鹏华盛世创新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	鹏华盛世创新混合
场内简称	鹏华创新
交易代码	160613
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	2008年10月10日
报告期末基金份额总额	65,333,298.16份
投资目标	精选具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类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	本基金的投资策略分为两个层次，第一层次是“自上而下”的资产配置策略，第二层次是“自下而上”的选股策略，主要投资于具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票。在充分控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%＋中证综合债指数收益率×25%
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，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。
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	1,565,349.56
2.本期利润	2,706,825.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0400
4.期末基金资产净值	93,472,814.56
5.期末基金份额净值	1.431

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。

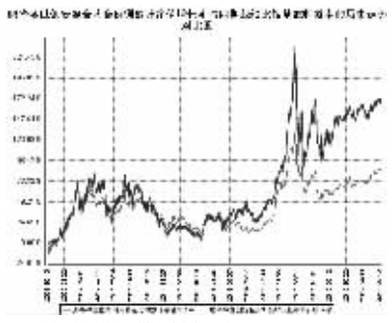
3.2基金净值表现

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	2.95%	0.65%	3.64%	0.44%	-0.69%	0.21%

注：业绩比较基准＝沪深300指数收益率×75%＋中证综合债指数收益率×25%。

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2008年10月10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		
伍旋	本基金基金经理	2011年12月28日	-	11	伍旋先生，国籍中国，工商管理硕士，11年证券从业经验。曾任职于中国建设银行，2006年6月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任研究部高级研究员、基金经理助理；2011年12月起担任鹏华盛世创新混合（LOF）基金基金经理，2015年2月至2017年2月兼任鹏华可转债债券基金基金经理，2015年4月起兼任鹏华改革红利股票基金基金经理，现同时担任权益投资一部副总经理。伍旋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，本基金未发生连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

综合各个宏观经济指标，我们认为前三季度显示宏观经济尽管有放缓的趋势，但仍处在温和复苏的区间，向下回落的风险概率较小，紧货币的政策环境下，流动性略有所改善，但短端利率依然维持较高的水平。因此，我们逐步处现了部分强周期类股票的收益，在食品饮料、传媒、医药以及非银金融等领域布局了公司激励机制与外部股东绑定、业绩增长稳健、估值依然处在合理区间的股票，以期待未来可持续的为组合带来超额收益。

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2.95%，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	87,850,459.02	91.92
	其中：股票	87,850,459.02	91.92
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	7,640,702.42	7.99
8	其他资产	85,431.09	0.09
9	合计	95,576,592.53	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	49,988,716.21	53.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,300,024.00	1.39
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	387,912.72	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	2,018,127.15	2.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,196,136.00	7.70
J	金融业	18,184,690.82	19.45
K	房地产业	5,447,889.40	5.83
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	3,326,962.72	3.56
S	综合	-	-
	合计	87,850,459.02	93.99

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	600519	贵州茅台	10,176	5,267,504.64	5.64
2	600201	生物股份	138,400	4,628,096.00	4.95
3	000333	美的集团	103,100	4,555,989.00	4.87
4	601336	新华保险	78,246	4,434,200.82	4.74
5	601688	华泰证券	178,700	4,042,194.00	4.32
6	002624	完美世界	109,000	3,570,840.00	3.82
7	601555	东吴证券	274,300	3,349,203.00	3.58
8	600885	宏发股份	76,400	3,172,128.00	3.39
9	000056	皇庭国际	249,142	3,164,103.40	3.39
10	002048	宁波华翔	120,000	3,135,600.00	3.35

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报告期末投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券之一的金宇生物技术股份有限公司（以下简称“公司”）于2016年12月3日公告，2016年12月1日，公司收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局（以下简称“内蒙古证监局”）《关于对金宇生物技术股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2016]7号，以下简称“《决定书》”）。现将《决定书》主要内容公告如下：

