

鹏华尊惠18个月定期开放混合型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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
报告期末的日期:2018-06-30
5.1 重要提示
基金管理人的董事、监事、高级管理人员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，并由董事长签章。

基金托管人的董事、监事、高级管理人员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，并由董事长签章。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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当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，投资者应当仔细阅读详细内容，阅读半年度报告正文。

本公司网站(www.phfund.com)披露。

本报刊于2018年3月21日《基金合同生效日》起至6月30日。

5.2 基金简介

2.1 基金的基本情况

基金名称 鹏华尊惠定期开放混合型证券投资基金

场内简称 -

基金代码 000416

场外交易代码 -

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 212,338,973,526份

基金总资产的证券交易所上市部分 -

上市日期 -

下属分级基金的基金简称 鹏华尊惠定期开放混合A 鹏华尊惠定期开放混合C

下属分级基金的交易代码 000416 006417

报告期末下属分级基金的份额总额 182,032,963,416份 29,246,100,989份

2.2 基金产品说明

投资目标 在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力争取得超越行业平均水平的收益。

1.资产配置策略：本基金将通过对宏观经济的正常宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2增速、利率水平、财政政策、货币政策等)以及对股票、债券、商品等大类资产的预期收益率、预期波动率、预期评估不同资产类别的风险特征以及其风险收益特征，在股票、债券和货币等资产之间进行大类资产的资产配置。

2.股票投资策略：本基金将通过深入研究股票基本面，精选个股，构建投资组合，从而在行业配置、个股选择、仓位控制等方面综合运用多种策略。

3.债券投资策略：本基金将通过深入研究宏观经济、利率、信用、流动性等要素变化，密切跟踪收益率曲线，动态调整组合久期，以期获得超额收益。

4.衍生品投资策略：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

5.资产支持证券投资策略：本基金将通过深入研究资产支持证券的基础资产的信用质量、违约率和未来收益波动率，结合信用风险、利率风险和流动性风险，通过信用风险分散、期限分散、品种分散、适度杠杆等方法，选择风险与收益相匹配的资产支持证券进行投资。

6.行业轮动策略：本基金将通过深入研究宏观经济、行业景气度、估值水平、政策导向、资金流向、市场情绪等指标，结合历史数据，通过量化模型，定期对各行业进行评价，从而确定行业配置比例，实现行业轮动。

7.股票期权投资策略：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股票期权交易。

8.其他金融工具投资策略：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

9.投资限制：本基金将根据法律法规的规定，结合基金运作经验，对投资范围、投资比例、投资组合等进行限制。

10.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

11.投资组合：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

12.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

13.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

14.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

15.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

16.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

17.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

18.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

19.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

20.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

21.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

22.投资决策：本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品种的投资。

23.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

姓名 张戈 张燕

电话 0755-82627057 0755-83190064

电子邮件 zhanggo@phfund.com.cn

客户服务电话 4006788999 96665

传真 0755-20212166 0755-83196201

登载基金半年度报告正文的管理人互联网址 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号深国投国际商会中心第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

金额单位:人民币元

3.1 本期主要财务指标

报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)

鹏华尊惠定期开放混合A

鹏华尊惠定期开放混合C

本期已实现收益 2,118,609,009

本期利润 -4,033,970,45

加权平均基金份额净值 -0.0131

本期基金份额净额增长率为 -1.31%

-1.45%

3.2 本期末数据和指标

报告期(2018年06月30日)

鹏华尊惠定期开放混合A

鹏华尊惠定期开放混合C

本期可供分配基金份额利润 -0.0131

-0.0145

期末基金资产净值 180,688,933,099

28,822,204,15

期末基金份额净值 0.9899

0.9885

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、股息红利收入、其他收入(不含公允价值变动收益)减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期间费用。

2.2.3 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

姓名 张戈 张燕

电话 0755-82627057 0755-83190064

电子邮件 zhanggo@phfund.com.cn

客户服务电话 4006788999 96665

传真 0755-20212166 0755-83196201

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号深国投国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司

§ 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 本期主要财务指标

报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)

鹏华尊惠定期开放混合A

鹏华尊惠定期开放混合C

本期已实现收益 2,118,609,009

本期利润 -4,033,970,45

加权平均基金份额净值 -0.0131

-1.45%

3.1.2 本期末数据和指标

报告期(2018年06月30日)

鹏华尊惠定期开放混合A

鹏华尊惠定期开放混合C

本期可供分配基金份额利润 -0.0131

-0.0145

期末基金资产净值 180,688,933,099

28,822,204,15

期末基金份额净值 0.9899

0.9885

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、股息红利收入、其他收入(不含公允价值变动收益)减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期间费用。

2.2.4 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

姓名 张戈 张燕

电话 0755-82627057 0755-83190064

电子邮件 zhanggo@phfund.com.cn

客户服务电话 4006788999 96665

传真 0755-20212166 0755-83196201

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号深国投国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司

§ 3.2 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.2.1 本期主要财务指标

报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)

鹏华尊惠定期开放混合A

鹏华尊惠定期开放混合C

本期已实现收益 2,118,609,009

本期利润 -4,033,970,45

加权平均基金份额净值 -0.0131

-1.45%

3.2.2 本期末数据和指标

报告期(2018年06月30日)

鹏华尊惠定期开放混合A

鹏华尊惠定期开放混合C

本期可供分配基金份额利润 -0.0131

-0.0145

期末基金资产净值 180,688,933,099

28,822,204,15

期末基金份额净值 0.9899

0.9885

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、股息红利收入、其他收入(不含公允价值变动收益)减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期间费用。

2.2.5 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

姓名 张戈 张燕

电话 0755-82627057 0755-83190064