

鹏华基金增发精选 3 号资产管理计划

2024 年第 1 季度报告

资产管理计划管理人：鹏华基金管理有限公司

资产管理计划托管人：中国工商银行股份有限公司

报告期间：2024 年 01 月 01 日 - 2024 年 03 月 31 日

报告送出日期：2024 年 04 月 22 日

1 基本信息

投资组合名称:	鹏华基金增发精选 3 号资产管理计划
合同生效时间:	2015-03-27
管理人:	鹏华基金管理有限公司
托管人:	中国工商银行股份有限公司

2 资产管理计划投资表现

2.1 基本收益率信息

	本期末
期末资产净值(元)	3,344,170.51
本期利润(元)	8,220.93
份额净值(元)	0.055
份额累计净值(元)	0.055

3 资产管理计划投资组合报告

3.1 期末资产配置情况

序号	资产类别	市值(元)	占总资产的比例(%)
1	权益投资	1,281,008.25	38.29
	其中:股票	1,281,008.25	38.29
2	固定收益投资	-	-
3	基金	1,311,911.71	39.22
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款及清算备付金	752,250.55	22.49
7	其他资产	-	-
8	资产合计	3,345,170.51	100.00

注:本资产管理计划期末持有期货合约 0 手。

3.2 期末资产投资前十名股票(按市值)明细

代码	名称	持仓数量(股)	市值(元)	市值占净资产比例(%)
400100	工新 3	5,124,033.00	1,281,008.25	38.31

3.3 期末资产投资前五名固收品种（按市值）明细

无。

3.4 期末资产投资前五名基金（按市值）明细

代码	名称	持仓数量(份)	市值(元)	市值占净资产比例(%)
000905	鹏华安盈宝货币 A	779,768.77	779,768.77	23.32
009824	鹏华添利宝货币 B	532,142.94	532,142.94	15.91

3.5 期末管理计划运用杠杆情况

截止本报告期末，本资产管理计划的杠杆比例为 100.03%，符合合同及相关规定。

4 管理人履职报告

4.1 投资经理（或投资经理小组成员）情况

投资经理姓名	学历	证券从业年限	主要工作经历
梁昶	硕士研究生	14 年	梁昶先生，国籍中国，经济学硕士，14 年证券从业经验。曾任广发证券发展研究中心分析师。2014 年 05 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究员高级研究员、资深研究员，现担任权益投资一部投资经理。梁昶先生具备基金从业资格

4.2 投资策略回顾与展望

本组合本报告期内按照资产管理合同的约定进行操作。

在 2024 年第一季度，A 股市场经历了较大幅度的波动。在春节前，由于量化资金短期因素的干扰，市场出现了较大的跌幅。然而，节后随着资本市场相关政策的持续释放正面支持信号，加之春节期间消费数据表现好于预期，市场出现了底部企稳和快速反弹。期间，沪深 300 指数上涨了 3.10%，而创业板则下跌了 3.87%，恒生指数下跌了 2.97%。

从宏观层面来看，国内经济基本面有所修复，结构性亮点突出。然而，海外市场仍然存在不确定性，美国经济的强劲表现以及美债利率的持续高位，再加上美联储在利率政策上的摇摆不定，都对市场整体风险偏好产生了一定压制。

针对这一情况，我们在保持一贯的价值投资判断的基础上，积极应对市场变化，同时密切关注上市公司披露的年报季报等基本面线索。

4.3 公平交易专项说明

1、公平交易制度的执行情况的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司管理的不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

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。公司对不同投资组合在不同时间窗口下的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

2、本资产管理计划与其他投资风格相似的证券投资基金之间的业绩比较的专项说明

本资产管理计划旗下无其他投资风格相似的证券投资基金。

3、异常交易行为的专项说明

报告期内，本资产管理计划未发生违法违规并且对资产管理计划财产造成损失的异常交易行为。

4.4 报告期内资管计划投资收益分配情况

无。

5 托管人履职报告

本报告期内，本资产管理计划托管人在托管过程中，严格遵守资产管理计划合同的相关规定和相关法律法规，不存在任何损害资产管理计划持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了资产管理计划托管人应尽的义务。

本报告期内，管理人在投资运作、资产管理计划资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害资产管理计划持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照资产管理计划合同的规定进行。

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本定期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

6.1 管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 03 月 31 日	上季度可比期间 2023 年 10 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的资产管理 计划应支付的管理费	-	-

注：本资产管理计划管理费年费率为 0.30%，逐日计提，按季支付。日管理费=前一日资产管理计划资产净值*0.30%/当年天数。本组合从 2020 年 5 月 29 日起不再计提管理费。

6.2 托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 03 月 31 日	上季度可比期间 2023 年 10 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的资产管理 计划应支付的托管费	-	-

注：本资产管理计划托管费年费率为 0.10%，逐日计提，按季支付。日托管费=前一日资产管理计划资产净值*0.10%/当年天数。本组合从 2020 年 5 月 29 日起不再计提托管费。

6.3 浮动管理费

注：本报告期未发生此事项。

6.4 业绩报酬

注：本报告期未发生此事项。

7 涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

7.1 投资经理变更

无。

7.2 公司关联人员的持有情况

项目	持有资产管理计划份额总量的数量区间（万份）
本公司董事、监事及其配偶	>=100
计划管理人所有从业人员及其配偶	-
控股股东、实际控制人或者其他关联方	-

截至本报告期末，本公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方投资、持有本资产管理计划符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

7.3 重大关联交易情况

本基金在本报告期内未参与基金管理人、托管人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。

7.4 报告期内开放期的相关说明

无。

7.5 其他

2023年11月10日，哈尔滨中级人民法院裁定确认工大高新等五家公司的《重整计划》已执行完毕，并终结工大高新等五家公司破产重整程序。2023年12月12日，工大高新发布《哈尔滨工大高新技术产业开发股份有限公司关于公司股票恢复转让的公告》，根据《两网公司及退市公司股票转让办法》等相关规定，经向全国股转公司申请，“工新3”股票自2023年12月13日起恢复转让。

“工新3”复牌交易后，截至本报告期末，本公司仍未收到委托人代表万超先生出具的卖出指令。鉴于此，委托人可能面临失去交易机会的风险，本公司特就前述风险进行提示。后续如收到委托人代表万超先生出具的卖出指令，本公司将按照卖出指令执行。特别提示各委托人，“工新3”股票复牌后交易日成交价格（含收盘价）不代表本计划股票卖出价格，也不代表本计划资产净值，本计划股票卖出价格以届时实际成交价格为准。

8 声明

郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表、附件真实、准确、完整。

鹏华基金管理有限公司

2024年04月22日