鹏华弘锐灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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:2016年4月20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2016年4月15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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华弘锐混合
场内简称	-
基金主代码	001492
交易代码	001492
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月24日
报告期末基金份额总额	1,502,010,000.71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 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 本基金将根据市场情况以及风险管理的原则,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.股票期权、权证等投资策略 本基金将根据市场情况以及风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股票期权合约。本基金力争利用股票期权的杠杆作用,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。 6.资产支持证券投资策略 本基金将通过对证券基本面的研究,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。
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	1,188,299,952.26份 / 313,710,048.45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(2016年1月1日 — 2016年3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	1,986,992.36	14,006,389.63
2. 本期利润	8,573,837.95	9,790,565.36
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0172	0.0102
4. 期末基金资产净值	1,221,998,977.81	554,408,911.99
5. 期末基金份额净值	1.028	1.767

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

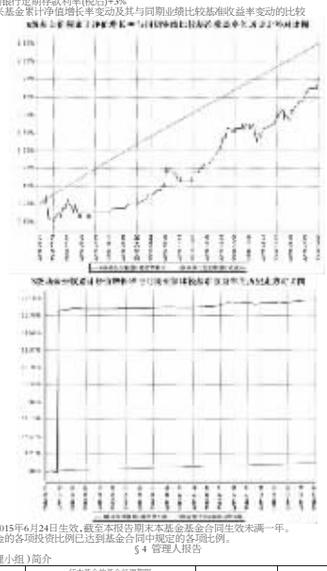
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.08%	0.08%	1.12%	0.02%	-0.04%	0.06%

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	0.97%	0.07%	1.12%	0.02%	-0.15%	0.05%

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2015年6月24日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。
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		
袁航	本基金基金经理	2015年6月24日	-	7	袁航先生,国籍中国,经济学硕士,7年证券从业经验。2009年4月加盟鹏华基金管理有限公司,从事行业研究及投资助理相关工作,担任研究部资深研究员、投资经理助理,2014年11月起担任鹏华光谱新趋势票基金基金经理,2015年2月起兼任鹏华弘盛混合基金基金经理,2015年4月起兼任鹏华弘泽混合基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华弘灵动力基金、鹏华弘信诚合基金基金经理,2015年6月起兼任鹏华弘锐混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华弘新趋势混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华弘鑫混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华弘盛利混合基金基金经理。袁航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,增聘对方正担任本基金基金经理。
李韵怡	本基金基金经理	2015年7月23日	-	9	李韵怡女士,国籍中国,经济学硕士,9年证券从业经验。曾任职于广州证券股份有限公司投资管理总部,先后担任研究员、交易员和投资经理等职务,从事新股及可转债申购、定增项目等工作;2015年4月加盟鹏华基金管理有限公司,从事投研工作,2015年7月起担任鹏华弘益混合基金、鹏华弘信诚合基金、鹏华弘惠混合基金、鹏华弘灵活合基金、鹏华弘锐混合基金、鹏华弘华混合基金、鹏华弘和混合基金基金经理。李韵怡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,增聘对方正担任本基金基金经理。
刘方正	本基金基金经理	2016年3月10日	-	6	刘方正先生,国籍中国,理学硕士,6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3月起担任鹏华弘利混合基金基金经理,2015年3月至2015年8月兼任鹏华行业成长基金(2015年8月已转型为鹏华弘泰混合基)基金经理,2015年4月起兼任鹏华弘润混合基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华弘和混合基金基金经理,2015年6月起兼任鹏华弘盛利混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华弘泰混合基、鹏华弘锐混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华弘新趋势混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华弘鑫混合基、鹏华弘华混合基、鹏华弘盛混合基金基金经理,2015年11月起担任鹏华弘盛利混合基金基金经理。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。

§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	31,677,673.46	1.44
	其中:股票	31,677,673.46	1.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,100,248,307.80	95.35
	其中:债券	2,100,248,307.80	95.35
	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	18,515,541.76	0.84
8	其他资产	52,289,070.96	2.37
9	合计	2,202,730,593.98	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	19,922,078.66	1.12
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输,仓储和邮政业	2,636,000.00	0.15
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	2,127,340.32	0.12
K	房地产业	1,429,700.00	0.08
L	租赁和商务服务业	3,101,820.00	0.17
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	2,424,500.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	31,677,673.46	1.78

