浦银安盛日日鑫货币市场基金

2019年第二季度报告

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16日

§1 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月12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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛日日鑫
基金主代码	003228
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月30日
报告期末基金份额总额	29,237,262,265.79份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	(1)滚动配置策略 本基金将根据具体投资品种的市场特性采用持续投资的方法,既能提高基金资产变现能力的稳定性,又能保证基金资产收益率与市场利率的基本一致。 (2)久期控制策略 本基金将根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期。在预期利率上升时,缩短基金资产的久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期利率下降时,延长基金资产的久期,以获取资本利得或锁定较高的收益率。 (3)套利策略 套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别,在满足基金目身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。 (4)时机选择策略 股票、债券发行以及年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡,从而推高市场利率。充分利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	浦银日日鑫A	浦银日日鑫B
下属分级基金的交易代码	003228	003229
报告期末下属分级基金的份额总额	65,876,551.17份	29,171,385,714.62份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	浦银日日鑫A	浦银日日鑫B
1. 本期已实现收益	352,755.48	216,804,068.02
2. 本期利润	352,755.48	216,804,068.02
3. 期末基金资产净值	65,876,551.17	29,171,385,714.62

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。
2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银日日鑫A

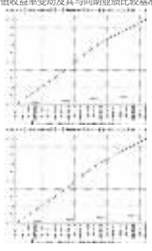
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6106%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.5233%	0.0005%

浦银日日鑫B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6706%	0.0006%	0.0873%	0.0000%	0.5833%	0.0006%

注:1.本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟明	公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛日鑫货币市场基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金以及浦银安盛双债增强债券型证券投资基金基金经理。	2017年11月1日	-	14	钟明女士,复旦大学MBA。2005年至2017年就职于兴全基金管理有限公司,先后从事基金会计岗位、债券交易员岗位、基金经理助理岗位和基金经理岗位。2017年5月加盟浦银安盛基金管理有限公司,担任固定收益投资部副总监之职。2017年11月起,担任公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金以及浦银安盛日鑫货币市场基金基金经理。2018年10月起担任浦银安盛中短债债券型证券投资基金的基金经理。2018年12月起担任浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。2019年5月起担任浦银安盛双债增强债券型证券投资基金的基金经理。
廉素君	公司旗下浦银安盛货币市场证券投资基金以及浦银安盛日日鑫货币市场基金基金经理	2019年3月4日	-	7	廉素君女士,华中科技大学金融学硕士。2012年3月至2013年6月在第一创业证券股份有限公司任职稽核与风险管理岗;2013年7月至2017年11月在郑州银行股份有限公司金融市场部,担任投资交易岗。2017年11月加盟浦银安盛基金管理有限公司,在固定收益投资部任职货币基金基金经理助理。2019年3月起担任浦银安盛货币市场证券投资基金以及浦银安盛日日鑫货币市场基金基金经理。

注:1.本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。
2.证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未有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

本基金管理人根据《公平交易管理规定》,建立并健全了有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个基金组合。

在具体执行中,在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的提供研究支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度,保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制;在交易执行环节上,详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定,以保证投资执行交易过程的公平性;从事后监控角度上,一方面是定期对投资交易情况进行分析,对不同投资组合(同日、3日、5日和10日)发生的不同品种的同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析,并进行统计显著性的检验,以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度;同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析;另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查,并对发现的问题进行及时的报告。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下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%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

经过一季度信贷投放刺激,市场预计二季度经济增速较一季度会放缓,货币政策将继续保持合理宽松水平,利好债市。实际情况看,二季度银行间资金面整体边际上虽然在4月略有上行,但随着后期经济数据趋弱和外围贸易战再次升级,资金面再次回归宽松态势;加之6月下旬包商事件引发的银行间流动性分层,预计将对市场产生长期影响,央行再次加码宽松力度。整体看,二季度银行间全市场隔夜质押式回购加权利率均值为2.08%,较一季度下行12bp,已低于前期央行利率走廊区间合意水平,货币市场各类资产大幅下行,尤其高评级短久期资产受到追捧。

