

基金评级

Wind 3年
★★★★
Wind 5年
★★★★

基金业绩

近一年
6.61%
近三年
-0.71%
近五年
15.61%
近十年
--
成立以来
19.77%
年化收益
2.01%

基本信息

成立日期
2015-04-17
基金公司
鹏华基金
基金经理
余展昌
基金规模
8.14亿元(2024-03-31)
投资类型
被动指数型基金
投资风格
大盘价值风格型
比较基准
中证银行指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%

投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

交易信息

最新交易日
2024-05-06
收盘价
1.0370
折溢价率
-0.44%
流通份额
1.96亿份
换手率
0.41%
上市日期
2021-01-18
上市交易份额
5.92亿份

购买信息

申购状态
开放申购
赎回状态
开放赎回
最小申赎单位
--
申购费率
0.00%-1.20%
赎回费率
0.00%-1.50%
管理费率
1.00%
托管费率
0.20%
销售服务费率
--
总费率(持有1年)
1.20%-3.90%

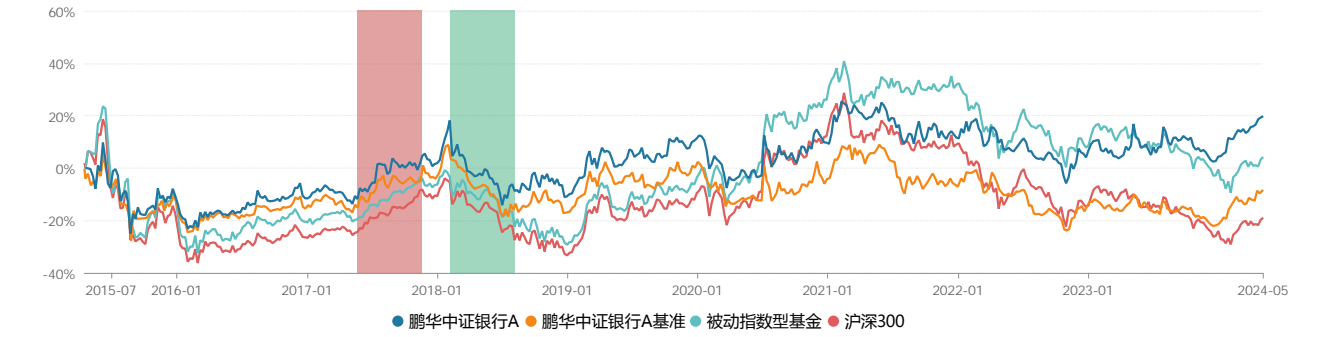
持股风格(2023-12-31)

| | | | |
|-----|-----|-----|----|
| 97% | 0% | 0% | 大盘 |
| 3% | 0% | 0% | |
| 0% | 0% | 0% | |
| 价值型 | 平衡型 | 成长型 | |

