

鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金

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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

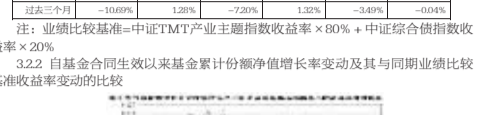
重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2018年07月01日起至09月30日。

3.1 主要财务指标和基金净值表现

Table with 4 columns: 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, 2.本期公允价值变动收益, 3.本期基金净值增长率, 4.本期基金份额净值增长率

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。

3.2.1 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对比
注:业绩比较基准=中证TMT产业主题指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。
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的对比



注:1.本基金基金合同于2017年06月26日生效,截至本报告期末本基金合同生效未满一年。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

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.任职日期和离任日期均以公告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的相关规定。
4.2 管理人对于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人利益的行为。

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
7.8月份受货币事件影响,加上终端消费数据整体偏弱,消费板块涨幅较多。本基金持仓结构均衡,消费板块占比高,7.8月份基金的回撤比例较多。在基金持仓上,目前的主要配置在消费和科技两大板块上。其中,在消费品细分行业中做了一定的调整,将地产相关的家电、家居等行业个股进行了清仓处理,增加了必需消费品的持仓比例。科技领域,三季度增配了通信和电子,主要围绕5G(PCB、主设备、天线)投资。

4.5 报告期内基金的投资组合报告
本基金本报告期内净值增长率为-10.69%,同期上证综指下跌0.92%,深证成指下跌10.43%,沪深300指数下跌12.05%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内,本基金存在连续六个工作日出现基金份额净值低于五千万元的情形,本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

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: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

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

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 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 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 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

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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贵金属投资明细

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的股指期货持仓尚未包含股指期货投资。
5.8.2 本基金股指期货投资的期末持仓
注:本基金基金合同的股指期货持仓尚未包含股指期货投资。
5.8.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金基金合同的国债期货交易尚未包含国债期货交易。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内前十名证券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。
5.9.2 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。
5.9.3 其他资产构成

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 鹏华中证TMT产业主题指数增强型证券投资基金

场内简称: -
基金代码: 000914
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

基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日期: 2017年06月26日
基金管理人基金登记机构: 鹏华基金管理有限公司

投资目标: 在有效控制风险的前提下,精选科技传媒主题上市公司进行投资,力求实现收益与长期资本增值。
投资策略: 1.资产配置策略:本基金将通过定量与定性相结合的方法,对宏观经济、行业景气度、市场估值水平、市场情绪等因素进行综合研判,在严格控制风险的前提下,动态调整资产配置比例,力争实现基金资产的长期增值。2.行业配置策略:本基金将重点关注科技、传媒、互联网等行业,并根据行业景气度、估值水平等因素,动态调整行业配置比例。3.个股选择策略:本基金将采用定量与定性相结合的方法,对个股的基本面、估值水平、成长性等因素进行综合研判,精选优质个股进行投资。4.风险控制策略:本基金将严格控制投资组合的波动率,通过分散投资、止损等方式,有效控制投资风险。5.其他投资策略:本基金将根据市场变化,灵活运用各种投资策略,力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准: 中证TMT产业主题指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征: 本基金属于中高风险,预期风险收益高于普通股票基金,但低于股票型基金。本基金的风险收益特征与中国公募基金市场整体风险收益特征相一致。

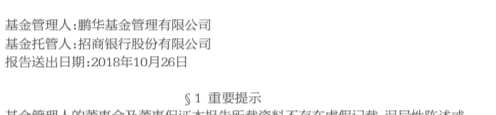
基金管理人: 鹏华基金管理有限公司
基金托管人: 招商银行股份有限公司
注:无。

3.1 主要财务指标

Table with 4 columns: 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, 2.本期公允价值变动收益, 3.本期基金净值增长率, 4.本期基金份额净值增长率

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。

3.2.1 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对比
注:业绩比较基准=中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。
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的对比



