

# 鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告

2018 年 03 月 31 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：2018 年 04 月 21 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 2018 年 4 月 18 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 2018 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华弘锐混合
场内简称	-
基金主代码	001492
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	2015 年 06 月 24 日
报告期末基金份额总额	24,817,571.07 份
投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，精选股票、债券等投资标的，力争实现绝对收益的目标。
投资策略	1、资产配置策略 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、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。 2、股票投资策略

略 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，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的绝对收益。

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、中小企业私募债投资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，力争实现组合的绝对收益。

(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。

(6) 信用策略 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。

(7) 中小企业私募债投资策略 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。

4、股指期货、

	<p>权证等投资策略 本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 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>	
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+3%	
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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏华弘锐混合 A	鹏华弘锐混合 C
下属分级基金的交易代码	001492	001493
报告期末下属分级基金的份额总额	11,281,421.61 份	13,536,149.46 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。

注：无。

### §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(2018年01月01日 - 2018年03月31日)	
	鹏华弘锐混合 A	鹏华弘锐混合 C
1. 本期已实现收益	1,106,296.60	4,342,556.43

2. 本期利润	318,884.04	2,192,005.80
3. 加权平均基金份额 本期利润	0.0280	0.0870
4. 期末基金资产净值	12,368,391.08	26,288,919.57
5. 期末基金份额净值	1.0964	1.9421

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

鹏华弘锐混合 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	2.63%	0.30%	1.11%	0.01%	1.52%	0.29%

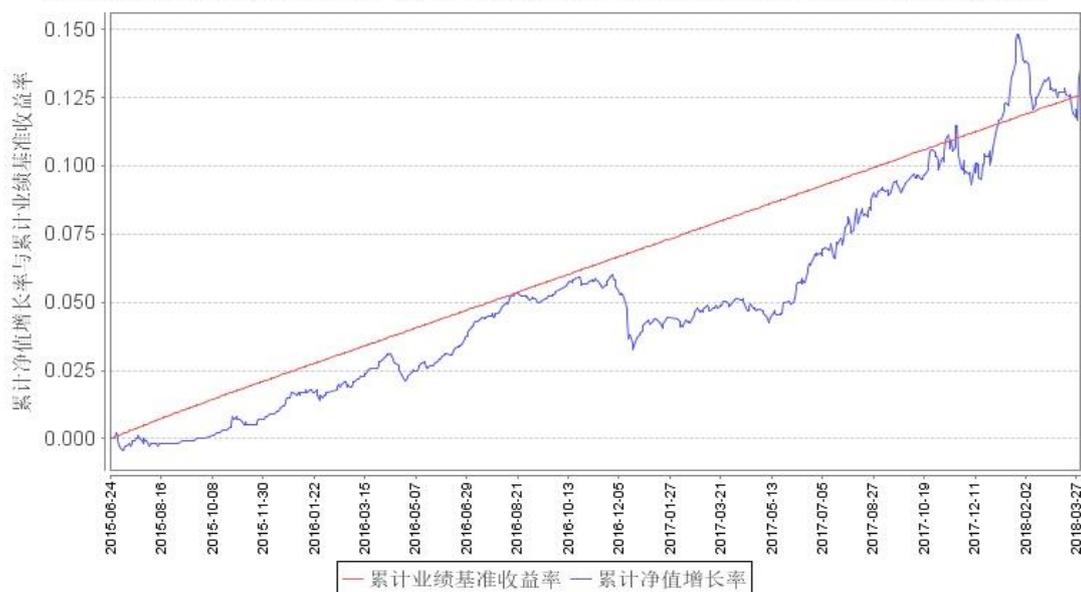
鹏华弘锐混合 C

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	2.61%	0.30%	1.11%	0.01%	1.50%	0.29%

