

鹏华健康环保灵活配置混合型证券投资基金

2017 年第 4 季度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 1 月 22 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 1 月 17 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 鹏华健康环保混合 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 002259 |
| 交易代码 | 002259 |
| 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 | 2016 年 1 月 20 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 218,117,062.65 份 |
| 投资目标 | 本基金为混合型基金，通过积极灵活的资产配置，并精选健康环保主题股票，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公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）</p> |

| | |
|--|--|
| | <p>自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>(1) 健康环保主题的定义</p> <p>本基金所投资的健康环保主题包括健康产业和环保产业。</p> <p>1) 健康产业涉及医药用品、保健用品、营养食品、医疗器械、医疗服务、养老地产、度假地产、健康金融、旅游航空、智慧医疗、互联网医疗、医药流通、医疗信息化、保健器具、休闲健身、文化产业、户外运动服装及器械、健康管理、健康咨询等多个与人类健康紧密相关的生产和服务领域。</p> <p>2) 环保产业指的是广义的环保，即人类为协调与环境的关系、解决环境问题、节约能源所采取的行动的总称，具体包括环保行业（环保设备、环保服务、清洁生产技术及清洁产品、资源利用、新材料、环保物联网等）以及环保优势行业（金融地产、公共事业、商业旅游、信息服务、食品饮料、消费、生态农业等）。未来如果基金管理人认为有更适当的健康环保主题的划分标准，基金管理人有权对上述界定方法进行变更。本基金由于上述原因变更界定方法不需经基金份额持有人大会通过，但应及时告知基金托管人并公告。</p> <p>若因基金管理人界定方法的调整等原因导致本基金持有的健康环保主题的证券的比例低于非现金基金资产的 80%，本基金将在三十个交易日之内进行调整。</p> <p>(2) 自上而下的行业遴选</p> <p>本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。</p> <p>(3) 自下而上的个股选择</p> <p>本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。</p> <p>1) 定性分析</p> <p>本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研</p> |
|--|--|

究分析并筛选出优质的公司：

一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。

另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

2) 定量分析

本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

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，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。

（1）久期策略

久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。

（2）收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。

（3）骑乘策略

本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。

（4）息差策略

本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。

（5）个券选择策略

本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

| | |
|--------|--|
| | <p>(6) 信用策略</p> <p>本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。</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> <p>7、资产支持证券的投资策略</p> <p>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变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。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证医药卫生指数收益率×40%+中证环保产业指数收益率×40%+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。 |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工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 10 月 1 日 — 2017 年 12 月 31 日) |
|-----------------|---|
| 1. 本期已实现收益 | 4,389,519.88 |
| 2. 本期利润 | 6,207,497.52 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0349 |
| 4. 期末基金资产净值 | 281,067,604.93 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.289 |

