鹏华纯债债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:中国建设银行股份有限公司

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的法律责任。

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	鹏华纯债债券
场内简称	-
交易代码	206015
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	2012年9月3日
报告期末基金份额总额	152,735,966.73份
投资目标	在适度控制风险的基础上,通过严格的利差分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金债券投资将主要采取久期策略,同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率曲线变动趋势的判断、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过严格的利差分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 在资产配置方面,本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。
业绩比较基准	中债总指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。
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

§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	916,417.88
2.本期利润	2,690,215.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0148
4.期末基金资产净值	154,161,942.66
5.期末基金份额净值	1.009

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。

3.2 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	1.41%	0.09%	0.33%	0.06%	1.08%	0.03%

注:业绩比较基准=中债总指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:1.本基金基金合同于2012年9月3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		
刘太阳	本基金基金经理	2012年9月3日	-	11	刘太阳先生,国籍中国,理学硕士,11年金融证券从业经验。曾任中国农业银行金融市场部高级交易员,从事债券投资交易工作;2011年5月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券研究工作,担任固定收益部研究员,2012年9月起担任鹏华纯债债券基金基金经理,2012年12月至2014年3月担任鹏华货币证券投资基金(LOF)基金经理,2012年12月至2014年3月担任鹏华理财21天债券基金(2014年3月已转型为鹏华月月发短期理财债券基金)基金经理,2013年4月起兼任鹏华丰利分级债券基金基金经理,2013年5月起兼任鹏华实业债纯债债券基金基金经理,2014年3月至2015年4月兼任鹏华月月发短期理财债券基金基金经理,2015年3月起兼任鹏华丰盛债券基金基金经理,2016年2月起兼任鹏华弘盛混合基金基金经理,2016年8月起兼任鹏华丰收债券、鹏华双债保利债券、鹏华丰安债券、鹏华丰达债券基金基金经理,2016年9月起兼任鹏华丰恒债券基金基金经理,2016年10月起兼任鹏华丰腾债券、鹏华丰禄债券基金基金经理,2016年12月起兼任鹏华普泰债券、鹏华丰惠债券基金基金经理,2017年2月起兼任鹏华安益增强混合基金基金经理,2017年3月起兼任鹏华丰享债券、鹏华丰玉债券、鹏华丰嘉债券、鹏华丰康债券基金基金经理,2017年4月起兼任鹏华丰瑞债券基金基金经理,2017年6月起兼任鹏华丰玺、丰源债券基金基金经理,现同时担任固定收益部副总经理。刘太阳先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度宏观经济整体比较平稳,供给侧改革成效逐步体现,传统产业供需格局显著改善,产品价格稳定,行业集中程度明显提升,龙头公司盈利能力强,经历了过去几年的供给收缩和供给侧改革,煤炭钢铁化工等行业供需格局显著改善,因为环保、金融等因素行业进入门槛不断攀升,上市公司竞争优势进一步加强,龙头公司估值不断提升。基金操作上减持了在利率上升环境中受损的环保板块,增加了金融板块、白酒、家电板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为3.38%,同期上证综指上涨4.90%,深证成指上涨5.30%,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

第三季度债券收益率震荡上行,期初受资金面略有改善影响,债券收益率小幅回落,后期资金面逐步趋紧,加上大宗商品价格上涨及经济增长略超市场预期影响,债券收益率震荡上行;其中短期债券品种收益率受资金面影响上行幅度较大,中长期债券品种收益率上行幅度较小,整体来看,债券收益率较二季度末小幅上行,受票息因素影响,第三季度大部分财富指数均出现不同程度的上涨,其中企业债财富指数上涨幅度最大,涨幅达1.24%。

在第三季度初,基于经济平稳运行及资金面难以宽松的判断,我们对整体债券市场持谨慎态度,组合久期维持中性较低水平,主要配置3年期以内的中短期品种,其中信用品种以中高评级为主,后期随着债券收益率的逐步上行,组合增加了中长期利率品种的配置。此外,在第三季度,我们还调整了可转债的配置力度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本季度基金份额净值增长率为1.41%,基准增长率为0.33%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	177,560,719.34	91.40
	其中:债券	177,560,719.34	91.40
	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	3,653,769.43	1.88
8	其他资产	13,043,625.14	6.71
9	合计	194,258,113.91	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

