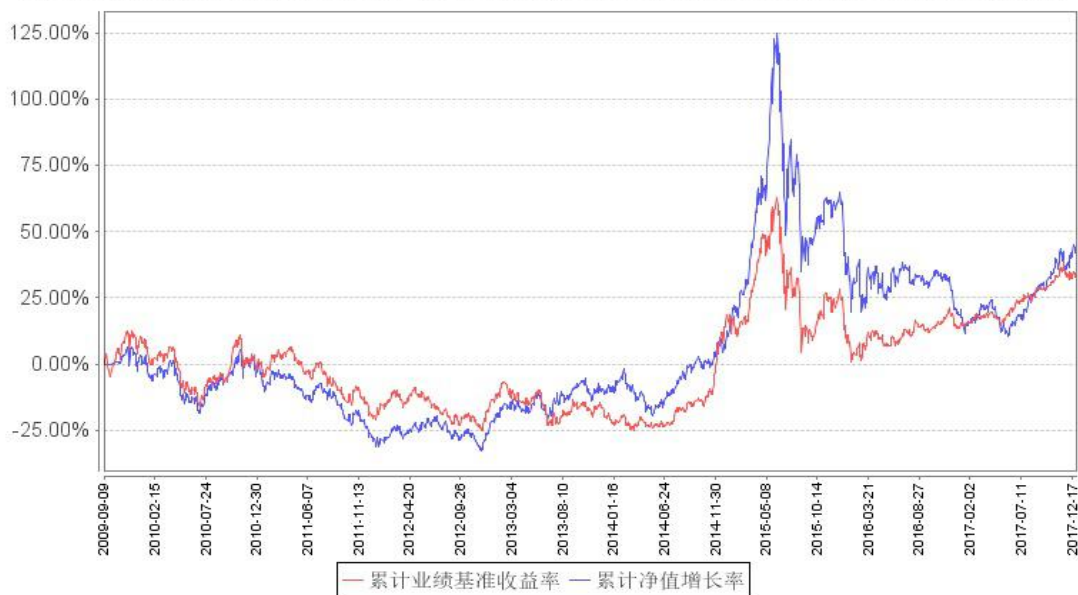
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率① (%)	净值增长率标准差② (%)	业绩比较基准收益率③ (%)	业绩比较基准收益率标准差④ (%)	①-③ (%)	②-④ (%)
过去三个月	9.99	1.02	3.97	0.64	6.02	0.38
过去六个月	22.00	0.91	7.96	0.56	14.04	0.35
过去一年	21.48	0.90	17.23	0.51	4.25	0.39
过去三年	33.15	1.77	15.30	1.35	17.85	0.42
过去五年	83.46	1.56	54.69	1.24	28.77	0.32
自基金成立起至今	44.20	1.41	33.68	1.20	10.52	0.21

