鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金

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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	鹏华弘盛混合
场内简称	-
基金主代码	001067
交易代码	001067
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月25日
报告期末基金份额总额	243,441,734.23份
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的绝对水平和增长率、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收益。 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：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、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，力争实现组合的绝对收益。 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。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

基金保证人	-	
下属分级基金的基金简称	鹏华弘盛混合A	鹏华弘盛混合C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	001067	001380
报告期末下属分级基金的份额总额	239,201,501.14份	4,240,233.09份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

§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）	
	鹏华弘盛混合A	鹏华弘盛混合C
1. 本期已实现收益	8,789,730.68	271,823.59
2. 本期利润	3,634,328.14	127,491.29
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0147	0.0224
4. 期末基金资产净值	277,885,528.42	6,709,806.01
5. 期末基金份额净值	1.1617	1.5824

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

鹏华弘盛混合A

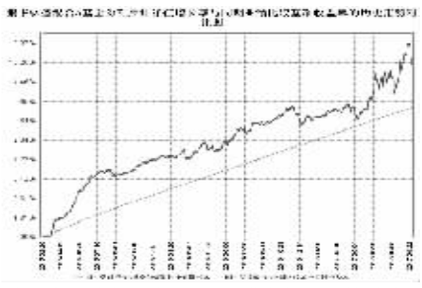
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.28%	0.35%	1.13%	0.01%	0.15%	0.34%

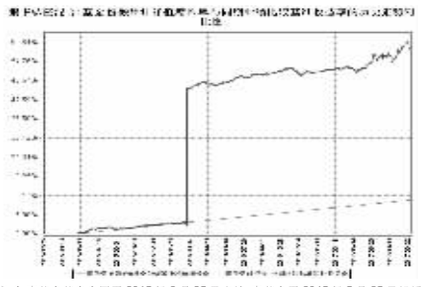
鹏华弘盛混合C

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	1.25%	0.35%	1.13%	0.01%	0.12%	0.34%

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2015年2月25日生效，本基金于2015年5月25日起新增C类份额。

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	2016年2月27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11月起兼任鹏华丰富债券基金基金经理，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月起兼任鹏华丰犇、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

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%。

受大宗商品价格上涨及经济增长略超市场预期影响，本季度权益市场震荡上涨。沪深300指数和创业板指数分别上涨4.63%和2.69%。本报告期内基金以短久期、流动性较好的债券品种为主，为组合提供了稳定收益；同时在控制仓位的前提下，适当寻求二级市场投资机会。此外组合积极参与新股申购。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，A、C类产品分别上涨1.28%、1.25%，同期业绩比较基准为1.13%。

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	65,464,245.82	16.47
	其中：股票	65,464,245.82	16.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	309,952,567.20	77.97
	其中：债券	309,952,567.20	77.97
	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	16,529,361.12	4.16
8	其他资产	5,563,264.69	1.40
9	合计	397,509,438.83	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	39,793.60	0.01
C	制造业	1,251,136.14	0.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	33,357.72	0.01
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
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	0.01
J	金融业	12,625,404.00	4.44
K	房地产业	38,213,828.48	13.43
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,072,000.00	4.59
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	0.04
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.02
S	综合	-	-
	合计	65,464,245.82	23.00

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	000002	万科A	930,600	24,428,250.00	8.58
2	000069	华侨城A	1,600,000	13,072,000.00	4.59
3	000001	平安银行	1,136,400	12,625,404.00	4.44
4	001979	招商蛇口	499,966	9,139,378.48	3.21
5	601155	新城控股	260,000	4,646,200.00	1.63
6	300699	光威复材	4,392	314,423.28	0.11
7	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.04
8	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.03
9	002900	哈三联	1,983	83,087.70	0.03
10	300702	天宇股份	1,124	68,968.64	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	221,212,067.20	77.73
5	企业短期融资券	45,130,500.00	15.86
6	中期票据	14,966,000.00	5.26
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	28,644,000.00	10.06
9	其他	-	-
10	合计	309,952,567.20	108.91