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

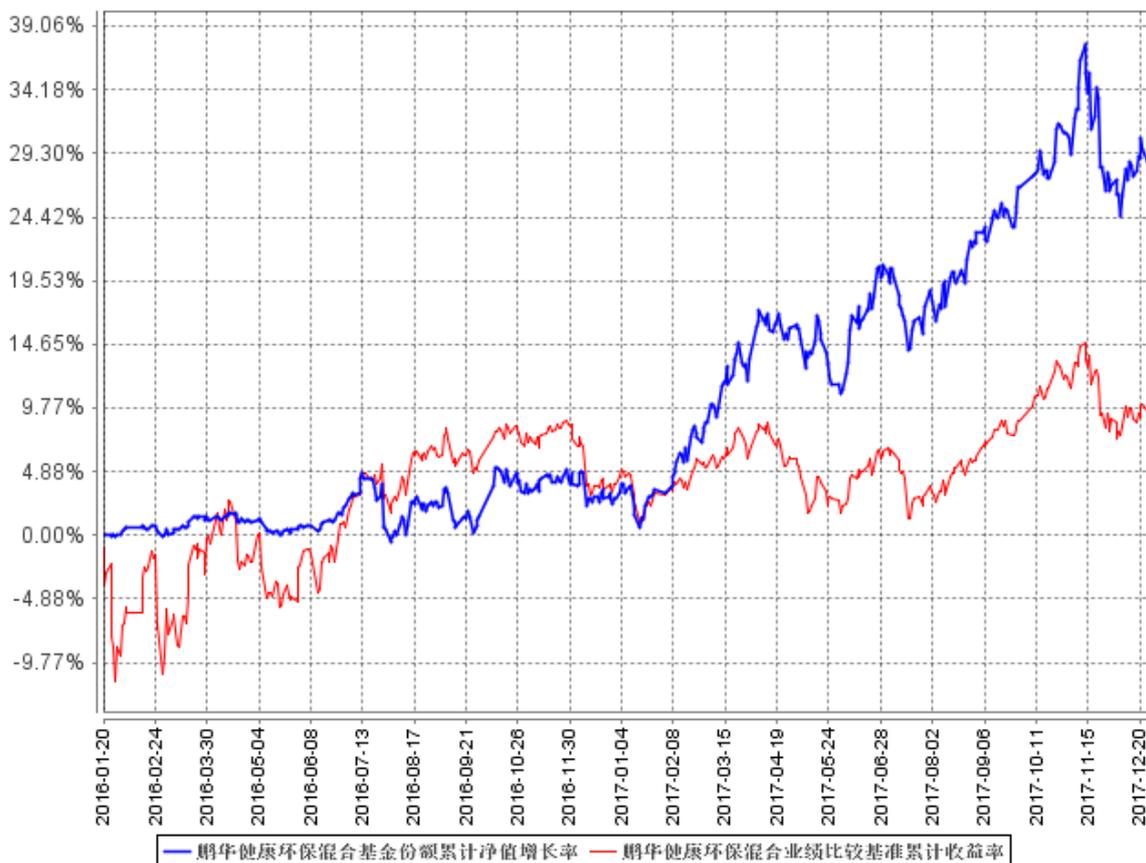
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 1.74% | 1.09% | 0.48% | 0.77% | 1.26% | 0.32% |

注：业绩比较基准=中证医药卫生指数收益率*40%+中证环保产业指数收益率*40%+中证综合债指数收益率*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

鹏华健康环保混合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 2016 年 1 月 20 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 | | |
| 蒋鑫 | 本基金基金经理 | 2016 年 6 月 24 日 | - | 7 | 蒋鑫女士，国籍中国，经济学硕士，7 年金融证券从业经验。历任 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 中国中投证券有限责任公司研究总部研究员；2015 年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司，担任研究部资深研究员，2017 年 5 月至 2017 年 9 月兼任鹏华新能源产业混合基金基金经理，2016 年 6 月起担任鹏华健康环保混合基金基金经理，2017 年 7 月起兼任普天收益基金、鹏华消费领先混合基金基金经理，2017 年 12 月起兼任鹏华优势企业基金基金经理。蒋鑫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 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

四季度，市场小幅调整，消费行业在四季度获得了明显的超额收益。从基金的操作看，由于我们仍然认为市场中有很多投资机会，因此并没有在仓位上做太多的选择。本基金仍将主要仓位集中在业绩增长和估值具备性价比的成长股上，主要集中在先进制造及消费升级。先进制造我们看好包括新能源汽车零部件、风电、OLED 等新兴成长行业，消费主要看好调味品、次高端白酒等食品饮料及生长激素、疫苗、药房等医药。

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 1.74%，同期上证综指下跌 1.25%，深证成指下跌 0.42%，沪深 300 指数上涨 5.07%。