业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

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

鹏华精选成长混合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

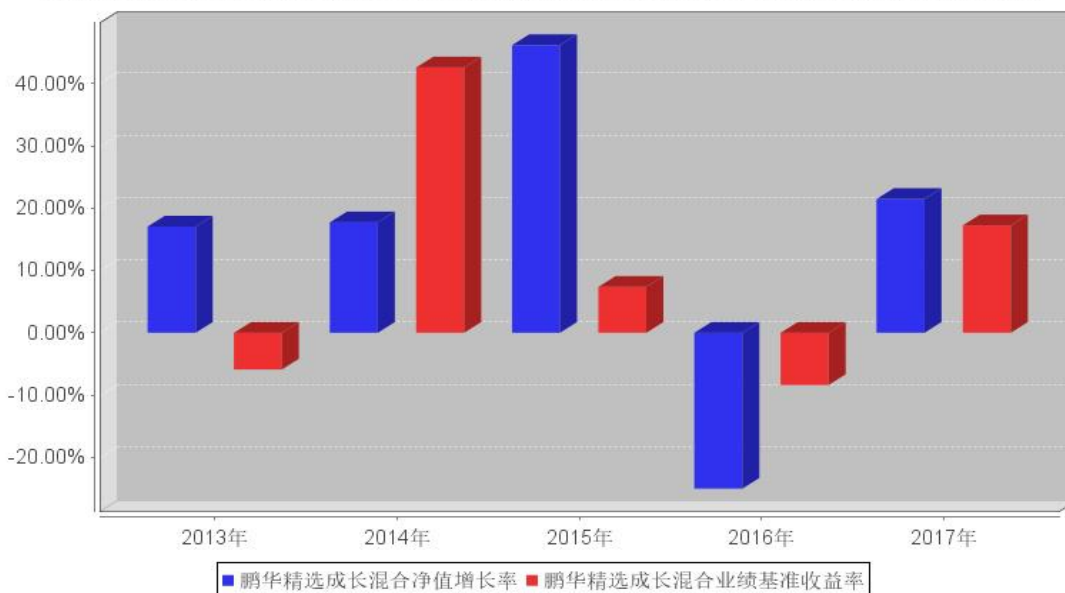


注：1、本基金基金合同于 2009 年 9 月 9 日生效；

2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华精选成长混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注:无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注:截止本报告期末,本基金未进行利润分配。

§ 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 12 月,公司管理资产总规模达到 4,685.45 亿元,管理 151 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		
吴印	本基金基金经理	2015 年 5 月 5 日	2017 年 3 月 3 日	11	吴印先生,国籍中国,经济学硕士,11 年金融证券从业经验。历任万家基金管理有限公司研究发展部行业分析师、基金经理助理、基金经理;2014 年 10 月加盟鹏华基金管理有限公司,曾任权益投资一部基金经理,现任权益投资一部投资经理。本报告期内本基金基金经理发生变动,增聘张清

					华、谢书英担任本基金基金经理,吴印不再担任本基金基金经理。
张清华	本基金基金经理	2017年3月3日	-	13	张清华先生,管理学硕士,13年金融证券从业经验。历任湘财证券机械行业研究员,金信证券机械汽车行业资深分析师,东方证券机械行业资深分析师,博时基金资深研究员。2009年8月加盟鹏华基金管理有限公司,曾任权益投资一部投资经理,2017年3月起担任鹏华精选成长混合基金基金经理。张清华先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,增聘张清华、谢书英担任本基金基金经理,吴印不再担任本基金基金经理。
谢书英	本基金基金经理	2017年7月29日	-	9	谢书英女士,国籍中国,经济学硕士,9年金融证券从业经验。曾任职于高盛高华证券有限公司投资银行部;2009年4月加盟鹏华基金管理有限公司,历任研究部高级研究员、投资经理助理,从事行业研究及投资助理相关工作,2014年4月至2017年3月担任鹏华金刚保本混合基金基金经理,2015年6月起担任鹏华价值优势混合(LOF)基金基金经

					理，2016 年 1 月起兼任鹏华文化传媒娱乐股票基金基金经理，2016 年 9 月起兼任鹏华增瑞混合基金基金经理，2017 年 7 月起兼任鹏华精选成长混合基金基金经理。谢书英女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘张清华、谢书英担任本基金基金经理，吴印不再担任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注:1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信

用产品投资管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公

司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 1 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

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

2017 年市场呈现出明显的“二八分化”，市场扣除当年上市的新股，实际上涨的股票个数不足市场的 20%；并且这些上涨的个股在行业分布上也比较集中，主要在金融、家电、食品饮料、以及周期类的板块上。2017 年基金整体业绩表现远好于市场平均，基金中位数的业绩回报在 15% 左右。2017 年，鹏华精选成长下半年组合在表现较好的行业上积极布局，取得了不错的效果。我们坚持自下而上的选股思路，采取“行业适度分散、个股适度集中”的组合构建策略，取得了较好的回报。尽管短期内来看，集中在少数优势行业上的持仓结构在 2017 年取得了更好的业绩表现，但是我们相信，通过行业上的适度分散，可以更好的分散组合风险，为投资者创造更好的风险调整后的收益，使得组合的净值尽可能实现平稳的上涨。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年本基金净值上涨 21.48%，同期上证综指上涨 6.56%，深证成指上涨 8.48%，沪深 300 指数上涨 21.78%，创业板指下跌 10.67%，

