鹏华信用增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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	鹏华信用增利债券
场内简称	-
基金主代码	206003
交易代码	206003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月31日
报告期末基金份额总额	375,344,560.88份
投资目标	在控制风险并保持良好流动性的基础上,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,在获取当期收益的同时,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金将在对未来宏观经济形势及利率变动趋势进行深入研究的基础上,对固定收益类资产、权益类资产和现金资产的配置比例进行动态调整。 2.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、债券选择策略、信用策略等积极投资策略。在控制风险并保持良好流动性的基础上,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,在获取当期收益的同时,力争实现基金资产的长期稳健增值。 3.股票投资策略 本基金股票投资以精选个股为主。在严格控制风险并判断未来股票市场趋势的基础上,考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素,精选流动性好、成长性高、估值水平低的股票进行投资。
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,其预期的风险和收益高于货币市场基金、低于混合型基金及股票型基金,为证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	鹏华信用增利债券A	鹏华信用增利债券B
下属分级基金的交易代码	206003	206004
报告期末下属分级基金的份额总额	359,899,893.73份	15,444,667.15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)	
	鹏华信用增利债券A	鹏华信用增利债券B
1. 本期已实现收益	4,657,040.81	197,626.45
2. 本期利润	5,971,535.88	258,781.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0164	0.0162
4. 期末基金资产净值	456,260,687.72	20,762,472.39
5. 期末基金份额净值	1.2677	1.3443

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

鹏华信用增利债券A

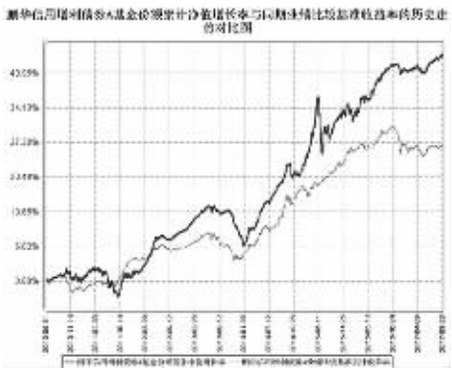
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.31%	0.07%	0.33%	0.06%	0.98%	0.01%

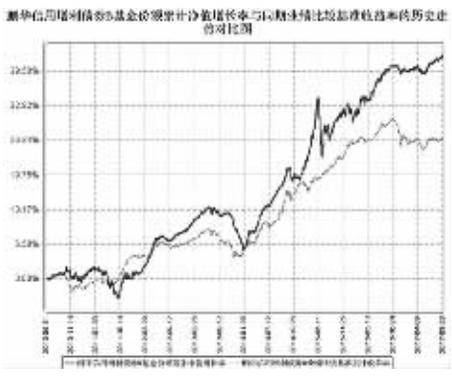
鹏华信用增利债券B

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	1.22%	0.06%	0.33%	0.06%	0.89%	0.00%

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2010年5月31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		
刘建容	本基金基金经理	2011年4月8日	-	11	刘建容先生,国籍中国,经济学硕士,11年金融证券从业经验。历任第一创业证券有限责任公司资管部投资经理,2009年12月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券研究分析工作。担任固定收益部债券研究员,2013年2月至2014年3月担任鹏华产业债债券基金基金经理,2013年3月至2016年5月兼任鹏华资金债债券基金基金经理,2013年11月至2016年5月兼任鹏华不动产债券基金基金经理,2011年4月起担任鹏华信用增利债券基金基金经理,2014年5月起兼任鹏华货币基金基金经理,2015年3月起兼任鹏华双债增利债券基金基金经理,2017年5月起兼任鹏华丰盈债券基金基金经理,2017年6月起兼任鹏华聚财通货币基金基金经理,2017年7月起兼任鹏华兴鑫宝货币基金基金经理,2017年8月起兼任鹏华金企宝货币基金基金经理,现同时担任固定收益部副总经理,刘建容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管理人对投资组合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运作分析

2017年三季度我国货币政策仍然保持中性,央行各项操作利率均维持不变。三季度的公开市场操作是小幅净投放,且整体来看货币市场在月末、季末时点的波动幅度要小于上半年,特别是9月的市场波动明显好于今年3月及6月。三季度人民币兑美元汇率大幅上升,很大程度上与美元对全球主要货币持续走弱有关,也使我国外汇占款的下降压力得到明显缓解。

2017年三季度中债总财富指数小幅上升0.33%。从各类属情况看,利率债收益率曲线继续趋于平坦化上升,以国开债为例,5年至7年期国开债估值收益率整体上升了4bp左右,10年国开债收益率在4.20%附近。三季度信用债市场的信用利差水平波动不大,银行间中期AAA级企业债估值收益率较二季度末上升了5bp左右,中低评级信用债的市场成交不活跃,存在较大的流动性溢价。2017年三季度权益市场继续呈分化行情,上证指数表现较好,创业板指数低迷。

