

鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF） 2021 年第 1 季度报告

2021 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：2021 年 4 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。

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 2021 年 04 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华盛世创新混合 (LOF)
场内简称	鹏华创新
基金主代码	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	243,477,269.79 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

注：无。

§ 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（2021年1月1日-2021年3月31日）
1. 本期已实现收益	24,533,621.64
2. 本期利润	9,509,477.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0409
4. 期末基金资产净值	342,186,673.79
5. 期末基金份额净值	1.405

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

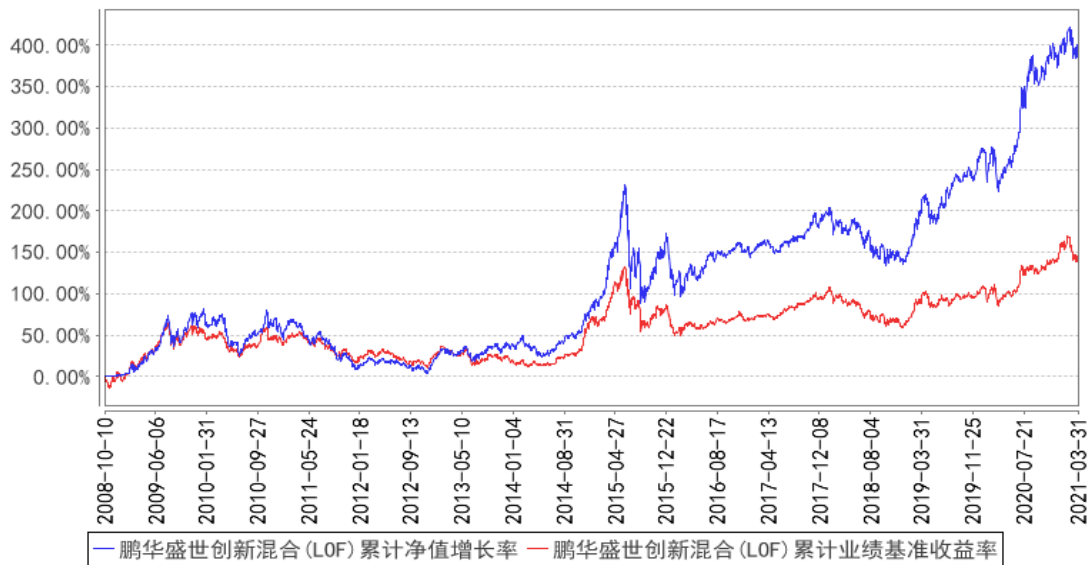
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.31%	1.28%	-1.99%	1.20%	4.30%	0.08%
过去六个月	10.96%	1.15%	8.23%	0.99%	2.73%	0.16%
过去一年	49.25%	1.28%	27.53%	0.99%	21.72%	0.29%
过去三年	79.49%	1.34%	27.49%	1.03%	52.00%	0.31%
过去五年	123.17%	1.18%	48.84%	0.88%	74.33%	0.30%
自基金合同 生效起至今	400.74%	1.47%	143.66%	1.17%	257.08%	0.30%

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 (LOF) 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	2011-12-28	-	15 年	伍旋先生，国籍中国，工商管理硕士，15 年证券基金从业经验。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员、基金经理助理，现担任权益投资一部副总经理/基金经理。2011 年 12 月担任鹏华盛世创新混合 (LOF) 基金基金经理，2015 年 02 月至 2017 年 02 月担任鹏华可转债债券基金基金经理，2015 年 04 月至 2019 年 12 月担任鹏华改革红利股票基金基金经理，2019 年 12 月担任鹏华优选价值股票基金基金经理，2020 年 03 月担任鹏华稳健回报混合基金基金经理，2020 年 05 月担任鹏华股息精选混合基金基金经理，2020 年 09 月担任鹏华启航两年封闭运作混合基金基金经理。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。
--	--	--	--	--	--------------------------------

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度权益市场波动加大。我们认为宏观经济仍保持较好的复苏趋势，但中性化的货币政策、通胀上升的预期使得较高的估值水平受到一定程度的压制。我们仍坚持基本面与估值相结合的基本框架，看好基本面因素改善以及估值具有吸引力的金融、制造业等领域。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内净值增长率为2.31%。同期上证综指涨跌幅为-0.90%，深证成指涨跌幅为-4.78%，沪深300指数涨跌幅为-3.13%。业绩比较基准增长率-1.99%。

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	314,849,379.65	90.01
	其中：股票	314,849,379.65	90.01
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	34,500,936.93	9.86
8	其他资产	437,106.39	0.12
9	合计	349,787,422.97	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	-	-
C	制造业	172,219,559.53	50.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.01
E	建筑业	8,875,419.00	2.59
F	批发和零售业	17,930,261.38	5.24
G	交通运输、仓储和邮政业	4,975,470.00	1.45
H	住宿和餐饮业	8,945,194.00	2.61
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,743,473.05	6.35
J	金融业	72,640,351.84	21.23
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	33,392.02	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,462,222.71	2.18
S	综合	-	-
	合计	314,849,379.65	92.01