注:无。

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

注:无。

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	28,094,000.00	18.22
	其中:政策性金融债	28,094,000.00	18.22
4	企业债券	132,197,060.04	85.75
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	17,269,659.30	11.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	177,560,719.34	115.18

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	160213	16国开13	200,000	18,108,000.00	11.75
2	122431	15闽高速	150,000	14,833,500.00	9.62
3	112296	15东北债	143,000	14,126,970.00	9.16
4	136115	15广证G2	120,000	11,797,200.00	7.65
5	113011	光大转债	100,000	11,142,000.00	7.23

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券之一的债券发行人东北证券股份有限公司,因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。2017年5月3日,公司收到中国证监会吉林监管局下发的《关于对东北证券股份有限公司采取暂停开展代销金融产品业务等行政监管措施的决定》(吉证监决[2017]2号),主要内容如下:

"经查,你公司长沙芙蓉中路营业部前员工涉嫌合同诈骗犯罪,部分员工和经纪人私自推介或销售非东北证券股份有限公司自主发行或代销的金融产品,持续时间较长、涉及金额大,后果严重,影响恶劣。虽未发现你公司参与有关诈骗活动,但你公司存在对营业部负责人把关不严、监督机制失效等问题。反映出公司内部控制不完善、经营管理混乱。

上述行为违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款、《证券公司分支机构监管规定》第十五条第一款的规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条第一款第一项、第六项的规定,我局决定对你公司采取如下行政监管措施:

一是责令限期改正,你公司应于2017年6月30日前完成整改,并向我局提交书面整改报告;

二是责令增加内部合规检查的次数,你公司应当对全部分支机构进行合规检查并于2017年10月底前提交检查报告和整改报告;

三是责令暂停开展代销金融产品业务6个月,期限自2017年5月11日至2017年11月10日止。"

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债券,本次处罚对该债券的投资价值不产生重大影响,从公告中知悉,针对上述问题,东北证券将按照监管要求进行全面自查并积极整改,加强分支机构业务和人员管理,持续完善公司的内部控制,目前公司经营情况正常,财务状况和偿债能力未受影响。敬请广大投资者注意投资风险。

本基金投资的前十名证券中的其他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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,749.49
2	应收证券清算款	10,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,037,385.22
5	应收申购款	1,490.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,043,625.14

5.10.4 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	113011	光大转债	11,142,000.00	7.23
2	113009	广汽转债	3,801,300.00	2.47
3	110033	国贸转债	2,205,180.00	1.43

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

5.10.6 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 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	212,523,536.07
报告期期间基金总申购份额	957,372.45
减:报告期期间基金总赎回份额	60,744,941.79
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	152,735,966.73

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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末申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§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

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	20170701~20170930	94,803,596.33	-	-	94,803,596.33	62.07%
	2	20170719~20170926	40,102,689.13	-	20,000,000.00	20,102,689.13	13.16%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品持有风险							
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分份额。

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)《鹏华纯债债券型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华纯债债券型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华纯债债券型证券投资基金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第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

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

鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告

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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25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	鹏华动力增长混合(LOF)
场内简称	鹏华动力
交易代码	160610
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年1月9日
报告期末基金份额总额	1,638,823,167.10份
投资目标	精选具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票,进行积极主动的投资管理,在有效控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	(1)股票投资:本基金股票投资采取"自上而下"和"自下而上"相结合的主动投资管理策略,策略分为战略性资产配置、动态资产配置和个股选择等三个层次,重点投资具备高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票。 (2)债券投资:本基金债券投资的主要目的是规避股票投资部分的系统性风险,在投资过程中综合运用久期、收益率曲线、流动性、相对价值挖掘、套利等策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型(偏股型)基金,其预期风险和收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金中的偏债型基金,低于股票型基金,为证券投资基金中的中等风险品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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	160,610.17
2.本期利润	2,690,215.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0148
4.期末基金资产净值	1,803,009,179.47
5.期末基金份额净值	1.100

