

# 鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金

## 金

### 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 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

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华外延成长
场内简称	-
基金主代码	001222
交易代码	001222
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 19 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
报告期末基金份额总额	636,907,297.25 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，通过积极灵活的资产配置，并精选外延成长主题股票，重点挖掘外延式成长的投资机会，在有效控制风险前提下，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>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、货币、税收、汇率政策等)来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>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，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、并购活动空间、产业政策、竞争格局、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地分析企业的竞争战略、资源禀赋情况、公告信息，评判企业并购活动的价值，从中选择通过并购活动实现企业外延式成长的上市公司。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权</p>

	<p>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。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>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。</p>
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，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	6,519,373.31
本期利润	88,318,741.14
加权平均基金份额本期利润	0.1456
本期基金份额净值增长率	19.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2201
期末基金资产净值	584,089,111.68
期末基金份额净值	0.917

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) 表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

#### 3.2 基金净值表现

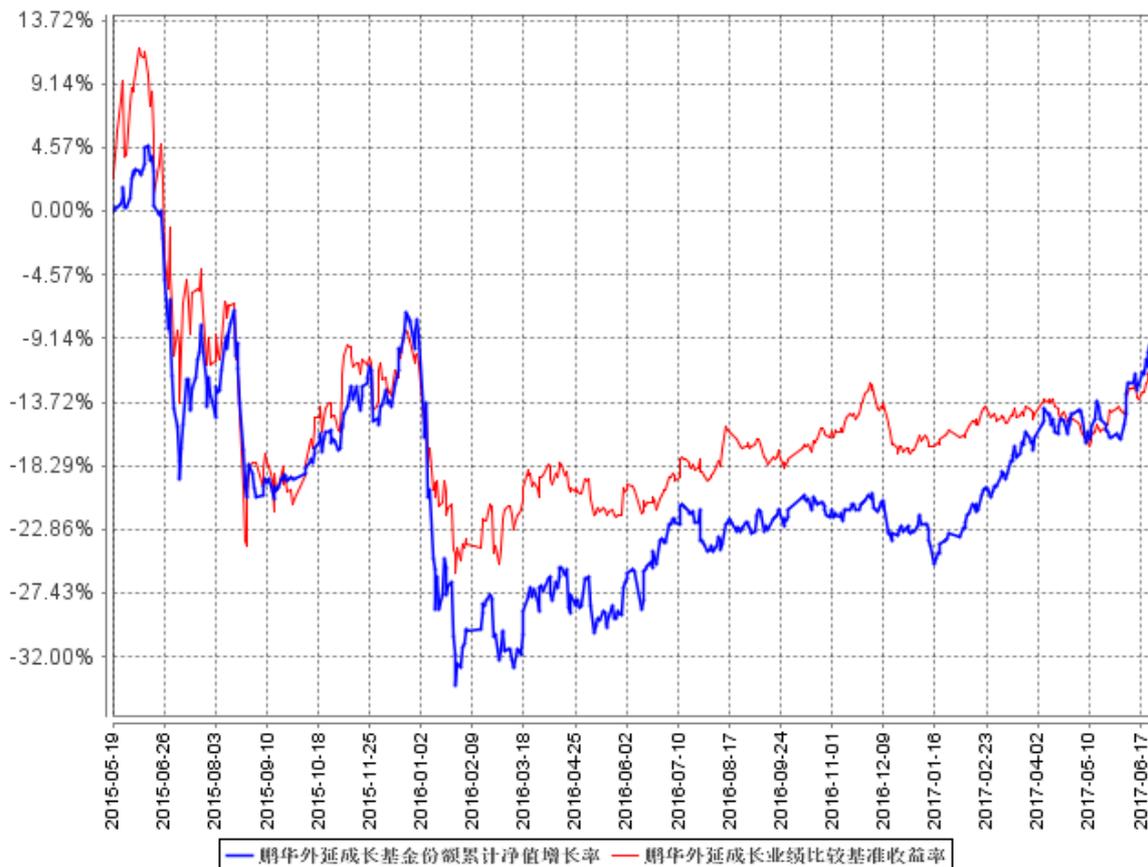
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	9.17%	0.85%	3.80%	0.47%	5.37%	0.38%
过去三个月	9.43%	0.81%	4.33%	0.44%	5.10%	0.37%
过去六个月	19.09%	0.71%	7.51%	0.40%	11.58%	0.31%
过去一年	20.34%	0.70%	11.46%	0.47%	8.88%	0.23%
自基金合同生效起至今	-8.30%	1.29%	-10.90%	1.28%	2.60%	0.01%