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年极端分化的市场表现，使得大部分机构投资者的持仓都集中到了少数去年表现较好的行业与个股上。这样拥挤的交易结构，非常容易引发短期的剧烈波动。今年 2 月份的快速下跌就是如此。展望 2018 年全年，我们对于整体市场相对乐观，一方面国内外的经济环境都处于温和复苏的阶段，国内经济韧性较强、消费升级叠加产业创新持续给经济提供动力。海外经济处于持续复苏的过程中，为中国经济的创造了良好的外部条件。2018 年我们将坚持自下而上的选股思路，寻找优秀的企业、在合理的估值水平上进行投资、期待 2018 年仍然能够取得不错的业绩回报。

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，本基金期末可供分配利润为 53,605,010.51 元，期末基金份额净值 1.442 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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 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 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表**7.1 资产负债表**

会计主体：鹏华精选成长混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款		17,511,459.01	35,016,332.29
结算备付金		504,091.78	1,657,374.15
存出保证金		92,185.65	128,177.27
交易性金融资产		159,172,379.41	196,117,224.77
其中：股票投资		159,172,379.41	196,117,224.77
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		8,810.20	13,574.71
应收股利		-	-
应收申购款		74,811.97	16,765.86
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		177,363,738.02	232,949,449.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,214,853.63	14,258,218.85
应付赎回款		121,628.14	37,797.98
应付管理人报酬		272,607.02	288,413.60
应付托管费		45,434.48	48,068.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		246,109.16	1,041,192.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		595,195.81	495,040.97
负债合计		2,495,828.24	16,168,733.09
所有者权益：			
实收基金		121,262,899.27	182,665,935.85
未分配利润		53,605,010.51	34,114,780.11
所有者权益合计		174,867,909.78	216,780,715.96
负债和所有者权益总计		177,363,738.02	232,949,449.05

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.442 元，基金份额总额 121,262,899.27 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华精选成长混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		49,886,151.62	-67,076,370.38
1. 利息收入		220,606.96	386,431.73
其中：存款利息收入		211,857.37	386,431.73
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		8,749.59	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		24,575,914.32	-46,892,924.78
其中：股票投资收益		23,212,857.49	-47,469,771.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,363,056.83	576,846.50
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)		25,071,390.95	-20,585,166.75
4. 汇兑收益(损失以“-”号填 列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填 列)		18,239.39	15,289.42
减：二、费用		6,853,708.89	8,258,743.44
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	3,234,396.04	3,760,915.74
2. 托管费	7.4.8.2.2	539,065.91	626,819.38
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		2,658,097.14	3,450,305.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-

6. 其他费用		422,149.80	420,703.13
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		43,032,442.73	-75,335,113.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		43,032,442.73	-75,335,113.82

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华精选成长混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 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)	182,665,935.85	34,114,780.11	216,780,715.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	43,032,442.73	43,032,442.73
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)	-61,403,036.58	-23,542,212.33	-84,945,248.91
其中：1. 基金申购款	16,110,657.49	4,230,643.95	20,341,301.44
2. 基金赎回款	-77,513,694.07	-27,772,856.28	-105,286,550.35
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)	121,262,899.27	53,605,010.51	174,867,909.78
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 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)	194,941,438.80	113,577,479.80	308,518,918.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-75,335,113.82	-75,335,113.82
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)	-12,275,502.95	-4,127,585.87	-16,403,088.82
其中：1. 基金申购款	12,783,665.30	4,098,719.25	16,882,384.55
2. 基金赎回款	-25,059,168.25	-8,226,305.12	-33,285,473.37
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)	182,665,935.85	34,114,780.11	216,780,715.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华精选成长混合型证券投资基金(原名鹏华精选成长股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)系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【2009】645号文“关于核准鹏华精选成长股票型证券投资基金募集的批复”的批准,由鹏华基金管理有限公司自2009年8月4日至2009年9月4日止向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2009)验字第60468989_H02号验资报告。本基金的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币3,013,054,770.97元,折合3,013,054,770.97份基金份额;

