

鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

2018 年 06 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

送出日期：2018 年 08 月 27 日

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华弘盛混合	
场内简称	-	
基金主代码	001067	
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 2 月 25 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	
报告期末基金份额总额	198,684,651.64 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称	鹏华弘盛混合 A	鹏华弘盛混合 C
下属分级基金的交易代码	001067	001380
报告期末下属分级基金的 份额总额	181,095,982.33 份	17,588,669.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下，严选安全边际较高的股票、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 的绝对水平的增长率、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收益。 2、股票投资策略 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；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，灵活的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。4、股指期货、权证等投资策略 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。
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，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。

注：无。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	95555
传真		0755-82021126	0755-83195201

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	http://www.phfund.com.cn
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（2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日）	
	鹏华弘盛混合 A	鹏华弘盛混合 C
本期已实现收益	-1,614,526.07	97,552.34

本期利润	202, 492. 34	-262, 707. 82
加权平均基金份额本期利润	0. 0010	-0. 0290
本期基金份额净值增长率	0. 04%	-0. 01%
3. 1. 2 期末数据和指标	报告期末（2018 年 06 月 30 日）	
期末可供分配基金份额利润	0. 2025	0. 6366
期末基金资产净值	217, 774, 451. 37	28, 786, 367. 19
期末基金份额净值	1. 2025	1. 6366

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

鹏华弘盛混合 A

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	-0.07	0.03	0.37	0.01	-0.44	0.02
过去三个月	-0.31	0.13	1.12	0.01	-1.43	0.12
过去六个月	0.04	0.17	2.23	0.01	-2.19	0.16

过去一年	4.84	0.24	4.50	0.01	0.34	0.23
过去三年	13.77	0.17	13.63	0.01	0.14	0.16
自基金成立起至今	20.25	0.16	15.49	0.01	4.76	0.15

鹏华弘盛混合 C

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	-0.07	0.04	0.37	0.01	-0.44	0.03
过去三个月	-0.33	0.13	1.12	0.01	-1.45	0.12
过去六个月	-0.01	0.17	2.23	0.01	-2.24	0.16
过去一年	4.72	0.24	4.50	0.01	0.22	0.23
过去三年	60.92	1.55	13.63	0.01	47.29	1.54
自基金成立起至今	63.66	1.53	14.16	0.01	49.50	1.52