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份额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

鹏华外延成长基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 5 月 19 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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止 2017 年 6 月，公司管理资产总规模达到 4509.30 亿元，管理 149 只公募基金、10 只全国社保投资组合、2 只基本养老保险投资组合。经过近 19 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈璇淼	本基金基金经理	2016 年 3 月 29 日	-	5	陈璇淼女士，国籍中国，经济学硕士，5 年金融证券从业经验。2012 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事行业研究工作，历任研究部基金经理助理/高级研究员，2016 年 3 月起担任鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。陈璇淼女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，张卓不再担任本基金基金经理。
张卓	本基金基金经理	2015 年 5 月 19 日	2017 年 3 月 18 日	13	张卓先生，国籍中国，管理学硕士，13 年证券从业经验。2004 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，历任行业研究员、鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理助理，2007 年 8 月至 2009 年 1 月担任鹏华优质治理股票基金（LOF）基金经理，2011 年 1 月至 2013 年 3

					月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理，2009年1月起担任鹏华普天收益基金基金经理，2015年5月至2017年3月兼任鹏华外延成长混合基金基金经理。张卓先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，张卓不再担任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年操作以稳健为主，主要配置集中于行业景气，估值合理的白电、白酒、消费电子板块，此外，出于宏观经济面的超预期，鹏华外延成长组合将部分仓位配置于估值较低的大金融板块，整体基金配置集中于估值偏低，行业景气度仍在上行的板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 19.09%，同期上证综指上涨 2.86%，深证成指上涨 3.46%，沪深 300 指数上涨 10.78%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，宏观面的超预期仍在继续，并且根据上市公司的中报，新能源汽车上游，次高端白酒，钢铁煤炭、工程机械、重卡等周期股的业绩均好于市场预期，鹏华外延成长将加大超预期板块的个股配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1. 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

###### (2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

##### 2. 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

##### 3. 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

##### 4. 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

1. 截止本报告期末，本基金可供分配利润为-140,181,960.50 元，期末基金份额净值 0.917 元，不符合利润分配条件。

2. 本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	98,686,530.77	33,396,321.60
结算备付金	970,794.69	823,120.89
存出保证金	172,286.12	184,251.84
交易性金融资产	485,413,373.60	313,670,198.16
其中：股票投资	485,413,373.60	313,670,198.16
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	2,007,078.33	92,835,622.62
应收利息	23,790.17	21,592.87
应收股利	-	-
应收申购款	8,615.35	6,753.63
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	587,282,469.03	440,937,861.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	1,849,115.99
应付赎回款	1,554,947.48	142,625.37
应付管理人报酬	697,578.94	565,619.03
应付托管费	116,263.15	94,269.85
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	495,785.09	484,779.73
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	328,782.69	405,289.78
负债合计	3,193,357.35	3,541,699.75
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	636,907,297.25	568,234,275.35
未分配利润	-52,818,185.57	-130,838,113.49
所有者权益合计	584,089,111.68	437,396,161.86
负债和所有者权益总计	587,282,469.03	440,937,861.61

