鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金

【2013】第四季度报告

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:2014年1月21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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月16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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华沪深300ETF
基金主代码	159927
交易代码	159927
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年7月19日
报告期末基金份额总额	70,192,168.00份
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。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式指数基金,采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。
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:本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下,可简称为"A300ETF"

§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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	6,132,532.94
2.本期利润	-5,384,903.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0650
4.期末基金资产净值	162,885,644.79
5.期末基金份额净值	2.3206

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

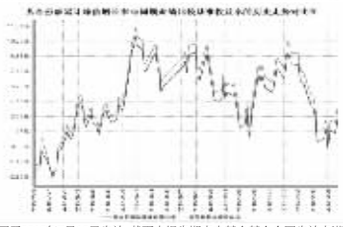
3.2 基金净值表现

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	-3.50%	1.12%	-3.28%	1.12%	-0.22%	0.00%

注:业绩比较基准=沪深300指数

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2013年7月19日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年且仍处于建仓期。
2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定,于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

§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		
崔俊杰	本基金基金经理	2013年7月19日	-	5	崔俊杰先生,国籍中国,金融工程专业管理学硕士,5年证券基金从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员、先后从事产品设计、量化研究工作,2013年3月起担任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理,2013年3月起兼任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理,2013年7月起兼任鹏华沪深300ETF基金基金经理。崔俊杰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%的交易次数为1次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年是流动性较为紧张的一年,6月与12月份的"钱荒效应"明显,利率单边走高对实体经济有一定冲击效应。预计2014年流动性收紧态势可能会转为流动性紧平衡状态,为"调结构,稳增长"营造一个有利的环境。第四季度为本基金运作的第二个季度,根据基金产品的特点,本基金维持高仓位并保证了较低的跟踪误差,较好的实现了跟踪标的指数的目标。

基金正式上市交易之后,面对市场震荡及基金申赎变动,我们进行了精心的管理,较好的实现了跟踪误差控制目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末,本基金份额净值为2.3206元,累计净值1.0269元;本报告期基金份额净值增长率为-3.50%。本报告期基金日均跟踪偏离度的绝对值0.008%,年跟踪误差0.153%。

对本基金而言,报告期内跟踪误差的主要来源为:样本股特殊事件导致的停复牌、成分股调整等,对此我们采取了进一步的"优化"策略进行应对。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看,经济总量增速依旧维持高位,但结构失衡较为严重,预期2014年将以经济结构调整为主线。2013年是流动性较为紧张的一年,6月和12月末的"钱荒效应"明显,利率单边走高对实体经济有一定冲击。也许在2014年流动性收紧态势可能会转为流动性紧平衡状态,为"调结构,稳增长"营造一个有利的外部环境。新颁布的官员考核机制也为地方经济增长方式的转变带来新的思考和期待。

2013年A股市场整体估值有所修复,QE得以继续,外需增加成为2013年经济数据维持的重要因素。也许,由于经济数据转好,短期估值逐步修复加上新政策的逐步推出和落实的诸多憧憬,会在2014年给市场带来估值持续提振的可能,但在市场波动中尤其要注意参与力度和风险控制,因此,我们建议继续密切关注与实体经济相关的宏观数据变化。

我们仍然强调前期的观点:反复的经济形势势必带来资产之间轮动演绎的复杂化和高频率化,资产配置犯错的概率和机会成本相对较高,建议投资者从中长期投资的角度来考虑战略资产配置,避免短期频繁操作带来的风险。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击,努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内,力争为投资者带来较好的投资回报。

§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	162,202,379.16	99.18
	其中:股票	162,202,379.16	99.18
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,103,598.35	0.67
6	其他资产	234,460.47	0.14
7	合计	163,540,437.98	100.00

注:上表中的股票投资项合可退替代款估值增值,而5.2.1的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	1,178,492.61	0.72
B	采矿业	9,916,298.85	6.09
C	制造业	59,254,217.64	36.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,028,440.20	3.09
E	建筑业	5,580,696.89	3.43
F	批发和零售业	5,206,336.10	3.20
G	交通运输、仓储和邮政业	4,448,485.91	2.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,625,051.56	2.84
J	金融业	54,542,246.09	33.48
K	房地产业	7,408,835.68	4.55
L	租赁和商务服务业	1,127,922.77	0.69
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,517,896.00	0.93
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	810,078.80	0.50
S	综合	1,557,380.06	0.96
	合计	162,202,379.16	99.58