业绩表现

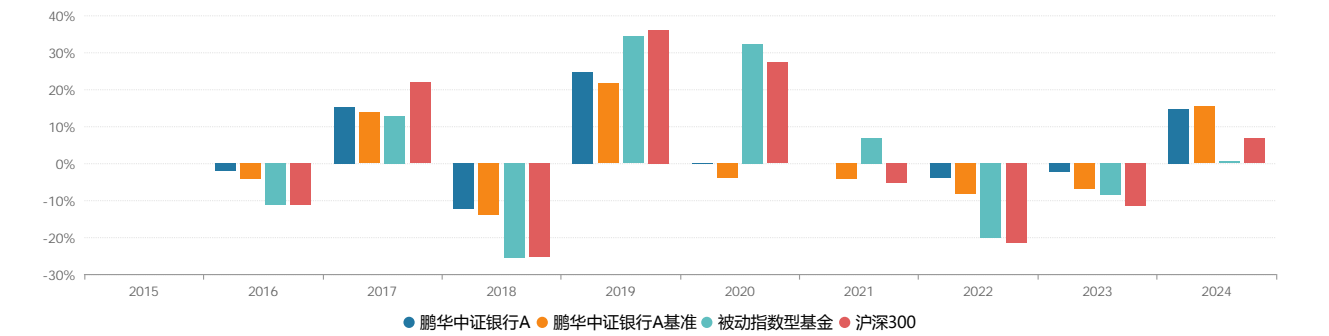
最高连续6月回报(%)：21.81

最差连续6月回报(%)：-23.10



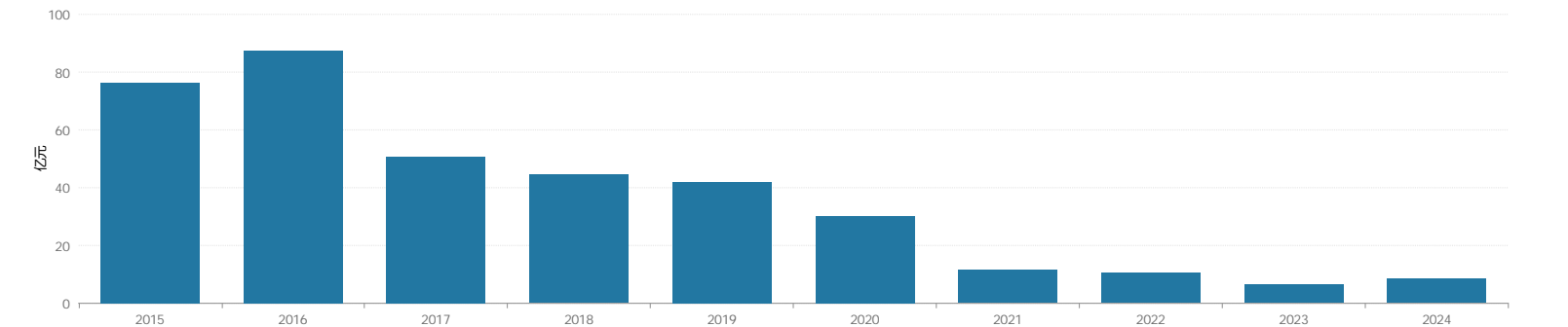
| | YTD | 近六月 | 近一年 | 近两年 | 近三年 | 近五年 | 近十年 | 总回报 (9.1年) | 年化回报 |
|-----------|---------|----------|---------|----------|---------|---------|-----|---------------|--------|
| 鹏华中证银行A | 14.71% | 11.28% | 6.61% | 10.34% | -0.71% | 15.61% | -- | 19.77% | 2.01% |
| 鹏华中证银行A基准 | 15.40% | 11.93% | 1.81% | 0.78% | -12.70% | -5.31% | -- | -8.35% | -0.96% |
| 被动指数型基金 | 0.43% | -3.76% | -11.44% | -4.40% | -16.68% | 22.02% | -- | 4.07% | 0.44% |
| 沪深300 | 6.61% | 0.70% | -8.94% | -6.42% | -27.73% | -0.73% | -- | -18.96% | -2.29% |
| 同类排名 | 77/2153 | 154/2049 | 83/1852 | 236/1538 | 153/991 | 314/547 | -- | 48/198 | 48/198 |

年度回报



| 年份 | 鹏华中证银行A | 鹏华中证银行A基准 | 被动指数型基金 | 沪深300 | Wind三年评级 | 同类排名 |
|------|---------|-----------|---------|---------|----------|------|
| 2024 | 14.71% | 15.40% | 0.43% | 6.61% | -- | -- |
| 2023 | -2.26% | -6.86% | -8.60% | -11.38% | -- | -- |
| 2022 | -4.03% | -8.26% | -20.08% | -21.63% | -- | -- |
| 2021 | 0.00% | -4.09% | 6.76% | -5.20% | -- | -- |
| 2020 | 0.07% | -3.90% | 32.19% | 27.21% | -- | -- |
| 2019 | 24.67% | 21.52% | 34.31% | 36.07% | -- | -- |
| 2018 | -12.42% | -13.91% | -25.51% | -25.31% | -- | -- |
| 2017 | 15.23% | 13.67% | 12.72% | 21.78% | -- | -- |
| 2016 | -1.98% | -4.06% | -11.10% | -11.28% | -- | -- |

