

鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

322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

鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注:1.本基金基金合同于2016年9月23日生效。
2.截至基金合同期末,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.其他指标

4.基金业绩(或基金净值)简介

4.1基金业绩(或基金净值)简介

基金名称 鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

基金简称 鹏华消费领先

基金代码 001203

基金管理人 鹏华基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

基金合同生效日期 2016年9月23日

基金合同期限 不定期

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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

323业绩比较基准

323.1业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.2业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.3业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.4业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.5业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.6业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.7业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.8业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.9业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.10业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.11业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.12业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.13业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.14业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.15业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.16业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.17业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.18业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.19业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.20业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.21业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.22业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.23业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.24业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.25业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.26业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.27业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.28业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.29业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.30业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

2.证券从业的含文通从行业从业关于从业从人员资格管理办的相关规定。

42管理人对报告期内本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。报告期内,本基金运作合规,不存在违法违规和损害基金份额持有人利益的行为。

43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、分配各环节得到公平对待。

43.2异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金管理人严格遵守关于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超过该证券当日成交量的5%的情况。

44报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,宏观经济企稳回升,流动性相对宽松,企业盈利情况总体向好,外需形势也出现回暖。物价水平有所回落,但总体仍保持在中低位水平。

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。报告期内,本基金运作合规,不存在违法违规和损害基金份额持有人利益的行为。

45报告期内基金资产组合情况

注:1.本基金基金合同于2016年9月23日生效。
2.截至基金合同期末,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.其他指标

4.基金业绩(或基金净值)简介

4.1基金业绩(或基金净值)简介

基金名称 鹏华消费领先灵活配置混合型证券投资基金

基金简称 鹏华消费领先

基金代码 001203

基金管理人 鹏华基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

基金合同生效日期 2016年9月23日

基金合同期限 不定期

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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

323业绩比较基准

323.1业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.2业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.3业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.4业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.5业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.6业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.7业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.8业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.9业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.10业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.11业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.12业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.13业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.14业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.15业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.16业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.17业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.18业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.19业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.20业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.21业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.22业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.23业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.24业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.25业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.26业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.27业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.28业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.29业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

323.30业绩比较基准

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+中证综合指数收益率×40%

53报告期内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细

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	000779	中航光电	495,273	18,948,918.68	6.63
2	000988	华鲁恒升	236,000	14,472,000.00	5.67
3	000561	皖江物流	366,000	13,094,400.00	5.44
4	000699	招商局港口	340,100	13,027,050.00	5.35
5	000789	凤凰传媒	428,000	12,903,760.00	4.78
6	000539	粤高速A	25,400	12,112,776.00	4.74
7	601518	中钨高新	200,000	10,832,000.00	4.24
8	000826	华利集团	238,674	10,327,532.68	4.04
9	000333	润兴股份	236,000	10,165,760.00	3.99
10	000897	兴发集团	210,000	8,980,776.00	3.52

54报告期内期末按品种分类的债券投资组合

注:无。

55报告期内期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:无。

56报告期内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:无。

57报告期内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

注:无。

58报告期内期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

59报告期内期末本基金投资的股指期货交易情况说明

59.1报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

59.2本基金股指期货的投资政策

本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,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,降低申购赎回现金流波动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。

59.3报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

59.3.1报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

59.3.2本基金国债期货的投资政策

本基金国债期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约,本基金力争利用国债期货的杠杆作用,降低申购赎回现金流波动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。

59.3.3报告期内本基金投资的期权交易情况说明

59.3.3.1报告期内本基金投资的期权持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含期权投资。

59.3.3.2本基金期权投资的投资政策

本基金期权投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的期权合约,本基金力争利用期权的杠杆作用,降低申购赎回现金流波动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。

59.3.3.3报告期内本基金投资的权证交易情况说明

59.3.3.3.1报告期内本基金投资的权证持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含权证投资。

59.3.3.3.2本基金权证投资的投资政策

本基金权证投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的权证合约,本基金力争利用权证的杠杆作用,降低申购赎回现金流波动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。

59.3.3.3.3报告期内本基金投资的权证交易情况说明

59.3.3.3.3.1报告期内本基金投资的权证持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含权证投资。

59.3.3.3.3.2本基金权证投资的投资政策

本基金权证投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的权证合约,本基金力争利用权证的杠杆作用,降低申购赎回现金流波动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。

59.3.3.3.3.3报告期内本基金投资的权证交易情况说明

59.3.3.3.3.3.1报告期内本基金投资的权证持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含权证投资。

59.3.3.3.3.3.2本基金权证投资的投资政策

本基金权证投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的权证合约,本基金力争利用权证的杠杆作用,降低申购赎回现金流波动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。

59.3.3.3.3.3.3报告期内本基金投资的权证交易情况说明

59.3.3.3.3.3.3.1报告期内本基金投资的权证持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含权证投资。

59.3.3.3.3.3.3.2本基金权证投资的投资政策