

鹏华创新驱动混合型证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	鹏华创新驱动混合
基金主代码	005967
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 6 日
报告期末基金份额总额	147,506,946.57 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，精选创新驱动主题的企业进行投资，分享其发展和成长的机会，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 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上分析研判 A 股市场以及港股市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票（包括 A 股和港股）、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各资产投资比例。</p> <p>2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘 A 股和港股的优质公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>（1）创新驱动主题的定义 本基金将沿着中国经济结构升级</p>

的方向，遵循“坚持创新驱动，打造富有活力的增长模式”的指导思想，主要投资于：受益于创新增长方式的企业（比如：信息产业、高端制造业等）；以及受益于创新政策手段的企业（比如：国企改革、供给侧改革等）。具体来说，本基金所指的创新驱动主题相关股票指的是在产品或服务、技术、商业模式、企业制度等方面具有创新能力的企业所发行的股票，隶属的行业包括但不限于节能环保、互联网技术、传媒、通信、医药、医疗服务、高端装备制造、新能源、新材料、汽车及家电等行业。未来如果基金管理人认为有更适当的创新驱动主题的划分标准，基金管理人有权对上述界定方法进行变更。本基金由于上述原因变更界定方法不需经基金份额持有人大会通过，但应及时告知基金托管人并公告。若因基金管理人界定方法的调整等原因导致本基金持有的创新驱动主题的股票的比例低于非现金基金资产的 80%，本基金将在十个交易日之内进行调整。

（2）自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。

（3）自下而上的个股选择 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。

1）定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：一方面为竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面为管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

2）定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

（4）港股通标的投资策略 除创新驱动主题的公司之外，本基金还将关注以下几类港股通标的：1）在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；2）具有行业稀缺性的港股上市公司；3）港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。

（5）存托凭证的投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活

	地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。 4、权证投资策略 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。 5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。 6、股指期货投资策略 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，实现股票组合的超额收益。 7、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。
业绩比较基准	中证沪港深互联互通综合指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
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，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及港股市场的风险。
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

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	39,683,560.50
2. 本期利润	-9,068,670.53
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0554
4. 期末基金资产净值	251,908,012.20
5. 期末基金份额净值	1.7078

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	-5.05%	1.74%	0.21%	1.15%	-5.26%	0.59%
过去六个月	-3.75%	1.53%	9.40%	0.96%	-13.15%	0.57%
过去一年	41.82%	1.66%	25.14%	0.97%	16.68%	0.69%
自基金合同 生效起至今	70.78%	1.54%	19.11%	0.99%	51.67%	0.55%

注：业绩比较基准=中证沪港深互联互通综合指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

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



注：1、本基金基金合同于 2018 年 06 月 06 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		
聂毅翔	本基金基金经理	2018-06-06	-	11 年	聂毅翔先生，国籍中国，理学博士，11 年证券基金从业经验。历任美国风暴通讯咨询公司高级项目经理，美国罗根斯通资本对冲基金公司交易员，美国期货交易监管委员会助理经济学家，鹏华基金国际业务部投资经理，中银国际证券投资主办人，国海富兰克林基金国际业务副总监，天弘基金基金经理；2017 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任研究部副总经理/基金经理。2017 年 08 月担任鹏华沪深港互联网基金基金经理，2018 年 06 月担任鹏华创新驱动混合基金基金经理，2018 年 09 月担任鹏华研究驱动混合基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华香港银行指数（LOF）基金基金经理，2021 年 01 月担任鹏华汇智优选混合基金基金经理，2021 年 03 月担任鹏华创新成长混合基金基金经理。聂毅翔先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，梁浩不再担任本基金基金经理。
梁浩	本基金基金经理	2018-06-06	2021-01-02	13 年	梁浩先生，国籍中国，经济学博士，13 年证券基金从业经验。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，历任研究部高级研究员、基金经理助理、副总经理、董事总经理（MD），现担任公司副总裁/研究部总经理，投资决策委员会成员。2011 年 07 月担任鹏华新兴产业混合基金基金经理，2014 年 03 月至 2015 年 12 月担任鹏华环保产业股票基金基金经理，2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任鹏华先进制造股票基金基金经理，2015 年 07 月至 2017 年 03 月担任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理，2016 年 01 月至 2017 年 03 月担任鹏华健康环保混合基金基金经理，2016 年 06 月至 2017 年 07 月担任鹏华医药科技股票基金基金经理，2017 年 10 月担任鹏华研究精选混合基金基金经理，2018