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	002791	坚朗五金	121,285	4,559,103.15	0.26
2	600276	恒瑞医药	80,000	3,778,400.00	0.21
3	000625	长安汽车	250,000	3,627,100.00	0.20
4	002792	通宇通讯	77,621	3,412,219.16	0.19
5	600057	象屿股份	304,100	3,101,820.00	0.17
6	002343	慈文传媒	50,000	2,424,500.00	0.14
7	600867	通化东宝	100,000	2,416,000.00	0.14
8	000001	平安银行	199,938	2,127,340.32	0.12
9	300196	长海股份	60,000	1,941,000.00	0.11
10	601006	大秦铁路	200,000	1,374,000.00	0.08

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	336,921,000.00	18.97
	其中:政策性金融债	336,921,000.00	18.97
4	企业债券	957,038,000.00	53.87
5	企业短期融资券	460,356,000.00	25.91
6	中期票据	331,258,000.00	18.65
7	可转债(可交换债)	14,675,307.80	0.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,100,248,307.80	118.23

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	136212	15招开12	1,500,000	152,565,000.00	8.59
2	122465	15广超01	1,200,000	122,544,000.00	6.90
3	150409	15农发09	1,000,000	102,550,000.00	5.77
4	101554063	15融高速MTN003(3年期)	800,000	82,064,000.00	4.62
5	011599534	15重产SCP005	800,000	80,376,000.00	4.52

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 报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末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

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

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

组合投资的前十名证券之一的16京债的发行主体东兴证券股份有限公司在2015年5月29日,发生了集中交易系统部分异常导致公司部分客户无法及时登录交易,公司未就该信息安全事件及时向北京证监局报告的情况,中国证监会北京监管局出具了《关于对东兴证券股份有限公司采取责令定期报告监管措施的决定》,要求公司在2015年6月15日至2015年12月15日期间,每15日向北京证监局报送一份有关信息系统运行情况的书面报告。2015年7月16日,中国证监会江西监管局出具了[2015]29号《关于东兴证券南昌抚河北路整王陶证券营业部采取责令改正措施的决定》,指出该营业部自2010年8月至2015年4月在江西省上饶市余干县利用固定场所非法经营证券业务,氣于营业部能够认识到问题严重性,采取措施主动整改,未造成严重后果,但上述行为反应营业部存在内部控制不完善的问题,对营业部采取责令改正的监管措施。2016年1月13日,中国证监会四川监管局《以下简称"四川证监局")作出《关于对东兴证券股份有限公司采取监管谈话措施的决定》(2016]3号),认定2015年7月30日至9月30日之间,"15老投债"发行人龙腾国际"未及时履行信息披露义务,对公司采取监管谈话措施,并要求公司提交书面整改报告。

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,认为东兴证券作为国内资产规模领先的大型券商,未来将受益于券商行业的大发展。本次行政监管措施对该证券的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,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	64,110.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,951,596.74
5	应收申购款	30,273,363.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,289,070.96

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

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	002791	坚朗五金	4,559,103.15	0.26	新股锁定
2	002792	通宇通讯	3,412,219.16	0.19	新股锁定

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
报告期初基金份额总额	221,005,640.58	1,436,742,917.30
报告期间基金总申购份额	979,877,145.89	19,366,684.99
减:报告期间基金总赎回份额	12,582,834.21	1,142,899,323.84
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期末基金份额总额	1,188,299,952.26	313,710,048.45

§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 备查文件目录

8.1 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2016年度第1季度报告》(原文)。

8.2 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

上海市浦东新区银城中路188号交通银行股份有限公司

8.3 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:400678899。

鹏华基金管理有限公司
2016年4月20日

鹏华弘润灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月20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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月15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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华弘润混合
场内简称	-
基金主代码	001190
交易代码	001190
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月14日
报告期末基金份额总额	1,608,427,850.73份
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 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 本基金将根据市场情况以及风险管理的原则,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,其预期的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	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	鹏华弘润混合A	鹏华弘润混合C类
下属分级基金的交易代码	001190	001191
报告期末下属分级基金的份额总额	379,021,098.32份	1,229,406,752.41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(2016年1月1日 — 2016年3月31日)	
	鹏华弘润混合A类	鹏华弘润混合C类
1. 本期已实现收益	4,207,595.14	13,525,754.53
2. 本期利润	5,628,205.24	16,971,270.67
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0137	0.0123
4. 期末基金资产净值	397,730,811.69	1,279,997,701.82
5. 期末基金份额净值	1.049	1.041

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

鹏华弘润混合A类

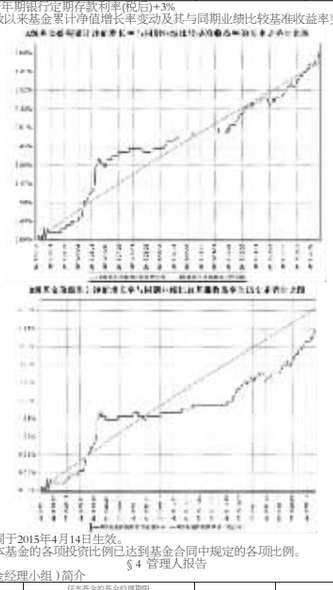
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.35%	0.06%	1.12%	0.02%	0.23%	0.04%