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	111785491	17广州农村商业银行CD169	300,000	28,644,000.00	10.06
2	122465	15广越01	283,980	28,170,816.00	9.90
3	136367	16国君G1	250,000	24,392,500.00	8.57
4	124284	13银洋油	200,000	20,094,000.00	7.06
5	136893	17泰达债	200,000	19,660,000.00	6.91

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拟基明细

注：无。

5.9.2 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。

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拟基明细

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	88,063.41
2	应收证券清算款	694,956.98
3	应收股利	-
4	应收利息	4,774,580.73
5	应收申购款	5,663.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,563,264.69

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

注：无。

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

项目	鹏华弘盛混合A	鹏华弘盛混合C
报告期期初基金份额总额	256,473,561.16	6,710,235.28
报告期期间基金总申购份额	664,042.30	206,260.36
减：报告期期间基金总赎回份额	17,936,102.32	2,676,262.55
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期末基金份额总额	239,201,501.14	4,240,233.09

§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未申购、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）《鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金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43层鹏华基金管理有限公司

深圳市深南大道7088号招商银行大厦招商银行股份有限公司

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

鹏华弘实灵活配置混合型证券投资基金

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	鹏华弘实混合
场内简称	-
交易代码	001329
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月25日
报告期末基金份额总额	523,052,205.89份
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的绝对水平和增长率、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目标。 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；自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、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，力争实现组合的绝对收益。 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，力争实现组合的绝对收益。 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。
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
基金保证人	-
下属分级基金的基金简称	鹏华弘实混合A	鹏华弘实混合C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	001329	001330
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	488,044,020.63份	35,008,185.26份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

§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）	
	鹏华弘实混合A	鹏华弘实混合C
1. 本期已实现收益	5,905,514.79	448,725.46
2. 本期利润	6,646,561.00	506,309.89
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0136	0.0144
4. 期末基金资产净值	536,725,800.99	41,070,383.21
5. 期末基金份额净值	1.0997	1.1732

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

鹏华弘实混合A

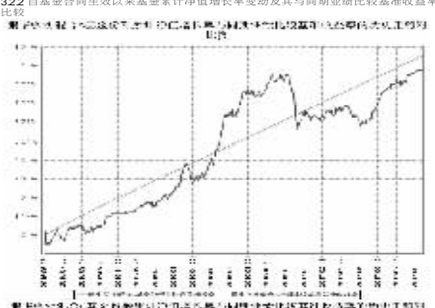
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.25%	0.07%	1.13%	0.01%	0.12%	0.06%

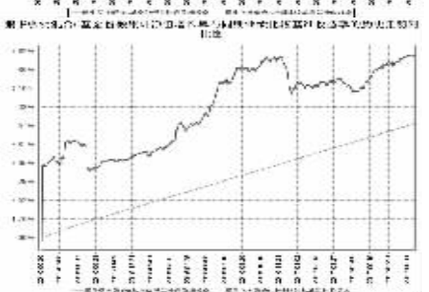
鹏华弘实混合C

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	1.24%	0.07%	1.13%	0.01%	0.11%	0.06%

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2015年5月25日生效，本基金于2015年5月25日起新增C类份额。

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		
李韵怡	本基金基金经理	2015年7月23日	-	10	李韵怡女士，国籍中国，经济学硕士，10年证券从业经验。曾任职于广州证券股份有限公司投资管理总部，先后担任研究员、交易员和投资经理等职务，从事新股及可转债申购、定增项目等工作；2015年6月加盟鹏华基金管理有限公司，从事投研工作，2015年7月起担任鹏华弘盛混合基金、鹏华弘鑫混合基金、鹏华弘和混合基金基金经理，2015年7月至2017年1月兼任鹏华弘毅混合基金、鹏华弘利混合基金基金经理，2015年7月至2017年2月兼任鹏华弘信基金基金经理，2015年7月至2017年3月兼任鹏华弘华混合基金基金经理，2016年6月起兼任鹏华兴泽定期开放混合基金基金经理，2016年9月起兼任鹏华兴润定期开放混合、鹏华兴安定期开放混合、鹏华兴宝定期开放混合基金基金经理，2016年12月起兼任鹏华弘樽混合基金基金经理，2017年1月起兼任鹏华兴惠定期开放混合基金基金经理。李韵怡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