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.917 元，基金份额总额 636,907,297.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		94,465,567.38	-90,887,778.75
1.利息收入		428,561.54	620,573.37
其中：存款利息收入		428,561.54	620,573.37
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,207,117.60	-82,137,753.06
其中：股票投资收益		8,996,870.70	-84,513,494.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		3,210,246.90	2,375,741.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		81,799,367.83	-9,441,260.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		30,520.41	70,661.46
<b>减：二、费用</b>		6,146,826.24	6,748,821.89
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	3,719,449.07	3,450,965.87
2. 托管费	6.4.8.2.2	619,908.19	575,161.04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,617,795.56	2,524,090.68

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		189,673.42	198,604.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		88,318,741.14	-97,636,600.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		88,318,741.14	-97,636,600.64

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	568,234,275.35	-130,838,113.49	437,396,161.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	88,318,741.14	88,318,741.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	68,673,021.90	-10,298,813.22	58,374,208.68
其中：1.基金申购款	118,582,657.94	-18,257,677.07	100,324,980.87
2.基金赎回款	-49,909,636.04	7,958,863.85	-41,950,772.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	636,907,297.25	-52,818,185.57	584,089,111.68
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	653,611,980.58	-58,878,123.54	594,733,857.04

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-97,636,600.64	-97,636,600.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-28,279,389.35	7,467,368.58	-20,812,020.77
其中:1.基金申购款	19,838,849.49	-5,270,770.38	14,568,079.11
2.基金赎回款	-48,118,238.84	12,738,138.96	-35,380,099.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	625,332,591.23	-149,047,355.60	476,285,235.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>          邓召明          </u>	<u>          高鹏          </u>	<u>          郝文高          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]567号《关于准予鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币807,011,614.09元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第502号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为807,362,402.97份基金份额,其中认购资金利息折合350,788.88份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行

上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%—95%,其中投资于外延成长主题的公司发行的证券不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华外延成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示

如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国信证券	239,108,034.05	21.66%	525,953,764.50	31.31%

#### 6.4.8.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国信证券	217,899.46	21.66%	36,253.49	7.31%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国信证券	479,302.79	31.31%	462,722.78	49.18%

注：（1）佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1%-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1%-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

(2) 本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定, 上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,719,449.07	3,450,965.87
其中: 支付销售机构的客户维护费	1,537,995.41	1,569,182.50

注: (1) 支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 1.50%, 逐日计提, 按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》, 基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费, 用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用, 客户维护费从基金管理费中列支。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	619,908.19	575,161.04

注: 支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为 0.25%, 逐日计提, 按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

注: 无。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注: 无。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

**6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

**6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	98,686,530.77	412,686.08	126,078,152.24	605,909.21

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

**6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-

		日	3 日							
300672	国科 微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流 通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达 精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流 通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满 电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流 通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾 股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流 通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注：截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证等其他证券。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股 票 名 称	停 牌 日 期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 （ 股 ）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
300145	中 金 环 境	2017 年 6 月 28 日	重 大 事 项	16.92	-	-	744,269	11,189,543.46	12,593,031.48	-

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	485,413,373.60	82.65
	其中：股票	485,413,373.60	82.65
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	99,657,325.46	16.97
7	其他各项资产	2,211,769.97	0.38
8	合计	587,282,469.03	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	23,180,927.22	3.97
C	制造业	390,357,753.17	66.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,930,373.24	1.87
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	1,376,031.30	0.24
J	金融业	33,808,367.57	5.79
K	房地产业	4,730,981.58	0.81
L	租赁和商务服务业	6,800,219.52	1.16
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,713,280.00	1.49
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	5,515,440.00	0.94
S	综合	-	-
	合计	485,413,373.60	83.11