				<p>年 06 月至 2021 年 01 月担任鹏华创新驱动混合基金基金经理，2018 年 09 月至 2020 年 03 月担任鹏华研究驱动混合基金基金经理，2019 年 05 月至 2021 年 01 月担任鹏华研究智选混合基金基金经理，2019 年 12 月至 2021 年 01 月担任鹏华价值驱动混合基金基金经理，2020 年 01 月担任鹏华科技创新混合基金基金经理，2020 年 07 月担任鹏华新兴成长混合基金基金经理，2020 年 10 月担任鹏华成长智选混合基金基金经理，2021 年 01 月担任鹏华汇智优选混合基金基金经理。梁浩先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，梁浩不再担任本基金基金经理。</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。

4.1.1 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，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年一季度市场结构化行情走向极致，出现前高后低的大幅波动。春节前所谓白马抱团股受到市场乐观情绪驱动估值大幅扩张，股价非理性冲高。春节后受到美国国债利率上行影响，处于估值高位的所谓白马抱团股股价快速回落。在经济基本面总体向好，企业盈利不断改善的环境下，市场股价大幅变化主要还是受估值波动和情绪面影响。组合一直秉持 GARP

(Growth At Reasonable Price) 的成长价值投资风格，并未一味追高抱团，所以受到短期所谓抱团股股价波动的影响相对较小。同时组合借市场波动机会进行了适当调整优化，主要优化配置到公司基本面扎实、估值合理、未来盈利增长可期的个股上。我们仍将继续从公司基本面出发以长期持有盈利增长确定性较高并且估值合理的个股为主，相信可以取得较好的长期收益表现。从长期投资角度，在当前阶段我们相对乐观。基金将继续坚持以“创新驱动”为线索的投资思路，坚持自下而上精选个股，着重发掘那些未来盈利增长可观且确定性较强的细分行业优质公司并长期持有。基金组合持仓相对稳定，持仓主线将继续保持“创新驱动”为核心的几个主要方向，包括科技、创新医药、新兴消费、高端制造和新材料等细分行业。我们相信这些长期赛道优秀、中长期盈利可期、基本面扎实的个股有望取得较好长期表现。

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-5.05%。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%。

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	232,125,856.22	91.67
	其中：股票	232,125,856.22	91.67
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	20,920,527.73	8.26
8	其他资产	180,281.96	0.07
9	合计	253,226,665.91	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 30,341,605.34 元，占净值比 12.04%。

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	138,184,923.44	54.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,679,168.82	7.42
G	交通运输、仓储和邮政业	10,016,200.00	3.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,981,747.11	11.90
J	金融业	1,183,425.93	0.47
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,354,794.24	1.33
M	科学研究和技术服务业	326,563.20	0.13
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	201,784,250.88	80.10

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	12,198,381.52	4.84
日常消费品	6,207,678.07	2.46

医疗保健	-	-
金融	1,324,809.51	0.53
信息技术	-	-
通信服务	10,610,736.24	4.21
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	30,341,605.34	12.04

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	600556	天下秀	1,550,502	15,474,009.96	6.14
2	300558	贝达药业	151,776	15,274,736.64	6.06
3	000026	飞亚达	965,700	15,248,403.00	6.05
4	002481	双塔食品	1,125,700	12,787,952.00	5.08
5	300792	壹网壹创	143,160	12,598,080.00	5.00
6	03690	美团-W	48,400	12,198,381.52	4.84
7	002648	卫星石化	308,100	11,606,127.00	4.61
8	00700	腾讯控股	20,581	10,610,736.24	4.21
9	300750	宁德时代	32,900	10,599,393.00	4.21
10	603713	密尔克卫	82,100	10,016,200.00	3.98

