

## 鹏 华 新 兴 产 业 混 合 型 证 券 投 资 基 金 2018年年度报告摘要

单位:人民币元

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

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

議至的以任並與計予代表與未來表现。及沒有內原。及沒者在計戶以及決策則於打和國 該本基金的用發說則书及其更新。 本年度报告擴要擴自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。 普生未遭中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了"标准无保 留意见"的审计报告。

L"的审计报告。 本报告期自2018年01月01日起至12月31日。

2.1 基金基本情况	§ 2 基金简介	
基金简称	鹏华新兴产业混合	
基金主代码	206009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月15日	
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	
报告期末基金份额总 额	,192,743,371.95 <del>()</del>	
基金合同存续期	不定期	
2.2 基金产品说明		
投资目标	在通度控制风险并保持良好流动性的前提下,挖捆未来推动经济发展的新兴产业并从中精选优质个股,力求超额收益与长期资本增值。	
	1、资产配置策略 本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、	

THE STATE OF THE S	
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	在通度控制风险并保持良好流动性的前提下,挖掘未来推动; 济发展的新兴产业并从中精选优质个股,力求超额收益与长 资本增值。
投资策略	1. 统产配置编修、本基金通过对宏观经济、模观经济运行会势 政策环境、利率走势、证券市场业场及证券市起则原的商务。 性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益 进行分析评估。运用定量及这些相信合约手段、制定股票。 务 现金参大类资产之间的企置任何,则整分及则则有整色温 2. 股票投资编修、基金通过规则。分析经济运行态势,经济 第以及产业结构的优化分级、则则经济发现过种具有良势 展别限的新兴产以及相关上市公司、针对各类公司的不同 证. 通过自上而下及目下出。杜特兰的方法随处出货和人工 发展配置,则限结构度证券。我取得处主动的空资格。在一 发展配置,则限结构度证券。我取得处主动的资资格。在一 发展配置,则限结构度证券。我取得处主动的资资格。在 则能分的的增压, 发掘取利用市场失衡推作的投资价金。 现余转任合管信。4. 权证产品投资储金。 就会必要。 一、"然后"以下,从一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个
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	本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币型金、债券基金,低于股票型基金,为证券投资基金中具有中高质验、中高收益的投资品种。

		坝目	基金官埋入	基並代官人
	名称		鹏华基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
	信息披	姓名	张戈	张燕
	露负责 人	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
		电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
	客户服务	电话	4006788999	95555

登载基金年度报告正文的管理人互联 tp://www.phfund.com

基金年度报告备置地点

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况		
3.1 主要会计数据和财务指标		
	金额单位:人民市	玩

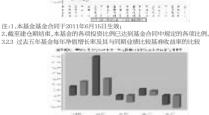
2016年	2017年	2018年	3.1.1 期 间数据和 指标
11,329,411.16	30,284,027.18	-209,971,639.91	本期已实 现收益
-56,559,973.19	122,639,398.05	-385,380,306.15	本期利润
-0.1069	0.2510	-0.4705	加权平均 基金份额 本期利润
-8.54%	11.86%	-16.71%	本期基金 份额净值 增长率
2016年末	2017年末	2018年末	3.12 期 末数据和 指标
0.9507	1.0158	0.6361	期末可供 分配基金 份額利润
1,071,352,055.08	984,005,512.47	2,091,806,894.29	期末基金 资产净值
2.057	2.301	1.754	期末基金 份额净值

注:(1) 本则已实现成益指益金型利息收入, 投资收益。其他权人(个管公允的"恒变动收益") 扣除相关费用后的金额 北州利润分本州巴之实现收益加上本明公允价值变动收益。 (2) 所述基金业缴制标不包括持有人从购成交易基金的各项费用(例如, 开放式基金的申购集团表 基金转换等等), 计发射启实示效益水平现低于所列数字。 (3)表中的"期末"均指报告期最后一日,即12月31日, 无论该日是否为开放日或交易所的

3.2.1 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	份额净值 增长率① (%)	份额净值 增长率标 准差② (%)	业绩比较基 准收益率③ (%)	业绩比较基准 收益率标准差 ④(%)	①-③ (%)	(2-4) (%)
过去三个月	-5.41	1.56	-10.44	1.32	5.03	0.24
过去六个月	-15.50	1.40	-14.50	1.20	-1.00	0.20
过去一年	-16.71	1.39	-22.65	1.12	5.94	0.27
过去三年	-14.79	1.30	-27.17	1.06	12.38	0.24
过去五年	67.52	1.60	18.46	1.32	49.06	0.28
自基金成立 起至今	106.55	1.42	13.59	1.27	92.96	0.15