2017年三季度，在人民币汇率呈著升值的大背景下，国内以股票、商品为代表的风险资产出现了大幅反弹，PPI随之开始企稳回升，通胀预期也有所升温，市场上出现了"新周期"之类的热烈讨论，这实出反应了市场风险偏好的上升，客观上对债券类固定收益资产构成了负面冲击，以5年期国债收益率为例，第三季度上升超过10bp。虽然进入9月随着经济数据陆续低于市场预期，债券投资者的情绪有所稳定，但资金面依旧吃紧。同期国际市场的资产价格在地缘政治的影响下同样剧烈波动，其中，美股、港股出现了大幅上涨，美国10年期国债收益率虽然季末依旧在2.3%左右，但期间的波幅近30BP。本报告期内基金以短久期、流动性较好的债券品种为主，为组合提供了稳定收益；同时在控制仓位的前提下，适当寻求二级市场投资机会。此外组合积极参与新股申购。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，A、C类产品分别上涨1.03%、1.03%，同期业绩比较基准为1.12%。

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	61,524,896.31	10.04
	其中：股票	61,524,896.31	10.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	530,827,000.00	86.65
	其中：债券	530,827,000.00	86.65
	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	1,000,000.00	0.16
	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	9,017,537.26	1.47
8	其他资产	10,220,292.24	1.67
9	合计	612,589,725.81	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	28,935.00	0.01
B	采矿业	2,057,023.60	0.36
C	制造业	16,798,474.19	2.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,593,575.00	0.28
E	建筑业	1,630,676.67	0.28
F	批发和零售业	507,118.95	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	1,040,926.91	0.18
H	住宿和餐饮业	15,700.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	341,513.03	0.06
J	金融业	27,961,685.48	4.84
K	房地产业	5,068,350.00	0.88
L	租赁和商务服务业	1,974,956.02	0.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,322,121.47	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	68,540.00	0.01
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	3,242,121.47	0.40
S	综合	68,540.00	0.01
	合计	61,524,896.31	10.65

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	601688	华泰证券	182,500	4,128,150.00	0.71
2	601398	工商银行	662,500	3,975,000.00	0.69
3	601318	中国平安	56,428	3,056,140.48	0.53
4	600201	生物股份	82,700	2,765,488.00	0.48
5	601988	中国银行	581,000	2,393,720.00	0.41
6	600048	保利地产	227,000	2,360,800.00	0.41
7	600885	宏发股份	56,100	2,329,272.00	0.40
8	601098	中南传媒	150,026	2,290,897.02	0.40
9	601336	新华保险	40,000	2,266,800.00	0.39
10	600036	招商银行	80,000	2,044,000.00	0.35

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	30,012,000.00	5.19
	其中：政策性金融债	30,012,000.00	5.19
4	企业债券	284,436,000.00	49.23
5	企业短期融资券	20,084,000.00	3.48
6	中期票据	177,187,000.00	30.67
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	19,108,000.00	3.31
9	其他	-	-
10	合计	530,827,000.00	91.87

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	101652003	16海电MTN001	500,000	49,180,000.00	8.51
2	136147	16中粮01	500,000	49,065,000.00	8.49
3	136144	16远东一	500,000	48,990,000.00	8.48
4	136151	16保利01	500,000	48,920,000.00	8.47
5	101559060	15光明MTN003	400,000	39,612,000.00	6.86

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拟基明细

注：无。

5.9.2 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。

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拟基明细

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	19,992.63
2	应收证券清算款	870,602.91
3	应收股利	-
4	应收利息	9,329,696.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,220,292.24

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

注：无。

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

项目	鹏华弘实混合A	鹏华弘实混合C
报告期期初基金份额总额	488,342,942.69	35,412,058.72
报告期期间基金总申购份额	3,367.88	5,443.18
减：报告期期间基金总赎回份额	302,289.94	409,316.64
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期末基金份额总额	488,044,020.63	35,008,185.26

§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