本报告期内信用增利基金以持有中高等评级信用债为主,组合久期保持中性,同时根据市场情况灵活调整权益仓位。

4.5报告期内基金的业绩表现

2017年三季度本基金A类份额净值增长率为1.31%,B类份额净值增长率为1.22%,同期业绩基准增长率为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	27,239,708.00	5.68
	其中:股票	27,239,708.00	5.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	418,654,377.60	87.31
	其中:债券	418,654,377.60	87.31
	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	12,000,000.00	2.50
	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	12,718,080.47	2.65
8	其他资产	8,865,495.22	1.85
9	合计	479,477,661.29	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	2,042,950.00	0.43
C	制造业	18,598,958.00	3.90
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	4,769,800.00	1.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,828,000.00	0.38
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	27,239,708.00	5.71

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	600038	中直股份	80,000	3,496,800.00	0.73
2	600176	中国巨石	300,000	3,438,000.00	0.72
3	002013	中航机电	262,350	3,116,718.00	0.65
4	600547	山东黄金	65,000	2,042,950.00	0.43
5	600845	宝信软件	110,000	1,873,300.00	0.39
6	001979	招商蛇口	100,000	1,828,000.00	0.38
7	300098	高新兴	120,000	1,734,000.00	0.36
8	300577	开润股份	27,000	1,484,190.00	0.31
9	000625	长安汽车	100,000	1,417,000.00	0.30
10	603686	龙马环卫	41,000	1,342,750.00	0.28

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	76,361,000.00	16.01
	其中:政策性金融债	76,361,000.00	16.01
4	企业债券	125,131,300.00	26.23
5	企业短期融资券	85,408,000.00	17.90
6	中期票据	129,677,000.00	27.18
7	可转债(可交换债)	2,077,077.60	0.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	418,654,377.60	87.76

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	170210	17国开10	400,000	39,196,000.00	8.22
2	101654092	16津城建MTN003	400,000	38,948,000.00	8.16
3	101456047	14华电MTN001	300,000	30,432,000.00	6.38
4	101554013	15中车MTN001	300,000	30,342,000.00	6.36
5	011751027	17安润煤业SCP001	300,000	30,144,000.00	6.32

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	4,415.50
2	应收证券清算款	1,024,593.15
3	应收股利	-
4	应收利息	7,807,604.85
5	应收申购款	28,881.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,865,495.22

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	1,671,300.00	0.35

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

项目	鹏华信用增利债券A	鹏华信用增利债券B
报告期期初基金份额总额	367,822,601.60	16,372,920.13
报告期期间基金总申购份额	1,531,887.91	738,823.63
减:报告期期间基金总赎回份额	9,454,595.78	1,667,076.61
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	359,899,893.73	15,444,667.15

§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中的其它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。

5.11.2

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	407,411.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,291.34
5	应收申购款	464,570.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	899,273.36

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

注: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	492,951,206.97
报告期期间基金总申购份额	46,862,219.41
减:报告期期间基金总赎回份额	64,060,560.14
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	475,752,866.24

§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

无。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

(一)《鹏华信用增利债券型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华信用增利债券型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华信用增利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68号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司

上海市仙霞路18号交通银行股份有限公司

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

鹏华新兴产业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	鹏华新兴产业混合
场内简称	-
基金主代码	206009
交易代码	206009
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	2011年6月15日
报告期末基金份额总额	475,752,866.24份
投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,挖掘未来推动经济发展的新兴产业并从中精选优质个股,力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场风险因素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,运用定量及定性相结合的手段,制定股票、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 本基金通过跟踪、分析经济运行态势、经济政策以及产业结构的优化升级,识别经济发展过程中具有良好发展前景的新兴产业及相关上市公司,针对各类公司的不同特征,通过自上而下及自下而上相结合的方法筛选出优秀的上市公司构建投资组合。 3.债券投资策略 本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等,采取积极主动的投资策略,在严格控制风险的前提下,实现积极利用市场失衡提供的投资机会,实现债券组合增值。 4.权证产品投资策略 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、期权定策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×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	招商银行股份有限公司

§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	-8,900,264.05
2.本期利润	15,779,743.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.0319
4.期末基金资产净值	1,057,397,489.30
5.期末基金份额净值	2.223

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。

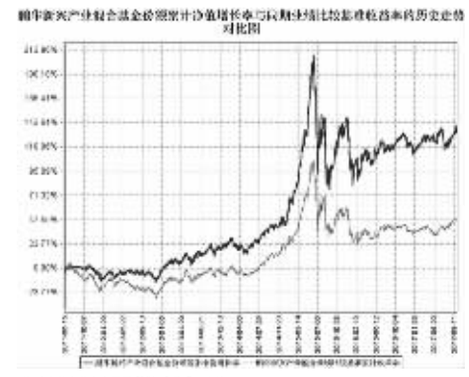
3.2基金净值表现

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	1.46%	0.92%	5.22%	0.64%	-3.76%	0.28%