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 | 244,426,745.19 | 86.41 |
| | 其中：股票 | 244,426,745.19 | 86.41 |
| 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 | 23,000,000.00 | 8.13 |
| | 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 | 15,184,073.47 | 5.37 |
| 8 | 其他资产 | 252,925.30 | 0.09 |
| 9 | 合计 | 282,863,743.96 | 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 | 8,362,620.00 | 2.98 |
| C | 制造业 | 207,425,070.48 | 73.80 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 8,686,321.00 | 3.09 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,942.76 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 34,112.55 | 0.01 |
| J | 金融业 | 10,510,200.00 | 3.74 |
| K | 房地产业 | 9,342,012.00 | 3.32 |
| 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 | 32,323.20 | 0.01 |
| 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 | 244,426,745.19 | 86.96 |

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 | 600885 | 宏发股份 | 320,123 | 13,243,488.51 | 4.71 |
| 2 | 002050 | 三花智控 | 627,775 | 11,513,393.50 | 4.10 |
| 3 | 002048 | 宁波华翔 | 478,002 | 11,376,447.60 | 4.05 |
| 4 | 600566 | 济川药业 | 292,600 | 11,162,690.00 | 3.97 |
| 5 | 002507 | 涪陵榨菜 | 590,671 | 10,602,544.45 | 3.77 |
| 6 | 600201 | 生物股份 | 322,257 | 10,228,437.18 | 3.64 |
| 7 | 600702 | 沱牌舍得 | 210,100 | 9,803,266.00 | 3.49 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 8 | 002396 | 星网锐捷 | 453,500 | 9,791,065.00 | 3.48 |
| 9 | 300545 | 联得装备 | 144,000 | 9,403,200.00 | 3.35 |
| 10 | 600597 | 光明乳业 | 619,600 | 9,386,940.00 | 3.34 |

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：本基金本报告期内未发生股指期货投资。

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的沱牌舍得：上海证券交易所口头警示通报

1、相关事项

2017 年 3 月 21 日，公司收到上海证券交易所《关于四川沱牌舍得酒业股份有限公司 2016 年年度报告的事后审核问询函》（上证公函[2017]0302 号）（以下简称“年报问询函”），对公司年报披露情况进行问询。2017 年 3 月 31 日，公司公告了对年报问询函的回复情况（公告编号：2017-027）。

根据年报问询函及回复内容，上海证券交易所认为：“根据披露，经勾稽核算，公司 2016 年第四季度营业收入约为 28,837.35 万元，但营业成本为-477.32 万元。对此，经问询，公司回复称，2016 年 1-3 季度将以产品结算的市场费用 11,859.46 万元计入营业成本，而年报将前述计入营业成本的市场费用调整计入销售费用的相关项目，导致 2016 年第 4 季度营业成本为负数。鉴此，公司存在季度财务数据披露不准确的问题。” 2017 年 4 月 26 日，基于上述信息披露不准确的情况，上海证券交易所对公司及副总经理、财务负责人李富全作出口头警示。

2、整改落实情况

公司已就口头警示中涉及的信息披露不准确的问题在 2016 年年报编制和披露过程中进行了调整，并在年报问询函回复中进行了说明。公司在发现上述问题后，积极采取措施及时调整，并进一步加强财务管理，组织内部相关人员学习培训，提高会计科目核算和信息披露的准确性，杜绝此类问题再次发生。

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、疫苗补偿费等的现金流出 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。

5.11.2

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 | 96,757.11 |
| 2 | 应收证券清算款 | 84,580.83 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | -6,434.75 |
| 5 | 应收申购款 | 78,022.11 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 252,925.30 |

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 | 002507 | 涪陵榨菜 | 10,602,544.45 | 3.77 | 重大事项 |

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 | 170,664,165.35 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 101,738,105.84 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 54,285,208.54 |
| 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 | 218,117,062.65 |

§ 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末申购、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 | 20171001~20171217 | 41,613,567.50 | - | - | 41,613,567.50 | 19.08% |
| | 2 | 20171208~20171217 | - | 40,159,839.36 | - | 40,159,839.36 | 18.41% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |

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

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华健康环保灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华健康环保灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华健康环保灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 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 55 号中国工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

2018 年 1 月 22 日