

鹏华新兴产业混合型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	鹏华新兴产业混合
场内简称	-
基金主代码	206009
交易代码	206009
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 15 日
报告期末基金份额总额	436,693,976.69 份
投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，挖掘未来推动经济发展的新兴产业并从中精选优质个股，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定量及定性相结合的手段，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过跟踪、分析经济运行态势、经济政策以及产业结构的优化升级，识别经济发展过程中具有</p>

	<p>良好发展前景的新兴产业及相关上市公司，针对各类公司的不同特征，通过自上而下及自下而上相结合的方法筛选出优秀的上市公司构建投资组合。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等，采取积极主动的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现债券组合增值。</p> <p>4、权证产品投资策略</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p>
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×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型基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中具有中高风险、中高收益的投资品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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	7,537,979.75
2. 本期利润	23,844,790.52
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0457
4. 期末基金资产净值	915,848,648.44
5. 期末基金份额净值	2.097

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

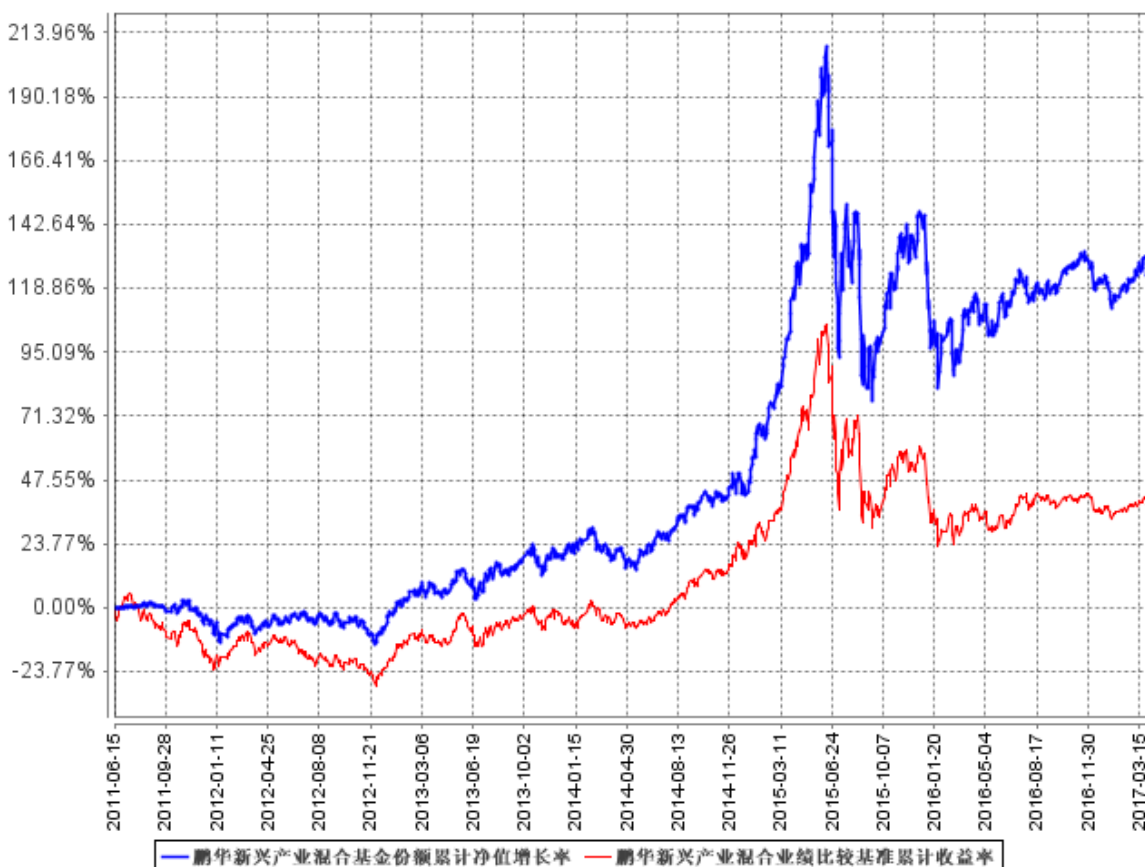
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.94%	0.70%	2.58%	0.50%	-0.64%	0.20%