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：无。

5.9.2 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，实现股票组合的超额收益。

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

卫星石化

一、2020 年 11 月卫星石化收到深交所《关于对浙江卫星石化股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》。

1.1 处罚事由

卫星石化及相关当事人存在以下违规行为：

1.1.1 船舶期租协议未履行审议程序且未及时对外披露

2018 年 7 月，卫星石化与船东 Delos Energy Transportation LLC（以下简称“原船东”）签订船舶期租协议，协议约定 6 艘船舶的租赁期限为 15 年，租期内总租金为 15.53 亿美元（扣除船舶检修停租天数），折合人民币 104.08 亿元。当月，原船东与两家造船公司签订 6 艘船舶建造合同。后续由于原船东未能支付造船进度款履行造船合同，两家造船公司计划终止造船合同，上

述期租协议未实际执行，卫星石化也未支付任何租金。上述船舶期租协议金额占卫星石化 2017 年经审计净资产的比例为 144.61%，卫星石化未履行审议程序且未及时对外披露。

1.1.2 造船承接协议未履行审议程序且未及时对外披露

2019 年 3 月，卫星石化与上述两家造船公司协商，由卫星石化设立六家香港子公司暂时承接上述造船合同，船舶总造价为 7.17 亿美元，折合人民币 48.13 亿元。上述造船承接协议金额占卫星石化 2018 年经审计净资产的比例为 59.87%，卫星石化未履行审议程序且未及时对外披露。前述两个协议直至 2020 年 8 月 11 日才对外完整披露。

卫星石化上述行为违反了深交所《股票上市规则（2018 年 4 月修订）》第 1.4 条、第 2.1 条、第 2.7 条、第 9.3 条和本所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条、第 2.1 条、第 2.7 条、第 9.3 条的规定。

卫星石化董事长兼总裁杨卫东未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务，违反了深交所《股票上市规则（2018 年 4 月修订）》第 1.4 条、第 2.2 条、第 3.1.5 条、第 3.1.6 条和深交所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条、第 2.2 条、第 3.1.5 条、第 3.1.6 条的规定，对卫星石化上述违规行为负有重要责任。

卫星石化董事会秘书沈晓炜未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务，违反了深交所《股票上市规则（2018 年 4 月修订）》第 1.4 条、第 2.2 条、第 3.1.5 条、第 3.2.2 条和深交所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条、第 2.2 条、第 3.1.5 条、第 3.2.2 条的规定，对卫星石化上述违规行为负有重要责任。

1.2 处罚机构及处罚结果

鉴于上述违规事实及情节，依据深交所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 17.2 条、第 17.3 条、第 17.4 条和深交所《上市公司纪律处分实施标准（试行）》第十六条的规定，经深交所纪律处分委员会审议通过，深交所作出如下处分决定：

对浙江卫星石化股份有限公司给予通报批评的处分。对浙江卫星石化股份有限公司董事长兼总裁杨卫东、董事会秘书沈晓炜给予通报批评的处分。

二、2020 年 12 月卫星石化发布《关于收到浙江证监局行政监管措施决定书公告》。

2.1 处罚事由

2020 年 12 月卫星石化发布《关于收到浙江证监局行政监管措施决定书公告》。2020 年 12 月 18 日，浙江卫星石化股份有限公司及相关责任人员收到中国证券监督管理委员会浙江证监局行政监管措施决定书《关于对浙江卫星石化股份有限公司及杨卫东、沈晓炜、王满英采取出具警示函措施的决定》（【2020】106 号），现将决定书内容公告如下：

