

## 鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)

## [2015]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:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人中银国际证券有限公司承诺以诚实信用、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。

报告书中的财务数据未经审计。

报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 鹏华价值优势混合型证券投资基金(LOF)

场内简称 鹏华价值

基金主代码 160607

交易代码 160607

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2006年7月18日

报告期末基金份额总额 2,517,319,323.00份

投资目标 依托公司的研究实力和投资纪律，强调运用相对价值分析方法，发掘我国资本市场的国际接轨趋势，寻找具有相对价值的行业和公司，寻求基金资产的长期增值。

(1)股票投资：首先根据公司的研究流程对宏观经济进行配置和个股选择，再运用相对价值的方法，精选出具有相对价值的行业和个股，从而达到投资收益最大化。对于个股层面由于基金经理对价值投资的认同，故基金经理的判断运用到选股上，但不保证基金经理的过往业绩并不代表其未来表现。

投资策略 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。

报告书中的财务数据未经审计。

报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期初次实现收入 -36,961,179.02

2.本期利润 -689,483,506.17

3.加权平均基金份额本期利润 -0.2665

4.期末基金份额净值 2,569,416.2206

5.期末基金资产净值 1,019

注:1.本期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，本期利润为本期初次实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所有营业费用指销售服务费、管理费、托管费和信息披露费等费用。

3.基金净值增长率=基金净值增长/基金净值年初数。

4.本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的差值。

5.3.2.1 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

注:基金净值增长率=基金净值增长/基金净值年初数。

3.2.3 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.4 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.5 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.6 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.7 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.8 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.9 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.10 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.11 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.12 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.13 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.14 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.15 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.16 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.17 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.18 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.19 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.20 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.21 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.22 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④

过去三个月 -19.83% 3.09% -21.60% 2.46% 1.82% 1.23%

注:自2015年6月30日起,业业绩比较基准=中证沪深300指数收益率\*70%+中证普债指数收益率\*30%。

3.2.23 本期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(%) 净值增长标准差(%) ① ② ③ ④</