有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 1,510,340.55 元，折合 1,510,072.93 份基金份额，利息折算差额人民币 267.62 元计入基金资产。以上收到的实收基金共计人民币 3,014,564,843.90 元，折合 3,014,564,843.90 份基金份额。本基金的基金合同于 2009 年 9 月 9 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，注册登记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（以下简称“中国建设银行”）。

为符合 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所适用投资比例的规定，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，鹏华基金管理有限公司决定自 2015 年 8 月 3 日起，将“鹏华精选成长股票型证券投资基金”更名为“鹏华精选成长混合型证券投资基金”，基金类别由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，并相应修订基金合同部分条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华精选成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票、债券、货币市场工具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。其中，股票资产占基金资产的 60%-95%，其中投资于具有良好持续成长潜力的上市公司发行的股票占股票资产的比例不低于 80%；债券、货币市场工具及其他资产不高于基金资产的 40%，其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府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：沪深 300 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

7.4.2 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》、《鹏华精选成长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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度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 12

月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

7.4.4.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自 2017 年 12 月 25 日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

7.4.5 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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。

7.4.7 关联方关系

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、基金销售机构、基金注册登记机构
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
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 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	345,650,332.12	19.85	478,431,594.53	20.79

7.4.8.1.2 债券交易

注:无。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	11,200,000.00	25.23	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

注:无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31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	314,990.59	19.85	93,328.86	37.92
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	439,575.52	20.89	26,014.97	2.50

注: 1. 佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买(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鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支持。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,234,396.04	3,760,915.74
其中: 支付销售机构的客户维护费	534,721.24	626,741.79

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

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	539,065.91	626,819.38

注: 支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提, 逐日计提, 按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% ÷ 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

注:无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注:本基金本年度及上年度可比报告期管理人未投资、持有本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期末及上年度末除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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	17,511,459.01	195,078.31	35,016,332.29	371,767.64

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2017年1月1日至2017年12月31日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
国信证券	002839	张家港行	网下申购	5,781	25,262.97
国信证券	002882	金龙羽	网下申购	2,966	18,389.20
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2017 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 01 月 05 日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 01 月 05 日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 01 月 03 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 01 月 05 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股	停牌日期	停	期末	复牌日期	复牌	数量（股）	期末	期末	备
------	---	------	---	----	------	----	-------	----	----	---

码	票名称		牌原因	估值单价		开盘单价		成本总额	估值总额	注
601600	中国铝业	2017-09-12	重大事项	6.67	2018-02-26	7.28	1,000,000	5,349,551.00	6,670,000.00	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-01-02	45.71	621	5,191.56	25,802.55	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-01-02	38.79	621	7,799.76	21,896.46	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	159,172,379.41	89.74
	其中：股票	159,172,379.41	89.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	18,015,550.79	10.16
8	其他各项资产	175,807.82	0.10
9	合计	177,363,738.02	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	87,687,219.67	50.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	165,576.70	0.09
E	建筑业	17,593,936.50	10.06
F	批发和零售业	8,630,025.30	4.94
G	交通运输、仓储和邮政业	6,861,798.76	3.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,140,235.05	4.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	14,150,931.10	8.09
L	租赁和商务服务业	10,353,784.32	5.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.02
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	6,556,548.81	3.75
S	综合	-	-
	合计	159,172,379.41	91.02

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002310	东方园林	698,950	14,097,821.50	8.06
2	002027	分众传媒	735,354	10,353,784.32	5.92
3	601155	新城控股	322,127	9,438,321.10	5.40
4	000651	格力电器	209,186	9,141,428.20	5.23
5	002048	宁波华翔	354,700	8,441,860.00	4.83
6	002624	完美世界	212,625	7,114,432.50	4.07
7	002531	天顺风能	848,920	6,876,252.00	3.93
8	600115	东方航空	833,600	6,843,856.00	3.91
9	601600	中国铝业	1,000,000	6,670,000.00	3.81
10	000858	五粮液	83,200	6,646,016.00	3.80