报告期,货币基金操作上采取高杠杆和交易策略,提高高等级流动性高的存单占比,给合资金面的波动获取短期交易机会,站活调整久期空间和交易品种,获取稳定超额回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期浦银日日鑫A的基金份额净值收益率为0.6106%,本报告期浦银日日鑫B的基金份额净值收益率为0.6706%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1.本报告期内未出现连续二个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
2.本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	8,499,115,764.65	28.64
	其中:债券	8,499,115,764.65	28.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	11,624,644,770.42	39.18
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	9,422,660,354.91	31.75
4	其他资产	127,207,834.99	0.43
5	合计	29,673,628,724.97	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		2.97
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	427,279,586.36	1.46
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
注:本报告期内本基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	37
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	45
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.92	1.46
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	1.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	6.61	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		101.06	1.46

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,152,174,692.80	7.36
	其中:政策性金融债	2,152,174,692.80	7.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,260,911,111.68	4.31
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,086,029,960.17	17.40
8	其他	-	-
9	合计	8,499,115,764.65	29.07
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180312	18进出12	3,700,000	370,510,061.23	1.27
2	011901174	19中电信SCP006	3,100,000	309,916,378.51	1.06
3	111811294	18平安银行CD294	3,000,000	299,595,685.11	1.02
4	111916163	19上海银行CD163	3,000,000	299,510,668.50	1.02
5	111808277	18中信银行CD277	3,000,000	299,141,935.29	1.02
6	111907092	19招商银行CD092	3,000,000	298,277,943.88	1.02
7	180209	18国开09	2,900,000	290,073,536.11	0.99
8	111811206	18平安银行CD206	2,800,000	279,368,308.17	0.96
9	180410	18农发10	2,300,000	230,086,640.36	0.79
10	011900048	19东航股SCP001	2,200,000	220,159,019.81	0.75

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0310%
报告期内偏离度的最低值	-0.0024%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0100%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
注:本报告期内无负偏离度绝对值达到0.25%的情况
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
注:本报告期内无正偏离度绝对值达到0.5%的情况
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1 基金计价方法说明
本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。
5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明
平安银行因未及时披露公司重大事项,未依法履行其他职责,中国人民银行于2018-07-26依据相关法规给予:公开处罚处分决定;因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会天津监管局于2018-06-28依据相关法规给予:公开处罚处分决定。上海银行因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会上海监管局于2018-10-18依据相关法规给予:公开处罚、责令改正处分决定;因未依法履行其他职责,中国银行业监督管理委员会上海监管局于2018-10-08依据相关法规给予:公开处罚、责令改正处分决定。中信银行因信息披露虚假或严重误导性陈述,未依法履行其他职责,中国银行保险监督管理委员会于2018-11-19依据相关法规给予:公开处罚处分决定。
5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	105,671,441.29
4	应收申购款	21,536,393.70
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	127,207,834.99

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	浦银日日鑫A	浦银日日鑫B
报告期期初基金份额总额	43,651,301.31	29,350,672,630.45
报告期期间基金总申购份额	98,086,931.07	14,734,210,627.80
报告期期间基金总赎回份额	75,861,681.21	14,913,497,543.63
报告期期末基金份额总额	65,876,551.17	29,171,385,714.62