“近期，我局对你公司进行了现场检查，发现你公司存在如下问题：

一、公司会计估计变更未披露。根据财税[2014]75号文件，2015年，公司子公司金宇保灵生物药品有限公司本期将100万元以下研发用固定资产折旧一次性进费用，子公司扬州优邦生物制药有限公司对生物制药专用设备采用加速折旧，两家子公司固定资产折旧方法与生物股份年报披露的固定资产折旧政策不一致（公司2015年年报中披露的固定资产折旧方法为年限平均法），共计影响当期固定资产折旧金额1557.39万元，上述事项应属会计估计变更。公司未对上述会计估计变更事项进行披露，年报中在重要会计政策和会计估计变更中选定为不适用。违反《上市公司信息披露管理办法》第三十条规定。

二、公司财务报表列报不准确。公司2015年年报中，将预付技术使用费1196万元和外购用友EHP系统费用268.27万元在“在建工程”项目进行核算。合并现金流量表时，将销售费用中技术推广费、疫苗补偿费等的现金流出7375.68万元计入“购买商品接受劳务支付的现金”。上述行为与《企业会计准则第30号—财务报表列报》第九条不符，违反《上市公司信息披露管理办法》第二条规定。

三、内幕信息知情人登记执行不到位。公司没有对分配股利、董事及三分之一以上董事发生变化的情况制作内幕信息知情人档案；2015年进行非公开发行时未制作重大事项进程备忘录；没有对内幕信息知情人买卖本公司股票进行自查的相关记录，内幕信息知情人登记制度中也没有规定进行自查的相关条款。违反《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第六条、第十条、第十二条的规定。

针对上述问题，根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的行政监管措施。

你公司应当在收到本决定书之日起30日内向我局提交书面整改报告，我局将适时组织检查验收。

如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起60日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起6个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。”

公司董事会对上述问题高度重视，将按照《决定书》要求在规定时间内提交整改报告，同时进一步规范公司治理，并根据相关规定及时履行信息披露义务。

对该股票的投资决策程序的说明：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证券之一的华泰证券：2017年1月18日公司收到中国证监会行政监管措施决定书《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2017]3号），原文如下：“经查，我会发现你公司营业部及资产管理子公司分别利用同名微信公众号、官方网站向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品。公司在公告中披露：“将按照相关法律、行政法规和中国证监会规定的要求落实整改，进一步梳理相关流程，强化有关人员守法合规意识，在今后的工作中防止此类情况的再次发生。

以上行政监管措施对公司业绩暂无重大不利影响，公司目前经营情况正常”。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该股票，证监会对公司给予的决定书事项，对该股票的投资价值不产生重大影响，该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，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。

5.12

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。

5.13其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	33,577.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,608.51
5	应收申购款	50,245.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,431.09

5.14报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.15报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.16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

报告期初基金份额总额	70,191,934.66
报告期间基金总申购份额	2,182,738.65
减：报告期期间基金总赎回份额	7,041,375.15
报告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	65,333,298.16

§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）《鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

（二）《鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

（三）《鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）2017年度第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

北京市西城区金融大街25号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

鹏华实业债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	鹏华实业债纯债债券
场内简称	-
基金主代码	000053
交易代码	000053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月3日
报告期末基金份额总额	19,309,884.14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，以实业债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	1.资产配置策略 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、信用特征的券种进行动态调整。 2.债券投资策略 本基金在债券投资中以实业债投资为主，一般情况下，在债券类投资产品中，实业债的收益率要高于国债、央行票据等其他债券的收益率。投资实业债是通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益，所以在个券的选择当中特别重视信用风险的评估和防范。 本基金将主要采取久期策略，同时辅之以信用策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略，在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以实业债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	中债企业债总指数×80%＋中债国债总指数×20%
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中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	871,152.08
2.本期利润	430,469.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0090
4.期末基金资产净值	25,967,102.62
5.期末基金份额净值	1.3448