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。

3.2 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	3.38%	0.63%	3.44%	0.41%	-0.06%	0.22%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:1.本基金基金合同于2007年1月9日生效。

2.截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

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		
郑川江	本基金基金经理	2016年6月24日	-	8	郑川江先生,国籍中国,经济学硕士,8年金融证券从业经验。历任鹏华基金管理有限公司研究员,长城证券研究所研究员、所长助理;2015年2月加盟鹏华基金管理有限公司,任职于研究部,从事行业研究工作;2015年6月起担任鹏华环保产业股票基金基金经理,2016年1月至2017年3月兼任鹏华健康环保混合基金基金经理,2016年6月起兼任鹏华动力增长混合(LOF)基金基金经理,2017年4月起兼任鹏华新能源产业混合基金基金经理。郑川江先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度宏观经济整体比较平稳,供给侧改革成效逐步体现,传统产业供需格局显著改善,产品价格稳定,行业集中程度明显提升,龙头公司盈利能力强,经历了过去几年的供给收缩和供给侧改革,煤炭钢铁化工等行业供需格局显著改善,因为环保、金融等因素行业进入门槛不断攀升,上市公司竞争优势进一步加强,龙头公司估值不断提升。基金操作上减持了在利率上升环境中受损的环保板块,增加了金融板块、白酒、家电板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为3.38%,同期上证综指上涨4.90%,深证成指上涨5.30%,沪深300指数上涨5.30%。

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	1,521,929,813.04	84.02
	其中:股票	1,521,929,813.04	84.02
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	288,388,970.08	15.92
8	其他资产	975,894.70	0.05
9	合计	1,811,294,677.82	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	73,468,265.50	4.07
C	制造业	1,000,184,994.45	55.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,653,818.26	2.98
E	建筑业	17,412,579.80	0.97
F	批发和零售业	77,286.30	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	348,923,227.73	19.35
K	房地产业	9,907,605.72	0.55
L	租赁和商务服务业	17,929,835.97	0.99
M	科学研究和技术服务业	90,826.86	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	51,243.66	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	71,788.86	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,521,929,813.04	84.41

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	601988	中国银行	21,059,702	86,765,972.24	4.81
2	600309	万华化学	2,000,000	84,300,000.00	4.68
3	601398	工商银行	13,718,382	82,310,292.00	4.57
4	300156	神雾环保	3,197,933	80,140,200.98	4.44
5	600809	山西汾酒	1,383,174	76,143,728.70	4.22
6	000968	蓝焰控股	4,389,030	73,428,471.90	4.07
7	000651	格力电器	1,900,580	72,031,982.00	4.00
8	000858	五粮液	1,189,440	68,131,123.20	3.78
9	601328	交通银行	9,381,400	59,290,448.00	3.29
10	600519	贵州茅台	111,707	57,824,011.48	3.21

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:无。

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

注:无。

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

注: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

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.2 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

注: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

本基金投资的前十名证券之一的万华化学集团股份有限公司(以下简称"公司")于2017年7月6日公告:近日,烟台市人民政府批复了《万华化学集团股份有限公司烟台工业园"9.20"较大爆炸事故调查报告》,现对相关事宜公告如下:

一、事故基本情况

2016年9月20日17时22分,万华化学集团股份有限公司烟台工业园在大修停车处理过程中,MDI(二苯基甲烷二异氰酸酯)装置光化工序一台12.1立方米粗MDI(以下简称粗M)缓冲罐发生爆炸,造成4人死亡、4人受伤,直接经济损失573.62万元。详细内容参见公司已发布的临2016-38号、临2016-39号、临2016-43号、临2016-45号、临2016-48号、临2016-49号公告。

事故发生后,烟台市政府成立了由市安监局、监察局、公安局、总工会、质监局、开发区管委等部门、单位参加的万华化学集团股份有限公司烟台工业园"9.20"较大爆炸事故调查组,同时邀请市检察院派员参加,并聘请了6名省市化工行业专家组成专家组,开展事故调查工作。