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 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	000725	京东方 A	24,893,000.00	11.48
2	600115	东方航空	21,229,942.25	9.79
3	002310	东方园林	17,596,183.95	8.12
4	002343	慈文传媒	15,776,819.77	7.28
5	600031	三一重工	15,334,224.00	7.07
6	603898	好莱客	15,001,059.00	6.92
7	600584	长电科技	14,985,395.07	6.91
8	600029	南方航空	14,960,957.00	6.90
9	300159	新研股份	14,584,476.74	6.73
10	000651	格力电器	14,547,371.29	6.71
11	600563	法拉电子	13,865,335.83	6.40
12	000799	酒鬼酒	13,818,826.00	6.37
13	600176	中国巨石	12,861,072.36	5.93
14	600416	湘电股份	12,275,104.33	5.66
15	601688	华泰证券	12,091,590.92	5.58
16	002027	分众传媒	12,052,425.40	5.56
17	601155	新城控股	11,460,276.17	5.29
18	002048	宁波华翔	10,765,317.26	4.97

19	002624	完美世界	10,224,586.07	4.72
20	601333	广深铁路	9,886,751.40	4.56
21	000878	云南铜业	9,467,083.00	4.37
22	002508	老板电器	9,261,151.38	4.27
23	300124	汇川技术	9,120,578.00	4.21
24	600201	生物股份	8,948,438.39	4.13
25	600428	中远海特	8,852,071.00	4.08
26	601668	中国建筑	8,736,108.00	4.03
27	600500	中化国际	8,714,643.00	4.02
28	600664	哈药股份	8,643,204.00	3.99
29	000050	深天马 A	8,616,219.86	3.97
30	600775	南京熊猫	8,525,260.60	3.93
31	600458	时代新材	8,493,898.00	3.92
32	001979	招商蛇口	8,374,099.20	3.86
33	600298	安琪酵母	8,058,507.22	3.72
34	600809	山西汾酒	7,804,301.58	3.60
35	600887	伊利股份	7,777,245.72	3.59
36	601398	工商银行	7,700,000.00	3.55
37	601211	国泰君安	7,551,860.80	3.48
38	002241	歌尔股份	7,526,333.02	3.47
39	000983	西山煤电	7,352,118.80	3.39
40	600750	江中药业	7,068,824.00	3.26
41	002007	华兰生物	7,033,882.87	3.24
42	300115	长盈精密	6,937,861.00	3.20
43	600885	宏发股份	6,894,668.92	3.18
44	300545	联得装备	6,829,837.00	3.15
45	000858	五粮液	6,715,319.56	3.10
46	002531	天顺风能	6,705,252.60	3.09
47	600019	宝钢股份	6,612,225.12	3.05
48	000932	华菱钢铁	6,582,653.00	3.04
49	600048	保利地产	6,449,187.92	2.97
50	300335	迪森股份	6,376,862.32	2.94
51	601766	中国中车	6,334,703.00	2.92
52	002739	万达电影	6,288,147.99	2.90
53	000002	万科 A	6,256,778.00	2.89
54	603306	华懋科技	6,171,504.00	2.85
55	002217	合力泰	5,989,861.68	2.76
56	000933	神火股份	5,980,396.03	2.76
57	601628	中国人寿	5,950,833.78	2.75
58	300496	中科创达	5,914,571.55	2.73
59	002185	华天科技	5,862,705.00	2.70
60	002371	北方华创	5,862,200.96	2.70