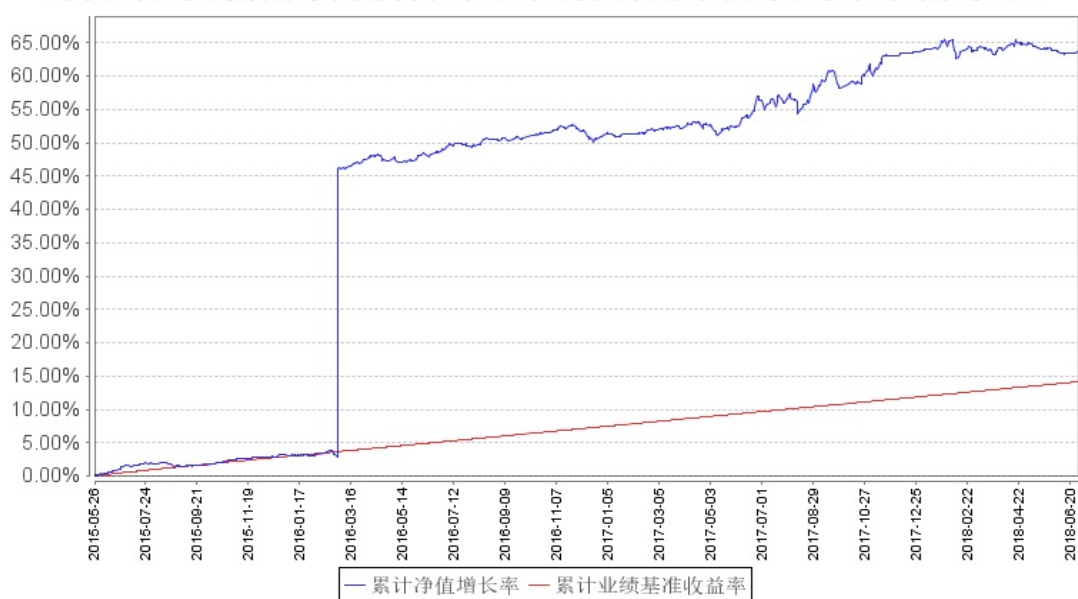
注：业绩比较基准=一年期银行定期存款利率(税后)+3%

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

鹏华弘盛混合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



鹏华弘盛混合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



§ 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 2018 年 6 月，公司管理资产总规模达到 5,232.30 亿元，管理 152 只公募基金、10 只全国社保投资组合、3 只基本养老保险投资组合。经过近 20 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		
刘涛	本基金基金经理	2018-03-28	-	5	刘涛先生，国籍中国理学硕士，5 年金融证券从业经验。2013 年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司从事债券投资研究工作，担任固定收益部债券研究员，2016 年 05 月担任鹏华丰融定期开放债券基金基金经理，2016 年 05 月担任鹏华国企债债券基金基金经理，2016 年 11 月担任鹏华丰禄债券基金基金经理，2017 年 02 月至 2017 年 09 月担任鹏华丰安债券基金基金经理，2017 年 02 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰达债券基金基金经理，2017 年 02 月担任鹏华丰恒债券基金基金经理，2017 年 02 月担任鹏华丰腾债券基金基金经理，2017 年 05 月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理，2017 年 05 月担任鹏华普天债券基金基金经理，2018 年 03 月担任鹏华实业债基金基金经理，2018 年 03 月担任鹏华弘盛

					混合基金基金经理。刘涛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，增聘刘涛为本基金基金经理，刘太阳不再担任本基金基金经理。
刘太阳	本基金基金经理	2016-02-27	2018-03-28	12	刘太阳先生，国籍中国，理学硕士，12 年金融证券从业经验。曾任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 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华纯债债券基金基金经理，2012 年 12 月至 2015 年 04 月担任鹏华月月发短期理财债券基金基金经理，2013 年 04 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰利债券 (LOF) 基金基金经理，2013 年 05 月担任鹏华实业债基金基金经理，2015 年 03 月担任鹏华丰盛债券基金基金经理，2016 年 02 月至 2018 年 03 月担任鹏华弘盛混合基金基金经理，2016 年 08 月担任鹏华双债保利债券基金基金经理，2016 年 08 月担任鹏华丰收债券基金基金经理，2016 年 08 月至 2017 年 09 月担任鹏

				<p>华丰安债券基金基金经理，2016 年 08 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰达债券基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰恒债券基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰禄债券基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰腾债券基金基金经理，2016 年 11 月担任鹏华丰盈债券基金基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 05 月担任鹏华普泰债券基金基金经理，2016 年 12 月担任鹏华丰惠债券基金基金经理，2017 年 02 月至 2018 年 06 月担任鹏华安益增强混合基金基金经理，2017 年 03 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰享债券基金基金经理，2017 年 03 月至 2018 年 06 月担任鹏华丰玉债券基金基金经理，2017 年 03 月至 2017 年 12 月担任鹏华丰嘉债券基金基金经理，2017 年 03 月至 2018 年 04 月担任鹏华丰康债券基金基金经理，2017 年 04 月至 2018 年 05 月担任鹏华丰瑞债券基金基金经理，2017 年 06 月至 2018 年 03 月担任</p>
--	--	--	--	--

					鹏华丰玺债券基金基金经理，2017 年 06 月至 2018 年 06 月担任鹏华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发生变动增聘刘涛为本基金基金经理，刘太阳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

一季度债市先跌后涨。1 月监管收紧叠加经济回暖等因素，债市出现一轮明显调整，收益率不断上行。2 月中旬至 3 月份，市场资金面持续宽松，市场预期经济有走弱趋势，长端收益率水