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	148,891	6,213,221.43	3.81
2	600036	招商银行	515,699	5,615,962.11	3.45
3	600016	民生银行	705,008	5,442,661.76	3.34
4	601166	兴业银行	358,820	3,638,434.80	2.23
5	600000	浦发银行	351,360	3,313,324.80	2.03
6	600837	海通证券	253,989	2,875,155.48	1.77
7	600030	中信证券	209,780	2,674,695.00	1.64
8	000651	格力电器	75,529	2,466,777.14	1.51
9	000002	万 科A	299,240	2,402,897.20	1.48
10	601288	农业银行	815,240	2,021,795.20	1.24

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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名的前五名债券投资明细
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名的前十名资产支持证券投资明细
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名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期内未发生股指期货投资。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1
本基金投资的前十名证券之一的中国平安的发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司(简称"中国平安")于2013年5月22日发布公告称其控股子公司平安证券收到中国证监会《行政处罚和市场禁入事先告知书》,中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。2013年10月15日,中国平安发布公告称近日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2013]48号),决定对平安证券予以前述行政处罚。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为中国平安作为国内最大的保险机构之一将长期受益于我国保险行业的发展,从处罚公告中知悉,2012年平安证券投行业务承销佣金收入占平安集团营业收入的0.19%,净利润的0.66%,对平安集团的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次行政处罚对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为ETF基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合ETF基金的管理规定,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。

本基金投资的前十名证券之一的海通证券的发行人海通证券股份有限公司于2013年4月22日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决【2013】12号)(以下简称"决定"),主要内容如下:"经查,我局发现你公司发行的"一海通财"系列产品系现行监管规则未予明确的创新型产品,但你公司未按照《证券公司业务(产品)创新工作指引(试行)》的规定,向中国证监会机构监管部履行创新产品方案报送义务。"针对决定提出的问题,发行人组织整改,完善相关工作程序,并对相关责任人进行了责任追究和处分。

对该股票的投资决策程序的说明:本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为ETF基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该股票的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合ETF基金的管理规定,该股票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。

本基金投资的其他前十名证券中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。

5.10.2
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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	234,097.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	363.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	234,460.47

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.10.7 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	104,192,168.00
报告期期间基金总申购份额	4,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	38,000,000.00
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	70,192,168.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
(一)《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
(二)《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
(三)《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第4季度报告》(原文)。

8.2 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
北京市西城区金融大街25 号中国建设银行股份有限公司

8.3 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
2014年1月21日

鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)

【2013】第四季度报告

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月16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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华沪深300指数(LOF)
基金主代码	160615
交易代码	160615
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年4月3日
报告期末基金份额总额	844,038,231.03份
投资目标	采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将日平均跟踪误差控制在0.35%以内,以实现对沪深300指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下,可简称为"鹏华300"。

§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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	754,714.52
2.本期利润	-16,483,620.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0154
4.期末基金资产净值	720,677,871.22
5.期末基金份额净值	0.854

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。

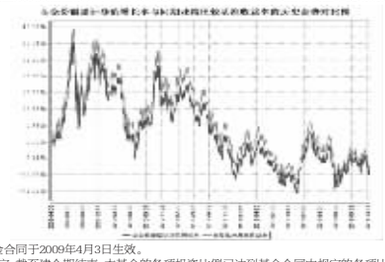
3.2 基金净值表现

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	-2.40%	1.07%	-3.09%	1.07%	0.69%	0.00%

注:业绩基准=沪深300指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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2009年4月3日生效。
2、按基金合同规定,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。

§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		
杨靖	本基金基金经理	2009年4月3日	-	13	杨靖先生,国籍中国,管理学硕士,13年证券从业经验。曾在长城证券公司从事证券研究工作,先后任研究员、行业研究小组组长;2001年6月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,2005年开始先后任鹏华中国50开放式证券投资基金、鹏华行业成长证券投资基金基金经理助理,2006年8月至2007年4月担任原鹏华普洞基金(2007年4月已转型为鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF))基金经理,2007年4月至2009年10月担任鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2009年4月起担任鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,2012年9月起兼任鹏华中证A股资源产业指数分级证券投资基金基金经理,2013年3月起兼任鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金经理。杨靖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%的交易次数为1次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