61	002419	天虹股份	5,759,518.00	2.66
62	002050	三花智控	5,743,820.00	2.65
63	002493	荣盛石化	5,710,938.50	2.63
64	000418	小天鹅A	5,600,823.00	2.58
65	002449	国星光电	5,478,545.01	2.53
66	000758	中色股份	5,421,963.00	2.50
67	601600	中国铝业	5,349,551.00	2.47
68	600030	中信证券	5,332,042.00	2.46
69	601225	陕西煤业	5,166,534.00	2.38
70	600198	大唐电信	5,105,670.00	2.36
71	600498	烽火通信	5,012,581.54	2.31
72	600036	招商银行	4,903,827.00	2.26
73	300567	精测电子	4,855,432.00	2.24
74	000703	恒逸石化	4,853,974.14	2.24
75	000089	深圳机场	4,740,175.00	2.19
76	002396	星网锐捷	4,726,098.00	2.18
77	002061	浙江交科	4,625,923.00	2.13
78	600516	方大炭素	4,567,635.00	2.11
79	300413	快乐购	4,566,065.00	2.11
80	600479	千金药业	4,561,168.34	2.10
81	600089	特变电工	4,550,939.98	2.10
82	000537	广宇发展	4,530,796.39	2.09
83	600660	福耀玻璃	4,489,729.00	2.07
84	002850	科达利	4,464,911.52	2.06
85	601988	中国银行	4,448,431.00	2.05
86	300463	迈克生物	4,433,374.00	2.05
87	600006	东风汽车	4,433,082.00	2.04
88	300043	星辉娱乐	4,403,311.00	2.03
89	600963	岳阳林纸	4,381,516.00	2.02
90	600703	三安光电	4,372,329.40	2.02

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%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	000725	京东方A	29,601,439.23	13.66
2	600885	宏发股份	19,308,585.08	8.91
3	600563	法拉电子	17,865,481.26	8.24
4	002475	立讯精密	17,181,631.04	7.93

5	300033	同花顺	16,937,987.13	7.81
6	300115	长盈精密	16,504,334.14	7.61
7	600029	南方航空	16,090,933.93	7.42
8	600031	三一重工	15,712,231.75	7.25
9	600115	东方航空	14,971,782.71	6.91
10	603898	好莱客	14,722,158.10	6.79
11	300159	新研股份	14,326,518.09	6.61
12	300496	中科创达	14,039,371.53	6.48
13	002530	金财互联	13,215,315.00	6.10
14	601688	华泰证券	13,062,884.55	6.03
15	600584	长电科技	12,832,260.10	5.92
16	002048	宁波华翔	12,668,334.38	5.84
17	600699	均胜电子	12,668,071.06	5.84
18	000799	酒鬼酒	11,473,006.13	5.29
19	601689	拓普集团	11,135,112.28	5.14
20	601333	广深铁路	11,082,577.87	5.11
21	002439	启明星辰	10,971,981.42	5.06
22	300302	同有科技	10,962,131.80	5.06
23	002250	联化科技	10,541,401.52	4.86
24	600887	伊利股份	10,301,516.20	4.75
25	000050	深天马 A	9,985,971.25	4.61
26	600176	中国巨石	9,817,948.20	4.53
27	300124	汇川技术	9,665,301.42	4.46
28	002343	慈文传媒	9,457,530.15	4.36
29	600428	中远海特	8,951,094.80	4.13
30	600416	湘电股份	8,893,620.76	4.10
31	000878	云南铜业	8,887,003.80	4.10
32	002262	恩华药业	8,872,889.37	4.09
33	601668	中国建筑	8,708,980.24	4.02
34	300458	全志科技	8,434,041.22	3.89
35	601211	国泰君安	8,304,286.37	3.83
36	001979	招商蛇口	8,189,037.04	3.78
37	601398	工商银行	8,187,403.51	3.78
38	002241	歌尔股份	7,918,422.28	3.65
39	600809	山西汾酒	7,739,421.00	3.57
40	000932	华菱钢铁	7,709,165.83	3.56
41	600664	哈药股份	7,674,074.00	3.54
42	600019	宝钢股份	7,538,029.84	3.48
43	000983	西山煤电	7,410,769.00	3.42
44	600500	中化国际	7,223,788.60	3.33
45	000933	神火股份	7,159,948.00	3.30
46	600750	江中药业	7,064,281.72	3.26