注：业绩比较基准=中证新兴产业指数收益率×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

鹏华新兴产业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 2011 年 6 月 15 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		
梁浩	本基金基金经理	2011 年 7 月 14 日	-	9	梁浩先生，国籍中国，经济学博士，9 年证券从业经验。曾任职于信息产业部电信研究院，从事产业政策研究工作；2008 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，担任研究部高级研究员、基金经理助理，2014 年 3 月至 2015 年 12 月兼任鹏华环保产业股票基金基金经理，2014 年 11 月至 2015 年 12 月兼任鹏华先进制造股票基金基金经理，2011 年 7 月起担任鹏华新兴产业混合基金基金经理，2015 年 7 月起兼任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理，2016 年 1 月起兼任鹏华健康环保混合基金基金经理，2016 年 6 月起兼任鹏华医药科技股票基金基金经理，现同时担任研究部总经理、投资决策委员会成员。梁浩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。

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

一季度，宏观经济的走势超出我们预期，三四线城市房地产交易量的攀升带来了传统产业一片向好。相应，以水泥为代表的周期股和估值相对较低但与宏观经济又息息相关的价值股也保持着强势。成长股则继续处于劣势地位。

我们相信，在趋于严格的监管环境下，市场将会更加健康运行。市场健康运行的标志将是优秀公司、优质产业合理定价以致适度溢价。我们将按此逻辑，将仓位更多放在着眼于长期逻辑，业绩稳定增长的公司上面。

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 1.94%，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	814,854,719.32	88.38
	其中：股票	814,854,719.32	88.38
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	105,532,553.71	11.45
8	其他资产	1,599,138.28	0.17
9	合计	921,986,411.31	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	14,109,111.07	1.54
C	制造业	542,895,253.04	59.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,598,159.20	1.05
E	建筑业	517,930.76	0.06
F	批发和零售业	52,601,181.44	5.74
G	交通运输、仓储和邮政业	187,432.05	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	350,259.52	0.04
J	金融业	5,371.52	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,082,414.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	77,636.96	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	47,249.50	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	98,808,807.53	10.79
R	文化、体育和娱乐业	86,573,912.73	9.45
S	综合	-	-
	合计	814,854,719.32	88.97

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	300577	开润股份	809,253	62,433,868.95	6.82
2	300244	迪安诊断	1,831,119	56,801,311.38	6.20
3	002173	*ST 创疗	2,563,780	51,275,600.00	5.60
4	002343	慈文传媒	1,310,032	50,711,338.72	5.54
5	600763	通策医疗	1,524,773	42,007,496.15	4.59
6	000028	国药一致	500,658	37,689,534.24	4.12
7	600419	天润乳业	657,546	36,737,095.02	4.01
8	002739	万达院线	633,585	35,810,224.20	3.91
9	002616	长青集团	1,556,793	35,743,967.28	3.90
10	000915	山大华特	839,244	32,688,553.80	3.57

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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：本基金本报告期末未持有债券。

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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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：本基金本报告期末未持有贵金属。

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：本基金本报告期末未持有权证。

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慈文传媒股份有限公司关于收到浙江证监局行政监管措施决定书的公告

慈文传媒股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 12 月 16 日收到中国证券监督管理委员会浙江监管局（本公告中称“浙江证监局”）作出的《关于对慈文传媒股份有限公司采取责令改正措施的决定》（〔2016〕36 号，以下简称“《决定书》”）。现将《决定书》主要内容

公告如下：

“你公司合并范围内控股子公司于 2016 年 4 月 20 日就其投资摄制的电视剧与湖南广播电视台卫视频道签订了《电视剧中国大陆独家首轮播映权转让协议》，合同总金额为 2.58 亿元，占你公司上年度经审计总收入的 30.14%，但是你公司未披露该重大经营合同。

你公司的上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第三十条、第三十一条和第三十三条的规定。按照《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，现责令你公司作出如下整改：

- 一、立即披露公司签订的上述重大经营合同。
- 二、加强相关法律法规学习，做好信息披露工作。

此外，你公司应及时披露本决定书，并于完成整改工作后 15 个工作日内向我局提交书面整改报告。

如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。”

公司董事会对《决定书》提出的问题高度重视，将针对上述问题认真进行核查、分析和整改，按照《决定书》要求在规定时间内提交整改报告，并根据相关规定及时履行信息披露义务。

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

公司董事会将组织加强对《上市公司信息披露管理办法》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司信息披露管理办法》等相关法律法规、规范性文件及公司内控制度的学习，公司管理层将加强对信息披露等方面的管理，保证及时、真实、准确、完整地履行信息披露义务。