鹏华弘润混合C类

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	1.26%	0.06%	1.12%	0.02%	0.14%	0.04%

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2015年4月14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		
刘方正	本基金基金经理	2015年4月14日	-	6	刘方正先生,国籍中国,理学硕士,6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3月起担任鹏华弘利混合基金基金经理,2015年5月至2015年8月兼任鹏华行业成长基金(2015年8月已转型为鹏华弘泰混合基)基金经理,2015年4月起兼任鹏华弘润混合基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华弘和混合基金基金经理,2015年6月起兼任鹏华弘盛利混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华弘泰混合、鹏华弘锐混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华弘新趋势混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华弘鑫混合、鹏华弘华混合、鹏华弘盛混合基金基金经理,2015年11月起担任鹏华弘盛利混合基金基金经理。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。
李君	本基金基金经理	2015年5月22日	-	7	李君女士,国籍中国,经济学硕士,7年金融证券从业经验。历任平安银行理财业务部部行理财产品管理岗,从事银行间市场资金交易工作;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;2013年1月至2014年5月担任鹏华货币基金基金经理,2014年2月至2015年5月担任鹏华增值宝货币基金基金经理,2015年4月起担任鹏华弘盛混合基金、鹏华弘利混合基金、鹏华弘泽混合基金、鹏华弘润混合基金、鹏华弘和混合基金、鹏华弘华混合基金、鹏华弘盛混合基金基金经理,2015年11月起担任鹏华弘安混合基金基金经理。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。

§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	36,401,212.40	2.17
	其中:股票	36,401,212.40	2.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,576,471,150.30	93.82
	其中:债券	1,576,471,150.30	93.82
	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	39,700,244.55	2.36
	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	13,821,498.33	0.82
8	其他资产	13,865,716.56	0.83
9	合计	1,680,259,732.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	32,512,077.92	1.94
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.00
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	537,900.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,313,000.00	0.20
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	36,401,212.40	2.17

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	600887	伊利股份	334,000	7,780,300.00	0.46
2	000858	五粮液	162,530	4,568,718.30	0.27
3	002791	坚朗五金	121,285	4,559,103.15	0.27
4	000895	双汇发展	178,160	3,758,638.50	0.22
5	000538	云南白药	61,000	3,739,300.00	0.22
6	002792	通宇通讯	77,621	3,412,219.16	0.20
7	600057	象屿股份	325,000	3,315,000.00	0.20
8	000651	格力电器	169,993	3,267,265.46	0.19
9	600519	贵州茅台	5,000	1,238,200.00	0.07
10	600000	浦发银行	30,000	537,900.00	0.03

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	100,250,000.00	5.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,665,000.00	3.02
	其中:政策性金融债	50,665,000.00	3.02
4	企业债券	558,997,500.00	33.32
5	企业短期融资券	541,881,000.00	32.30
6	中期票据	317,807,000.00	18.94
7	可转债(可交换债)	6,870,650.30	0.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,576,471,150.30	93.96

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	136175	16理帆债	800,000	80,320,000.00	4.79
2	101652003	16南电MTN001	800,000	79,808,000.00	4.76
3	1282330	12徐团投MTN1	500,000	52,135,000.00	3.11
4	120304	12进出04	500,000	50,665,000.00	3.02
5	136239	16国联01	500,000	50,440,000.00	3.01

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:本基金本报告期末未持有股指期货。

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

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	69,447.07
2	应收证券清算款	255,999,523.33
3	应收股利	-
4	应收利息	12,804,484.48
5	应收申购款	91,371.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	268,964,826.00

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

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	300443	金雷风电	11,114,748.32	0.93	新股锁定
2	300436	广生堂	5,674,694.06	0.47	新股锁定
3	002791	坚朗五金	4,559,103.15	0.38	新股锁定
4	600873	梅花生物	3,656,000.00	0.31	重大事项
5	000890	法尔胜	3,613,920.24	0.30	重大事项
6	002792	通宇通讯	3,412,219.16	0.28	新股锁定
7	300362	天翔环境	3,158,400.00	0.26	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	鹏华弘润混合A	鹏华弘润混合C
报告期初基金份额总额	457,644,482.05	1,735,337,121.98
报告期间基金总申购份额	686,300.39	211,929.29
减:报告期间基金总赎回份额	79,309,684.32	506,142,298.86
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期末基金份额总额	379,021,098.32	1,229,406,752.41

§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