47	000651	格力电器	6,926,308.76	3.20
48	300335	迪森股份	6,658,518.24	3.07
49	002739	万达电影	6,573,485.20	3.03
50	601155	新城控股	6,568,991.48	3.03
51	601225	陕西煤业	6,469,222.00	2.98
52	600775	南京熊猫	6,457,720.00	2.98
53	000002	万科A	6,357,034.00	2.93
54	300166	东方国信	6,337,611.52	2.92
55	002007	华兰生物	6,161,668.85	2.84
56	600201	生物股份	6,074,621.00	2.80
57	300078	思创医惠	6,070,546.97	2.80
58	600458	时代新材	6,032,384.00	2.78
59	002493	荣盛石化	5,960,838.50	2.75
60	002217	合力泰	5,951,212.00	2.75
61	601628	中国人寿	5,922,240.19	2.73
62	002185	华天科技	5,886,618.50	2.72
63	601766	中国中车	5,821,699.00	2.69
64	600516	方大炭素	5,732,730.00	2.64
65	603306	华懋科技	5,600,881.00	2.58
66	002310	东方园林	5,595,530.00	2.58
67	002449	国星光电	5,513,612.82	2.54
68	000513	丽珠集团	5,500,314.00	2.54
69	600298	安琪酵母	5,424,751.50	2.50
70	600030	中信证券	5,299,749.00	2.44
71	002027	分众传媒	5,289,069.14	2.44
72	002508	老板电器	5,194,939.68	2.40
73	600198	大唐电信	5,058,017.00	2.33
74	002371	北方华创	5,016,709.30	2.31
75	002315	焦点科技	4,999,573.97	2.31
76	600036	招商银行	4,998,725.00	2.31
77	600963	岳阳林纸	4,954,939.00	2.29
78	600498	烽火通信	4,890,199.94	2.26
79	600048	保利地产	4,832,003.29	2.23
80	000418	小天鹅A	4,769,436.00	2.20
81	000703	恒逸石化	4,641,402.24	2.14
82	000807	云铝股份	4,579,872.07	2.11
83	600161	天坛生物	4,572,241.60	2.11
84	300567	精测电子	4,486,130.00	2.07
85	600660	福耀玻璃	4,468,000.00	2.06
86	000089	深圳机场	4,450,659.00	2.05

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。

8.4.3 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	831,403,322.79
卖出股票收入（成交）总额	916,632,416.59

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

前十大重仓股之分众传媒

广东监管局于 2017 年 4 月 17 日至 5 月 12 日对分众传媒信息技术股份有限公司进行了年报及重组上市事项现场检查，并于 2017 年 6 月 2 日向公司出具了《关于对分众传媒信息技术股份有限公司采取出具警示函措施的决定》。

一、公司部分临时报告信息未披露、披露不及时、不完整，2015 年年报信息披露存在遗漏 具体情况：（一）公司 2015 年年报财务报表附注“货币资金—使用有限制的货币资金”中未披露上海分众德峰广告传播有限公司银行账户被有权机关冻结的情况。（二）公司披露与方源资本成立体育基金暨关联交易进展情况的时间晚于相关媒体发布会的时间。（三）公司披露下属子公司与 WME/IMG 中国签订商业合作协议的公告，公告中关于协议的主要内容的表述过于简单，未将协议中主要条款进行充分披露。

二、公司未在股东大会授权范围内购买银行理财产品 具体情况：2016 年，经公司股东大会

审议通过的相关《关于使用自有闲置 资金购买银行理财产品的议案》均同意公司可以使用不超过一定额度的人民币的 自有闲置资金购买安全性高、流动性好的、由商业银行发行的保证收益型的保本 型理财产品，并授权公司总裁、财务负责人根据上述原则行使具体理财产品的购 买决策权，并由财务部负责具体购买事宜。但公司实际购买的属于非保本型浮动 收益银行理财产品，公司未在股东大会授权范围内购买银行理财产品。