率变动的比较



注:合同生效当年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算

注:尤。 3.4 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10份基金份額 分红数	现金形式发放总 額	再投资形式发放 总额	年度利润分配合 计	备注
2018 年	1.6680	162,647,715.47	30,007,733.97	192,655,449.44	-
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	_	_	_	_	-
合计	1.6680	162,647,715.47	30,007,733.97	192,655,449.44	_

41 基金管理人及基金经理情况

4.1 基金管理人及基金经明情况 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验 斯华基金管理者限公司成立于1998 年12 月22 日,业务范围包括基金募集、基金销售、 资产管理及中国证监会许可的其他业务,截止本报告明末、公司股东由国信证券股份有限公 司,意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR Sp.A.)、深圳市北融信投 资发展有限公司组成、公司性度为中外合资企业。公司原注册资本8,000 万元人民币,后于 2001年9月完成增资扩股,增至15,000 万元人民币。截至2018年12月,公司管理资产总规模 达到5,164.62亿元,管理146只公募基金、10.74亿元,被上30亿元之7、公司重发》。必晚 达到5,164.62亿元,管理146只公募基金、10.74全国社保及股组合。只基本学老保险投资组 合。经过20年投资管理基金、在基金投资,风险控制专方面积累了丰富经验。 41.2 基金处理(或基金处理),以及基金处理的理局个 数据。

姓名	职务	理)排	HPR	旧好从业中	说明
		任职日期	离任日期	PR	
梁浩	本基金基 金经理 3期和 <u></u> 聚件F	2011-07-14	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	10	深治完生。国籍,经济学基金服衍。 10年证券等基金服衍。 10年证券。管理信息 (16里次),在10年证券。 10年证券。管理信息 (16里次),在10年还,10年还,10年还,10年还,10年还,10年还,10年还,10年还,

合同和损害基金份额持有利益的行为。 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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;但让朝成丛壁业盘金经期的,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。
42. 管理人对报告期内本基金运作遵规守信前恋的说明
报告期内、本基金管理人等检查令证券收载基金法》等法律法规,中国证监会的有关规定以及基金合同的约定,本替被实守信,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,为基金份额持有人以求最大利益。本报告期内,本基金运作合规,不存在违反基金

43.1 公平交易制度和控制方法 根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《鹏华基

金管理有限公司公平交易管理规定》,将公司所管理的封闭式基金,开放式基金,社保组合、特定客户等产管理组合等不同资产组合的授权。研究分析、投资决策、交易执行、业债评估等投资管理运动的从公平交易管理。在业务资程和岗位更中市地区公平交易的跨域则则和控制活动,建立对公平交易的块价、监督发审核流程,严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究体行、1、公司使用唯一的研究报告发布平价。研究报告管理平价、确保各投资组合在获得投资信息在实现,实现不是 

4.32 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 各本节得别公平对待。同时,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求、公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现存在违反公平交易原则的证明

4.33 异常交易行为的专项说明 报告期内,本基金未发生违法进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 交交较少的单边交易最超过该证券当日成交量的5%的情况。 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和运行处于 4.4 管理人对报告期内基金投资策略和运行分析

4.4 国地人对拉自用内基金的投资策略和业绩表现的说明 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析 2018年,我国宏观经济形势发生了较多变化、增速下行的态势越来越明显。上半年突如其 来的中变贸易战在下半年愈演愈烈,不断给市场传递负面信息。在这种复杂的环境下,我们坚 持续任的目下而上,精造个股的原则,为解统造出一些未来几年格局较好。和稳定的公司。 我们增持并稳定持有了云计算相关的标的,我们增加了对消费股份研究和覆盖。在逆势中 转得一些故者,我们还通逻辑与了部分交业级,对之间的重色的,我们保持者紧密的跟踪。经历 过2012年至2015年的经济下行和2016年至2018年上半年的经济上行,我们的投资理念,投资 方法,研究方法经过市场的统礼,愈加清晰和坚定。 4.4.2 报告期内基金的业绩表现 报告期内,本基金净值增长率—16.71%。同期上证综指涨跌幅为—24.59%,深证成指涨跌 概为—34.42%,必需公的指数逐渐到为—25.31%。 4.5 管理人对宏观经济。证券市场及行业走势的商业展量。 我们从为"2019年是中级经济人高速增长到中遗增长的转折年,经济增速持续探底下行 难以避免,过去几年,地产的过度繁荣及其对宏观经济潜在增长水平的遗支将会持续短观,上 市公司整体金费用也将受到影响。