注:1.本基金基金合同于2011年06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

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.任职日期和离任日期均以公告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的相关规定。
4.2 管理人对于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人利益的行为。

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

鹏华新兴产业混合型证券投资基金

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

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预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前请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: 基金名称, 鹏华新兴产业混合型证券投资基金

场内简称: -
基金代码: 390009
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

基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日期: 2011年06月15日
基金管理人基金登记机构: 鹏华基金管理有限公司

投资目标: 在有效控制风险的前提下,精选新兴产业上市公司进行投资,力求实现收益与长期资本增值。
投资策略: 1.资产配置策略:本基金将通过定量与定性相结合的方法,对宏观经济、行业景气度、市场估值水平、市场情绪等因素进行综合研判,在严格控制风险的前提下,动态调整资产配置比例,力争实现基金资产的长期增值。2.行业配置策略:本基金将重点关注新兴产业,并根据行业景气度、估值水平等因素,动态调整行业配置比例。3.个股选择策略:本基金将采用定量与定性相结合的方法,对个股的基本面、估值水平、成长性等因素进行综合研判,精选优质个股进行投资。4.风险控制策略:本基金将严格控制投资组合的波动率,通过分散投资、止损等方式,有效控制投资风险。5.其他投资策略:本基金将根据市场变化,灵活运用各种投资策略,力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准: 中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征: 本基金属于中高风险,预期风险收益高于普通股票基金,但低于股票型基金。本基金的风险收益特征与中国公募基金市场整体风险收益特征相一致。

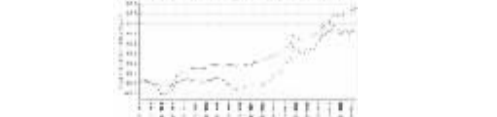
基金管理人: 鹏华基金管理有限公司
基金托管人: 招商银行股份有限公司
注:无。

3.1 主要财务指标

Table with 4 columns: 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, 2.本期公允价值变动收益, 3.本期基金净值增长率, 4.本期基金份额净值增长率

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。

3.2.1 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对比
注:业绩比较基准=中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。
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的对比



注:1.本基金基金合同于2011年06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

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.任职日期和离任日期均以公告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的相关规定。
4.2 管理人对于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人利益的行为。

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

鹏华新兴互联网混合型证券投资基金

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

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预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前请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: 基金名称, 鹏华新兴互联网混合型证券投资基金

场内简称: -
基金代码: 390010
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

基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日期: 2011年06月15日
基金管理人基金登记机构: 鹏华基金管理有限公司

投资目标: 在有效控制风险的前提下,精选新兴互联网上市公司进行投资,力求实现收益与长期资本增值。
投资策略: 1.资产配置策略:本基金将通过定量与定性相结合的方法,对宏观经济、行业景气度、市场估值水平、市场情绪等因素进行综合研判,在严格控制风险的前提下,动态调整资产配置比例,力争实现基金资产的长期增值。2.行业配置策略:本基金将重点关注新兴互联网行业,并根据行业景气度、估值水平等因素,动态调整行业配置比例。3.个股选择策略:本基金将采用定量与定性相结合的方法,对个股的基本面、估值水平、成长性等因素进行综合研判,精选优质个股进行投资。4.风险控制策略:本基金将严格控制投资组合的波动率,通过分散投资、止损等方式,有效控制投资风险。5.其他投资策略:本基金将根据市场变化,灵活运用各种投资策略,力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准: 中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征: 本基金属于中高风险,预期风险收益高于普通股票基金,但低于股票型基金。本基金的风险收益特征与中国公募基金市场整体风险收益特征相一致。

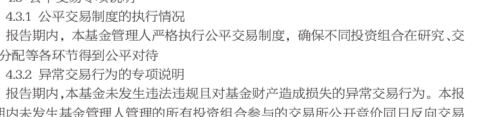
基金管理人: 鹏华基金管理有限公司
基金托管人: 招商银行股份有限公司
注:无。