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利发放	2019年4月1日	14,355.98	14,355.98	0.00%
2	红利发放	2019年4月2日	4,713.72	4,713.72	0.00%
3	红利发放	2019年4月3日	4,749.60	4,749.60	0.00%
4	红利发放	2019年4月4日	4,447.56	4,447.56	0.00%
5	红利发放	2019年4月8日	17,205.71	17,205.71	0.00%
6	红利发放	2019年4月9日	4,621.30	4,621.30	0.00%
7	红利发放	2019年4月10日	4,823.96	4,823.96	0.00%
8	红利发放	2019年4月11日	4,226.39	4,226.39	0.00%
9	红利发放	2019年4月12日	4,270.93	4,270.93	0.00%
10	红利发放	2019年4月15日	12,856.94	12,856.94	0.00%
11	红利发放	2019年4月16日	4,313.48	4,313.48	0.00%
12	红利发放	2019年4月17日	4,460.68	4,460.68	0.00%
13	红利发放	2019年4月18日	4,720.85	4,720.85	0.00%
14	红利发放	2019年4月19日	4,571.88	4,571.88	0.00%
15	红利发放	2019年4月22日	14,241.72	14,241.72	0.00%
16	红利发放	2019年4月23日	4,536.27	4,536.27	0.00%
17	红利发放	2019年4月24日	4,526.18	4,526.18	0.00%
18	红利发放	2019年4月25日	4,539.06	4,539.06	0.00%
19	红利发放	2019年4月26日	4,485.53	4,485.53	0.00%
20	红利发放	2019年4月29日	13,497.82	13,497.82	0.00%
21	红利发放	2019年4月30日	4,499.71	4,499.71	0.00%
22	红利发放	2019年5月6日	28,122.59	28,122.59	0.00%
23	红利发放	2019年5月7日	4,463.90	4,463.90	0.00%
24	红利发放	2019年5月8日	4,260.05	4,260.05	0.00%
25	红利发放	2019年5月9日	4,280.10	4,280.10	0.00%
26	红利发放	2019年5月10日	4,826.55	4,826.55	0.00%
27	红利发放	2019年5月13日	12,390.87	12,390.87	0.00%
28	红利发放	2019年5月14日	5,628.61	5,628.61	0.00%
29	红利发放	2019年5月15日	4,145.80	4,145.80	0.00%
30	红利发放	2019年5月16日	4,165.95	4,165.95	0.00%
31	红利发放	2019年5月17日	4,196.31	4,196.31	0.00%
32	红利发放	2019年5月20日	12,679.47	12,679.47	0.00%
33	红利发放	2019年5月21日	4,221.00	4,221.00	0.00%
34	红利发放	2019年5月22日	4,288.36	4,288.36	0.00%
35	红利发放	2019年5月23日	4,315.22	4,315.22	0.00%
36	红利发放	2019年5月24日	4,317.50	4,317.50	0.00%
37	红利发放	2019年5月27日	12,881.15	12,881.15	0.00%
38	红利发放	2019年5月28日	5,147.14	5,147.14	0.00%
39	红利发放	2019年5月29日	4,381.86	4,381.86	0.00%
40	红利发放	2019年5月30日	4,272.57	4,272.57	0.00%
41	红利发放	2019年5月31日	4,308.31	4,308.31	0.00%
42	红利发放	2019年6月3日	13,097.99	13,097.99	0.00%
43	红利发放	2019年6月4日	4,267.51	4,267.51	0.00%
44	红利发放	2019年6月5日	4,273.63	4,273.63	0.00%
45	红利发放	2019年6月6日	4,580.67	4,580.67	0.00%
46	红利发放	2019年6月10日	16,987.52	16,987.52	0.00%
47	红利发放	2019年6月11日	4,259.25	4,259.25	0.00%
48	红利发放	2019年6月12日	4,265.58	4,265.58	0.00%
49	红利发放	2019年6月13日	4,250.34	4,250.34	0.00%
50	红利发放	2019年6月14日	4,267.36	4,267.36	0.00%
51	红利发放	2019年6月17日	13,190.25	13,190.25	0.00%
52	红利发放	2019年6月18日	5,572.37	5,572.37	0.00%
53	红利发放	2019年6月19日	4,609.68	4,609.68	0.00%
54	红利发放	2019年6月20日	5,088.40	5,088.40	0.00%
55	红利发放	2019年6月21日	5,370.50	5,370.50	0.00%
56	红利发放	2019年6月24日	13,909.53	13,909.53	0.00%
57	红利发放	2019年6月25日	4,781.54	4,781.54	0.00%
58	红利发放	2019年6月26日	4,747.11	4,747.11	0.00%
59	红利发放	2019年6月27日	5,080.36	5,080.36	0.00%
60	红利发放	2019年6月28日	4,489.49	4,489.49	0.00%
合计			409,047.66	409,047.66	

注:1.截至本报告期末,本基金管理人持有浦银日日鑫B 61,245,166.29份。
2.截至本报告期末,本基金管理人的全资子公司上海浦银安盛资产管理有限公司持有本基金浦银日日鑫B 152,326,770.71份。
3.基金管理人固有资金投资本基金费用按照本基金法律文件约定收取,本基金无申购赎回手续费。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019年4月1日-2019年6月30日	9,630,738,768.61	64,485,191.11	500,000,000.00	9,195,223,959.72	31.45%
	2	2019年6月18日-2019年6月30日	4,824,891,320.14	1,037,248,876.98	0.00	5,862,140,197.12	20.05%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