印公司建华延州屯村交到影响。 虽然宏观低涨。但我们仍能看到不少经营稳健、积极寻求创新的公司,其经营格局受宏观 经济影响并不显著。同时考虑到市场估值整体处于历史底部,我们对2019年的权益市场持谨

程(可能) 4.6 管理人人对报告期内基金估值程序等事项的说明 1. 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述 (1) 日常估值流程 基金的估值由基金会计负责,基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体,独立 建账、独立体院。 建账、独立体院。 保证不同基金之间在品牌经过。 张沙区、党公规、张师已基金等方面相互独立 立、基金会计核算独立于公司会计核算、基金会计核算采用专用的财务核算软年系统进行基金 核算及帐务处理。每日按时接收成交数据及权益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金 管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式、每日设据金的会计核算、基金估值 等与托管银行进行核对;每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除 设有专职基金会计核算岗外,还设有基金会计复核岗位,负责基金会计核算的日常事后复核工

设有专职基金会计核算的外, 还设有基金会计整核岗位,负责基金会计核算的日常事后复核工作。确保基金合性核算沉思, 配給的基金会计量各会计资格和基金从业资格, 在基金核算与估值方面常搬了丰富的知识和经验,熟悉及了解基金估值法规,政策和方法。 (2.)特殊业务估值流程 规则中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定,本公司成立停脚股票等没有市价的投资品种估值小组,成员由基金经理,行业研究员,监察稽核部。金融工程师,登记结算部相关人员组成。 2.基金经理参与成决定基金目常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论,发表相关意见和建议,与估值小组成员共

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

1.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明1、截止本报告期末,本基金期末可供分配利润为758,649,163.77元,期末基金份额净值

元。 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

§ 5 托管人报告 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明: 招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管 职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管

资产。

5. 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
指商银行根据法律法规,托管协议的灾产的投资监督条款、对托管产品的投资行为进行监
着并根据监管课来题行报告义务。
指商银行按照托管协议设定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本
产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。
本年度报告中利司分配书或其实,推确。
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实,推确几完整发表意见
本年度报告中财务制作。为值表则,财务会计报告,润润分配、投资组合报告等内容真实、
准确和完整、不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遭遇。

7.1 资产负债表 会计主体:鹏华新兴产业混合型证券投资基金 报告截止曰:2018年12月31日

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		518,780,020.02	153,220,077.08
结算备付金		1,319,825.95	2,998,718.10
存出保证金		706,292.70	447,983.83
交易性金融资产		1,582,226,859.56	833,419,627.43
其中:股票投资		1,581,124,961.06	832,314,293.63
基金投资		_	_
债券投资		1,101,898.50	1,105,333.80
资产支持证券投资		-	_
贵金属投资		_	_
衍生金融资产		_	_
买人返售金融资产		_	_
应收证券清算款		_	_
应收利息		117,101.81	36,950.84
应收股利		_	
应收申购款		430,605.75	1,009,243.30
递延所得税资产		_	
其他资产		_	
资产总计		2,103,580,705.79	991,132,600.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	_
交易性金融负债		_	_
衍生金融负债		_	_
卖出回购金融资产款		_	_
应付证券清算款		6,200,148.78	_
应付赎回款		618,993.45	4,051,840.66
应付管理人报酬		2,673,022.65	1,271,076.32
应付托管费		445,503.78	211,846.04
应付销售服务费		_	
应付交易费用		1,434,071.33	988,005.27
应交税费		11.46	
应付利息		_	_
应付利润		_	_
递延所得税负债		_	_
其他负债		402,060.05	604,319.82
负债合计		11,773,811.50	7,127,088.11
所有者权益:		, ,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	, , ,
实收基金		1,192,743,371.95	427,641,331.61
未分配利润	<b>†</b>	899,063,522.34	556,364,180.86
所有者权益合计		2,091,806,894.29	984,005,512.47
负债和所有者权益总计		2,103,580,705.79	991,132,600.58
主: 报告截止日2018年:	O D O O D		

