鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25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2018年07月01日起至09月30日。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华一带一路分级	
场内简称	带路分级	
基金主代码	160638	
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6月18日	
报告期末基金份额总额	408,097,046.92份	
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。	
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。本基金力争鹏华医药分级净值增长率与同期业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离或跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。	
业绩比较基准	中证一带一路主题指数收益率×95%＋商业银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金与指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	
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	

下属分级基金的基金简称	鹏华一带一路分级	鹏华带路A	鹏华带路B	
下属分级基金的场内简称	带路分级	带路A	带路B	
下属分级基金的交易代码	160638	150273	150274	
下属分级基金的前端交易代码	–	–	–	
下属分级基金的后端交易代码	–	–	–	
报告期末下属分级基金的份额总额	387,961,502.92份	10,067,772.00份	10,067,772.00份	
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	鹏华带路A分级为稳健收益类分级,具有风险具预期收益相对较低的特征。	鹏华带路B分级为积极收益类分级,具有高风险且预期收益相对较高的特征。	

注:无。

§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(2018年07月01日 – 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	–21,465,540.80
2.本期利润	22,374,949.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0515
4.期末基金资产净值	430,883,638.09
5.期末基金份额净值	1.056

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。

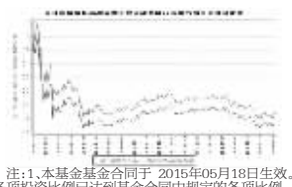
3.2 基金净值表现

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

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	5.60%	1.32%	0.77%	1.27%	1.83%	0.06%

注:业绩比较基准=中证一带一路主题指数收益率×95%＋商业银行活期存款利率(税后)×5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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05月18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。

3.3 其他指标

注:无。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张羽翔	本基金基金经理	2016-11-23	–	11年	张羽翔先生,国籍中国,工学硕士,11年证券基金从业经验。曾任招商银行软件中心项目经理,历任广发证券股份有限公司,历任监察稽核部投资业务稽核岗、资产管理总部产品设计岗、量化及衍生品投资部量化研究员。先后从事金融工程、量化研究等工作。2015年09月担任鹏华上证民企50ETF基金基金经理,2015年09月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理,2016年06月至2018年06月担任鹏华新兴路分级基金基金经理,2016年07月担任鹏华高铁分级基金基金经理,2016年09月担任鹏华沪深300指数(LOF)基金基金经理,2016年09月担任鹏华中证500指数(LOF)基金基金经理,2016年10月担任鹏华一带一路分级基金基金经理,2016年11月担任鹏华新能源分级基金基金经理,2016年11月担任鹏华创业板分级基金基金经理,2016年12月担任鹏华互联网分级基金基金经理,2018年04月担任鹏华创新分级基金基金经理,2018年04月担任鹏华互联网分级基金基金经理,2018年06月至2018年06月担任鹏华沪深300指数基金基金经理,2018年06月担任鹏华香港中小企业指数(LOF)基金基金经理,2018年06月担任鹏华新锐分级基金基金经理。张羽翔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。
罗捷	本基金基金经理	2018-03-28	–	6年	罗捷先生,国籍中国,管理学硕士,5年证券基金从业经验。历任联合证券研究员、万寿投资咨询产品经理、阿里巴巴(中国)网络技术有限公司产品经理;2013年8月加盟鹏华基金管理有限公司,历任投资部稽核部高级金融工程师、量化及衍生品投资部投资组合量化研究员、先后从事金融工程、量化研究等工作。2015年09月担任鹏华上证民企50ETF基金基金经理,2015年09月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理,2016年06月至2018年06月担任鹏华新兴路分级基金基金经理,2018年01月担任鹏华证民营ETF联接基金基金经理,2018年01月担任鹏华高铁分级基金基金经理,2018年03月担任鹏华医药指数(LOF)基金基金经理,2018年03月担任鹏华量化策略混合基金基金经理,2018年03月担任鹏华医药指数(LOF)基金基金经理,2018年04月担任鹏华沪深300指数基金基金经理,2018年06月担任鹏华香港中小企业指数(LOF)基金基金经理。罗捷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。

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利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金秉承指数基金的投资策略,在应对基金申购赎回的基础上,力争跟踪指数的收益,并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.056元;本报告期基金份额净值增长率为5.60%。

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 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	405,790,364.04	93.60
	其中:股票	405,790,364.04	93.60
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	27,449,001.39	6.33
8	其他资产	281,969.69	0.07
9	合计	433,521,335.02	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	54,218,367.29	12.58
C	制造业	199,472,911.14	46.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	789,315.00	0.18
E	建筑业	93,263,636.32	21.64
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	44,172,562.54	10.25
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,163,387.65	3.05
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	619,946.00	0.14
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	405,700,125.94	94.16