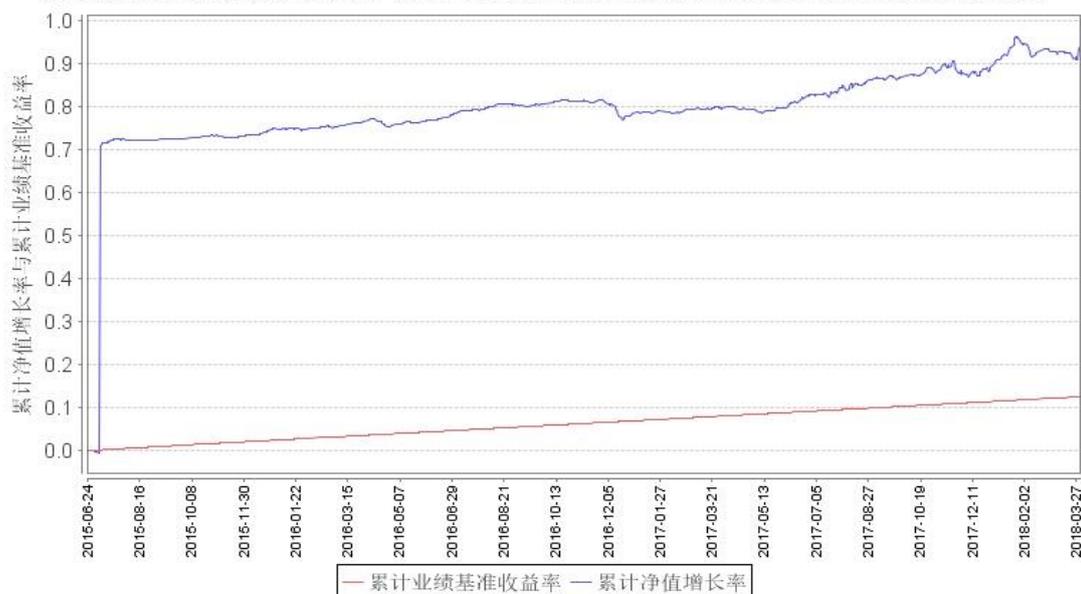
注：业绩比较基准=一年期银行定期存款利率(税后)+3%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

鹏华弘锐混合A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



鹏华弘锐混合C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 6 月 24 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		
李君	本基金基	2017 年 09 月	-	9 年	李君女士, 国

	金经理	06 日		<p>籍中国, 经济学硕士, 9 年金融证券从业经验。历任平安银行资金交易部银行账户管理岗, 从事银行间市场资金交易工作;</p> <p>2010 年 8 月加盟鹏华基金管理有限公司, 担任集中交易室债券交易员, 从事债券研究、交易工作;</p> <p>2013 年 01 月至 2014 年 05 月担任鹏华货币基金基金经理, 2014 年 02 月至 2015 年 05 月担任鹏华增值宝货币基金基金经理, 2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华品牌传承混合基金基金经理, 2015 年 05 月担任鹏华弘利混合基金基金经理, 2015 年 05 月担任鹏华弘润混合基金基金经理, 2015 年 05 月至 2017 年 02 月担任鹏华弘</p>
--	-----	------	--	---

					<p>盛混合基金基金经理，2015年05月至2017年02月担任鹏华弘泽混合基金基金经理，2015年11月担任鹏华弘安混合基金基金经理，2016年05月担任鹏华兴利定期开放混合基金基金经理，2016年06月担任鹏华兴华定期开放混合基金基金经理，2016年06月担任鹏华兴益定期开放混合基金基金经理，2016年08月担任鹏华兴盛定期开放混合基金基金经理，2016年09月至2017年11月担任鹏华兴锐定期开放混合基金基金经理，2017年02月担任鹏华兴康定期开放混合基金基金经理，2017年05月担任鹏华聚财货币基金基金经理，2017</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>年 09 月担任鹏华弘锐混合基金基金经理，2018 年 03 月担任鹏华尊惠定期开放混合基金基金经理。李君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。</p>
刘方正	本基金基金经理	2016 年 03 月 10 日	-	8 年	<p>刘方正先生，国籍中国，理学硕士，8 年证券从业经验。2010 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，担任固定收益部高级研究员、基金经理助理，2015 年 03 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘利混合基金基金经理，2015 年 03 月至 2015 年 08 月担任鹏华行业成长基金(2015 年 8 月已转型为鹏华弘泰混合基金)基金经理，2015 年 04 月至 2017 年 01 月担任鹏华弘润混合基</p>

