

鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

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 管理人对于报告期内基金运作遵守信情况的说明

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投资限制条款持有利益的行为。

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 报告期内本基金投资策略和运作分析

三季度组合操作较少,继续在文化传媒领域寻找具备投资价值的个股进行积极配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内净值增长率为-13.67%,业绩比较基准增长率为-11.11%。同期上证综指下跌0.92%,深证成指下跌0.43%,沪深300指数下跌2.05%。

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 with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%)

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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.4 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资产支持证券投资明细

注:无。

5.2.5 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贵金属投资明细

注:无。

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.2.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.9 投资组合报告附注

5.2.10 本基金投资的前十名证券中有超出基金合同规定的证券选择库

5.2.11 其他资产构成

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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3.1 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3.2 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 with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:无。

5.3.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:无。

5.3.5 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权证投资明细

注:无。

5.3.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.3.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.3.8 投资组合报告附注

5.3.9 本基金投资的前十名证券中有超出基金合同规定的证券选择库

5.3.10 其他资产构成

5.4 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%)

5.5 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.5.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5.2 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:无。

5.5.5 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贵金属投资明细

注:无。

5.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.5.9 投资组合报告附注

5.5.10 本基金投资的前十名证券中有超出基金合同规定的证券选择库

5.5.11 其他资产构成

5.6 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%)

5.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.7.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7.2 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.7.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:无。

5.7.5 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贵金属投资明细

注:无。

5.7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.7.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.7.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.7.9 投资组合报告附注

5.7.10 本基金投资的前十名证券中有超出基金合同规定的证券选择库

5.7.11 其他资产构成

5.8 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%)

5.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.9.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.9.2 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.9.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.9.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:无。

5.9.5 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贵金属投资明细

注:无。

5.9.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.9.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.9 投资组合报告附注

5.9.10 本基金投资的前十名证券中有超出基金合同规定的证券选择库

5.9.11 其他资产构成

5.10 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%)

5.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.11.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.2 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:无。

5.11.5 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贵金属投资明细

注:无。

5.11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.11.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.9 投资组合报告附注

5.11.10 本基金投资的前十名证券中有超出基金合同规定的证券选择库

5.11.11 其他资产构成

5.12 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%)

5.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.13.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.13.2 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.13.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.13.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:无。

5.13.5 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贵金属投资明细

注:无。

5.13.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.13.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.13.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.13.9 投资组合报告附注

5.13.10 本基金投资的前十名证券中有超出基金合同规定的证券选择库

5.13.11 其他资产构成

5.14 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%)

5.15 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.15.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.15.2 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.15.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.15.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:无。

5.15.5 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贵金属投资明细

注:无。

5.15.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.15.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.15.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.15.9 投资组合报告附注

5.15.10 本基金投资的前十名证券中有超出基金合同规定的证券选择库

5.15.11 其他资产构成

5.16 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%)

5.17 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.17.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.17.2 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.17.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.17.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:无。

5.17.5 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贵金属投资明细

注:无。

5.17.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.17.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.17.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.17.9 投资组合报告附注

5.17.10 本基金投资的前十名证券中有超出基金合同规定的证券选择库

5.17.11 其他资产构成

5.18 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%)

5.19 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.19.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.19.2 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.19.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.19.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:无。

5.19.5 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贵金属投资明细

注:无。

5.19.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

5.19.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.19.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.19.9 投资组合报告附注

5.19.10 本基金投资的前十名证券中有超出基金合同规定的证券选择库

5.19.11 其他资产构成

5.20 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产比例(%)

5.21 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.21.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.21.2 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 3 columns: 序号, 代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.21.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.21.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:无。

5.21.5 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贵金属投资明细

注:无。

5.21.6