基金管理人提示投资者注意:当特定的机构投资者进行大额赎回操作时,基金管理人需通过对基金持有证券的快速变现以支付赎回款,该等操作可能会产生基金仓位调整的困难,产生冲击成本的风险,并造成基金净值的波动;同时,该等大额赎回将可能产生(1)单位净值尾差风险;(2)基金净值大幅波动的风险;(3)因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险;以及(4)因基金资产净值低于5000万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、 中国证监会批准基金募集的文件
2、 浦银安盛日日鑫货币市场基金基金合同
3、 浦银安盛日日鑫货币市场基金招募说明书
4、 浦银安盛日日鑫货币市场基金托管协议
5、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
7、 本报告期内在中国证监会指定报刊上披露的各项公告
8、 中国证监会要求的其他文件
9.2 存放地点
上海市淮海中路381号中环广场38楼基金管理人办公场所
9.3 查阅方式
投资者可登录基金管理人网站(www.py-axa.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。
投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人。
客户服务中心电话:400-8828-999 或 021-33079999

浦银安盛基金管理有限公司
2019年7月16日

鹏华中证医药卫生指数证券投资基金(LOF)

2019年第二季度报告

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月16日

§1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华中证医药卫生
场内简称	医药基金
基金主代码	160635
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2015年08月17日
报告期末基金份额总额	58,354,864.20份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预测成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。 本基金力争鹏华医药分级净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如预期数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 1.股票投资策略 (1)股票投资组合的构建 本基金在建仓期内,将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及期限标的指数的成份股却将调整或其他影响指数复制的因素时,本基金可以根据市场情况,结合研究分析,对基金财产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。 (2)股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况,对其进行适时调整,以保证鹏华医药分级净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。 基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金将会采用合理方法寻求替代。 1)定期调整 根据标的指数的调整规则剔备选股票的剔期,对股票投资组合及时进行调整。 2)不定期调整 根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、适配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整;根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;根据法律、法规规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。 2.债券投资策略 本基金可以根据流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。 3.衍生品投资策略 本基金可投资股指期货,权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以期期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制管制度并报董事会批准。 本基金通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	-2,560,744.37
2.本期利润	-5,202,124.85
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0878
4.期末基金资产净值	55,875,922.85
5.期末基金份额净值	0.958

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。

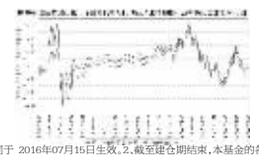
3.2 基金净值表现

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①	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	-8.41%	1.53%	-8.47%	1.54%	0.06%	-0.01%

注:业绩比较基准=中证医药卫生指数收益率×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份额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 2016年07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规定的各项比例。

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

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
崔俊杰	本基金基金经理	2016-07-15	-	11年	崔俊杰先生,国籍中国,管理学硕士,11年证券基金从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任产品规划部产品设计师、量化及衍生品投资部量化研究员,先后从事产品设计、量化研究工作,现任量化及衍生品投资部副总经理,基金经理。2013年03月担任鹏华深证民营ETF基金基金经理,2013年03月担任鹏华深证民营ETF联接基金基金经理,2013年03月担任鹏华上证民企50ETF基金基金经理,2013年07月至2018年02月担任鹏华沪深300ETF基金基金经理,2014年12月担任鹏华资源分级基金基金经理,2014年12月担任鹏华传媒分级基金基金经理,2015年04月担任鹏华银行分级基金基金经理,2015年08月至2016年07月担任鹏华医药分级基金基金经理,2016年07月担任鹏华医药指数(LOF)基金基金经理,2016年11月担任鹏华香港银行指数(LOF)基金基金经理,2018年02月至2018年03月担任鹏华量化先锋混合基金基金经理。崔俊杰先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
罗捷	本基金基金经理	2018-03-28	-	7年	罗捷先生,国籍中国,管理学硕士,7年证券基金从业经验。历任联合证券研究员、万得资讯产品经理、阿里巴巴(中国)网络技术有限公司产品经理;2013年8月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部高级金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员、投资经理,2018年01月担任鹏华深证民营ETF基金基金经理,2018年01月担任鹏华深证民营ETF联接基金基金经理,2018年03月担任鹏华量化先锋混合基金基金经理,2018年03月至2019年05月担任鹏华量化策略混合基金基金经理,2018年03月担任鹏华医药卫生指数证券基金基金经理,2018年08月担任鹏华沪深300指数增强基金基金经理。罗捷先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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