				<p>金基金经理， 2015年05月担任鹏华弘和混合基金基金经理， 2015年05月担任鹏华弘华混合基金基金经理， 2015年05月至2017年01月担任鹏华弘益混合基金基金经理， 2015年06月至2017年01月担任鹏华弘鑫混合基金基金经理， 2015年08月担任鹏华前海万科 REITs 基金基金经理， 2015年08月至2017年01月担任鹏华弘泰混合基金基金经理， 2016年03月担任鹏华弘信混合基金基金经理， 2016年03月担任鹏华弘锐混合基金基金经理， 2016年03月至2017年05月担任鹏华弘实混合基金基金经理， 2016年08月担任鹏华弘达混合基金</p>
--	--	--	--	---

					<p>基金经理，2016年08月至2017年12月担任鹏华弘嘉混合基金基金经理，2016年09月担任鹏华弘惠混合基金基金经理，2016年11月至2018年1月担任鹏华兴裕定开混合基金基金经理，2016年11月担任鹏华兴泰定开混合基金基金经理，2016年12月担任鹏华兴悦定开混合基金基金经理。刘方正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。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2018 年一季度，随着两会的顺利召开，新一届领导班子的最终确定，中国经济向高质量发展转型的既定进程进入到了新的更深层次的实施阶段。高质量的发展必然需要一定的金融环境的配合，这其中就包括合理的汇率和利率水平，人民币汇率去年至今的大幅升值已经对简单初级的加工行业形成了转型促进，而强势的汇率必然也会对国内的高利率形成一种缓冲，今年一季度债券收益率稳步下行，科技、医药行业领涨 A 股的市场逻辑均出于如此。

具体操作方面，该基金寻求的是在控制回撤的前提下，追求稳定收益的策略。股票配置以价值投资为核心，积极参与新股申购等套利机会，同时投资于回购、短期债券等兼具流动性和收益性的固定收益品种。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2018 年一季度本基金 A、C 的净值增长率为分别为 2.63% 和 2.61%，同期业绩基准增长率为 1.11%。

#### 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	75,794.40	0.19
	其中：股票	75,794.40	0.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,000,000.00	25.58
	其中：债券	10,000,000.00	25.58
	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	14,500,000.00	37.08
	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	10,144,522.90	25.95
8	其他资产	4,379,655.82	11.20
9	合计	39,099,973.12	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	75,794.40	0.20
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	-	-
K	房地产业	-	-
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	75,794.40	0.20

### 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	600309	万华化学	2,160	75,794.40	0.20

### 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	10,000,000.00	25.87
	其中：政策性金融债	10,000,000.00	25.87
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,000,000.00	25.87

### 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	150207	15 国开 07	100,000	10,000,000.00	25.87

### 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：无。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组

合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

## 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

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

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

万华化学

事件：2016 年 9 月 20 日 17 时 22 分，万华化学集团股份有限公司烟台工业园在大修停车处理过程中，MDI（二苯基甲烷二异氰酸酯）装置光化工序一台 12.1 立方米粗 MDI（以下简称粗 M）缓冲罐发生爆炸，造成 4 人死亡、4 人受伤，直接经济损失 573.62 万元。详细内容参见公司已发布的临 2016-38 号、临 2016-39 号、临 2016-43 号、临 2016-45 号、临 2016-48 号、临 2016-49 号公告。

事故发生后，烟台市政府成立了由市安监局、监察局、公安局、总工会、质监局、开发区管委等部门、单位参加的万华化学集团股份有限公司烟台工业园“9.20”较大爆炸事故调查组，同时邀请市检察院派员参加，并聘请了 6 名省市化工行业专家组成专家组，开展事故调查工作。

调查结果：公司 2017 年 7 月 6 日发布公告，烟台市人民政府批复了《万华化学集团股份有限公司烟台工业园“9.20”较大爆炸事故调查报告》，相关情况如下：

#### 一、事故原因和性质

（一）事故直接原因：DAM 管线进料手动球阀限位板损坏导致阀门未关严，且仪表操作人员没有按操作规程将 DAM 管线远程开关阀关闭，造成 DAM 误入反应系统，与系统中粗 M 反应生成缩聚脲和缩二脲。缩聚脲和缩二脲进入粗 M 缓冲罐，在高温（200℃）下催化粗 M 自聚反应，生成碳化二亚胺（CDI）和二氧化碳（CO<sub>2</sub>）。粗 M 自聚产生的高粘度聚合物以及脲类物质将粗 M 缓冲罐出口口、进料口、两根压力平衡管堵塞。随着聚合反应的持续发生，粗 M 缓冲罐内 CO<sub>2</sub> 量不断增多，压力逐渐升高，最终超压爆炸。

