

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:2015年10月27日

基金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。

基金的过往业绩并不代表未来表现,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。

报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 鹏华新兴产业混合

场内简称 -

交易代码 206009

基金代码 206009

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2011年6月14日

报告期末基金份额总额 443,701,144.51份

投资目标 在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,把握未来推动经济发展的新兴产业并从中精选优质个股,力求超越收益与长期资本增值。

1.资产配置策略

本基金将对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场的走势及市场的系统性风险以及未来一段时期内各类资产的预期回报率进行综合分析,运用定量及定性相结合的手段,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例,实现资产的保值增值。

2.股票投资策略

本基金通过对宏观经济、分析宏观经济运行、经济政策以及产业结构的优化,结合经济运行过程中对具有良好发展前景的新兴产业的把握,精选各公司的投资品种,通过以上市公司和二级市场上相关公司的投资,实现资产的保值增值。

3.债券投资策略

本基金通过久期配置、类属配置、期限配置等策略,选取相对估值较低的债券品种,把握利率下行的时机,发掘和利用市场失衡带来的投资机会,以期获得超额收益。

4.权证投资策略

本基金通过对权证的特征基本面的研究,并结合权证定价模型及对市场的判断,对权证进行买卖操作,以期获得超额收益。

5.现金类资产投资

本基金通过现金类资产的配置,在保证流动性的前提下,把握现金类资产的配置机会。

6.中小企业私募债投资

本基金将根据对中小企业私募债的综合评估,精选具有投资价值的中小企业私募债品种,通过以上市公司和二级市场上相关公司的投资,实现资产的保值增值。

7.资产配置比例

本基金将对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场的走势及市场的系统性风险以及未来一段时期内各类资产的预期回报率进行综合分析,运用定量及定性相结合的手段,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例,实现资产的保值增值。

8.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基金、债券基金,低于股票型基金,为证券投资基金中具有中高风险、中高收益的品种。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -91,659,162.83

2.本期利润 -217,816,903.63

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0540

4.期末基金资产净值 814,074,197.64

5.期末基金份额净值 1.036

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.本基金的基金管理费不包括持有人认购或申购基金时所支付的申购费、赎回费、基金转换费等,计入费用后实际收益水平将低于不计费的情况。

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

过去三个月 -20.11% 3.80% -21.12% 3.10%

3.2.2.自基金成立以来至报告期末基金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:无。

鹏华新兴产业混合型证券投资基金

2015年第3季度报告

2015年第3季度报告