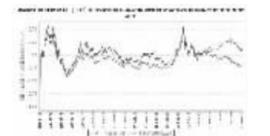


信息披露 Disclosure

鹏华优质治理混合型证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告



注:1.本基金成立于2017年06月15日生效,2.截至本报告期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的各项比例。

3.3 其他指标

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Appointment/Resignation Date, and Bio. Lists managers like 魏庆生 and 郑宇.

注:1.在任职日期和离任日期均指公司作出决定并正式对外公告之日,担任或成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

2.基金经理的离任日期指行业协会从业从业人员资格管理中心的相关规定。

3.基金经理的离任日期指行业协会从业从业人员资格管理中心的相关规定。

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,本着诚实信用、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。报告期内,本基金运作合规,不存在违反基金合同和投资策略基金合同约定的行为。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 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,确保不同投资组合间研究、交易、分配等各项环节得到公平对待。

4.2.2 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。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单边交易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

三季度宏观经济下行压力加大,稳增长政策持续推进,地方财政连续三年加杠杆,财政赤字规模以及中央国债发行量下业对央行扩表预期增加,对多数行业未来更乐观,因此我们调整策略,经济和货币政策上开始宽松,前瞻的财政政策预期,上半年央行货币政策进行了调整,我们在操作上也进行了对政策敏感,现金流充沛的电力配置,同时考虑到政策超预期,增加了主题板块,天然气产能超预期在板块中地位凸显。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值增长率为-3.36%,同期上证指数下跌0.02%,深证成指下跌10.43%,沪深300指数下跌2.0%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists investments in various sectors like 制造业, 医药, etc.

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

Table with columns: No., Industry, Fair Value (RMB), and Proportion of Assets. Lists industry allocations like 农林牧渔, 医药, etc.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

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

Table with columns: No., Stock Name, Fair Value (RMB), and Proportion of Assets. Lists top 10 stocks like 伊利股份, 招商银行, etc.

5.4 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债券投资明细

无。

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十名资产支持证券投资明细

无。

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贵金属投资明细

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十名权证投资明细

无。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

无。

5.11 报告期末本基金投资的场外衍生品交易情况说明

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4 投资组合报告附注

5.12.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.3 其他资产构成

Table with columns: No., Item, Amount (RMB), and Proportion of Assets. Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4 投资组合报告附注

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.1 本基金投资的前十名股票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。

5.12.4.4.4.4.4.4.4.4.4.4.2 本基金投资的前十名股票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。