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

## 7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	1,148,200	47,271,394.00	8.09
2	002050	三花智控	2,167,653	35,376,096.96	6.06
3	002508	老板电器	540,860	23,516,592.80	4.03
4	000968	蓝焰控股	1,603,107	23,180,927.22	3.97
5	000568	泸州老窖	412,820	20,880,435.60	3.57
6	300156	神雾环保	554,700	18,171,972.00	3.11
7	600201	生物股份	501,682	17,844,828.74	3.06
8	002185	华天科技	2,449,578	17,734,944.72	3.04
9	002241	歌尔股份	869,906	16,771,787.68	2.87
10	603626	科森科技	234,700	15,297,746.00	2.62

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站

<http://www.phfund.com> 的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300332	天壕环境	20,800,417.63	4.76
2	000968	蓝焰控股	19,158,871.99	4.38
3	000568	泸州老窖	18,223,787.00	4.17
4	600201	生物股份	17,492,688.12	4.00
5	002185	华天科技	16,305,877.70	3.73

6	002705	新宝股份	15,801,333.90	3.61
7	002241	歌尔股份	15,299,185.53	3.50
8	002050	三花智控	14,846,946.24	3.39
9	601988	中国银行	14,020,000.00	3.21
10	603626	科森科技	12,764,279.60	2.92
11	600522	中天科技	12,671,655.00	2.90
12	000333	美的集团	12,247,347.00	2.80
13	000651	格力电器	12,209,541.68	2.79
14	600028	中国石化	11,619,439.40	2.66
15	000581	威孚高科	11,445,361.28	2.62
16	601398	工商银行	11,429,100.00	2.61
17	002616	长青集团	11,254,423.40	2.57
18	002217	合力泰	11,020,021.51	2.52
19	601318	中国平安	10,978,604.00	2.51
20	601012	隆基股份	10,305,440.00	2.36
21	002507	涪陵榨菜	10,171,453.68	2.33
22	601788	光大证券	9,725,927.00	2.22
23	002035	华帝股份	9,704,860.00	2.22
24	600016	民生银行	9,110,000.00	2.08
25	002833	弘亚数控	9,075,785.94	2.07
26	601377	兴业证券	8,974,500.00	2.05
27	600566	济川药业	8,854,856.00	2.02
28	002831	裕同科技	8,791,327.00	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300332	天壕环境	23,229,602.81	5.31
2	600498	烽火通信	17,244,923.00	3.94
3	000541	佛山照明	14,480,364.86	3.31
4	601988	中国银行	14,040,000.00	3.21
5	002616	长青集团	13,647,007.29	3.12
6	000030	富奥股份	13,425,357.95	3.07
7	000333	美的集团	12,158,599.86	2.78
8	300244	迪安诊断	11,933,313.48	2.73

9	000581	威孚高科	11,581,791.44	2.65
10	600028	中国石化	11,327,704.16	2.59
11	300241	瑞丰光电	10,035,342.45	2.29
12	002497	雅化集团	9,897,350.00	2.26
13	300408	三环集团	9,620,650.38	2.20
14	601788	光大证券	9,546,709.60	2.18
15	300083	劲胜智能	9,397,518.44	2.15
16	601377	兴业证券	9,215,991.80	2.11
17	600691	阳煤化工	9,132,286.36	2.09
18	600016	民生银行	9,100,000.00	2.08
19	600567	山鹰纸业	8,983,475.60	2.05
20	002518	科士达	8,973,069.54	2.05
21	600030	中信证券	8,792,650.10	2.01

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	594,617,280.31
卖出股票收入（成交）总额	513,670,343.40

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

#### 7.6 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。

#### 7.7 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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

注：无。

#### 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未发生股指期货投资。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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 1,557.39 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 1,196 万元和外购用友 ERP 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、疫苗补偿费等现金流出 7,375.68 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监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歌尔股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 7 月 14 日收到中国证券监督管理委员会山东监管局（以下简称“山东证监局”）《关于对歌尔股份有限