8年1月1日至2018 12日31日 148,499,68 .利息收/ 其中:存款利息收/ 责券利息收人 工人返售金融资产收 -176.929.441.4 54.035.807. 中:股票投资收益 生工具收益 -175,408,666. 92,355,370 5.其他收入(损失以 508,290. 592,284.4 减.二.费用 . 管理人报酬 15,646,184 4,264,739 7,184,264.49 1. 交易费用 6,471,15 422,232.8 422,136.3

-385.380.306.

122,639,398

会计主体:鹏华新兴产业混合型证券投资基金 本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

、净利润(净亏损 -"号填列)

家收基金 427,641,331.61 - 765,102,040.34 999,154,590.89 234,052,550.55 - 192,743,371.95	来分配利润 556,364,190.96 -385,380,306.15 920,735,097.07 1,199,223,025.00 -278,487,927.93 -192,655,449.44 899,063,522.34 上年度可比剛師	-385,380,306.16  1,685,837,137.41  2,198,377,615.88  -512,540,478.48  -192,665,449.44  2,091,806,894.25
765,102,040.34 999,154,590.89 234,052,550.55 - 192,743,371.95	-385,380,306.15 920,735,097.07 1,199,223,025.00 -278,487,927.93 -192,665,449.44 上年度可比期间	1,685,837,137.41 2,198,377,615.88 -512,540,478.48 -192,655,449.44 2,091,806,894.29
999, 154, 590.89 2234, 052, 550.55 - 192, 743, 371.95	920,735,097.07  1,199,223,025.00  -278,487,927.93  -192,655,449.44  899,063,522.34 上年度可比期间	2,198,377,615.88 -512,540,478.48 -192,655,449.44 2,091,806,894.28
999, 154, 590.89 2234, 052, 550.55 - 192, 743, 371.95	1,199,223,025.00 -278,487,927.93 -192,655,449.44 899,063,522.34 上年度可比期间	2,091,806,894.29
	-278,487,927.93 -192,655,449.44 899,063,522.34 上年度可比期间	-512,540,478.48 -192,655,449.44 2,091,806,894.29
.192,743,371.95	-192,655,449.44 899,063,522.34 上年度可比期间	-192,655,449.44 2,091,806,894.29
20	899,063,522.34 上年度可比期间	-192,655,449.44 2,091,806,894.29
20	上年度可比期间	
空板其今	2017年1月1日至2017年12月31日	
344人2532	未分配利润	所有者权益合计
520,947,265.95	550,404,789.13	1,071,352,055.08
-	122,639,398.05	122,639,398.05
-93,305,934.34	-116,680,006.32	-209,985,940.66
236,287,071.78	266,748,763.70	503,035,835.48
329,593,006.12	-383,428,770.02	-713,021,776.14
-	-	_
	236,287,071.78	236,287,071.78 266,748,763.70

主管会计工作负责人 基金管理人负责人 7.4 报表附注 7.4.1 基金基本情况

证综合债指数收益率×25%。 本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报

7.4.2 会计报表的编制基础 本基金的财务报表程限财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则一基 证准则》,各项具体会计准则及相关规定以下合称"企业会计准则"),中国证监会颁布的《证 程义强金信息政策XBRJ(粮废称马号(年度报告者),但证券投资基金信息政策公司, "百商条"中国最金边协会》,然而作的《证券投资基金会计模实业务看引》、《哪年前关产业程 设证券投资基金基金信则》和任财务报表的注中听列示的中国证监会、中国基金业协会发 "尚有关规定及计时报金行业实务操作编制。 本财务报表以持续经营为基础编制。 本财务报表以持续经营为基础编制。 本财务报表以持续经营为基础编制。 本财务报表以持续经营为基础编制。 不3.3 课债业会计准规划定的有关 第31日的财务状况以及2018年度的经营成果报基金净值变动情况等有关信息。 7.44 本报告则所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明 无。

元。 7.4.4.2 会计估计变更的说明

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司 ("鹏华基金公司")	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司("国信证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:1.本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。 2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 74.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注:无。 7.4.7.1.2 债券交易