特此公告

慈文传媒股份有限公司董事会

2016 年 12 月 19 日

股票代码：002343 股票简称：慈文传媒 公告编号：2017-008

慈文传媒股份有限公司

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及相应整改措施的公告

慈文传媒股份有限公司（以下简称“公司”）严格按照《中华人民共和国公司法》、《中华

《中华人民共和国证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司章程》等相关要求，不断完善公司治理结构，建立健全内部管理及控制制度，规范公司运营，提高公司治理水平，促进公司持续、健康、稳定发展。公司拟申请非公开发行 A 股股票，现将公司最近五年被证券监管部门和交易所处罚或采取监管措施的情况公告如下：

一、公司最近五年被证券监管部门和交易所处罚的情况

经自查，公司最近五年不存在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的情况和相应的整改措施

（一）2015 年 9 月 2 日，深圳证券交易所《关于对浙江禾欣实业集团股份有限公司的监管关注函》

2015 年 9 月 2 日，深圳证券交易所中小板公司管理部向公司下发《关于对浙江禾欣实业集团股份有限公司的监管关注函》（中小板关注函【2015】第 415 号），就公司停牌事项进行了问询。公司于 2015 年 9 月 9 日向深圳证券交易所中小板公司管理部报送了《关于对深交所中小板关注函的回复》。

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

（二）2016 年 12 月 12 日，浙江证监局《关于对慈文传媒股份有限公司采取责令改正措施的决定》

2016 年 12 月 12 日，中国证券监督管理委员会浙江监管局（本公告中称“浙江证监局”）向公司下发了《关于对慈文传媒股份有限公司采取责令改正措施的决定》（【2016】36 号），就信息披露相关问题指出需要改正的方面。

公司董事会对《决定书》提出的相关信息披露问题高度重视，针对上述问题认真进行了核查、分析和整改，按照《决定书》要求在规定时间内提交了整改报告，并根据相关规定及时履行信息披露义务。

公司董事会组织加强对《上市公司信息披露管理办法》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司信息披露管理办法》等相关法律法规、规范性文件及公司内控制度的学习，公司管理层将继续加强对信息披露等方面的管理，保证及时、真实、准确、完整地履行信息披露义务。

（三）2016 年 12 月 12 日，浙江证监局《上市公司监管关注函》

2016 年 12 月 12 日，浙江证监局向公司下发了《上市公司监管关注函》（【2016】136 号，以下简称《关注函》），指出了公司在信息披露方面、财务方面、公司治理方面和内幕信息知情人登记方面存在的问题。

公司收到《关注函》后，高度重视《关注函》中指出的问题，按照《关注函》的要求，在信息披露管理流程、财务制度管理、公司治理、内幕信息登记人管理等方面制定了切实可行的整改措施，积极落实了整改，并向浙江证监局报送了整改报告。

（四）2016 年 12 月 22 日，深圳证券交易所《关于对慈文传媒股份有限公司未及时披露合同的监管函》

2016 年 12 月 22 日，深圳证券交易所中小板公司管理部向公司下发了《关于对慈文传媒股份有限公司未及时披露合同的监管函》（中小板监管函【2016】第 203 号），指出了公司合同相关信息披露滞后的问题。

公司在收到监管函后高度重视相关问题，组织相关责任人认真学习了《股票上市规则》和《中小企业板上市公司规范运作指引》等规定，落实改进后续工作管理。

（五）2017 年 1 月 12 日，深圳证券交易所《关于对慈文传媒股份有限公司的关注函》

2017 年 1 月 12 日，深圳证券交易所中小板公司管理部向公司下发了《关于对慈文传媒股份有限公司的关注函》（中小板关注函【2017】第 10 号），对公司董事、高管人员变动表示关注。

公司按照关注函的要求，积极落实离任董事及高管的工作交接，确保公司正常生产经营。

除上述情况外，公司最近五年内无其他被证券监管部门和交易所采取监管措施的情形。

特此公告

慈文传媒股份有限公司董事会

2017 年 1 月 26 日

本基金投资的前十名证券中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	718,390.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	38,940.44
5	应收申购款	841,807.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,599,138.28

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

注：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	520,947,265.95
报告期期间基金总申购份额	40,348,293.00
减：报告期期间基金总赎回份额	124,601,582.26
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	436,693,976.69

§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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一)《鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华新兴产业股票型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华新兴产业股票型证券投资基金 2017 年第 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

深圳深南大道 7088 号招商银行大厦招商银行股份有限公司

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