平有所下行。二季度债市震荡上涨。通过央行两次降准，二季度以来利率债收益率整体有所回落，金融债表现相对较好，资本利得贡献高收益。在债券的配置上，我们以中长久期利率债和中高等级信用债为主，从而使得组合净值在二季度债市整体调整的情况下表现稳健，并且在 5 月下旬抓住时机适当加仓长端利率债券，使得净值表现相对较佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年上半年鹏华弘盛混合 A 组合净值增长率 0.04%;鹏华弘盛混合 C 组合净值增长率-0.01%;同期业绩基准增长率为 2.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年与 2014 年有着较多的相似之处：2014 年反腐，2018 年管好地方政府债务、国企去杠杆、抑制居民杠杆过快上涨，融资增速均出现了明显下降；房地产、基建投资均处于下行周期；2014 年 4 月和 6 月央行两次定向降准，开始打造利率走廊管理，资金稳定性变好。但是与 2014 年也有不同：外围货币环境不同，美联储持续加息制约；经济韧性有所不同；银行体系资产扩张难度更大，表外理财还面临收缩；14 年融资需求主动收缩，18 年目前还是被动收缩。今年可以看做是缩小版的 14 年，下行幅度不及 14 年，但下半年仍存在 30bp 以上的下行空间。今年以来，央行货币政策边际转向，银行超储率提升，银行间资金利率回落且稳定性提升，回购利率互换出现明显下行，信用债券的息差空间凸显。下半年央行货币政策大概率继续结构性放松，银行间资金利率中枢下移和稳定性提升，信用债加杠杆吃息差策略能够得到非常可观的回报。年初以来信用债收益率出现了大幅回落，绝对收益率跟历史水平相比回到了历史中位数附近。高等级信用利差仍保持在低位，相对价值不大，不过绝对票息仍有不错的价值，可精选久期 3 年左右的中高等级优质信用债品种，维持杠杆操作。

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账务处理；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[2017]13号《中国证监会关于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. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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 A 类期末可供分配利润为 36,678,469.04 元，期末基金份额净值 1.2025 元；本基金 C 类期末可供分配利润为 11,197,697.88 元，期末基金份额净值 1.6366 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	5,021,071.08	10,308,546.32
结算备付金	8,887,620.77	8,172,088.20
存出保证金	54,247.14	58,541.90
交易性金融资产	317,363,446.95	301,213,787.50
其中：股票投资	-	72,293.70
基金投资	-	-
债券投资	293,346,781.20	301,141,493.80
资产支持证券投资	24,016,665.75	-
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	-	-
应收利息	5,745,170.90	4,805,520.82
应收股利	-	-
应收申购款	4,373.48	4,165.81
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	337,075,930.32	324,562,650.55

负债和所有者权益	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债:		
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	89,000,000.00	55,900,000.00
应付证券清算款	-	4,715,137.59
应付赎回款	985,896.11	220,200.39
应付管理人报酬	123,400.67	135,244.06
应付托管费	51,416.95	56,351.69
应付销售服务费	2,896.06	587.30
应付交易费用	104,534.37	69,482.99
应交税费	30,145.83	-
应付利息	33,815.06	-28,784.39
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	183,006.71	549,017.80
负债合计	90,515,111.76	61,617,237.43
所有者权益:		
实收基金	198,684,651.64	217,496,060.66
未分配利润	47,876,166.92	45,449,352.46
所有者权益合计	246,560,818.56	262,945,413.12
负债和所有者权益总计	337,075,930.32	324,562,650.55

注: 报告截止日 2018 年 06 月 30 日, 基金份额总额 198,684,651.64 份, 其中鹏华弘盛混合 A 基金份额的份额总额为 181,095,982.33 份, 份额净值 1.2025 元, 鹏华弘盛混合 C 基金份额的份额总额为 17,588,669.31 份, 份额净值 1.6366 元

6.2 利润表

会计主体: 鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		3,028,062.32	25,897,730.33
1. 利息收入		7,359,723.42	14,533,259.95
其中: 存款利息收入		88,142.92	283,493.50
债券利息收入		6,948,890.53	14,178,270.76
资产支持证券利息收入		293,953.79	-

买入返售金融资产收入		28,736.18	71,495.69
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,793,131.90	37,922,764.97
其中：股票投资收益		-4,200,002.02	41,668,678.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,594,729.88	-3,961,546.22
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		1,600.00	215,632.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,456,758.25	-26,559,649.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		4,712.55	1,354.69
减：二、费用		3,088,277.80	8,260,208.65
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	744,667.20	2,647,239.77
2. 托管费	6.4.8.2.2	310,278.01	1,103,016.63
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	8,723.29	154,657.40
4. 交易费用		315,998.58	637,912.79
5. 利息支出		1,474,848.33	3,486,799.99
其中：卖出回购金融资产支出		1,474,848.33	3,486,799.99
6. 税金及附加		21,962.03	-
7. 其他费用		211,800.36	230,582.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-60,215.48	17,637,521.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-60,215.48	17,637,521.68