注:无。 7.4.7.1.3 债券回购交易 注:无

注:无。 7.4.7.1.4 权证交易

7.4.7.2 关联方报酬 7.4.7.2.1 基金管理费

2018年1月1日至2018年12 月31日 当期发生的基金应支付的管

中央 4.053.46728b 4.576.059331 注:1支付基金管理人爾华基金公司的管理人與申我率为150%。连日日提,按月支付。 理理费=前一日基金统产净值×150%。当年天被、 2. 根据《开放式选择投资基金销售费用管理规定》,基金管理人依据销售机构销售基金 有建提限。产证代例客户维护成,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生 其关键用、客户维护费从基金管理费中列支。 7.4722 基金任管费

			十匹・バレ	
	项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日	
	当期发生的基金应支付的托管 费	4,264,739.54	2,607,697.42	
前一	注:支付基金托管人招商银行的 日基金资产净值×0.25% = 当约 74.7.2.3 销售服务费 注:无。 74.7.3 与关联方进行银行间同 34	<b>F</b> 天数。	日计提,按月支付。日托管	费=

2018年1月1日至 当期利息收入 期末余額 3,015,000.25 153,220,077.08 7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

	203	18年1月1日至20	)18年12月31日			
				基金在承销期内买人		
关联方名称	证券代码 证券名称		发行方式	数量(単位: 张 )	总金额	
-	-	-	-	-	-	
	203	上年度可! 17年1月1日至20				
				基金在承報	期内买人	
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量(単位: 张 )	总金额	
国信证券	002839	张家港行	网下申购	14,352	62,718.24	
国信证券	002882	金龙羽	网下申购	2,966	18,389.20	
7.4.7.7 其他关联	交易事项的说	初				

证券 代码	证券名称	成功 认购日	可流通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (位: 股)	期末 成本总 额	期末估 值总额	备注
6018 60	紫金银行	2018-12 -20	2019-01 -03	新股 流通 受限	3.14	3.14	15, 970	50, 145.80	50, 145.80	-

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购 注:无。 7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购 7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 公允价值 金融工具公允价值计量的方法 价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属

公元川區日 建口水川區 14500000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 1450000 14500

第三层次)。
《介伯·伯斯展层次间的重大变动 未益金以下,第二层次61.665、526.767、美三层次)。
《印金人尔伯·伯斯展层次间的重大变动 未益金以导致各层次之间转换的明点。 对于证券交易所上价的股票和债券,若出现重大事项停除。交易不活跃(经括张跌停时的 交易不活跃,设施于非公开投行等的成,本益企产会于停脚日至交易不远跌(经括张跌停时的 不可观察输入值对于大灾,在一个大厅的一个大厅,不可观察输入值对于大厅的信仰人房。 展次 并根据付属槽中果用的 不可观察输入值对于大厅他们的影响起度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。 。 第三层次公允价值余额和本期变动金额

70。 (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具 于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31

。 ),不以公允价值计量的金融工具 以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与

(i) 各层次金融工具公允价值 于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为15.632,176。713.76元。属于第二层次的余额为50.145.80元。无属于第三层次的余额2017年12月31日;第一层次771,854,100.65元。第二层次61,565,526.78元,充第三层次。

CDF1担相左似小。 (2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。 ◎ 8 投资组合报告 8.1 期末基金资产组合情况

			金额单位:人民币元
序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,581,124,961.06	75.16
	其中:股票	1,581,124,961.06	75.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,101,898.50	0.05
	其中:债券	1,101,898.50	0.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买人返售金融资产		_
	其中:买断式回购的买人返售金融 资产	-	_
7	银行存款和结算备付金合计	520,099,845.97	24.72
8	其他各项资产	1,254,000.26	0.06
9	合计	2,103,580,705.79	100.00

代码	行业类别	行业类别 公允价值(元)	
Α	农、林、牧、渔业	91,243,982.02	4.36
В	采矿业	-	-
C	制造业	1,194,261,621.27	57.09
D	电力、热力、燃气及水生产 和供应业	-	-
E	建筑业	60,727.90	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	-
Ι	信息传输、软件和信息技术 服务业	177,575,892.08	8.49
J	金融业	307,917.74	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	102,271,324.14	4.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理 业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务 业	-	-
P	教育	_	-
Ω	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,403,495.91	0.74
S	综合	_	-
	合计	1,581,124,961.06	75.59