#### （二）事故间接原因

1. 工艺管理不到位。操作规程中规定停车时应关闭远程切断阀，但实际操作中将远程切断阀作为紧急切断阀使用，停车操作时仅关闭流量调节阀和现场手动切断阀；当班班长、工序主管、工艺工程师、装置经理等各级管理人员均未纠正仪表操作工未按操作规程关闭远程切断阀的行为。

2. 生产异常情况处置不得当。操作人员及生产管理人员均未能及时发现系统温度、液位、流量等参数异常；在对粗 M 缓冲罐异常情况处置过程中，现场人员发现本次异常与以往不同，未意识到可能存在的风险，未及时向有关部门报告，未停止作业、撤离人员。

3. 不了解脲类物质对 MDI 缩聚的催化机理。本次事故之前，未对脲类物质对 MDI 缩聚的催化机理进行过科学研究，无法预见 DAM 误入系统导致脲类催化 MDI 自聚反应引发的严重后果。

（三）事故性质：经调查认定：万华化学集团股份有限公司“9.20”爆炸事故是一起较大生产安全责任事故。

## 二、事故人员伤亡和经济损失及对周边影响

(一) 事故造成的人员伤亡和直接经济损失：本次事故造成 4 人死亡，4 人受伤；直接经济损失 573.62 万元。

(二) 事故对周边的破坏情况：从事故现场看，无危险化学品液体和气体泄漏，未发生火灾，企业环境监测组和市区两级环保部门对事故周边区域进行了环境检测，未检出污染物，事故未造成次生灾害。

三、责任认定及处理：根据烟台市人民政府批复的《万华化学集团股份有限公司烟台工业园“9.20”较大爆炸事故调查报告》的建议，公司对 9 名相关责任人给予相应责任追究，包括解除劳动合同、撤职、留厂查看、降级、记过、警告等处分；烟台市安监局对万华化学集团股份有限公司负责人处上一年收入 40% 的罚款，对万华化学集团股份有限公司处以 80 万元罚款。

四、事故整改措施：严格工艺纪律管理，对重要和风险高的操作实行确认制，加强工艺纪律检查，及时发现并严肃处理违反操作规程的行为；加强异常情况和开停车作业管理，进一步修订生产异常应急处置操作法，设备、设施等发生异常情况应及时采取有效措施，并及时按程序报告有关管理人员，协调有关岗位及时处理；加强阀门等安全部件的全程管理，建立实行重要阀门开关确认制度，确保规范操作；进一步加强 MDI 生产的反应机理研究，将有关研究结果纳入生产技术文件中，进一步优化工艺参数和操作规程，采取可靠措施确保工艺安全。

公司将认真吸取事故教训，进一步加强安全管理，切实提高各级管理人员和员工的安全意识和责任心，确保公司安全、持续、稳定运行。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司本次的安全事故对公司长期价值并不产生实质性影响。上述通告对该公司债券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证券没有超出基金合同规定的证券备选库

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	29,646.89
2	应收证券清算款	3,921,291.63
3	应收股利	-
4	应收利息	428,593.48
5	应收申购款	123.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,379,655.82

### 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	600309	万华化学	75,794.40	0.20	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

项目	鹏华弘锐混合 A	鹏华弘锐混合 C
报告期期初基金份额总额	11,523,778.99	42,066,747.45
报告期期间基金总申购份额	77,895.25	6,373,390.44
减：报告期期间基金总赎回份额	320,252.63	34,903,988.43
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	11,281,421.61	13,536,149.46

## §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：无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## §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	20180101~20180205	16,986,976.22	-	16,986,976.22	-	-
	2	20180101~20180131, 20180206~20180331	22,926,682.03	-	17,426,682.03	5,500,000.00	22.16

	3	20180201~201803 31	9,207,79 5.99	3,493,98 8.28	-	12,701 ,784.2 7	51.18
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)《鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 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第 43 层鹏华基金管理有限公司。

### 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 04 月 21 日