沪深300指数在4季度呈现震荡走势。临近年底资金面持续偏紧、市场对IPO开闸的预期都制约了市场上涨的空间。在成交量持续萎缩的情况下,权重股难有表现。

四季度本基金经过精心操作,其跟踪误差控制在较低的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.854元;本报告期基金份额净值增长率为-2.40%,同期沪深300指数为-3.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

党的十八届三中全会胜利召开,展示了管理层坚定改革的决心和必胜信心。但转换经济增长方式是一个长期的努力过程,必然伴随着改革阵痛。未来在GDP增长中枢下移、金融去杠杆的大背景下,市场由估值推动的上升空间有限,投资者将更多关注改革红利、企业机制和产品技术创新带来的行业和个股的投资机会。

沪深300指数在整体估值创历史新低的情况下,未来市场震荡盘升的可能性较大。我们建议投资者可考虑逢低增持鹏华沪深300基金。

§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	681,376,057.41	83.83
	其中:股票	681,376,057.41	83.83
2	固定收益投资	3,082,513.20	0.38
	其中:债券	3,082,513.20	0.38
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	127,772,171.35	15.72
6	其他资产	536,811.74	0.07
7	合计	812,767,553.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	2,301,989.23	0.32
B	采矿业	32,334,769.98	4.49
C	制造业	231,185,213.34	32.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,646,709.54	4.53
E	建筑业	30,952,076.92	4.29
F	批发和零售业	22,529,057.68	3.13
G	交通运输、仓储和邮政业	13,136,919.89	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,350,705.92	2.41
J	金融业	229,736,968.71	31.88
K	房地产业	50,702,973.88	7.04
L	租赁和商务服务业	3,818,704.24	0.53
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,046,328.00	1.12
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	2,323,527.23	0.32
S	综合	4,310,112.85	0.60
	合计	681,376,057.41	94.55

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	600016	民生银行	3,159,613	24,392,212.36	3.38
2	601318	中国平安	506,594	21,140,167.62	2.93
3	600036	招商银行	1,806,840	19,676,487.60	2.73
4	601166	兴业银行	1,629,360	16,521,710.40	2.29
5	600000	浦发银行	1,534,326	14,468,694.18	2.01
6	600837	海通证券	1,153,309	13,055,457.88	1.81
7	000002	万 科A	1,422,957	11,426,344.71	1.59
8	600030	中信证券	728,939	9,293,972.25	1.29
9	000001	平安银行	690,458	8,458,110.50	1.17
10	601668	中国建筑	2,652,912	8,330,143.68	1.16

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,082,513.20	0.43
8	其他	-	-
9	合计	3,082,513.20	0.43

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	27,440	2,942,940.00	0.41
2	127002	徐工转债	1,495	139,573.20	0.02

注:上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
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名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资

5.8.2 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

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1
本基金投资的前十名证券之一的中国平安的发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司(简称"中国平安")于2013年5月22日发布公告称其控股子公司平安证券收到中国证监会《行政处罚和市场禁入事先告知书》,中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。2013年10月15日,中国平安发布公告称近日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2013]48号),决定对平安证券予以前述行政处罚。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为中国平安作为国内最大的保险机构之一将长期受益于我国保险行业的发展,从处罚公告中知悉,2012年平安证券投行业务承销佣金收入占平安集团营业收入的0.19%,净利润的0.66%,对平安集团的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次行政处罚对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,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。

本基金投资的前十名证券之一的海通证券的发行人海通证券股份有限公司于2013年4月22日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决【2013】12号)(以下简称"决定"),主要内容如下:"经查,我局发现你公司发行的"一海通财"系列产品系现行监管规则未予明确的创新型产品,但你公司未按照《证券公司业务(产品)创新工作指引(试行)》的规定,向中国证监会机构监管部履行创新产品方案报送义务。"针对决定提出的问题,发行人组织整改,完善相关工作程序,并对相关责任人进行了责任追究和处分。

对该股票的投资决策程序的说明:本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该股票的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,该股票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。

5.10.2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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	381,123.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,918.47
5	应收申购款	144,769.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	536,811.74

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.10.7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	1,125,470,108.61
报告期期间基金总申购份额	14,175,111.54
减:报告期期间基金总赎回份额	295,606,989.12
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	844,038,231.03

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
(一)《鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》;
(二)《鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)托管协议》;
(三)《鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)2013年第4季度报告》(原文)。

8.2 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
北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行股份有限公司

8.3 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
2014年1月21日

鹏华丰泽分级债券型证券投资基金

【2013】第四季度报告

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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