5.2.2 报告期末积极投资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	90,238.10	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
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	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
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	90,238.10	0.02

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注: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

5.3.1 指数投资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	601857	中国石油	1,801,000	16,515,170.00	3.83
2	600031	三一重工	1,851,345	16,439,943.60	3.82
3	600028	中国石化	2,293,720	16,331,286.40	3.79
4	600585	海螺水泥	440,500	16,206,996.00	3.76
5	600487	亨通光电	633,160	15,126,192.40	3.51
6	601186	中国铁建	1,324,216	14,765,008.40	3.43
7	000338	潍柴动力	1,600,000	13,680,000.00	3.17
8	601390	中国中铁	1,731,468	13,453,506.36	3.12
9	600406	国电南瑞	745,801	13,163,387.65	3.05
10	601668	中国建筑	2,178,980	11,962,600.20	2.78

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002937	兴瑞科技	2,114	36,503.24	0.01
2	300749	顶固集创	1,316	30,833.88	0.01
3	300748	金力永磁	2,008	22,810.88	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

注: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资产支持证券投资明细

注: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五名贵金属投资明细

注:无。

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:无。

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:本基金本报告期内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

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

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证券没有超出基金合同规定的证券备选库

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	88,096.57
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	5,722.47
5	应收申购款	188,140.66
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	281,959.69

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

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	鹏华一带一路分级	鹏华带路A	鹏华带路B
报告期期初基金份额总额	426,725,588.42	10,966,319.00	10,966,319.00
报告期期间基金总申购份额	59,381,699.50	–	–
减:报告期期间基金总赎回份额	99,920,879.00	–	–
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	1,775,094.00	–887,547.00	–887,547.00
报告期期末基金份额总额	387,961,502.92	10,067,772.00	10,067,772.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换的份额。

§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:无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注: 无。

§8 报告期内单一投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金2018年第3季度报告》(原文)。

9.2 存放地点

深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司。

9.3 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:4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2018年10月26日

鹏华中证医药卫生指数证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

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:2018年10月26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2018年10月25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2018年07月01日起至09月30日。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华中证医药卫生	
场内简称	医药基金	
基金主代码	160635	
前端交易代码	–	
后端交易代码	–	
基金运作方式	上市型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2015年06月17日	
报告期末基金份额总额	57,764,747.84份	
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。	
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。本基金力争鹏华医药分级净值增长率与同期业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离或跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。	
业绩比较基准	中证一带一路主题指数收益率×95%＋商业银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金与指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	
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	鹏华医药分级	鹏华医药A	鹏华医药B
下属分级基金的场内简称	医药分级	医药A	医药B
下属分级基金的交易代码	160636	150275	150276
下属分级基金的前端交易代码	–	–	–
下属分级基金的后端交易代码	–	–	–
报告期末下属分级基金的份额总额	116,941,794.57份	6,419,310.00份	6,419,310.00份
下属分级基金的风险收益特征	鹏华医药分级为稳健收益类分级,具有低风险且预期收益相对较低的特征。	鹏华医药A分级为积极收益类分级,具有高风险且预期收益相对较高的特征。	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

§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(2018年07月01日 – 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	–1,605,572.92
2.本期利润	–11,399,160.58
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0871
4.期末基金资产净值	110,849,960.15
5.期末基金份额净值	0.854

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

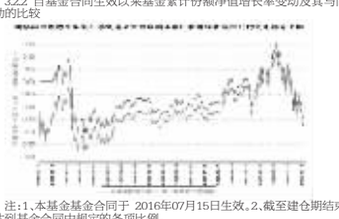
3.2 基金净值表现

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

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	–9.25%	1.62%	–9.75%	1.67%	0.50%	–0.05%

注:业绩比较基准=中证移动互联网指数收益率×95%＋商业银行活期存款利率(税后)×5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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 2016年07月15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。