注:业绩比较基准=中证新兴产业指数收益率×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2011年6月15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		
梁浩	本基金基金经理	2011年7月14日	-	9	梁浩先生,国籍中国,经济学博士,9年证券从业经验。曾任职于信息产业部电信研究院,从事产业政策研究工作;2008年5月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,担任研发部高级研究员、基金经理助理;2014年3月至2015年12月兼任鹏华环保产业股票基金基金经理,2014年11月至2015年12月兼任鹏华先进制造股票基金基金经理,2015年7月至2017年3月兼任鹏华动力增长混合(LOF)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月至2017年7月兼任鹏华医药科技股票基金基金经理,2011年7月起担任鹏华新兴产业混合基金基金经理,现同时担任固定收益部副总经理,梁浩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管理人对投资组合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

季度初,成长股大幅下跌,组合以成长股为主,净值遭遇一定损失。但我们仍维持着成长风格,积极寻找优质标的。我们也相信真正的优质公司虽然会有短期的波动,其价值也一定最终会被市场挖掘。

整个三季度,宏观经济表现良好,投资、出口等各项数据均显示经济处于较好状态。我们预计四季度的经济形势会略显疲态,但总体仍较为稳健。产业升级、消费升级、品牌化、新的城市群逐步呈现,在这些因素的共同作用下,我们看好未来一段时间的市场表现。

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14.6%,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	922,594,357.87	86.85
	其中:股票	922,594,357.87	86.85
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	138,774,915.68	13.06
8	其他资产	899,273.36	0.08
9	合计	1,062,268,546.91	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

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	25,133,739.61	2.38
C	制造业	636,488,881.04	60.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,596,613.50	1.76
E	建筑业	187,845.04	0.02
F	批发和零售业	70,794,282.52	6.70
G	交通运输、仓储和邮政业	196,035.81	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	51,362.55	0.00
J	金融业	48,556,874.00	4.59
K	房地产业	22,825,375.45	2.16
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.01
M	科学研究和技术服务业	199,701.55	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	18,641,243.66	1.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,559,238.31	0.90
R	文化、体育和娱乐业	71,283,840.11	6.74
S	综合	-	-
	合计	922,594,357.87	87.25

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	300577	开润股份	1,526,755	83,925,722.35	7.94
2	300630	普利制药	965,898	55,442,545.20	5.24
3	600419	天润乳业	837,346	52,719,304.16	4.99
4	002343	慈文传媒	1,310,032	50,711,338.72	4.80
5	000028	国药一致	550,647	37,262,282.49	3.52
6	002396	星网锐捷	1,800,000	37,080,000.00	3.51
7	600566	洪川药业	999,983	36,859,373.38	3.49
8	000858	五粮液	595,200	34,093,056.00	3.22
9	002251	步步高	2,489,273	33,505,614.58	3.17
10	601231	环旭电子	1,971,400	28,131,878.00	2.66

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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:本基金本报告期末未持有债券。

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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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:本基金本报告期末未持有贵金属。

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:本基金本报告期末未持有权证。

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发行人中信证券股份有限公司(以下简称"公司")于2016年12月16日收到中国证券监督管理委员会浙江监管局(本公告中称"浙江证监局")作出的《关于对慈文传媒股份有限公司采取责令改正措施的决定》([2016]36号,以下简称"《决定书》")。现将《决定书》主要内容公告如下:

"你公司合并范围内控股子公司于2016年4月20日就其投资摇制的电视剧与湖南广播电视台卫视频道签订了《电视剧中国大陆独家首轮播映权转让协议》,合同总金额为2.58亿元,占你公司上年度经审计总收入的30.18%,但是你公司未披露该重大经营合同。

你公司的上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第三十条、第三十一条和第三十三条的规定。按照《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定,现责令你公司作出如下整改:

一、立即披露公司签订的上述重大经营合同。

二、加强相关法律法规学习,做好信息披露工作。

此外,你公司应及时披露本决定书,并于完成整改工作后15个工作日内向我局提交书面整改报告。

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《决定书》提出的问题高度重视,将针对上述问题认真进行核查、分析和整改,按照《决定书》要求在规定时间内提交整改报告,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中的其它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。

5.11.2

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	407,411.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,291.34
5	应收申购款	464,570.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	899,273.36

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

注: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	492,951,206.97
报告期期间基金总申购份额	46,862,219.41
减:报告期期间基金总赎回份额	64,060,560.14
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	475,752,866.24

§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)《鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华新兴产业股票型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华新兴产业股票型证券投资基金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68号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司

广东省深圳市罗湖区深南东路5047号平安银行股份有限公司

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