

# 鹏华盛世创新混合型证券投资基金 (LOF) 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 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：2016 年 10 月 25 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 2016 年 10 月 20 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 2016 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	71,906,809.68 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（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	2,180,359.16
2. 本期利润	2,790,848.98
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0389
4. 期末基金资产净值	93,634,147.22
5. 期末基金份额净值	1.302

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

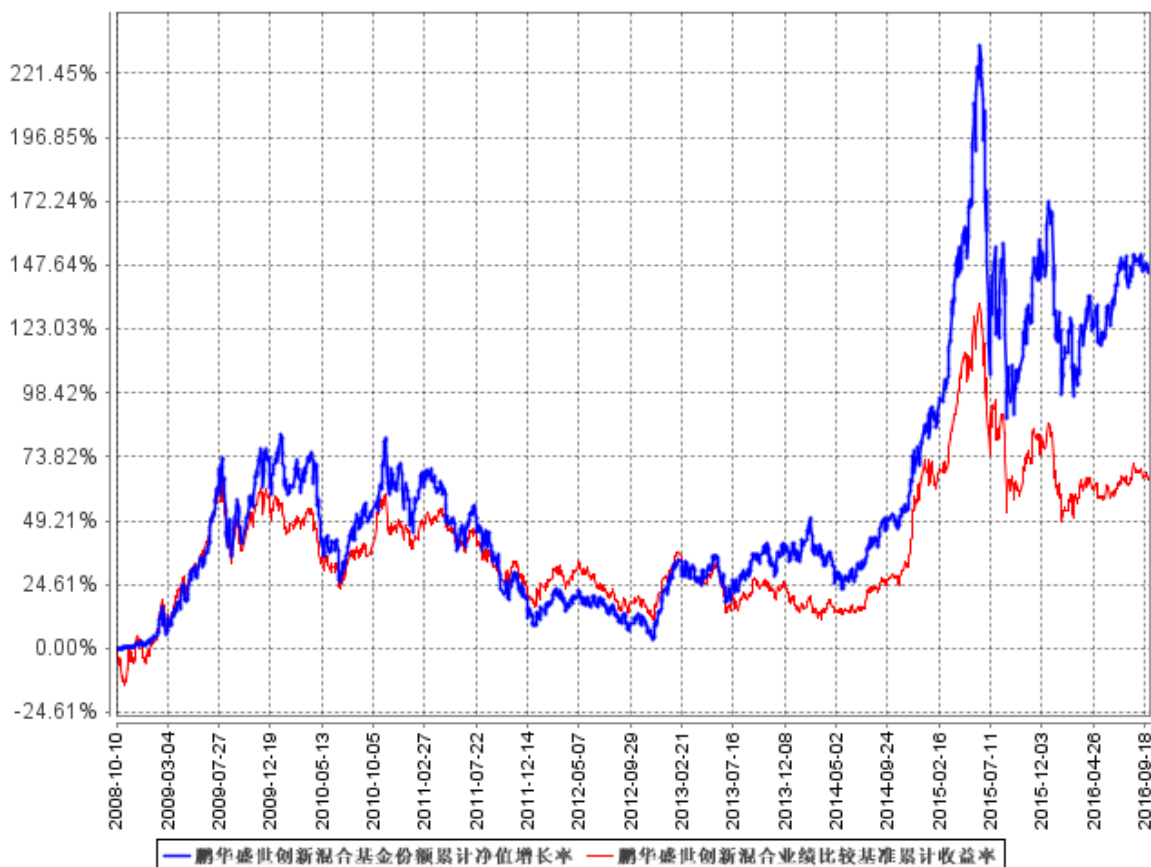
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.09%	0.80%	2.89%	0.60%	0.20%	0.20%

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。

## §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	2011 年 12 月 28 日	-	10	伍旋先生，国籍中国，工商管理硕士，10 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

					<p>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 月起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，现同时担任研究部副总经理。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合规守信情况的说明

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、分配等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% 的交易次数为 2 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

3 季度宏观经济处于“弱稳定”的底部区域，受益于价格的先行上涨，工业生产有改善的迹象，但需求依旧疲弱，持续性存疑。外围环境，美国经济复苏迹象较明显，年内联储加息概率

上升。2016 年 3 季度，沪深 300 指数上涨 3.15%，中小板指数下跌 1.58%，创业板指数下跌 3.50%，市场呈现缩量震荡的行情，我们结合一贯的选股策略，适时调整了在贵金属、新能源等领域的持仓。

#### 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 3.09%，同期上证综指上涨 2.56%，深证成指上涨 0.74%，沪深 300 指数上涨 3.15%。

#### 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	74,480,649.49	78.94
	其中：股票	74,480,649.49	78.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,399,744.40	2.54
	其中：债券	2,399,744.40	2.54
	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	17,415,550.29	18.46
8	其他资产	54,254.34	0.06
9	合计	94,350,198.52	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	1,065,501.00	1.14
C	制造业	47,805,360.43	51.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	2,005,408.36	2.14
F	批发和零售业	2,119,276.16	2.26
G	交通运输、仓储和邮政业	3,466,354.52	3.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,555,209.67	5.93
J	金融业	2,669,405.18	2.85
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,987,943.93	3.19
M	科学研究和技术服务业	1,012,500.00	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,383,000.00	1.48
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	4,410,690.24	4.71
S	综合	-	-
	合计	74,480,649.49	79.54

### 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	4,410,690.24	4.71
2	601058	赛轮金宇	908,261	3,596,713.56	3.84
3	300145	中金环境	124,680	3,307,760.40	3.53
4	002400	省广股份	211,461	2,987,943.93	3.19
5	601398	工商银行	596,642	2,643,124.06	2.82
6	600831	广电网络	175,905	2,432,766.15	2.60
7	601006	大秦铁路	376,398	2,386,363.32	2.55
8	300408	三环集团	128,200	2,375,546.00	2.54
9	600835	上海机电	113,800	2,310,140.00	2.47
10	600566	济川药业	74,233	2,218,824.37	2.37

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,399,744.40	2.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,399,744.40	2.56

### 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

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（%）
1	132004	15 国盛 EB	24,060	2,399,744.40	2.56

### 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

注：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中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	19,098.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,887.47
5	应收申购款	14,268.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,254.34

### 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

注：无。

### 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	71,347,776.58
报告期期间基金总申购份额	5,718,763.37
减：报告期期间基金总赎回份额	5,159,730.27
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	71,906,809.68

## §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 备查文件目录

### 8.1 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)2016 年度第 3 季度报告》（原文）。

### 8.2 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

### 8.3 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  
2016 年 10 月 25 日