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	217,496,060.66	45,449,352.46	262,945,413.12
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-60,215.48	-60,215.48
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)	-18,811,409.02	2,487,029.94	-16,324,379.08
其中: 1. 基金申购款	16,781,185.16	10,494,790.98	27,275,976.14
2. 基金赎回款	-35,592,594.18	-8,007,761.04	-43,600,355.22
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)	198,684,651.64	47,876,166.92	246,560,818.56
项目	上年度可比期间 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)	1,265,187,096.05	295,695,605.79	1,560,882,701.84
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	17,637,521.68	17,637,521.68
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)	-1,002,003,299.61	-271,856,940.00	-1,273,860,239.61
其中: 1. 基金申购款	2,916,302.01	1,209,416.96	4,125,718.97
2. 基金赎回款	-1,004,919,601.62	-273,066,356.96	-1,277,985,958.58
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)	263,183,796.44	41,476,187.47	304,659,983.91

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:

邓召明

苏波

郝文高

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

鹏华弘盛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]221号《关于核准鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，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《鹏华弘盛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 3,740,313,629.42 元，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 151 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,742,247,774.07 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,934,144.65 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《关于鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，本基金自 2015 年 5 月 25 日起根据销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者持有基金期间不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者持有基金期间从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。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%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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：一年期银行定存款利率（税后）+3%

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》、《鹏华弘盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年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 2018 年 06 月 30 日的财务状况以及 2018 年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

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以

2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构

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

注：无。

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

注:无。

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 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	744,667.20	2,647,239.77
其中:支付销售机构的客户维护费	354,862.01	528,894.58

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0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷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 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	310,278.01	1,103,016.63

注:支付基金托管人招商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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘盛混合 A	鹏华弘盛混合 C	合计
鹏华基金公司	-	5,975.33	5,975.33
招商银行	-	968.59	968.59
合计	-	6,943.92	6,943.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华弘盛混合 A	鹏华弘盛混合 C	合计
鹏华基金公司	-	145,593.60	145,593.60
招商银行	-	3,557.99	3,557.99
合计	-	149,151.59	149,151.59

注：支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值 0.12% 的年费率计提，逐日计提，按月支付，A 类基金份额不收取销售服务费。日销售服务费= 前一日 C 类的基金资产净值×0.12%÷当年天数。

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自有资金投资本基金的情况

注：无。

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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 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

招商银行	5,021,071.08	28,744.28	5,842,308.08	76,351.10
------	--------------	-----------	--------------	-----------

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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年06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

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

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

注:无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 89,000,000.00 元,于 2018 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算成标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§ 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	317,363,446.95	94.15
	其中:债券	293,346,781.20	87.03
	资产支持证券	24,016,665.75	7.13
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	13,908,691.85	4.13
8	其他各项资产	5,803,791.52	1.72
9	合计	337,075,930.32	100.00

7.2 报告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

注：无。

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

注：无。

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	601398	工商银行	11,224,780.00	4.27
2	300408	三环集团	6,846,432.00	2.60
3	601155	新城控股	6,435,919.90	2.45
4	300098	高新兴	6,182,779.02	2.35
5	300059	东方财富	6,128,355.80	2.33
6	300017	网宿科技	5,475,263.00	2.08
7	300047	天源迪科	5,295,631.00	2.01
8	601988	中国银行	4,940,573.98	1.88
9	601939	建设银行	4,861,929.00	1.85
10	000002	万科A	4,285,300.00	1.63
11	300124	汇川技术	4,255,322.00	1.62
12	600048	保利地产	4,082,615.00	1.55
13	601318	中国平安	3,315,416.50	1.26
14	000333	美的集团	2,648,203.33	1.01
15	002142	宁波银行	2,531,149.00	0.96
16	002271	东方雨虹	2,421,120.00	0.92
17	002035	华帝股份	2,400,635.00	0.91

18	000001	平安银行	2,273,491.00	0.86
19	601088	中国神华	1,888,335.00	0.72
20	300113	顺网科技	1,871,968.00	0.71

