

鹏华养老目标日期2045年持有期混合型发起式基金(FOF)2019年第2季度报告

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2019-07-16

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等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2019年4月22日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 场内简称, 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) and Value (鹏华养老2045混合发起式(FOF), 007271, 契约型开放式, 2019-01-22, 10,091,063.79, 在严格控制风险的前提下, 通过资产配置, 优选基金力求实现基金资产的稳健增值, 为投资者提供稳健的养老理财工具...

主要财务指标

Table with 2 columns: Item (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) and Value (15,001.60, 31,103.34, 0.0031, 10,122,167.16, 1.0031)

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低于列载数据。

基金净值表现

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

Table with 2 columns: Period (过去三个月) and Value (净增长率①: 0.31%, 业绩比较基准②: 0.04%, 超额收益③: -4.86%, 基准收益④: 6.97%, 超额收益⑤: 5.17%, 超额收益⑥: -0.93%)

注：业绩比较基准=时间加权业绩比较基准。基金合同生效日:2019-12-31,中证800指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%,2018-01-01-2022-12-31,中证800指数收益率×60%+中证全债指数收益率×41% 2023-01-01-2032-12-31,中证800指数收益率×60%+中证全债指数收益率×44% 2033-01-01-2042-12-31,中证800指数收益率×60%+中证全债指数收益率×47% 2043-01-01-2044-12-31,中证800指数收益率×60%+中证全债指数收益率×50% 2045-01-01-2045-12-31,中证800指数收益率×60%+中证全债指数收益率×53% 2046-01-01-2046-12-31,中证800指数收益率×60%+中证全债指数收益率×56% 2047-01-01-2047-12-31,中证800指数收益率×60%+中证全债指数收益率×59%

本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



注：1、本基金基金合同于2019年04月22日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。2、本基金管理人将严格按照基金合同约定，本基金投资组合遵循各项投资比例符合基金合同约定。

其他指标

Table with 2 columns: Item (其他指标) and Value (报告期(2019-04-22至2019-06-30), 报告期(2019-06-30))

基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: Name (傅文亮, 赵强), Position (本基金基金经理), Tenure (2019-04-22), and Bio (傅文亮先生, 国籍中国, 经济学硕士, 10年证券基金从业经验, 2009年6月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任投资稽核部金融工程师...

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. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理业务的相关规定。

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、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定, 本基金运作规范, 勤勉尽责的履行职责和管理运用基金资产, 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, 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, 确保不同投资组合间, 交易、分配等各项环节得到公平对待。

异常交易行为的专项说明: 报告期内, 本基金管理人未发现过且可能对基金财产造成重大影响的异常交易行为。本基金报告期内本基金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未超过该证券当日成交量5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金的投资目标是在严格控制风险的前提下, 为投资者提供稳健的养老理财工具。在严格控制风险的前提下, 通过资产配置, 优选基金力求实现基金资产的稳健增值。在报告期末, 本基金的主要任务是跟踪养老目标客户的持有体验, 进行稳健配置。从4月22日基金成立至6月30日, 国内宏观经济形势较为动荡, 特别是中美贸易战的进程造成了本基金股票类资产的波动, 本基金积极跟踪, 本基金主要投资于权益类资产, 在月中权益类资产出现回调, 全球资产配置及港股仓位后, 风险资产出现回调, 本基金少量建立了权益仓位, 从实际操作效果来看, 本基金的净值走势体现了养老目标基金的特征。

本报告期末基金在基金合同生效至2019年12月31日的权益类资产配置比例为43%左右, 自12月31日建仓以来基金仓位逐步在安全仓位。

报告期内基金的业绩表现

鹏华养老2045混合(FOF)业绩比较基准收益率-4.86%, 鹏华养老2045混合(FOF)组合净值增长率0.31%。

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 4 columns: Category (序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: Category (序号, 行业类别, 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股票投资明细

注：无。

报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: Category (序号, 债券品种, 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五名债券投资明细

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

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

无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 4 columns: Item (代码, 名称, 持仓量(买/卖), 公允价值(元), 公允价值变动(元), 风险说明)

本基金投资策略的说明

本基金基金合同的投资范围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 4 columns: Item (代码, 名称, 持仓量(买/卖), 公允价值(元), 公允价值变动(元), 风险说明)

投资组合报告附注

受到制裁以及处罚情况: 本基金投资前十名证券中本期没有发生被监管部门立案调查的, 或在报告编制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: Category (序号, 项目) and Value (1, 存出保证金: 685.49, 2, 应收证券清算款: 116.01, 3, 应收股利: 5,444.25, 4, 应收利息: 315.19, 5, 其他应收款: 492,531.46, 6, 其他: 8.97, 7, 持有待售: 5,561.14)

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细: 无。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明: 无。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于扣除五人的原因, 投资组合报告中数字之和与合计项之间可能存在尾差。

基金合同

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基金投资明细

Table with 6 columns: 序号, 基金代码, 基金名称, 运作方式, 持有份额(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

当期交易及持有产生的费用

Table with 2 columns: Item (项目), Value (2019-04-22至2019-06-30)

注: 本基金基金合同于2019年4月22日生效。

本基金持有的基金发生的重大影响事件: 无。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: Item (项目), Value (基金份额)

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人持有本基金份额变动情况: Table with 2 columns: Item (项目), Value (基金份额)

注: 本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准一致。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号, 交易日期, 交易金额(份), 交易金额(元), 适用费率

注: 本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准一致。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 6 columns: Item (项目), 持有份额总额, 持有份额占基金总份额比例, 发起资金总额, 发起资金占基金总份额比例, 发起资金承诺持有期限

报告期末前十名投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 6 columns: Investor (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: 1. 申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、场内买入份额、指数公募基金申购份额和红利再购; 2. 赎回份额包含基金赎回份额、场内卖出份额和指数基金份额赎回份额。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- (一) 鹏华养老目标日期2045年持有期混合型发起式基金(FOF)基金合同; (二) 鹏华养老目标日期2045年持有期混合型发起式基金(FOF)托管协议; (三) 鹏华养老目标日期2045年持有期混合型发起式基金(FOF)2019年第2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

投资者可在本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, 或访问本基金管理人网站( http://www.phfund.com.cn )查阅。

投资者对本报告如有疑问, 可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司, 本公司还可开客户服务中心, 咨询电话: 4006789999。