

# 鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF） 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 4 月 24 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 2017 年 4 月 19 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 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华盛世创新混合
场内简称	鹏华创新
基金主代码	160613
交易代码	160613
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2008 年 10 月 10 日
报告期末基金份额总额	71,107,880.12 份
投资目标	精选具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票，进行积极主动的投资管理，在有效控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层次：第一层次是“自上而下”的资产配置策略，第二层次是“自下而上”的选股策略，主要投资于具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票。在充分控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
业绩比较基准	沪深 300 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市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。
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（2017年1月1日—2017年3月31日）
1. 本期已实现收益	891,347.46
2. 本期利润	3,484,832.76
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0482
4. 期末基金资产净值	97,351,147.18
5. 期末基金份额净值	1.369

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

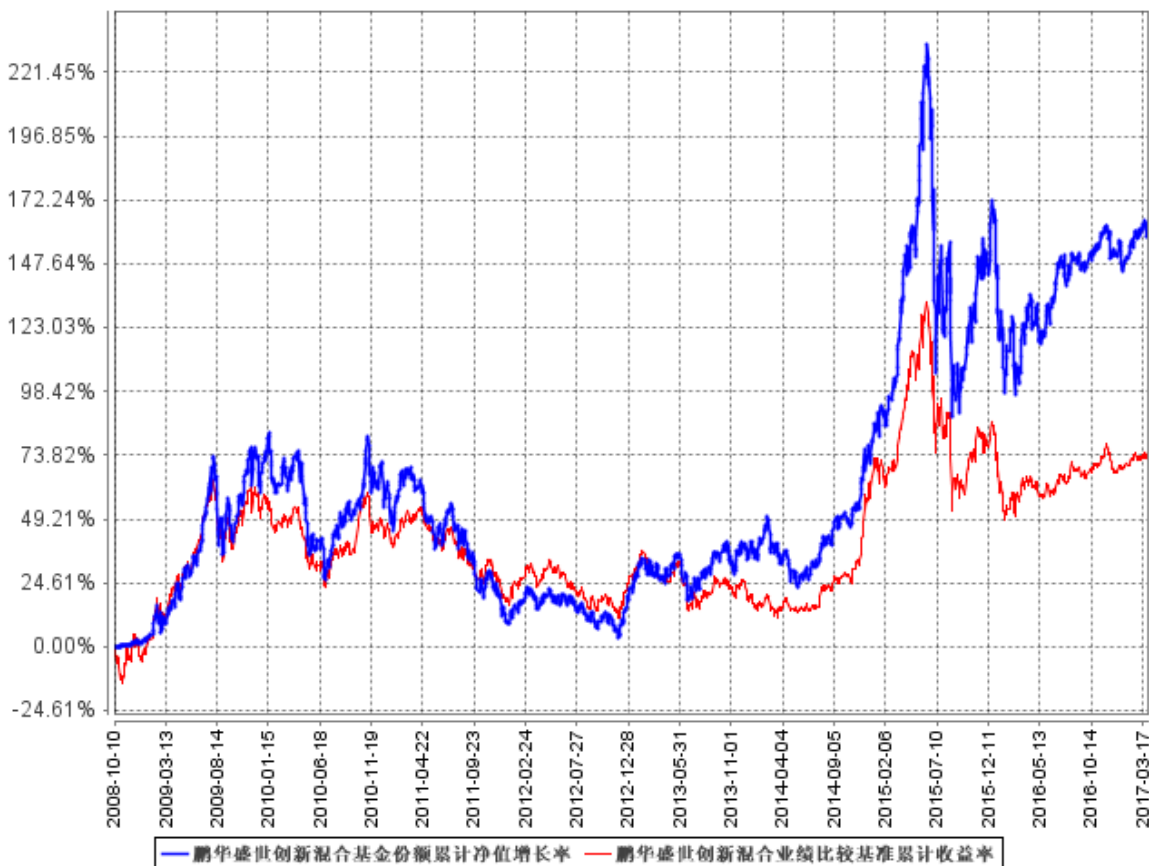
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.63%	0.65%	3.27%	0.39%	0.36%	0.26%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

### 3.2.2 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

鹏华盛世创新混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2008 年 10 月 10 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		
伍旋	本基金基金经理	2015 年 2 月 3 日	-	11	伍旋先生，国籍中国，工商管理硕士，11 年证券从业经验。曾任职于中国建设银行，2006 年 6 月加盟鹏华

					<p>基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任研究部高级研究员、基金经理助理；2011年12月起担任鹏华盛世创新混合（LOF）基金基金经理，2015年2月至2017年2月兼任鹏华可转债债券基金基金经理，2015年4月起兼任鹏华改革红利股票基金基金经理，现同时担任权益投资一部副总经理。伍旋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。</p>
--	--	--	--	--	---

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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和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