3.3 其他指标

注:无。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
崔俊杰	本基金基金经理	2016-07-15	–	10年	崔俊杰先生,国籍中国,管理学硕士,10年证券基金从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任产品规划部产品设计师、量化及衍生品投资部量化研究员、先后从事产品设计、量化研究工作,现任量化风控主管投资部总经理。基金经理:2013年03月担任鹏华保证长债债券型证券投资基金基金经理,2013年04月担任鹏华保证民营ETF联接基金基金经理,2013年05月担任鹏华上证民企50ETF基金基金经理,2016年06月至2018年06月担任鹏华新兴路分级基金基金经理,2016年07月担任鹏华高铁分级基金基金经理,2016年09月担任鹏华沪深300指数(LOF)基金基金经理,2016年09月担任鹏华中证500指数(LOF)基金基金经理,2016年10月担任鹏华一带一路分级基金基金经理,2016年11月担任鹏华新能源分级基金基金经理,2016年11月担任鹏华创业板分级基金基金经理,2016年12月担任鹏华互联网分级基金基金经理,2018年04月担任鹏华创新分级基金基金经理,2018年04月担任鹏华互联网分级基金基金经理,2018年06月至2018年06月担任鹏华沪深300指数基金基金经理,2018年06月担任鹏华香港中小企业指数(LOF)基金基金经理,2018年06月担任鹏华新锐分级基金基金经理。崔俊杰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。
罗捷	本基金基金经理	2018-03-28	–	6年	罗捷先生,国籍中国,管理学硕士,5年证券基金从业经验。历任联合证券研究员、万寿投资咨询产品经理、阿里巴巴(中国)网络技术有限公司产品经理;2013年8月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部高级金融工程师、量化及衍生品投资部投资组合量化研究员、先后从事金融工程、量化研究等工作。2015年09月担任鹏华上证民企50ETF基金基金经理,2015年09月担任鹏华上证民企50ETF联接基金基金经理,2016年06月至2018年06月担任鹏华新兴路分级基金基金经理,2016年07月担任鹏华高铁分级基金基金经理,2016年09月担任鹏华沪深300指数(LOF)基金基金经理,2016年09月担任鹏华中证500指数(LOF)基金基金经理,2016年10月担任鹏华一带一路分级基金基金经理,2016年11月担任鹏华新能源分级基金基金经理,2016年11月担任鹏华创业板分级基金基金经理,2018年04月担任鹏华创新分级基金基金经理,2018年06月至2018年06月担任鹏华沪深300指数基金基金经理,2018年06月担任鹏华香港中小企业指数(LOF)基金基金经理,2018年06月担任鹏华新锐分级基金基金经理。罗捷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。

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利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第三季度,整个A股市场波动剧烈,市场震荡下行,波动率上升很快。本基金秉承指数基金的投资策略,在应对申购赎回的基础上,力争跟踪指数收益,并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

2018年第三季度本基金申购赎回较为频繁,对基金的管理运作带来一定影响,面临这种情况,我们进行了精心的管理,较好的实现了跟踪误差控制目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

基金在报告期内收益率–12.76%,业绩基准收益率–12.31%,同期上证综指涨跌幅为–0.9155%,深证成指涨跌幅为–10.4311%,沪深300指数涨跌幅为–2.0541%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形;截至报告期末,本基金资产净值仍低于五千万元。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	53,592,653.34	90.78
	其中:股票	53,592,653.34	90.78
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	5,088,898.88	8.61
8	其他资产	357,673.92	0.61
9	合计	59,036,226.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	44,121,305.84	75.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	5,180,048.50	8.86
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	881,206.20	1.51
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	321,708.00	0.55
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	3,088,384.80	5.28
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	53,592,653.34	91.67

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:无。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注: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

5.3.1 指数投资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	600276	恒瑞医药	86,248	5,476,748.00	9.37
2	600518	康美药业	160,900	3,520,492.00	6.02
3	000538	云南白药	28,100	1,973,463.00	3.38
4	000661	长春高新	7,400	1,753,800.00	3.00
5	300003	乐普医疗	57,700	1,751,195.00	3.00
6	600196	复星医药	54,200	1,710,010.00	2.92
7	300015	爱尔眼科	51,448	1,659,198.00	2.84
8	600436	片仔癀	16,300	1,650,538.00	2.82
9	000963	华东医药	39,300	1,649,814.00	2.82
10	600867	通化东宝	77,500	1,405,850.00	2.40

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: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五名债券投资明细

注: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资产支持证券投资明细

注: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五名贵金属投资明细

注:无。

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:无。

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:无。

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

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

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证券没有超出基金合同规定的证券备选库

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	17,832.72
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,066.08
5	应收申购款	338,775.12
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	357,673.92

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

5.11.5 报告期末指数投资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	000538	云南白药	1,973,463.00	3.38	重大事项

5.11.6 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

5.11.7 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

报告期期初基金份额总额	56,647,088.05
报告期期间基金总申购份额	30,421,442.55
减:报告期期间基金总赎回份额	28,303,779.76
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"–"填列)	–
报告期期末基金份额总额	57,764,747.84

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,464,661.18
报告期期间买