

鹏华产业精选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

注:无。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年10月01日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-71,408,577.63
2.本期利润	-187,779,746.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1768
4.期末基金资产净值	765,476,024.00
5.期末基金份额总额	69,623,000.00

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。

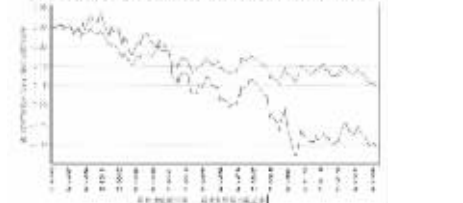
3.2 基金净值表现

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	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-18.07%	2.05%	-20.12%	1.16%	-11.84%
过去六个月	-18.07%	2.05%	-20.12%	1.16%	-11.84%
过去一年	-18.07%	2.05%	-20.12%	1.16%	-11.84%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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2018年05月09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规定的各项比例。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
王皓	鹏华基金基金经理	2018-06-19	12年	王皓先生,中国国籍,毕业于清华大学,2010年加入鹏华基金管理有限公司,曾任鹏华基金基金经理助理,2018年6月19日正式担任鹏华基金基金经理。王皓先生具有多年证券从业经验,曾任鹏华基金基金经理助理,负责鹏华基金的日常运作,对鹏华基金的投资策略和风险控制有深入的研究。王皓先生具有多年证券从业经验,曾任鹏华基金基金经理助理,负责鹏华基金的日常运作,对鹏华基金的投资策略和风险控制有深入的研究。

注:无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	621,343,676.28	80.96
2	其中:股票	621,343,676.28	80.96
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	103,240,152.86	13.46
8	其他资产	42,879,014.44	5.60
9	合计	767,462,843.58	100.00

注:无。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	27,148,196.94	3.53
B	采矿业	-	-
C	制造业	110,567,300.28	14.39
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	1,338,144.68	0.17
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	96,455,194.23	12.51
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,516,274.49	0.19
M	科学研究和技术服务业	71,644,342.06	9.29
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	卫生和社会工作	11,066,765.04	1.44
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,066,765.04	1.44
R	文化、体育和娱乐业	13,460,265.74	1.74
S	合计	229,900,691.14	29.77

注:1.在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,本着诚实信用、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,本基金未发生基金管理人管理的有关投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。

本基金采用指数基金的投资策略,在对基金申购赎回费的基础上,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

4.5.1 本报告期内基金净值增长率为-11.00%,业绩比较基准增长率为-10.80%。本报告期,基金年化跟踪误差为1.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:无。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2018年10月01日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-28,404,140.00
2.本期利润	-30,407,696.61
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0907
4.期末基金资产净值	360,176,346.00
5.期末基金份额总额	69,623,000.00

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。

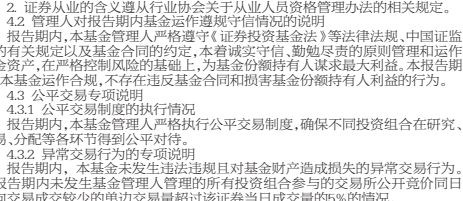
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-11.00%	1.88%	-12.88%	1.88%	-0.26%
过去六个月	-11.00%	1.88%	-12.88%	1.88%	-0.26%
过去一年	-11.00%	1.88%	-12.88%	1.88%	-0.26%

注:业绩比较基准=创业板指数收益率×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.在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,本着诚实信用、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,本基金未发生基金管理人管理的有关投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。

本基金采用指数基金的投资策略,在对基金申购赎回费的基础上,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

4.5.1 本报告期内基金净值增长率为-11.00%,业绩比较基准增长率为-10.80%。本报告期,基金年化跟踪误差为1.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:无。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2018年10月01日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-66,404,140.00
2.本期利润	-68,407,696.61
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0907
4.期末基金资产净值	360,176,346.00
5.期末基金份额总额	69,623,000.00

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。

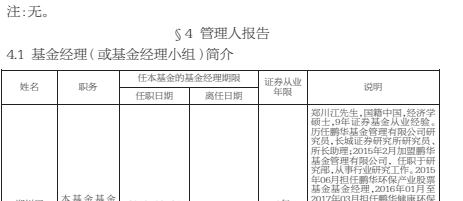
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%
过去六个月	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%
过去一年	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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.在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,本着诚实信用、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,本基金未发生基金管理人管理的有关投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。

本基金采用指数基金的投资策略,在对基金申购赎回费的基础上,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

4.5.1 本报告期内基金净值增长率为-11.00%,业绩比较基准增长率为-10.80%。本报告期,基金年化跟踪误差为1.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:无。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2018年10月01日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-66,404,140.00
2.本期利润	-68,407,696.61
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0907
4.期末基金资产净值	360,176,346.00
5.期末基金份额总额	69,623,000.00

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比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%
过去六个月	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%
过去一年	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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.在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,本着诚实信用、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,本基金未发生基金管理人管理的有关投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。

本基金采用指数基金的投资策略,在对基金申购赎回费的基础上,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

4.5.1 本报告期内基金净值增长率为-11.00%,业绩比较基准增长率为-10.80%。本报告期,基金年化跟踪误差为1.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:无。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2018年10月01日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-66,404,140.00
2.本期利润	-68,407,696.61
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0907
4.期末基金资产净值	360,176,346.00
5.期末基金份额总额	69,623,000.00

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比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%
过去六个月	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%
过去一年	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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.在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,本着诚实信用、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,本基金未发生基金管理人管理的有关投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。

本基金采用指数基金的投资策略,在对基金申购赎回费的基础上,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

4.5.1 本报告期内基金净值增长率为-11.00%,业绩比较基准增长率为-10.80%。本报告期,基金年化跟踪误差为1.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:无。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2018年10月01日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-66,404,140.00
2.本期利润	-68,407,696.61
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0907
4.期末基金资产净值	360,176,346.00
5.期末基金份额总额	69,623,000.00

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比较

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率-业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%
过去六个月	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%
过去一年	-11.00%	1.00%	-12.00%	1.00%	-0.26%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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.在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,本着诚实信用、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