鹏华可转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	鹏华可转债
场内简称	-
基金主代码	000297
交易代码	000297
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月3日
报告期末基金份额总额	52,652,257.23份
投资目标	在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上,以可转债为主要投资标的,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要投资于可转换债券等固定收益类品种,在有效控制风险的基础上,以可转换债券为主要投资标的,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×60%+中债总指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
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	2,169,570.80
2.本期利润	1,583,308.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0267
4.期末基金资产净值	45,134,091.80
5.期末基金份额净值	0.857

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。

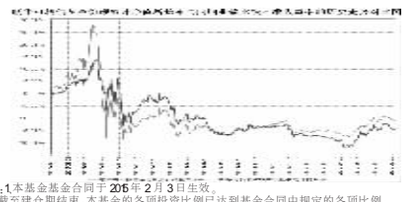
3.2基金净值表现

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	2.51%	0.48%	3.13%	0.38%	-0.62%	0.10%

注:业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率*60%+中债总指数收益率*30%+沪深300指数收益率*10%

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		
李振宇	本基金基金经理	2017年2月4日	-	5	李振宇先生,国籍中国,经济学硕士,5年证券基金从业经验。曾任银华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理,从事债券投资研究工作;2016年8月加盟鹏华基金管理有限公司,担任固定收益部投资经理,2016年12月起担任鹏华丰惠债券、鹏华丰源债券基金基金经理,2017年2月起兼任鹏华可转债基金基金经理,2017年5月起兼任鹏华丰康债券、鹏华金城保本混合基金基金经理。李振宇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,因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形,本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保不同投资组合在研究、交易、分配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业绩表现

报告期内,本基金管理人严格按照本基金合同的约定,于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

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10.9%,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

注: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	4,832,506.72	10.47
	其中:股票	4,832,506.72	10.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,213,078.78	80.66
	其中:债券	37,213,078.78	80.66
	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	1,900,000.00	4.12
	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	1,971,795.13	4.27
8	其他资产	217,619.97	0.47
9	合计	46,135,000.60	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	-	-
C	制造业	2,813,808.00	6.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,669,573.72	3.70
K	房地产业	349,125.00	0.77
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,832,506.72	10.71

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	601398	工商银行	118,531	711,186.00	1.58
2	600779	水井坊	15,600	652,392.00	1.45
3	601318	中国平安	9,076	491,556.16	1.09
4	600660	福耀玻璃	19,000	484,310.00	1.07
5	002078	太阳纸业	47,300	473,000.00	1.05
6	601688	华泰证券	20,638	466,831.56	1.03
7	601233	桐昆股份	25,900	444,444.00	0.98
8	601727	上海电气	49,100	393,782.00	0.87
9	603799	华友钴业	4,000	365,880.00	0.81
10	000002	万科A	13,300	349,125.00	0.77

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	2,829,613.50	6.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	34,383,465.28	76.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	37,213,078.78	82.45

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	113009	广汽转债	48,600	6,158,106.00	13.64
2	132008	17山高EB	43,790	4,186,324.00	9.28
3	132001	14宝钢EB	27,020	3,755,509.80	8.32
4	113013	国君转债	25,470	3,189,862.80	7.07
5	132002	15天集EB	29,680	3,074,848.00	6.81

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

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.2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

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投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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	26,701.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	187,545.39
5	应收申购款	3,373.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	217,619.97

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	113009	广汽转债	6,158,106.00	13.64
2	132001	14宝钢EB	3,755,509.80	8.32
3	132002	15天集EB	3,074,848.00	6.81
4	132004	15国盛EB	2,267,798.50	5.02
5	110032	三一转债	2,149,872.60	4.76
6	132005	15国资EB	1,385,100.00	3.07
7	113011	光大转债	1,113,085.80	2.47
8	128010	顺昌转债	588,814.38	1.30

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	56,535,187.01
报告期间基金总申购份额	11,781,934.39
减:报告期期间基金总赎回份额	15,664,864.17
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	52,652,257.23

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	6,128,409.71
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	6,128,409.71
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	11.64

注:本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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

无。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

(一)《鹏华可转债债券型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华可转债债券型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华可转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43层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司

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

鹏华量化策略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	鹏华量化策略混合
场内简称	-
基金主代码	004489
交易代码	004489
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	2017年6月21日
报告期末基金份额总额	47,917,693.17份
投资目标	本基金通过灵活运用多种量化投资策略,在充分控制基金财产风险和保证基金资产流动性的基础上,力争实现基金资产长期稳健的保值增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金依据宏观和行业经济变量、资本市场金融时间序列数据等构建量化模型和工具对市场的投资者行为、市场情绪、风险偏好等进行系统分析和评估,通过基本面分析框架与量化模型相结合的方式综合评估不同大类资产在不同时期的投资价值及其风险收益特征,在股票、债券和货币等资产间进行大类资产的灵活配置。在基金合同要求内,合理使用金融工具动态调整组合的风险暴露,以期达到控制组合下行风险实现稳健增值的目标。 2.股票投资策略 本基金以量化方法构建股票组合,并结合基本面研究成果对股票组合进行评估,期除投资风险较大的个股,以期获得相对市场表现的长期稳定的超额回报。量化选股体系包括量化选股模型、风险评估模型以及组合优化模型等。 (1)量化选股模型 本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值(value)、质量(quality)、动量(momentum)、成长(growth)、一致预期(consensus expectation)等因子,通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系,挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合,进而得出具有稳定超额回报的股票组合。由于宏观经济环境和市场环境总是变化的,本基金将在充分评估的基础上对因子组合进行动态调整。 (2)风险评估模型 本基金将对股票组合的风险暴露进行分解,构建风险因子。在分析个股的风险因子暴露程度后,通过量化方法对投资组合的风险进行综合评估,最终将投资组合风险控制在目标范围内。 (3)组合优化模型 本基金将综合考虑量化选股模型、风险评估模型、交易和冲击成本、投资品种和比例限制,最终得出优化目标下的个股及权重,形成组合优化模型。 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、信用策略等积极投资策略,灵活地调整组合的券种搭配,精选安全边际较高的个券,力争实现组合的保值增值。 4.权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。 5.资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险等化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 6.股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目标,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,充分考虑股指期货的风险收益特征,通过多头或空头的套期保值策略,以改善投资组合的投资效果,实现股票组合的超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
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市场基金、债券基金,低于股票型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
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	1,355,854.10
2.本期利润	1,338,870.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0231
4.期末基金资产净值	48,922,051.73
5.期末基金份额净值	1.0210