公司采取责令改正措施的决定》(【2016】32 号)。现将有关事项公告如下：根据中国证监会《上市公司现场检查办法》(证监会公告【2010】12 号)、《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》(证监会公告【2011】30 号)的有关规定，山东证监局对公司 2015 年以来内幕信息知情人登记管理情况进行了专项检查。经查，主要存在以下问题：1、《2014 年年报披露》、《2015 年一季报披露》、《2015 年半年报披露》、《2015 年三季报披露》、《2015 年年报披露》、《2016 年一季报披露》相关的内幕信息知情人档案，未登记董事、监事、高级管理人员、签字会计师以外的审计机构项目组成员、重要财务岗位人员知悉内幕信息情况。内幕信息知情人名单明显不符合定期报告编制、审计、通知、审议、披露所涉及的岗位和人员情况。2、《2014 年年度利润分配》、《2015 年年度利润分配》相关的内幕信息知情人档案，未登记董事、监事、高级管理人员、实际控制人等内幕信息知情人。内幕信息知情人名单明显不符合利润分配商议筹划、论证、提议、通知、审议所涉及的人员情况。3、《员工持股计划》、《重大事项停牌》相关的内幕信息知情人档案，登记的内幕信息知情人与该事项所需的审批权限明显不匹配。在向相关部门报告重大事项后，未登记相关部门工作人员知悉内幕信息情况。针对以上问题，山东证监局决定对公司采取责令改正的行政监管措施。公司将依据《公司法》、《证券法》、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》、《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》(证监会公告【2011】30 号)等相关规定，对照公司现行《内幕信息知情人管理制度》，积极做好上述问题的整改工作，进一步加强内幕信息知情人档案的合规管理，公司将按照山东证监局要求 30 日内完成整改工作并披露整改报告。

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。

### 7.12.2

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。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	172,286.12
2	应收证券清算款	2,007,078.33
3	应收股利	-
4	应收利息	23,790.17
5	应收申购款	8,615.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,211,769.97

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：无。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：无。

**7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
8,724	73,006.34	112,452,813.69	17.66%	524,454,483.56	82.34%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	573,991.17	0.09%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年5月19日）基金份额总额	807,362,402.97
本报告期期初基金份额总额	568,234,275.35
本报告期基金总申购份额	118,582,657.94
减：本报告期基金总赎回份额	49,909,636.04
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	636,907,297.25

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动：报告期内，经公司董事会审议通过，公司聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动：报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

国信证券	2	239,108,034.05	21.66%	217,899.46	21.66%	-
华创证券	1	180,130,589.56	16.31%	164,151.08	16.31%	-
国泰君安	2	179,529,700.96	16.26%	163,605.49	16.26%	-
天风证券	1	104,779,319.87	9.49%	95,484.72	9.49%	-
德邦证券	1	85,090,758.28	7.71%	77,542.88	7.71%	-
东方财富证券	1	60,808,861.40	5.51%	55,415.13	5.51%	-
中金公司	2	48,244,186.19	4.37%	43,965.00	4.37%	-
中泰证券	2	38,426,930.90	3.48%	35,018.62	3.48%	-
光大证券	1	33,546,007.21	3.04%	30,570.29	3.04%	-
海通证券	2	31,162,633.82	2.82%	28,398.56	2.82%	-
广发证券	1	27,952,405.73	2.53%	25,473.15	2.53%	-
中航证券	2	23,831,633.15	2.16%	21,717.82	2.16%	-
平安证券	2	18,123,686.02	1.64%	16,516.03	1.64%	-
长城证券	1	14,283,656.20	1.29%	13,016.70	1.29%	-
中信建投	2	10,201,427.65	0.92%	9,296.53	0.92%	-
银河证券	1	4,695,099.04	0.43%	4,278.45	0.43%	-
兴业证券	1	4,203,714.96	0.38%	3,830.77	0.38%	-
方正证券	2	-	-	-	-	报告期内 新增 1 个
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

(1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

## 2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

### **10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

注：本基金本报告期内未通过券商交易单元进行权证交易、债券交易及债券回购交易。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

鹏华基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日