二、事故原因和性质

(一)事故直接原因

DAM管线进料手动球阀限位板损坏导致阀门未关严,且仪表操作人员没有按操作规程将DAM管线远程开关阀关闭,造成DAM误入反应系统,与系统中粗M反应生成缩聚酯和缩二脲。缩聚酯和缩二脲进入粗M缓冲罐,在高温(200℃)下催化粗M自聚反应,生成碳化二亚胺(CDI)和二氧化碳(CO2)。粗M自聚产生的高粘度聚合物以及聚类物质将粗M缓冲罐出料口、进料口、两根压力平衡管堵塞。随着聚合反应的持续发生,粗M缓冲罐内CO2量不断增多,压力逐渐升高,最终超压爆炸。

(二)事故间接原因

1.工艺管理不到位。操作规程中规定停车时应关闭远程切断阀,但实际操作中将远程切断阀作为紧急切断阀使用,停车操作时仅关闭流量调节阀和现场手动切断阀;当班班长、工序主管、工艺工程师、装置经理等各级管理人员均未纠正仅表操作工未按操作规程关闭远程切断阀的行为。

2.生产异常情况处置不得当。操作人员及生产管理人员均未能及时发现系统温度、液位、流量等参数异常;在对粗M缓冲罐异常情况处置过程中,现场人员发现本次异常与以往不同,未意识到可能存在的风险,未及时向有关部门报告,未停止作业、撤离人员。

3.不了解聚类物质对MDI缩聚的催化机理。本次事故之前,未对聚类物质对MDI缩聚的催化机理进行过科学研究,无法预见DAM误入系统导致聚类催化MDI自聚反应引发的严重后果。

(三)事故性质

经调查认定:万华化学集团股份有限公司"9.20"爆炸事故是一起较大生产安全责任事故。

三、事故人员伤亡和经济损失及对周边影响

(一)事故造成的人员伤亡和直接经济损失

本次事故造成4人死亡,4人受伤;直接经济损失573.62万元。

(二)事故对周边的破坏情况

从事故现场看,无危险化学品液体和气体泄漏,未发生火灾,企业环境监测组和市区两级环保部门对事故周边区域进行了环境检测,未检出污染物,事故未造成次生灾害。

四、责任认定及处理

根据烟台市人民政府批复的《万华化学集团股份有限公司烟台工业园"9.20"较大爆炸事故调查报告》的建议,公司对9名相关责任人给予相应责任追究,包括解除劳动合同、撤职、留厂查看、降级、记过、警告等处分;烟台市安监局对万华化学集团股份有限公司负责人处上一年收入40%的罚款,对万华化学集团股份有限公司处以80万元罚款。

五、事故整改措施

严格工艺纪律管理,对重要和风险高的操作实行确认制,加强工艺纪律检查,及时发现并严肃处理违反操作规程的行为;加强异常情况和开停车作业管理,进一步修订生产异常应急处置操作法,设备、设施等发生异常情况应及时采取有效措施,并及时按程序报告有关管理人员,协调有关岗位及时处理;加强阀门等安全部件的全程管理,建立实行重要阀门开关确认制度,确保规范操作;进一步加强MDI生产的反应机理研究,将有关研究结果纳入生产技术文件中,进一步优化工艺参数和操作规程,采取可靠措施确保工艺安全。

公司将认真吸取事故教训,进一步加强安全管理,切实提高各级管理人员和员工的安全意识和责任心,确保公司安全、持续、稳定运行。

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。

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	814,482.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	50,671.63
5	应收申购款	110,740.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	975,894.70

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

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	300156	神雾环保	80,140,200.98	4.44	重大事项

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 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,754,197,822.19
报告期期间基金总申购份额	14,570,305.38
减:报告期期间基金总赎回份额	129,944,960.47
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,638,823,167.10

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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末申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§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

注:无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;

(二)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;

(三)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)2017年第3季度