

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

重要提示
基金管理人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法律责任。
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26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。
本报告自2018年07月01日起至09月30日。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details like fund name, type, and manager information.

注:1.本基金基金合同于2017年04月25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

3.1 主要财务指标和基金净值表现

Table showing financial metrics like net asset value, return, and expenses for the period.

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 本基金净值表现

Table comparing fund performance against benchmarks like the CSI 300 Index.

注:业绩比较基准=中证500指数收益率

3.3 其他指标

注:无。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table listing the fund manager's name, tenure, and other relevant details.

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。

4.2 管理人报告

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用基金资产,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人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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、分配等环节得到公平对待。

4.4 报告期内基金投资运作分析

报告期内,本基金管理人管理的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超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2018年第三季度本基金净值增长率为-0.96%,同期业绩基准增长率为7.11%。

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

Table showing the breakdown of the fund's assets by sector and asset class.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table detailing the fund's equity investments across various industries.

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 listing the top 10 stocks held by the fund based on their fair value.

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table showing the fund's bond investments categorized by type.

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

Table listing the top 5 bonds held by the fund based on their fair value.

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

Table listing the top 10 asset-backed securities held by the fund.

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

Table listing the top 5 precious metal investments held by the fund.

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

Table listing the top 5 warrant investments held by the fund.

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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交易。

5.9.2 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交易。

5.9.3 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交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券选择库。

5.10.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets held by the fund.

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table listing convertible bonds held by the fund that are due for conversion.

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table listing the top 10 stocks with any restricted circulation status.

5.10.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table listing warrants held by the fund with any restricted circulation status.

5.10.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.7.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.7.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.7.3 报告期末股指期货投资评价
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.8.1 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交易。

5.10.8.2 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交易。

5.10.8.3 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交易。

5.10.9 投资组合报告附注

5.10.9.1 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。

5.10.9.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券选择库。

5.10.9.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets held by the fund.

5.10.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table listing convertible bonds held by the fund that are due for conversion.

5.10.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table listing the top 10 stocks with any restricted circulation status.

5.10.9.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table listing warrants held by the fund with any restricted circulation status.

5.10.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.9.7.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.7.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.7.3 报告期末股指期货投资评价
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.9.8.1 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交易。

5.10.9.8.2 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交易。

5.10.9.8.3 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交易。

5.10.9.9 投资组合报告附注

5.10.9.9.1 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。

5.10.9.9.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券选择库。

5.10.9.9.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets held by the fund.

5.10.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table listing convertible bonds held by the fund that are due for conversion.

5.10.9.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table listing the top 10 stocks with any restricted circulation status.

5.10.9.9.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table listing warrants held by the fund with any restricted circulation status.

5.10.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.9.9.7.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.7.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.7.3 报告期末股指期货投资评价
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.9.9.8.1 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交易。

5.10.9.9.8.2 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交易。

5.10.9.9.8.3 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交易。

5.10.9.9.9 投资组合报告附注

5.10.9.9.9.1 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。

5.10.9.9.9.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券选择库。

5.10.9.9.9.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets held by the fund.

5.10.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table listing convertible bonds held by the fund that are due for conversion.

5.10.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table listing the top 10 stocks with any restricted circulation status.

5.10.9.9.9.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table listing warrants held by the fund with any restricted circulation status.

5.10.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.9.9.9.7.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.7.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.7.3 报告期末股指期货投资评价
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.9.9.9.8.1 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交易。

5.10.9.9.9.8.2 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交易。

5.10.9.9.9.8.3 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交易。

5.10.9.9.9.9 投资组合报告附注

5.10.9.9.9.9.1 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。

5.10.9.9.9.9.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券选择库。

5.10.9.9.9.9.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets held by the fund.

5.10.9.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table listing convertible bonds held by the fund that are due for conversion.

5.10.9.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table listing the top 10 stocks with any restricted circulation status.

5.10.9.9.9.9.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table listing warrants held by the fund with any restricted circulation status.

5.10.9.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.9.9.9.9.7.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.7.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.7.3 报告期末股指期货投资评价
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.9.9.9.9.8.1 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交易。

5.10.9.9.9.9.8.2 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交易。

5.10.9.9.9.9.8.3 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交易。

5.10.9.9.9.9.9 投资组合报告附注

5.10.9.9.9.9.9.1 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。

5.10.9.9.9.9.9.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券选择库。

5.10.9.9.9.9.9.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets held by the fund.

5.10.9.9.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table listing convertible bonds held by the fund that are due for conversion.

5.10.9.9.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table listing the top 10 stocks with any restricted circulation status.

5.10.9.9.9.9.9.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table listing warrants held by the fund with any restricted circulation status.

5.10.9.9.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.9.9.9.9.9.7.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.9.7.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.9.7.3 报告期末股指期货投资评价
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.9.9.9.9.9.8.1 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交易。

5.10.9.9.9.9.9.8.2 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交易。

5.10.9.9.9.9.9.8.3 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交易。

5.10.9.9.9.9.9.9 投资组合报告附注

5.10.9.9.9.9.9.9.1 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。

5.10.9.9.9.9.9.9.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券选择库。

5.10.9.9.9.9.9.9.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets held by the fund.

5.10.9.9.9.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table listing convertible bonds held by the fund that are due for conversion.

5.10.9.9.9.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table listing the top 10 stocks with any restricted circulation status.

5.10.9.9.9.9.9.9.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table listing warrants held by the fund with any restricted circulation status.

5.10.9.9.9.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.9.9.9.9.9.9.7.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.7.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.7.3 报告期末股指期货投资评价
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.9.9.9.9.9.9.8.1 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交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.8.2 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交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.8.3 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交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.9 投资组合报告附注

5.10.9.9.9.9.9.9.9.1 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。

5.10.9.9.9.9.9.9.9.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券选择库。

5.10.9.9.9.9.9.9.9.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets held by the fund.

5.10.9.9.9.9.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table listing convertible bonds held by the fund that are due for conversion.

5.10.9.9.9.9.9.9.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table listing the top 10 stocks with any restricted circulation status.

5.10.9.9.9.9.9.9.9.6 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

Table listing warrants held by the fund with any restricted circulation status.

5.10.9.9.9.9.9.9.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.9.9.9.9.9.9.9.7.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.9.7.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.9.7.3 报告期末股指期货投资评价
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.9.9.9.9.9.9.9.8.1 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交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.9.8.2 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交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.9.8.3 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交易。

5.10.9.9.9.9.9.9.9.9 投资组合报告附注

5.10.9.9.9.9.9.9.9.9.1 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。

5.10.9.9.9.9.9.9.9.9.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券选择库。

5.10.9.9.9.9.9.9.9.9.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets held by the fund.

5.10.9.9.9.9.9.9.9.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table listing convertible bonds held by the fund that are due for conversion.