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。

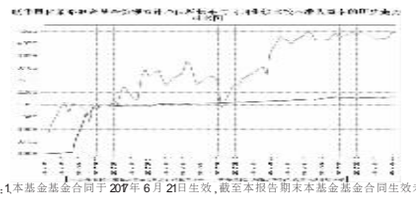
3.2基金净值表现

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	1.61%	0.12%	2.60%	0.29%	-0.99%	-0.17%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

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2017年6月21日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2.本基金管理人将严格按照本基金合同的约定,于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

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		
余斌	本基金基金经理	2017年6月16日	-	10	余斌先生,国籍中国,经济学硕士,10年证券从业经验。曾任职于招商证券股份有限公司,担任风险控制部市场风险分析师;2009年10月加盟鹏华基金管理有限公司,历任机构理财和大客户经理、量化投资部量化研究员,先后从事特定客户资产管理务产品设计、量化研究等工作;2014年5月起担任鹏华信息分级基金基金经理,2014年5月起兼任鹏华证券保险分级基金基金经理,2014年11月起兼任鹏华国防分级基金基金经理,2015年4月起兼任鹏华造分级基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华证券分级基金基金经理,2015年6月起兼任鹏华环保分级基金基金经理,2016年6月起兼任鹏华空天一体军工指数(LOF)、鹏华量化策略混合基金基金经理。余斌先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生未发生变动。

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

本基金于6月21日成立。基于本基金成立时间较短,以及权益市场震荡走势特征明显,报告期内,本基金以稳定增值为主要投资目标,投资策略方面,基于对市场利率走势易上难下的判断,组合重点配置了信用级别较高的短期现金管理工具。此外,组合逐步配置了部分股票,以获得一定的收益增强。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期末,基金份额净值为1.0210,累计净值1.0210。本报告期基金份额净值增长率为1.61%。

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	1,125,490.00	2.29
	其中:股票	1,125,490.00	2.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,574,000.00	80.48
	其中:债券	39,574,000.00	80.48
	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	3,193,416.49	6.49
8	其他资产	5,281,967.46	10.74
9	合计	49,174,873.95	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	125,037.00	0.26
C	制造业	366,124.00	0.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	39,227.00	0.08
F	批发和零售业	22,155.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	22,607.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,843.00	0.09
J	金融业	372,857.00	0.76
K	房地产业	96,213.00	0.20
L	租赁和商务服务业	15,680.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,573.00	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	7,662.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	4,512.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,125,490.00	2.30

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	601318	中国平安	2,900	157,064.00	0.32
2	601088	中国神华	4,500	94,230.00	0.19
3	601328	交通银行	11,600	73,312.00	0.15
4	000002	万科A	1,600	42,000.00	0.09
5	600000	浦发银行	2,300	29,601.00	0.06
6	000333	美的集团	600	26,514.00	0.05
7	601600	中国铝业	3,500	26,495.00	0.05
8	002415	海康威视	800	25,600.00	0.05
9	000001	平安银行	2,200	24,442.00	0.05
10	002241	歌尔股份	1,100	22,264.00	0.05

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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	39,574,000.00	80.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,574,000.00	80.89

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	111710373	17兴业银行CD373	100,000	9,895,000.00	20.23
1	111715253	17民生银行CD253	100,000	9,895,000.00	20.23
1	111720147	17广发银行CD147	100,000	9,895,000.00	20.23
2	111707236	17招商银行CD236	100,000	9,889,000.00	20.21

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:无。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目标,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,充分考虑股指期货的风险收益特征,通过多头或空头的套期保值策略,以改善投资组合的投资效果,实现股票组合的超额收益。

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	-
2	应收证券清算款	5,009,465.75
3	应收股利	-
4	应收利息	268,252.70
5	应收申购款	4,249.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,281,967.46

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	601600	中国铝业	26,495.00	0.05	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	206,941,725.65
报告期期间基金总申购份额	1,397,523.61
减:报告期期间基金总赎回份额	160,421,556.09
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	47,917,693.17

§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)《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华量化策略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

北京市西城区阜内大街1号院1号楼

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

鹏华精选成长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	鹏华精选成长混合
场内简称	-
基金主代码	206002
交易代码	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
报告期末基金份额总额	171,631,009.50份
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 本基金债券投资将采取久期策略、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,将通过对权证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。
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	10,799,636.62
2.本期利润	22,398,785.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.1286
4.期末基金资产净值	224,974,771.18
5.期末基金份额净值	1.311

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