注:无。 8.3 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纸

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(%)
1	002878	元隆雅图	4,029,603	102,271, 324.14	4.89
2	002705	新宝股份	10,990,597	100,893, 680.46	4.82
3	002851	麦格米特	4,553,292	96,529, 790.40	4.61
4	300577	开润股份	3,088,407	96,296, 530.26	4.60
5	300047	天源迪科	8,603,599	95,585, 984.89	4.57
6	300170	汉得信息	8,370,833	81,866, 746.74	3.91
7	603043	广州酒家	2,646,929	71,678, 837.32	3.43
8	600566	济川药业	1,907,273	63,950, 863.69	3.06
9	300207	欣旺达	6,869,775	59,011, 367.25	2.82
10	300498	温氏股份	1,924,137	50,373, 906.66	2.41
投资者	欲了解本报	告期末基金投	资的所有股票	限明细,应阅读3	<b>登载于鹏华基金管</b> 理

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动8.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细 本期累计买人金 占期初基金资产净值比例 额 (%) 股票名称

序号

股票代码

2	002475	立讯精密	114,796,855.31	11.67
3	300047	天源迪科	112,278,419.17	11.41
4	603043	广州酒家	107,312,414.81	10.91
5	601601	中国太保	97,950,339.64	9.95
6	002878	元隆雅图	95,988,840.10	9.75
7	300207	欣旺达	86,348,749.34	8.78
8	002851	麦格米特	73,755,605.69	7.50
9	300170	汉得信息	73,313,328.06	7.45
10	601231	环旭电子	73,053,711.36	7.42
11	002831	裕同科技	72,884,357.46	7.41
12	002614	奥佳华	72,223,796.11	7.34
13	002624	完美世界	70,374,994.24	7.15
14	601318	中国平安	69,549,494.45	7.07
15	600104	上汽集团	68,119,551.14	6.92
16	000063	中兴通讯	64,654,716.00	6.57
17	600030	中信证券	63,125,639.00	6.42
18	300470	日机密封	60,579,822.71	6.16
19	300408	三环集团	58,186,864.09	5.91
20	002594	比亚迪	57,196,493.37	5.81
21	300687	赛意信息	53,949,292.37	5.48
22	603799	华友钴业	53,409,886.62	5.43
23	603345	安井食品	50,322,150.32	5.11
24	002343	慈文传媒	49,497,305.84	5.03
25	600566	济川药业	49,148,855.68	4.99
26	300498	温氏股份	48,987,897.88	4.98
27	000661	长春高新	48,647,502.19	4.94
28	300618	寒锐钴业	46,380,214.96	4.71
29	300558	贝达药业	46,056,214.03	4.68
30	300724	捷佳伟创	43,378,473.95	4.41
31	300326	凯利泰	43,268,305.63	4.40
32	002299	圣农发展	42,783,585,87	4.35
33	600419	天润乳业	38,457,047.90	3.91
34	002616	长青集团	36,170,868.01	3.68
35	300628	亿联网络	34,992,826.91	3.56
36	002709	天賜材料	32,794,059.99	3.33
37	002396	星网锐捷	32,788,169.93	3.33
38	300357	我武生物	32,683,121.60	3.32
39	002127	南极电商	28,807,598.66	2.93
40	603826	坤彩科技	27,499,552.65	2.79
41	600771	广誉远	27,237,888.74	2.77
42	300699	光威复材	25,282,441.50	2.57
43	002027	分众传媒	24,940,504.10	2.53
44	000513	丽珠集团	23,148,031.78	2.35
45	000802	北京文化	22,911,445.50	2.33
46	603538	美诺华	21,829,540.07	2.22
47	002157	正邦科技	21,398,323.88	2.17
48	603228	景旺电子	20,994,821.38	2.13
49	603989	艾华集团	20,939,911.81	2.13
50	002419	天虹股份	20,503,271.18	2.08
51	600048	保利地产	19,814,209.00	2.01