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。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违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成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 1 季度，17 年经济开局良好。1-2 月工业增加值为 6.3%，好于市场预期，固定资产投资有所回升，增速为 8.9%，1-2 月社会零售总额增速为 9.5%，汽车销售下滑，但建材类消费明显回升，日用品消费仍然稳定。宏观经济数据显示内外需均有不同程度的好转，消费保持相对平稳，尽管货币政策偏紧，但政策的目标更多的定位于“去杠杆+补短板”（治理房地产泡沫、金融去杠杆和监管升级延续），经济整体有望保持弱复苏的趋势。在资本市场上，监管政策发生明显变化，例如：IPO 加速及再融资收紧、对于题材炒作监管趋严，以及投资者结构的变迁对市场风险偏好和风格产生显著影响，已经使得中小创对于价值股的相对“溢价”位移发生明显改变。高分红价值股、白马龙头股享受估值溢价的时代已经到来。虽然我们认为过往宽松的货币环境发生了变化，但当前弱复苏的经济状况并不支持全面的货币紧缩，因而股票市场的估值出现系统性坍塌的概率较低。因此，我们对于组合维持了较高的股票仓位，适时调整了部分持仓。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 3.63%，同期上证综指上涨 3.83%，深证成指上涨 2.47%，沪深 300 指数上涨 4.41%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	89,873,639.67	91.47
	其中：股票	89,873,639.67	91.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,203,946.32	8.35
8	其他资产	174,676.61	0.18
9	合计	98,252,262.60	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,872,858.00	1.92
C	制造业	53,655,999.78	55.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,517,116.00	1.56
E	建筑业	4,346,778.24	4.47
F	批发和零售业	6,385,652.04	6.56
G	交通运输、仓储和邮政业	3,917,360.86	4.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,284,547.64	7.48
J	金融业	1,809,236.00	1.86
K	房地产业	1,965,564.00	2.02
L	租赁和商务服务业	2,645,377.11	2.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	30,319.08	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,442,830.92	4.56
S	综合	-	-
	合计	89,873,639.67	92.32

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

**5.3 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	601098	中南传媒	247,236	4,442,830.92	4.56
2	600519	贵州茅台	10,176	3,931,599.36	4.04
3	000333	美的集团	103,100	3,433,230.00	3.53
4	600499	科达洁能	410,500	3,226,530.00	3.31
5	601006	大秦铁路	376,398	2,849,332.86	2.93
6	600885	宏发股份	76,400	2,774,848.00	2.85
7	603123	翠微股份	269,400	2,696,694.00	2.77
8	002400	省广股份	211,461	2,645,377.11	2.72
9	002531	天顺风能	349,860	2,560,975.20	2.63
10	600566	济川药业	74,233	2,500,909.77	2.57

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：无。

**5.5 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债券投资明细**

注：无。

**5.6 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：无。

**5.7 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**

注：无。

**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五名权证投资明细**

注：无。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 报告期末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。



## 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 5.10.2 报告期末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。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本基金投资的前十名证券之一广东科达洁能股份有限公司

关于最近五年被证券监管部门和交易所

采取处罚或监管措施的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

广东科达洁能股份有限公司（以下简称“公司”）2016 年非公开发行股票申请文件已于 2016 年 11 月 4 日获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）受理，目前该事项处于中国证监会审核阶段。2016 年 12 月 23 日，公司收到中国证监会下发的《中国证监会行政许可项目审查反馈意见通知书》（163316 号）（以下简称“《反馈意见》”）。根据《反馈意见》的要求，公司现将最近五年被证券监管部门和交易所处罚或采取监管措施情况及相应的整改措施公告如下：

#### 一、公司最近五年被证券监管部门和交易所采取处罚情况

经自查，公司最近五年内未有被证券监管部门和交易所处罚的情况。

#### 二、公司最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施及整改情况

最近五年，公司收到上海证券交易所口头警示两次，具体情况如下：

##### （一）预案披露及复牌不及时

2016 年 9 月 28 日，上海证券交易所向公司下发了口头警示通报，警示事项如下：公司 2016

年 9 月 2 日筹划非公开发行进入停牌程序，2016 年 9 月 20 日，停牌满十天，应当披露非公开发行预案。但是由于非公开发行预案，以及拟发行对象的《简式权益变动报告书》尚有部分内容需要进一步确认，公司未在 9 月 20 日及时披露预案并复牌，迟至 9 月 21 日才披露并复牌。现就公司预案及复牌不及时问题给予公司及董秘口头警告。

针对上述问题，公司高度重视，通过组织相关人员进行专门培训学习等方式，提高信息披露水平，以保障公司和全体股东的合法权益。 2

## （二）董监高增持计划信息披露不准确

2016 年 1 月 14 日，上海证券交易所向公司下发了口头警示通报，警示事项如下：2016 年 1 月 13 日，公司披露“公司部分董事、监事、高级管理人员亦有择机继续增持本公司股份计划”，但未明确董监高具体的增持计划以及期限。次日，公司披露，除董事郝来春已买入 20600 股外，公司其他董监高尚未制定具体增持计划。公司在实际未制定具体增持计划时，对外披露用“择机增持”此类模糊笼统的概念，信息披露不谨慎，可能对投资者产生误导。经讨论，给予公司和董秘口头警告。

针对上述问题，公司及信息披露相关部门及时进行反省，对信息披露相关文件进行全面自查，以保证公司信息披露内容准确、严谨，提升信息披露质量。

除上述事项外，公司最近五年不存在其他被证券监管部门和交易所采取处罚或监管措施的情况。在未来日常经营中，公司将在证券监管部门和交易所的监管和指导下，继续完善公司法人治理机制，加强规范运作，促进公司持续发展。

特此公告。

广东科达洁能股份有限公司董事会

二〇一七年一月十二日

本基金投资的前十名证券其他证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	23,381.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,464.72
5	应收申购款	149,830.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	174,676.61

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002400	省广股份	2,645,377.11	2.72	重大事项

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	72,739,550.57
报告期期间基金总申购份额	2,511,608.94
减：报告期期间基金总赎回份额	4,143,279.39
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	71,107,880.12

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:截止本报告期末, 本基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金管理人本报告期末申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

## § 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

注: 无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注: 无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华盛世创新混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;
- (二) 《鹏华盛世创新混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;
- (三) 《鹏华盛世创新混合型证券投资基金(LOF)2017 年度第 1 季度报告》(原文)。

### 9.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行股份有限公司

### 9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅, 也可按工本费购买复印件, 或通过本基金管理人网站 (<http://www.phfund.com>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问, 可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司, 本公司已开通客户服务系统, 咨询电话: 4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2017 年 4 月 24 日