历年规模变化



历任基金经理

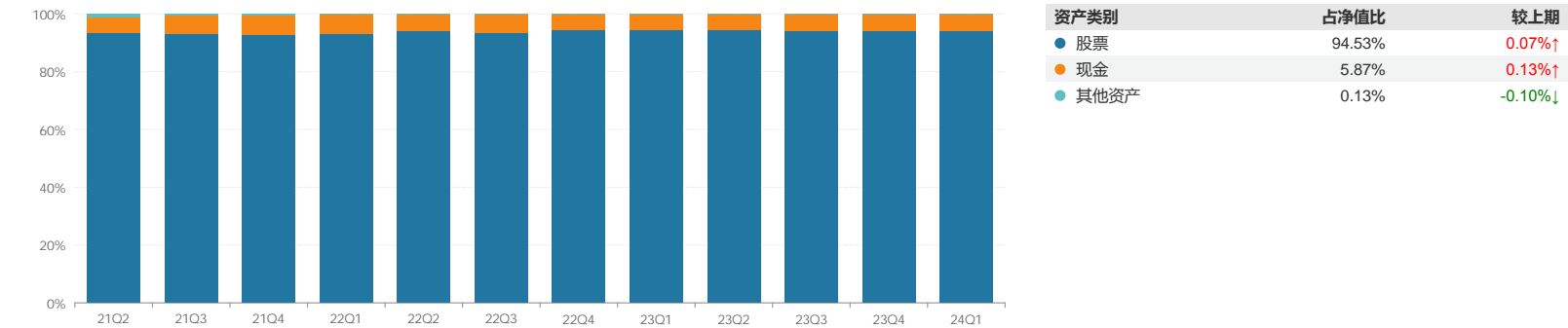
| 基金经理 | 任职日期 | 离任日期 | 任职总回报 | 任职年化回报 | 同类排名 | 超越基准回报 |
|------|------------|------------|---------|--------|----------|--------|
| 余展昌 | 2022-10-15 | -- | 17.83% | 11.08% | 147/1673 | 4.82% |
| 张羽翔 | 2021-01-20 | 2022-10-15 | -15.49% | -9.25% | 304/883 | 6.83% |
| 闫冬 | 2019-11-20 | 2021-01-20 | 9.12% | 7.75% | 606/660 | 4.49% |
| 崔俊杰 | 2015-04-17 | 2019-11-20 | 10.22% | 2.14% | 41/198 | 10.44% |

风险收益分析 (近三年)

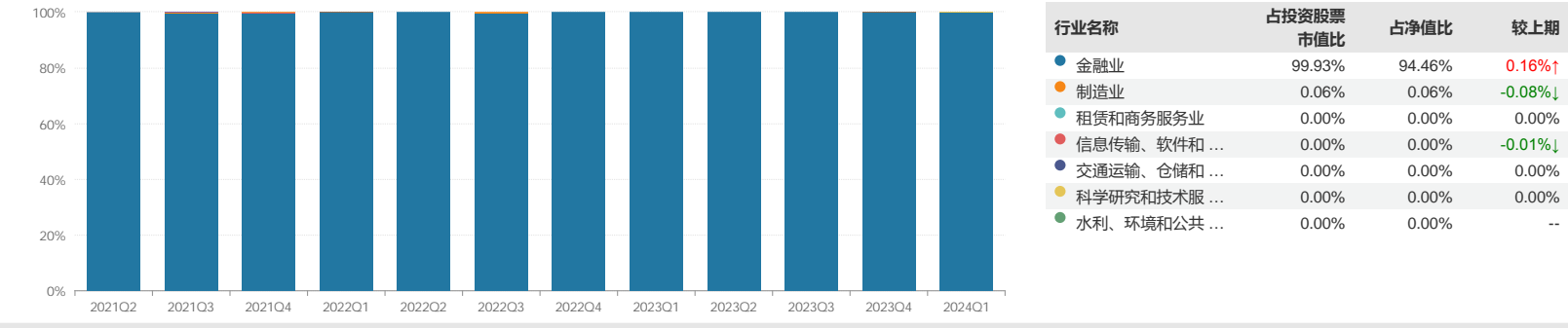
| | 年化收益率 | 年化波动率 | 最大回撤 | 恢复天数 | 年化夏普比率 | 卡玛比率 | 月度正收益率 |
|------|--------|--------|---------|------|--------|-------|--------|
| 本基金 | -0.24% | 15.41% | -25.41% | -- | -0.06 | -0.01 | 45.71% |
| 同类基金 | -6.33% | 20.21% | -40.99% | 188 | -0.32 | -0.12 | 43.37% |