5.2.2 报告期末按行业分类的港股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	000157	中联重科	1,676,500	21,308,315.00	6.23
2	603992	松霖科技	1,031,470	17,308,066.60	5.06
3	000001	平安银行	728,700	16,038,687.00	4.69
4	601318	中国平安	185,100	14,567,370.00	4.26
5	601166	兴业银行	585,300	14,099,877.00	4.12
6	002262	恩华药业	919,300	13,633,219.00	3.98
7	603330	上海天洋	435,347	13,008,763.61	3.80
8	000895	双汇发展	311,087	12,754,567.00	3.73
9	002624	完美世界	644,676	12,751,691.28	3.73
10	601398	工商银行	2,260,064	12,520,754.56	3.66

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

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

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的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

工商银行

处罚事由：

2020 年，公司收到《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）71 号）》，认为其主要违法违规事实为：

- 一、未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告
- 二、关键岗位未进行实质性轮岗
- 三、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞
- 四、为同业投资业务提供隐性担保
- 五、理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益
- 六、非标准化债权资产限额测算不准确
- 七、理财资金通过投资集合资金信托计划优先级的方式变相放大劣后级受益人的杠杆比例
- 八、部分重点领域业务未向监管部门真实反映
- 九、为违规的政府购买服务项目提供融资
- 十、理财资金违规用于缴纳或置换土地款

- 十一、通过转让分级互投实现不良资产虚假出表
- 十二、理财资金投资本行不良资产或不良资产收益权
- 十三、面向一般个人客户发行的理财产品投资权益性资产
- 十四、理财资金投资他行信贷资产收益权或非标资产收益权
- 十五、全权委托业务不规范
- 十六、用其他资金支付结构性存款收益
- 十七、自营贷款承接本行理财融资、贷款用途管理不尽职
- 十八、理财资金承接本行自营贷款
- 十九、封闭式理财产品相互交易调节收益
- 二十、滚动发行产品承接风险资产，且按原价交易调节收益
- 二十一、高净值客户认定不审慎
- 二十二、理财产品信息披露不到位
- 二十三、部分理财产品在全国银行业理财信息登记系统中未登记或超时限登记

处罚机构及处罚结果：

中国银行保险监督管理委员会依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第三十三条、第四十六条和相关审慎经营规则，予以罚款 5470 万元的行政处罚决定。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

平安银行

2020 年 10 月，公司曾收到《宁波银保监局行政处罚信息公开表(甬银保监罚决字(2020)66 号)》。

一、处罚事由

平安银行存在贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违法违规事实。

二、处罚机构及处罚结果

根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，宁波银保监局予以平安银行合计罚款人民币 100 万元的行政处罚决定。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

兴业银行

2021年1月,公司曾收到《交易商协会对永煤控股相关11家机构作出处分决定》。

一、处罚事由

经交易商协会查明,永煤控股突发性违约的背后,涉及多家机构、多类主体、多个环节的违规,既有发行人信息披露和合规意识淡漠的情况,也有中介机构“守门人”作用履职不充分的现象,还暴露出部分金融机构未能遵守执业道德的问题。其中兴业银行作为主承销商之一,存在内控管理不到位的情况。

二、处罚机构及处罚结果

经中国银行间市场交易商协会自律处分会议审议,对兴业银行予以通报批评或诫勉谈话。

2020年9月,公司曾收到《福建银保监局行政处罚信息公开表(闽银保监罚决字(2020)24号)》。

一、处罚事由

同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。

二、处罚机构及处罚结果

依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、四十六条、《中华人民共和国商业银行法》第七十四条,中国银保监会福建监管局予以兴业银行没收违法所得6,361,807.97元,并合计处以罚款15,961,807.97元的行政处罚决定。

2020年5月,公司曾收到《交易商协会自律处分信息——兴业银行》。

一、处罚事由

兴业银行作为债务融资工具主承销商,在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中,中标承销费率远低于市场正常水平,预估承销费收入远低于其业务开展平均成本。

二、处罚机构及处罚结果

依据相关自律规定,经中国银行间市场交易商协会2020年第5次自律处分会议审议,对兴业银行予以警告,责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

对该证券的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该公司,认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

5.11.2 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证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	108,174.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,815.12
5	应收申购款	326,116.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	437,106.39

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	603330	上海天洋	3,222,140.88	0.94	锁定期股票

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	241,118,533.92
报告期期间基金总申购份额	89,275,042.52
减：报告期期间基金总赎回份额	86,916,306.65
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	243,477,269.79

§ 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：无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 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 (%)
机构	1	20210119~20210125	41,353,540.38	10,677,897.96	11,000,000.00	41,031,438.34	16.85
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

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) 2021 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第 43 层鹏华基金管理有限公司。

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.cn>) 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

2021 年 4 月 21 日