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。

对该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之一的珠海格力电器股份有限公司（以下简称“公司”）于 2017 年 7 月 26 日公告：近日收到中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称“广东证监局”）对公司董事徐自发先生下达的行政监管措施决定书《关于对徐自发采取出具警示函措施的决定》（〔2017〕39 号，以下简称“《决定书》”），现将有关情况公告如下：

一、《决定书》的主要内容

“徐自发，经查，你于 2015 年 6 月起至今任格力电器董事。2016 年 11 月 24 日，你通过交易所集中竞价交易的方式买入格力电器股票 575,300 股，成交均价为 26.39 元/股，成交金额 1518.22 万元。2017 年 5 月 22 日，你再次通过交易所集中竞价交易的方式，卖出格力电器股票 400,825 股，成交均价为 33.45 元/股，成交金额 1340.76 万元。你作为格力电器的董事，将持有的格力电器股票在买入后不足 6 个月卖出，违反了《证券法》第四十七条的规定，现对你采取出具警示函的监管措施。你应认真吸取教训，加强证券法律法规学习，严格规范买卖上市公司股票行为，采取切实有效措施杜绝此类违规行为再次发生。”

二、相关说明

徐自发先生于 2017 年 5 月 22 日通过深圳证券交易所集中竞价交易系统减持了本公司部分股份。减持过程中，因其委托某券商营业部客户经理对短线交易相关法律法规理解偏差，出现本次短线交易。公司已于 2017 年 5 月 27 日对相关情况进行了公告（公告编号：2017-020），徐自发先

生因本次短线交易产生的收益 2,829,824.5 元已经收归公司所有。

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

本基金投资的前十名的其它证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.12.2

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。

8.12.3 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	92,185.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,810.20
5	应收申购款	74,811.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	175,807.82

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

8.12.5 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	601600	中国铝业	6,670,000.00	3.81	重大事项
---	--------	------	--------------	------	------

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
6,760	17,938.30	267,187.47	0.22	120,995,711.80	99.78

9.2 期末上市基金前十名持有人

注：无。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年9月9日）基 金份额总额	3,014,564,843.90
本报告期期初基金份额总额	182,665,935.85
本报告期基金总申购份额	16,110,657.49
减：本报告期基金总赎回份额	77,513,694.07
本报告期基金拆分变动份额（份额减少）	-

以“-”填列)	
本报告期末基金份额总额	121,262,899.27

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:2017 年 9 月 1 日,中国建设银行发布公告,聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,本基金投资策略未改变。

11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 95,000.00 元,该审计机构已提供审计服务的年限为 5 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中金公司	2	483,088,745.64	27.74%	440,237.47	27.74%	-
国信证券	2	345,650,332.12	19.85%	314,990.59	19.85%	-
申万宏源	1	324,855,544.80	18.65%	296,041.64	18.65%	-
海通证券	1	163,095,503.46	9.37%	148,629.10	9.37%	-
安信证券	1	135,382,841.29	7.77%	123,374.94	7.77%	-
中信建投	1	103,184,376.25	5.93%	94,032.40	5.93%	-
中泰证券	1	92,354,440.53	5.30%	84,162.64	5.30%	-
德邦证券	1	44,529,211.25	2.56%	40,579.60	2.56%	-
方正证券	1	19,787,616.62	1.14%	18,032.48	1.14%	-
国泰君安	1	16,917,846.84	0.97%	15,417.20	0.97%	-
国金证券	1	12,599,009.66	0.72%	11,481.55	0.72%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单位的程序:

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位的对象。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。

11.7.2 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
安信证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	11,200,000.00	25.23%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	33,200,000.00	74.77%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20170101~20171220	38,888,199.88	-	38,888,199.88	0.00	0.00
个人	-	-	-	-	-	-	-
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份额；

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分份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

鹏华基金管理有限公司

2018年03月29日