序号	股票代 码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601601	中国太保	107,916,811.12	10.97
2	002027	分众传媒	80,913,960.19	8.22
3	601231	环旭电子	69,324,440.20	7.05
4	601318	中国平安	67,925,300.72	6.90
5	002475	立讯精密	65,477,435.77	6.65
6	600104	上汽集团	60,876,521.48	6.19
7	002396	星网锐捷	60,034,050.98	6.10
8	600030	中信证券	59,363,868.50	6.03
9	002594	比亚迪	55,417,493.47	5.63
10	002624	完美世界	54,360,759.44	5.52
11	300408	三环集团	50,755,396.72	5.16
12	002343	慈文传媒	50,405,564.00	5.12
13	000661	长春高新	48,650,878.95	4.94
14	300687	赛意信息	44,244,575.57	4.50
15	000063	中兴通讯	39,413,746.93	4.01
16	603043	广州酒家	38,572,562.00	3.92
17	603826	坤彩科技	36,807,830.04	3.74
18	002831	裕同科技	35,758,946.90	3.63
19	603799	华友钴业	34,524,784.07	3.51
20	600419	天润乳业	34,356,976.23	3.49
21	000802	北京文化	32,660,486.55	3.32
22	300618	寒锐钴业	32,388,971.34	3.29
23	002709	天赐材料	29,049,759.17	2.95
24	002127	南极电商	25,172,008.54	2.56
25	000813	德展健康	24,297,595.49	2.47
26	300630	普利制药	24,121,219.78	2.45
27	603883	老百姓	23,730,707.50	2.41
28	600771	广誉远	23,387,189.60	2.38
29	300207	欣旺达	23,135,105.38	2.35
30	603538	美诺华	21,966,254.95	2.23
31	002419	天虹股份	21.727.735.24	2.21

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额 买入股票成本(成交)总额 卖出股票收入(成交)总额 1,823,876,282.17 E:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考

生金资产净值比例 (%)	公允价值	债券品种	序号
_	-	国家债券	1
_	-	央行票据	2
_	-	金融债券	3
_	-	其中:政策性金融债	
_	-	企业债券	4
_	-	企业短期融资券	5
-	-	中期票据	6
0.08	1,101,898.50	可转债(可交换债)	7
_	-	同业存单	8
_	-	其他	9
0.05	1,101,898.50	合计	10

9	其他			-		-	
10	合i	+	1,10	1,898.50		0.05	
6 期末	天按公允价值占基	金资产净值	七例大小排序	的前五名		月细  :额单位:人民	· :市:
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公分	论价值	占基金资产 净值比例 (%)	
1	110038	济川转债	10,410	1,	101,898.50	0.05	
7 期末	交按公允价值占基	金资产净值	七例大小排序	的前十名	资产支持证	E券投资明细	

3.8 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贵金属投资明细

ェ:元。 3.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和股益明组 注:本基金基金合同的投资范围尚未包会股指期货投资。 8.10.2 本基金投资股捐期货的投资政策 本基金基金合同的投资范围尚未包含股捐期货投资。 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易将6次总明 8.11.1 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投资。 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和股益明细 注:本基金基金合同的投资范围债未包含国债期货投资。 8.11.3 本期国债期货投资评价

8.12 投资组合报告附注
8.12.12 济川药业本次公告源因为收到此前参州市环境保护局出真的(参州市环境保护局费收正游社等为块空书(参环市改字(2018)2-67号)》。具体情况说明如下、2018年7月3-4日,泰州市环境保护局分公司废水、废渣及废气的处理情况进行了现场检查、根据《参学市环场监测的监测报信、优惠(今)字(2018)第(704)》)。济川的业团有限公司废气排放口(西广)非甲烷总经排放农度均值起标50.08倍。针对上述情况。泰州市环境保护局于为了日口出真(《参州市环境保护局费令设正违法行为决定书(参环费次字(2018)2-57号)》,指出公司开发区分下污水处理设施废气处理是微排放口非常规念经因予超过了国家规定的水气污染综合排放标题,费令公司这即停止超标排放下气污染物行为。公司疾知上达情况后,立即进行"疲坏"为老托江苏泰市检测技术有限处合同常州分公司进行了相关结果检测、根据其2018年7月17日出真的(检测报告(17514)201811066号)》,公司开发人是引发的报告, 了相关结果检测。根据其2018年7月17日出具的《检测报告《TCH (2018)1068号》)。公司开发区分厂污水处型轮廉空处型装置推放工事性综总经的排放放废和排放速率均含气国案机关标准。2018年7月31日,泰州市环境能产局针对公司整改情况进行了进一步检查、根据《泰兴市环境监测站监测站监测报告(环监(气)字(2018)第(089)号)》。公司上述排放口的非甲烷总经排放改度符合国家东港要求。另外,泰州市环境保护局在现场检查中提出。公司中海车间两套公司的收装置的不派性尾气经收集后,未使用污染纺油设施直接高空排放以及出激室无组织标告。

