

2018年12月31日
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
报告送达日期：2019年01月21日

1 重要提示
基金管理人的董事、监事、经理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。
本基金中财务资料未经审计。
本报告期自2018年10月01日起至12月31日。
§ 2 基金产品概况

2.1 基本情况

基金名称 鹏华研究驱动混合型证券投资基金

基金简称 鹏华研究驱动混合

基金主代码 000620

前端交易代码 -

后端交易代码 -

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2018年09月14日

报告期末基金资产总额 121,431,302,999

投资目标 在严格控制净值回撤的前提下，使基金持有人的资产实现增值能力，通过对行业基本面的深入分析，结合各行业的发展趋势，精选具有持续发展能力的公司，力争在控制风险的前提下，获得超越基准的收益。

1.0%配置比例，本基金将通过挑选通常被认为具有吸引力的股票（包括价值型股票、成长型股票、周期型股票等）以及债券、货币市场工具等固定收益类资产，同时根据宏观经济形势、并结合对大类资产的配置与组合策略，合理确定在基金资产中股票（包括A股和港股）、债券、现金等资产的配置比例，并结合各自资产的风险收益特征，通过定期调整资产配置比例，从而达到既满足资产配置需求，又能够降低整体风险的目的。

本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。

本基金中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月01日起至12月31日。

§ 3 基金产品概况

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10月01日-2018年12月31日

1.本期已实现收益 679,363,004

2.期间利润 -1,570,541,010

3.期末可供分配基金份额利润 129,465,597.90

4.期末基金资产净值 30,083

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.所列财务指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），费用计算方法参见本招募说明书。

3.2.1 本期报告期基金份额净值增长率及其与同期比较基准收益率的比较

前一阶段 业绩增长长期基准 业绩比较基准收益率差值

过去一个月 -16.65% -24.1% 1.20% -5.76% -0.67%

注：业绩比较基准=沪深300指数收益率×40%+恒生指数收益率(经汇率调整后)×40%+中证综合债指数收益率×20%

3.2.2 自基合同成立以来，来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

4.3 公平交易项目说明

4.3.1 公平交易执行情况

报告期内未发生公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金持有人数或基金资产净值变动情况

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) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 73,093,693.00 66.43

2 基金投资 - 73,093,693.00 66.43

3 固定收益投资 -

4 货币市场工具 -

5 金融衍生投资 -

6 金融商品投资 -

7 其他 -

注：1.本基金于2018年09月14日生效，截至本报告期末本基金基金合同尚未满一年，因此未进行定期报告。

2.本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。

3.报告书中的财务资料未经审计。

4.报告期自2018年10月01日起至12月31日。

§ 2 基金产品概况

2.1 基本情况

基金名称 鹏华兴定期开放混合型证券投资基金

基金简称 鹏华兴定期开放

基金主代码 000620

前端交易代码 -

后端交易代码 -

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2018年09月25日

报告期末基金资产总额 142,194,044.00

投资目标 在严格控制净值回撤的前提下，通过定期开放的模式保持适度流动，力争取得超越业绩基准的稳定收益。

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。

本基金中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月01日起至12月31日。

§ 3 基金产品概况

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10月01日-2018年12月31日

1.本期已实现收益 -6,343,164.10

2.期间利润 -0.0416

3.期末可供分配基金份额利润 146,000,763.97

4.期末基金资产净值 1,027.00

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.所列财务指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），费用计算方法参见本招募说明书。

3.2.1 本期报告期基金份额净值增长率及其与同期比较基准收益率的比较

前一阶段 业绩增长长期基准 业绩比较基准收益率差值

过去一个月 -3.00% 0.34% -1.70% 0.49% -1.10%

注：业绩比较基准=沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%

3.2.2 自基合同成立以来，来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

4.3 公平交易项目说明

4.3.1 公平交易执行情况

报告期内未发生公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金持有人数或基金资产净值变动情况

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) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 73,093,693.00 66.43

2 基金投资 - 73,093,693.00 66.43

3 固定收益投资 -

4 货币市场工具 -

5 金融衍生投资 -

6 金融商品投资 -

7 其他 -

注：1.本基金于2018年09月25日生效，截至本报告期末本基金基金合同尚未满一年，因此未进行定期报告。

2.本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。

3.报告书中的财务资料未经审计。

4.报告期自2018年10月01日起至12月31日。

§ 2 基金产品概况

2.1 基本情况

基金名称 鹏华兴定期开放混合型证券投资基金

基金简称 鹏华兴定期开放

基金主代码 000620

前端交易代码 -

后端交易代码 -

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2018年09月25日

报告期末基金资产总额 720,841,807.09

投资目标 在严格控制净值回撤的前提下，通过定期开放的模式保持适度流动，力争取得超越业绩基准的稳定收益。

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。

本基金中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月01日起至12月31日。

§ 3 基金产品概况

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10月01日-2018年12月31日

1.本期已实现收益 -67,446.17

2.期间利润 -0.0000

3.期末可供分配基金份额利润 776,846,164.00

4.期末基金资产净值 1,008.00

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.所列财务指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），费用计算方法参见本招募说明书。

3.2.1 本期报告期基金份额净值增长率及其与同期比较基准收益率的比较

前一阶段 业绩增长长期基准 业绩比较基准收益率差值

过去一个月 -0.01% 0.17% -1.00% 1.00% -0.99%

注：业绩比较基准=沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%

3.2.2 自基合同成立以来，来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的比较

4.3 公平交易项目说明

4.3.1 公平交易执行情况

报告期内未发生公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金持有人数或基金资产净值变动情况

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) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 57,099,989.00 6.82

2 基金投资 - 57,099,989.00 6.82

3 固定收益投资 795,947,500.00 90.27

4 货币市场工具 795,947,500.00 90.27

5 金融衍生投资 -

6 金融商品投资 -

7 其他 -

注：1.本基金于2018年09月25日生效，截至本报告期末本基金基金合同尚未满一年，因此未进行定期报告。