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。

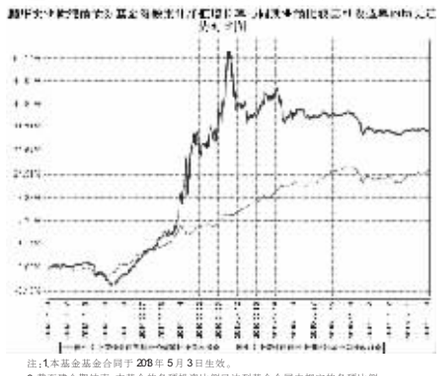
3.2基金净值表现

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	-0.16%	0.05%	1.00%	0.03%	-1.16%	0.02%

注：业绩比较基准＝中债企业债总指数×80%＋中债国债总指数×20%

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2013年5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

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	2013年5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。曾任职于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月起兼任鹏华丰裕债券、鹏华丰祥债券基金基金经理，2016年11月起兼任鹏华丰盈债券基金基金经理，2016年12月起兼任鹏华菩泰债券、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，本基金未发生连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%。

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-0.16%，基准增长率为1%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

§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	25,265,350.00	94.29
	其中：债券	25,265,350.00	94.29
	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	1,096,340.96	4.09
8	其他资产	432,882.77	1.62
9	合计	26,794,573.73	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

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

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

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	379,810.00	1.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	17,642,500.00	67.94
5	企业短期融资券	4,018,400.00	15.47
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,224,640.00	12.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,265,350.00	97.30

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	011758002	17深圳将发SCP001	20,000	2,010,400.00	7.74
2	041653066	16首机场股CP001	20,000	2,008,000.00	7.73
3	122395	15富力债	20,000	1,990,800.00	7.67
4	122209	12中油01	19,000	1,900,000.00	7.32
5	113011	光大转债	10,000	1,114,200.00	4.29

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

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

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

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

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山西永东化工股份有限公司，收到稷山县环境保护局《行政处罚决定书》，主要内容如下：

“经调查核实，你公司烟气在线监测数据显示氮氧化物超出排放标准。该行为违反了《中华人民共和国大气污染防治法》第十八条（企业事业单位和其他生产经营者建设对大气环境有影响的项目，应当依法进行环境影响评价、公开环境影响评价文件；向大气排放污染物的，应当符合大气污染物排放标准，遵守重点大气污染物排放总量控制要求）之规定。

依据《中华人民共和国大气污染防治法》第九十九条第二款（违反本法规定，有下列行为之一的，由县级以上人民政府环境保护主管部门责令改正或者限制生产、停产整治，并处十万元以上一百万元以下的罚款；情节严重的，报经有批准权的人民政府批准，责令停业、关闭；（二）超过大气污染物排放标准或者超过重点大气污染物排放总量控制指标排放大气污染物的；）之规定，我局对你公司决定作出如下行政处罚：

1.立即改正该违法行为，限期九十日内完成。

2.罚款人民币壹伯万元整。”

对该证券的投资决策程序的说明：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，公司收到通知后，即刻召开环保整治专题会议，严格按照通知要求逐条整改。目前公司生产经营正常，本行政处罚不会对公司的生产、经营造成重大影响。

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	13,518.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	409,045.44
5	应收申购款	10,318.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	432,882.77

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	1,114,200.00	4.29

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

报告期初基金份额总额	164,768,763.59
报告期间基金总申购份额	623,666.46
减：报告期期间基金总赎回份额	146,082,545.91
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	19,309,884.14

§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

单位：份

报告期期初基金份额	2,501,654.67
报告期期间买入/申购份额	-
报告期期间卖出/赎回份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	2,501,654.67
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	12.96

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

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

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	20170701~20170920	49,999,000.00	-	49,999,000.00	-	0.00%	
	2	20170701~20170926	60,011,500.00	-	60,011,500.00	-	0.00%	
个人	1	20170927~20170930	446,473.22	-	-	446,473.22	21.03%	
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

注：无。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

（一）《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金托管协议》；

（三）《鹏华实业债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43层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区金融大街25号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

鹏华双债保利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：上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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	鹏华双债保利债券
场内简称	-
基金主代码	000338
交易代码	000338
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	2013年9月18日
报告期末基金份额总额	2,122,885.28份
投资目标	在合理控制风险、保持适当流动性的基础上，以信用债和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	本基金综合运用定