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	601398	工商银行	10,828,720.00	4.12
2	300408	三环集团	6,710,943.60	2.55
3	601155	新城控股	6,597,707.98	2.51
4	300098	高新兴	6,579,768.00	2.50
5	300047	天源迪科	6,194,155.00	2.36
6	300059	东方财富	6,143,510.00	2.34
7	300017	网宿科技	5,439,619.89	2.07
8	601939	建设银行	4,791,246.32	1.82
9	601988	中国银行	4,691,500.00	1.78
10	300124	汇川技术	4,190,184.00	1.59
11	000002	万科A	3,622,396.40	1.38
12	600048	保利地产	3,069,829.00	1.17
13	601318	中国平安	3,058,190.00	1.16
14	000333	美的集团	2,441,800.97	0.93
15	002142	宁波银行	2,431,870.18	0.92
16	002271	东方雨虹	2,315,648.42	0.88
17	000001	平安银行	2,274,000.00	0.86
18	002035	华帝股份	2,088,260.00	0.79
19	300113	顺网科技	1,886,920.00	0.72
20	300078	思创医惠	1,719,843.80	0.65

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	105,981,914.98
卖出股票收入(成交)总额	101,795,753.07

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	58,928,850.00	23.90
	其中：政策性金融债	19,444,850.00	7.89
4	企业债券	183,678,631.20	74.50
5	企业短期融资券	15,112,500.00	6.13
6	中期票据	35,626,800.00	14.45
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	293,346,781.20	118.98

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	136367	16 国君 G1	200,000	19,766,000.00	8.02
2	136315	16 远东三	200,000	19,744,000.00	8.01
3	136455	16 银河 G1	200,000	19,718,000.00	8.00
4	136893	17 泰达债	200,000	19,642,000.00	7.97
5	124284	13 琼洋浦	200,000	19,600,000.00	7.95

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	116878	逸锬优 3	140,000	14,016,665.75	5.68
2	116866	尚隼 03A	100,000	10,000,000.00	4.06

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：无。

7.10.2 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。

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。

7.12.2

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

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	54,247.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,745,170.90
5	应收申购款	4,373.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,803,791.52

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

份额 级别	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 (%)
鹏华 弘盛 混合 A	1,440	125,761.10	0	0.00	181,095,982.33	100.00
鹏华 弘盛 混合 C	352	49,967.81	15112441.06	85.92	2476228.25	14.08
合计	1,792	110,873.13	15,112,441.06	7.61	183,572,210.58	92.39

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:截止本报告期末,本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

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

项目	鹏华弘盛混合 A	鹏华弘盛混合 C
基金合同生效日 (2015年2月25日)基 金份额总额	3,742,247,774.07	-
本报告期期初基金份额总 额	214,032,094.10	3,463,966.56
本报告期基金总申购份额	1,059,270.92	15,721,914.24
减:本报告期基金总赎回	33,995,382.69	1,597,211.49

份额		
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）		
本报告期期末基金份额总额	181,095,982.33	17,588,669.31

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

基金管理人的重大人事变动：基金管理人本报告期内无重大人事变动。

基金托管人的重大人事变动：本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本基金投资策略未发生改变。

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	
天风证券	1	82,360,033.6	39.64%	75,054.66	39.81%	-

		7				
中泰证券	2	36,115,088.48	17.38%	32,911.29	17.46%	-
广发证券	1	25,451,149.48	12.25%	23,193.72	12.30%	-
平安证券	1	24,800,724.20	11.94%	22,600.82	11.99%	-
安信证券	2	21,541,189.40	10.37%	19,630.30	10.41%	-
方正证券	1	8,724,813.00	4.20%	7,950.83	4.22%	-
东方财富证券	1	8,198,012.82	3.95%	6,650.92	3.53%	-
国金证券	1	586,657.00	0.28%	534.64	0.28%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	本报告期新增

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	333,597.57	0.27%	94,888,000.00	1.08%	-	-
中泰证券	51,307,400.00	41.56%	2,446,700,000.00	27.80%	-	-
广发证券	19,846,934.40	16.08%	1,909,600,000.00	21.70%	-	-
平安证券	-	-	17,548,000.00	0.20%	-	-
安信证券	-	-	467,500,000.00	5.31%	-	-
方正证券	-	-	76,141,000.00	0.87%	-	-
东方财富证券	29,998.10	0.02%	3,674,200,000.00	41.75%	-	-
国金证券	-	-	114,800,000.00	1.30%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	51,923,520.00	42.06%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

§ 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

2018 年 08 月 27 日