鹏华中证银行A自2021/05/06以来，年化收益率为-0.24%，高于同类平均水平；年化波动率为15.41%，低于同类平均水平；最大回撤为-25.41%，优于同类平均水平。综合该基金的年化波动率和最大回撤在同类基金中的排名，该基金风险较低。该基金区间年化夏普比率为-0.06%，高于同类平均水平；月度正收益率为45.71%，高于同类平均水平。

资产配置 (2024-03-31)



股票行业配置 (2024-03-31)



重仓持股 (2024-03-31)

| 股票名称 | 持仓市值(元) | 持仓数量 | 相对上期增减 | 占股票市值比 | 占基金净值比 | 占流通股本比 | 所属行业 | 区间涨跌幅 | 行业区间涨跌幅 |
|------|----------------|------------|--------|---------|---------|--------|------|--------|---------|
| 招商银行 | 119,312,881.80 | 3,705,369 | 16.42% | 15.50%↑ | 14.65%↑ | 0.02% | 金融 | 15.74% | 3.50% |
| 兴业银行 | 71,020,414.80 | 4,500,660 | 16.41% | 9.23%↓ | 8.72%↓ | 0.02% | 金融 | -2.65% | 3.50% |
| 工商银行 | 57,275,027.04 | 10,847,543 | 16.42% | 7.44%↓ | 7.03%↓ | 0.00% | 金融 | 10.46% | 3.50% |
| 交通银行 | 53,911,898.36 | 8,503,454 | 16.41% | 7.01%↓ | 6.62%↓ | 0.02% | 金融 | 10.45% | 3.50% |
| 江苏银行 | 44,868,642.50 | 5,679,575 | 16.41% | 5.83%↑ | 5.51%↑ | 0.03% | 金融 | 18.09% | 3.50% |
| 农业银行 | 41,794,003.17 | 9,880,379 | 16.42% | 5.43%↑ | 5.13%↑ | 0.00% | 金融 | 16.21% | 3.50% |
| 平安银行 | 31,592,275.36 | 3,003,068 | 16.42% | 4.11%↑ | 3.88%↑ | 0.02% | 金融 | 12.03% | 3.50% |
| 民生银行 | 31,114,768.95 | 7,682,659 | 16.42% | 4.04%↓ | 3.82%↓ | 0.02% | 金融 | 8.29% | 3.50% |
| 中国银行 | 28,701,389.20 | 6,523,043 | 16.42% | 3.73%↓ | 3.53%↓ | 0.00% | 金融 | 10.28% | 3.50% |
| 北京银行 | 25,926,003.56 | 4,580,566 | -- | 3.37% | 3.18% | 0.02% | 金融 | 24.94% | 3.50% |
| 合计 | 505,517,304.74 | -- | -- | 65.69% | 62.09% | -- | -- | -- | -- |

市场分析 (2024-03-31)

本基金秉承指数基金的投资策略，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。