3.1 主要财务指标

Table with 4 columns: 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, 2.本期公允价值变动收益, 3.本期基金净值增长率, 4.本期基金份额净值增长率

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。

3.2.1 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对比
注:业绩比较基准=中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。
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的对比



注:1.本基金基金合同于2011年06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

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.任职日期和离任日期均以公告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的相关规定。
4.2 管理人对于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人利益的行为。

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

鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金

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:中国银行股份有限公司
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预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前请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: 基金名称, 鹏华中证TMT产业主题指数增强型证券投资基金

场内简称: -
基金代码: 000914
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

基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日期: 2017年06月26日
基金管理人基金登记机构: 鹏华基金管理有限公司

投资目标: 在有效控制风险的前提下,精选科技传媒主题上市公司进行投资,力求实现收益与长期资本增值。
投资策略: 1.资产配置策略:本基金将通过定量与定性相结合的方法,对宏观经济、行业景气度、市场估值水平、市场情绪等因素进行综合研判,在严格控制风险的前提下,动态调整资产配置比例,力争实现基金资产的长期增值。2.行业配置策略:本基金将重点关注科技、传媒、互联网等行业,并根据行业景气度、估值水平等因素,动态调整行业配置比例。3.个股选择策略:本基金将采用定量与定性相结合的方法,对个股的基本面、估值水平、成长性等因素进行综合研判,精选优质个股进行投资。4.风险控制策略:本基金将严格控制投资组合的波动率,通过分散投资、止损等方式,有效控制投资风险。5.其他投资策略:本基金将根据市场变化,灵活运用各种投资策略,力争实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准: 中证TMT产业主题指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征: 本基金属于中高风险,预期风险收益高于普通股票基金,但低于股票型基金。本基金的风险收益特征与中国公募基金市场整体风险收益特征相一致。

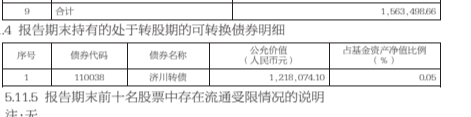
基金管理人: 鹏华基金管理有限公司
基金托管人: 招商银行股份有限公司
注:无。

3.1 主要财务指标

Table with 4 columns: 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, 2.本期公允价值变动收益, 3.本期基金净值增长率, 4.本期基金份额净值增长率

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。

3.2.1 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对比
注:业绩比较基准=中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。
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的对比



注:1.本基金基金合同于2017年06月26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

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1.任职日期和离任日期均以公告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的相关规定。
4.2 管理人对于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人利益的行为。

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
7.8月份受货币事件影响,加上终端消费数据整体偏弱,消费板块涨幅较多。本基金持仓结构均衡,消费板块占比高,7.8月份基金的回撤比例较多。在基金持仓上,目前的主要配置在消费和科技两大板块上。其中,在消费品细分行业中做了一定的调整,将地产相关的家电、家居等行业个股进行了清仓处理,增加了必需消费品的持仓比例。科技领域,三季度增配了通信和电子,主要围绕5G(PCB、主设备、天线)投资。

4.5 报告期内基金的投资组合报告
本基金本报告期内净值增长率为-10.69%,同期上证综指下跌0.92%,深证成指下跌10.43%,沪深300指数下跌12.05%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内,本基金存在连续六个工作日出现基金份额净值低于五千万元的情形,本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金资产净值比例

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

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: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

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

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 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 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 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

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.6.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的股指期货持仓尚未包含股指期货投资。
5.6.2 本基金股指期货投资的期末持仓
注:本基金基金合同的股指期货持仓尚未包含股指期货投资。
5.6.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金基金合同的国债期货交易尚未包含国债期货交易。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内前十名证券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。
5.9.2 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。
5.9.3 其他资产构成

鹏华新兴产业混合型证券投资基金

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

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预示其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料