

重要提示

基金管理人鹏华基金管理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，保证基金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、勤勉尽责的管理理念和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读基金的投资说明书。

本报告自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

注：无。

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30). Includes 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值.

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将低于所列数据。

基金净值表现

Table with 2 columns: 阶段 and 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 超额比较基准收益率③, ①-②, ③-②. Includes 过去三个月.

注：业绩比较基准=中证医药卫生指数收益率×40%+中证环保行业指数收益率×40%+中证综合债指数收益率×20%

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变动的比较



注：1、本基金基金合同于2016年01月20日生效。2、截至建仓结束前，本基金的各项投资比例未达到基金合同中约定的各项比例。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 and 报告期 (2019-04-01至2019-06-30). Includes 其他指标.

注：无。

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间 (任期日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes 曹鑫.

注：1、任职日期和离任日期均指公司公告聘任或解聘日期。2、截至本报告期末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认定办法的相关规定。

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、中国证监会的相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。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。

公平交易专项说明

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、分配等各环节得到公平对待。

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。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交易量的5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，中美贸易战的反复，以及市场对于经济结构的担忧，导致二季度市场经历了一波调整，尤其是与贸易战相关的ent行业涨幅靠前。一季度市场的估值有所修复，但我们认为机会依然大于风险，因此仓位仍然维持在较高水平，组合保持了以成长性较高的行业和个股为主的配置。我们依然认为，从长期来看，估值合理而业绩成长性公司在更长的时间跨度会获得更高的超额收益。

展望未来，我们认为随着中美对于经济结构的政策调整和财政政策的出台，随着减税降费政策的显现，经济会逐步企稳。我们对长期依然乐观。我们目前组合以成长性较高的行业个股为主，包括医药，食品饮料，券商等行业。我们会继续优选那些业绩增长对更高且估值匹配的行业和个股。相比2018年，我们在持仓获得超额收益的同时，会更加关注估值，控制回撤，争取为持有人带来更好的回报。

报告期内基金的投资表现

鹏华健康环保组合净值增长率-3.27%；业绩比较基准增长率-7.78%；同期上证综指涨跌幅为-3.6198%，深证成指涨跌幅为-7.3540%，沪深300指数涨跌幅为-1.2074%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Includes 权益类投资, 固定收益投资, 资产支持证券, 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 银行存款和结算备付金合计, 其他资产, 合计.

报告期末按行业分类的境内投资组合

Table with 3 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Includes 农林牧渔, 采矿业, 制造业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输、仓储和邮政业, 住宿和餐饮业, 信息传输、软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 租赁和商务服务业, 科学研究和技术服务业, 水利、环境和公共设施管理业, 交通运输、仓储和邮政业, 教育, 卫生和社会工作, 文化、体育和娱乐业, 综合, 合计.

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

Table with 5 columns: 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(%). Includes 000661, 300488, 603899, 000651, 603338, 603085, 602175, 601135, 602597, 603711.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Includes 国家债券, 央行票据, 金融债券, 企业债券, 企业短期融资券, 中期票据, 可转债(可交换债), 同业存单, 其他, 合计.

注：无。

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

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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。

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

Table with 3 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

注：无。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：无。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明.

公允价值变动总额合计(元)
股指期货投资本期收益(元)
股指期货投资本期公允价值变动(元)

本基金投资股指期货的投资政策
本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现投资组合的超额收益。

报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本期国债期货投资政策
本基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险指标说明.

公允价值变动总额合计(元)
国债期货投资本期收益(元)
国债期货投资本期公允价值变动(元)

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
本基金投资的前十名证券中本期没有发生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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
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。

其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 应收利息, 应收申购款, 其他应收款, 其他费用, 合计.

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：无。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：无。

投资组合报告附注的其他文字描述部分
注：无。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 and 数值. Includes 报告期初基金份额总额, 报告期间基金总申购份额, 报告期间基金总赎回份额, 报告期末基金份额总额.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金基金份额变动情况

Table with 2 columns: 项目 and 基金份额. Includes 报告期初管理人持有的本基金份额, 报告期间买入/赎回基金份额, 报告期间卖出/申购基金份额, 报告期末管理人持有的本基金份额, 报告期末持有的本基金份额占本基金总份额比例(%).

注：无。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易金额(份), 交易金额(元), 适用费率.

注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 5 columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额承诺持有期限.

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

Table with 6 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过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.

注：无。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- (一)《鹏华健康环保灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
(二)《鹏华健康环保灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
(三)《鹏华健康环保灵活配置混合型证券投资基金2019年第3季度报告》（原文）。

存放地点

深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司。

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.pfund.com.cn）查阅。
投资者对本报告如有任何疑问，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热线，咨询电话：4008788899。