度气未收集处理。 对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该公司,认为公司的上述违

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管型人长明跟踪研究该公司,认为公司的上述违 银行为涉及的开发区分于主要力中移提取在间和眼科有车间,主要进行前能查消失口服被等 产品的中药提取以及强占城泊酸铁原料终生产。泰州市环境较早周对公司出租的营令改正决 定不属于重大行政处罚、不涉及停工停产,也未影响公司正常生产经营,对公司并不产生实质 性影响。上途遗告对该公司股票的投资价值不产生重大影响、该公司的废气能放设施已进行安 装调整、严格执行国家规定的大气污染综合排放标准,符合法律法规和公司制度的规定。 8.122 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

债券代码

本公司高级管理人员、基金投资和研究

本报告期基金总申购份额

序号	名称	金額
1	存出保证金	706,292.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	117,101.81
5	应收申购款	430,605.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,254,000.26
8.12.4 期末持	有的处于转股期的可转拍	<b>英债券明细</b>

1 110038 济川转债 3.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

公允价值

持有基金份额总量的数量区间(万份)

债券名称

由于四會五人的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。 §9基金份额持有人信息 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

中均持有的 基金份额 持有份额 持有份额 期末基金管理人的从业人员 持有份额总数

基金管理人所有从业人员持有本基 2,921,395.5 金 上: 截至本报告期末,本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证 

本基金基金经理持有本开放式基金

基金会同生效日(2011年6日15日 1,361,139,361,80

本报告期基金拆分变动份额 (份) 域少以 "–" 填列 ) 1,192,743,371.9 § 11 重大事件揭示 2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

3. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 标报告用无涉及对公司运营更及基金运作产生重大影响的,与本基金管理人、基金财 发生。 空、基金托管业务相关的诉讼事 1.4 基金投资策略的改变 本基金投资策略未改变。

1.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

股票交易 应支付该券商

券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	金总量的比例	备注
天风证券	1	1,272,335, 301.55	26.77%	1,159,479.76	27.44%	-
中泰证券	2	671,140,311.74	14.12%	611,611.60	14.47%	-
东 方 财 富 证券	1	563,252,602.90	11.85%	456,960.76	10.81%	-
安信证券	2	522,056,579.59	10.99%	475,740.71	11.26%	-
爱建证券	1	474,899,922.03	9.99%	385,286.01	9.12%	本报 告期 新增
方正证券	1	287,959,030.94	6.06%	262,416.48	6.21%	-
广发证券	1	260,948,646.95	5.49%	237,799.83	5.63%	-
平安证券	1	229,324,192.21	4.83%	208,984.10	4.95%	-
东北证券	1	187,802,976.70	3.95%	171,143.50	4.05%	-
国金证券	1	137,273,437.20	2.89%	125,096.21	2.96%	-
招商证券	1	134,130,503.14	2.82%	122,231.13	2.89%	-
山西证券	1	11,042,906.00	0.23%	8,959.00	0.21%	本报 告期 新增
西南证券	2	_	-	-	_	-
东方证券	1	_	-	-	_	-
浙商证券	1	_	-	-	-	-
川财证券	1	_	-	-	_	-
中信建投	1	_	-	_	-	-

3 这時交易甲2017程2年: 我公司根据上述标准,設定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部 门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比,评比内容包括,提供研究报告預量,数量,及时 性及提供研究服务主动性和服整等物产,并依据甲比结果确定交易单节交易的具体情况。我公 古在比较了多家证券经营机构的财务状况,经营状况。研究平后,向券籍租用交易单元作为

基金专用交易单元。 11.72 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况注:无。

在:元。 § 12 影响投资者决策的其他重要信息 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%[ 报告期内持有基金份额变化情况

有的基金份额所占比例过于集中时,可能会因某单一基金份额持有。 金净值刚烈波动,甚至可能引发基金流动性风险,基金管理人可能无 以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时 、申购份额包含基金申购份额、基金转换人份额、强制调增份额、场内买人份额、指数

赎回 份额

分级基金合并份额和红利再投; 2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额和指数分