浙江卫星石化股份有限公司、杨卫东、沈晓炜、王满英：

经查，浙江监管局发现浙江卫星石化股份有限公司（以下简称“卫星石化”或者“公司”）存在以下违规事项：

2.1.1 2018 年 7 月，卫星石化与船东 Delos Energy Transportation LLC（以下简称“原船东”）签订船舶期租协议，租期为 15 年，租金总额为 15.53 亿美元，折合人民币 104.08 亿元。当月，原船东与两家造船公司签订 6 艘船舶建造合同。2019 年 1 月，原船东未如期支付造船款，两家造船公司因此取消造船合同。公司未实际执行上述期租协议，也未支付任何租金。公司迟至 2020 年 8 月 11 日才对外完整披露上述期租协议，存在未履行审议程序和信息披露义务的情形。

2.1.2 2019 年 3 月，卫星石化与上述两家造船公司协商，由卫星石化设立六家香港子公司暂时承接上述造船合同，并垫付造船款项。造船合同总金额合计 7.17 亿美元，折合人民币 48.13 亿元。公司在 2019 年半年报中未准确披露已垫付的造船款，且迟至 2020 年 6 月 29 日才对外完整披露承接的造船合同，存在未履行审议程序和信息披露义务的情形。

2.1.3 卫星石化于 2017 年 8 月非公开发行股票筹集资金 30 亿元。2018 年 5 月 30 日至 2019 年 3 月 5 日期间，卫星石化使用部分闲置募集资金（最高额达 2 亿元）循环购买了 10 笔结构性存款，累计金额 12.50 亿元。卫星石化使用闲置募集资金购买结构性存款的行为未履行公司审议程序和信息披露义务。

2.2 处罚机构及处罚结果

卫星石化的上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条、第三条、第三十条和《上市公司监管指引第 2 号—上市公司募集资金管理和使用的监管要求》第七条等规定。公司董事长兼总裁杨卫东、董事会秘书沈晓炜、财务负责人王满英对上述问题负有主要责任，按照《上市公司信息披露管理办法》第五十八条、第五十九条的规定，浙江监管局决定采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案。相关责任人应充分吸取教训，加强相关法律法规学习，提高规范运作意识，认真履行股东大会、董事会和监事会审议程序和信息披露义务，采取切实有效措施杜绝此类违规行为再次发生，并于 2020 年 12 月 30 日前向浙江监管局提交书面整改报告。

三、2021 年 1 月卫星石化收到深交所中小板公司管理部《关于对浙江卫星石化股份有限公司的监管函》。

3.1 处罚事由

监管函：2017 年 11 月 13 日，卫星石化股东大会审议通过《关于公司调整闲置募集资金进行现金管理的投资范围和期限的议案》，使用不超过 100,000 万元闲置的募集资金购买安全性高、流动性好的银行、证券公司或信托公司等金融机构保本型理财产品。卫星石化后续使用上述闲置募

集资金购买理财产品时，存在超出上述审议范围的情形。

3.2 处罚机构及处罚结果

卫星石化的上述行为违反了深交所《中小企业板上市公司规范运作指引（2015 年修订）》第 6.3.13 条的规定。要求卫星石化董事会充分重视上述问题，吸取教训，及时整改，杜绝上述问题的再次发生。

同时，提醒卫星石化：上市公司应当按照国家法律、法规、深交所《股票上市规则》和《上市公司规范运作指引》等规定，诚实守信，规范运作，认真和及时地履行信息披露义务。上市公司全体董事、监事、高级管理人员应当保证信息披露内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并就其保证承担个别和连带的责任。

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。

腾讯控股

2021 年 3 月 12 日，国家市场监督管理总局针对腾讯控股有限公司收购猿辅导（YUAN INC）股权构成未依法申报违法实施的经营者集中，给予腾讯 50 万元人民币罚款的行政处罚。

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，认为该罚款不影响公司的长期投资价值。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	92,782.91
2	应收证券清算款	12,485.52
3	应收股利	-
4	应收利息	2,496.41
5	应收申购款	72,517.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	180,281.96

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	300558	贝达药业	15,274,736.64	6.06	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	207,041,861.15
报告期期间基金总申购份额	8,534,207.66
减：报告期期间基金总赎回份额	68,069,122.24
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	147,506,946.57

§ 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

注：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) 《鹏华创新驱动混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华创新驱动混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华创新驱动混合型证券投资基金 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